## 海富通富盈混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告 2022 年 9 月 30 日

基金管理人:海富通基金管理有限公司 基金托管人:兴业银行股份有限公司 报告送出日期:二〇二二年十月二十六日

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年7月1日起至9月30日止。

### № 基金产品概况

| 基金简称       | 海富通富盈混合  |
|------------|--|
| 基金主代码      | 009154   |
| 交易代码       | 009154   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2020年5月20日   |
| 报告期末基金份额总额 | 179,075,169.25 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的管理,追求基金资产的长期稳定回报。  |
| 投资策略       | 本基金以在风险可控下寻求稳定的超额收益作为投资理念,采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究,同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素,兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动,结合投资时钟理论,确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整组合中各类资产的比例,或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应,以规避或分散市场风险。股票投资方面,本基 |

|                     | 核心理念,通过量化模型构 债券投资主要采取利率策略 略以及杠杆策略,力求在指定的收益。另外,本基金投投资策略、可转换债券及可                                     | 建股票组合,以价值投资作为<br>构建多因子 alpha 模型。<br>路、信用策略、收益率曲线策<br>控制各类风险的基础上获取稳<br>设策略还包括资产支持证券<br>了交换债券投资策略、股指期<br>转投资策略、股票期权投资策 |  |  |
|---------------------|--|--|--|--|
|                     | 略。   | , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,  |  |  |
| 业绩比较基准              | 中债-综合全价(总值)指数<br>收益率×15%+恒生指数收益  | 效收益率×80%+沪深 300 指数<br>6率(经汇率调整)×5%   |  |  |
| 风险收益特征              | 本基金为混合型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金,但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |  |  |  |
| 基金管理人               | 海富通基金管理有限公司  |  |  |  |
| 基金托管人               | 兴业银行股份有限公司   |  |  |  |
| 下属两级基金的基金简称         | 海富通富盈混合 A  | 海富通富盈混合C   |  |  |
| 下属两级基金的交易代码         | 009154   | 009155   |  |  |
| 报告期末下属两级基金的<br>份额总额 | 83,628,105.12 份  | 95,447,064.13 份  |  |  |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

|                | 报告期           |                |  |
|----------------|---------------|----------------|--|
| 主要财务指标         | (2022年7月1日-   | 2022年9月30日)    |  |
|                | 海富通富盈混合 A     | 海富通富盈混合C       |  |
| 1.本期已实现收益      | 929,814.32    | 1,832,375.84   |  |
| 2.本期利润         | -3,158,905.14 | -4,792,684.80  |  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0352       | -0.0331        |  |
| 4.期末基金资产净值     | 89,227,570.76 | 100,874,378.84 |  |

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 1、海富通富盈混合 A:

| 阶段                 | 净值增长 率① | 净值增长 率标准差 ② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差 | 1)-3)  | 2-4   |
|--------------------|---------|-------------|--------------------|----------------------|--------|-------|
| 过去三个 月             | -3.30%  | 0.30%       | -2.70%             | 0.18%                | -0.60% | 0.12% |
| 过去六个 月             | -0.94%  | 0.32%       | -1.24%             | 0.24%                | 0.30%  | 0.08% |
| 过去一年               | -2.82%  | 0.30%       | -3.28%             | 0.24%                | 0.46%  | 0.06% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 6.70%   | 0.30%       | -0.75%             | 0.24%                | 7.45%  | 0.06% |

### 2、海富通富盈混合 C:

| 阶段                 | 净值增长 率① | 净值增长 率标准差 ② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差 | 1)-3)  | 2-4   |
|--------------------|---------|-------------|--------------------|----------------------|--------|-------|
| 过去三个 月             | -3.40%  | 0.30%       | -2.70%             | 0.18%                | -0.70% | 0.12% |
| 过去六个 月             | -1.13%  | 0.32%       | -1.24%             | 0.24%                | 0.11%  | 0.08% |
| 过去一年               | -3.21%  | 0.30%       | -3.28%             | 0.24%                | 0.07%  | 0.06% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 5.69%   | 0.30%       | -0.75%             | 0.24%                | 6.44%  | 0.06% |

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通富盈混合型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

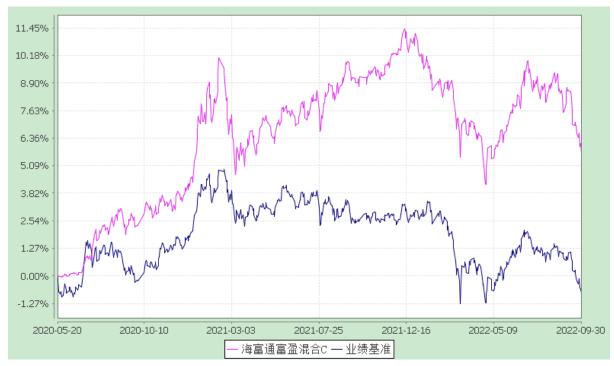
1. 海富通富盈混合 A

(2020年5月20日至2022年9月30日)



### 2. 海富通富盈混合 C

(2020年5月20日至2022年9月30日)



注:本基金合同于2020年5月20日生效。按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)投资范围、(四)投资限制中规定的各项比例。

### 84 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名  | 职务                   | 任本基金的基金经理<br>职务 期限 |      | 证券从业 | 说明  |
|-----|----------------------|--------------------|------|------|---|
|     |                      | 任职日期               | 离任日期 | 年限   |   |
| 杜晓海 | 本金基经总理理量投部基的金;经助兼化资总 | 2020-05-20         | -    | 22 年 | 硕士,持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师, American Bourses Corporation中国区总经理,海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监,现任海富通基金管理有限公 |

| <ul> <li>監。 2016 年 6 月起任海富<br/>通安颐收益混合(原海富通<br/>老收益混合)基金经理。2016<br/>年 6 月至2020年 10 月素任海<br/>富通新內需混合基金经理。2017<br/>年 9 月起兼任海宫通欣<br/>荣混合基金经理。2017 年 4<br/>月至 2018 年 1 月兼任海宫通<br/>欣縣定开混合基金经理。2017<br/>年 5 月至 2019年 10 月兼任海<br/>富通富育混合(现海富通沙深<br/>300增强)基金经理。2018年<br/>3月至 2019年 10 月兼任海<br/>富通车财大数据混合基金经理。2018年<br/>4 月至 2018年 7 月兼任海<br/>富通东财大数据混合基金经理。2018年 4 月至 2028年 7 月衰后通<br/>通所财产。2018年 4 月起兼任海<br/>高通量化前锋股票、海宫通时<br/>业板增强的基金经理。2018年 4 月至 2020年 10 月兼任海宫通<br/>国收益债券、海宫通讯全 2019年 10 月兼任海宫通院<br/>强合、海宫通中化多因子混合的基金经理。2019年 10 月兼任海宫通信<br/>混合人海宫通中企业2020年 1 月至 2020年 1 月至 2020年 7 月棄任海宫通守证 500增强(原海宫通守证 500增强(原海宫通中证 500增强(原海宫重中证 500增强(原海宫重中证 500增强(原海宫重中证 500增强(原海宫重中证 500增强(原海宫重中证 500增强(原海宫重中证 500增强(原海宫重中证 500增强(原海宫重中证 500增强(原海宫重 2020年 5 月起来任海宫通宫<br/>净混合基金经理。2020年 5 月起来任海宫通宫<br/>泽混合基金经理。2021年 7 月起兼任海宫通宫南泽和三个月<br/>持有混合基金经理。</li> <li>夏妍妍 本基 2020-05 8年 上海交通大学经济学硕士,持</li> </ul>   |     | ilた |          |   |    | 司                                       |
|--|-----|-----|----------|---|----|---|
| 通安版收益混合 (原海富 通养 老收益混合) 基金经理。2016年6月至2020年10月兼任海富通新内需混合基金经理。2016年9月起兼任海富通旅内需混合基金经理。2017年4月至2018年1月来任海富通旅盛定开混合基金经理。2017年5月至2019年10月兼任海富通富者混合《现海富通沪、300增强》基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海富通富祥混合基金经理。2018年4月至2018年4月起兼富通商派财大数据混合基金经理。2018年4月至2020年10月兼富通量化前海流流合、海富通全化等区分的基金经理。2018年4月至2020年10月兼后通量化多因合的基金经理。2018年4月至2020年10月来任海高通高流合、海富通上化多因合的基金经理。2019年6月至2022年8月末后第一日至2020年10月来任海高近高台的基金经理。2020年1月至2021年7月来在海市运行。2020年1月至2021年7月来任海高通记中证内地低碳指数)基金年7月来任海高通流合基金经理。2020年4月至2021年7月来任海高通流台基金经理。2020年4月至2021年7月来任海高通流台基金经理。2020年4月至2021年7月来任海高通流台基金经理。2020年4月至2021年7月来任海高通流台基金经理。2020年5月起兼任海高通高社任海高三省泽混合基金经理。2020年6月起来任海高河高利三个月持有混合基金经理。2021年7月起兼任海高河三个月持有混合基金经理。2021年7月起兼任海高河三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海高河三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海高河三个月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月起来任海高河三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海高河三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海高河三个月持有混合基金经理。2021年7月持在基金经理。2021年7月持在基金经理。2021年7月持在基金经理。2021年7月持在基金经理。2021年7月持在基金经理。2021年1日月本经过2021年1日月本经验证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证  |     | Ш.∘ |          |   |    |   |
| 老收益混合)基金经理。2016<br>年6月至2020年10月兼任海<br>富通新內需混合基金经理。2017年4<br>月至2018年1月兼任海富通<br>於盛定开混合基金经理。2017年5月至2019年10月兼任海<br>富通富睿混合(现海富通300增强)基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海富<br>通高有混合经理。2018年3月至2018年4月至2018年4月至2018年7月兼任海宫<br>通面标则大数据混合基金经理。2018年4月至2018年4月至2018年4月起兼任海园创业板增强的基金经理。2018年4月起兼任海园创业板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海宫通保的基金经理。2018年4月至2019年10月兼任海宫通保合的基金经理。2019年6月寿在海园依治海宫通量化多因介绍。2019年6月寿至2020年10月末日海园依治海宫通量化多因介绍。2020年1月寿至2021年7月素任海宫通中证内地低碳指数)基金经理。2020年3月至2021年7月兼在海宫通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海宫通保护工产的增强的基金经理。2020年5月起兼任海宫通宫和中证内地低碳指数,基金经理。2020年5月表经理。2020年5月起来任海宫通宫和中证内地低碳指数,基金经理。2020年5月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起,在西宫通过2021年7月起,在西宫通过2021年7月起,在西宫通过2021年7月起,在西宫通过2021年7月起,在西宫通过2021年10月第1日,由于西宫通过2021年10月第1日,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021年10月间,由于西宫通过2021 |     |     |          |   |    | , |
| 年6月至2020年10月兼任海宫通所内需混合基金经理。 2016年9月起兼任海宫通所荣混合基金经理。2017年4月至2018年1月兼任海宫通际盛定开混合基金经理。2017年5月至2019年10月兼任海宫通宫者混合(现海宫通沙深300增强)基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海宫通宫祥混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海宫通业板增强的基金经理。2018年4月至2018年4月至2020年10月兼任海宫通业板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海宫通收查债券、海宫通量化前锋股票。海宫通量化多因行为基金经理。2019年10月兼任海宫通验。2019年10月兼任海宫通常全经理。2019年10月兼任海宫通际资流合基金经理。2019年10月至2020年1月至2020年1月至2020年1月至2020年1月至2020年1月至2020年1月至2020年1月至2021年7月兼任海宫通中证方的增强的潜途经理。2020年1月至2021年7月兼任海宫通常基金经理。2020年5月起来任海宫通常是全经理。2020年6月起来任海宫通宫温启是金经理。2020年6月起来任海宫通宫温启是金经理。2020年6月起来任海宫通宫泽混合基金经理。2020年6月起来任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫邓三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 通安颐收益混合(原海富通养                           |
| 富通新内需混合基金经理。2016年9月起兼任海宫通欣荣混合基金经理。2017年4月至2018年1月新任海宫通欣陈盛定开混合基金经理。2017年5月至2019年10月兼任海宫通宫睿混合(现海宫通通)邓海宫通道。2018年3月至2019年10月兼任海宫通宫有混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海宫通家财大数据混合基金经理。2018年4月至2018年4月至2020年10月兼任海宫通验优增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海宫通收遗债券、海宫通量化前锋股票、海宫通量化前锋股票、海宫通量化前锋企员。2018年4月至2020年1月兼任海宫通收益债券、海宫通量化多因合的基金经理。2019年6月开张任海宫通时正500增强(原海宫运行中7月兼任海宫通中证方地低碳指数)基金经理。2020年7月兼任海宫通中证的地低碳指数)基金经理。2020年7月兼任海宫通中证的地低碳指数。2020年6月起兼任海宫通宫强治企务。2020年6月起兼任海宫通宫强治全基金经理。2020年6月起兼任海宫通宫有月起兼任海宫通宫不足。2020年6月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2020年6月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起兼任海宫道宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫道宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫道宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起兼任海宫道宫科三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 老收益混合)基金经理。2016                         |
| 2016年9月起兼任海宫通欣荣混合基金经理。2017年4<br>月至2018年1月兼任海宫通欣盛定开混合毒金经理。2017年5月至2019年10月兼任海宫通宫春混合(现海宫通沪深300增强)基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海宫通密样混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海宫通师尔法对冲混合上海宫通验化质增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海宫通量化的锋股票海宫通水应。2018年4月至2020年10月兼任海宫通验债券、海宫通验管理。2018年4月至2020年10月兼任海宫通验检理。2019年10月兼任海宫通验检理。2019年10月末任海宫通际流流合产的基金经理。2019年10月末任海宫通际资源。2020年1月至2021年7月兼任海宫通安益对冲混合基金经理。2020年1月至2021年7月兼任海宫通时证500增强《原海宫通时证500增强《原海宫通时证500增强《原海宫通时证500增强《原海宫通时证500增强《原海宫通时证500增强《原海宫经理。2020年1月至2021年7月兼任海宫通宫强合基金经理。2020年6月起兼任海宫通宫强宫是经理。2020年6月起来任海宫通宫强治是全经理。2020年6月起来任海宫通宫泽混合基金经理。2020年7月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起兼任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | 年6月至2020年10月兼任海                         |
| 2016年9月起兼任海宫通欣荣混合基金经理。2017年4<br>月至2018年1月兼任海宫通欣盛定开混合基金经理。2017年5月至2019年10月兼任海宫通宫春混合(现海宫通沪深300增强)基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海宫通宫样混合基金经理。2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2020年1月兼任海宫通量化的锋股票海宫通水板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海宫通验债券、海宫通量化的锋股票海宫通水营宫通验检理。2019年10月兼任海宫通验混合的基金经理。2019年10月兼任海宫通研究混合的基金经理。2019年10月末任海宫通研究混合的基金经理。2019年1月至2020年1月至2020年1月至2020年1月至2021年7月兼任海宫通安益对冲混合基金经理。2020年1月至2021年7月兼任海宫通空设验,基金经理。2020年1月至2021年7月来任海宫通际企业经理。2020年4月至2021年7月来任海宫通济企业经理。2020年6月起兼任海宫通济企业经理。2020年6月起来任海宫通济企业经理。2020年6月起来任海宫通济企业经理。2020年6月起来任海宫通济是经经理。2020年7月来任海宫通常温宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通常和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月持有混合基金经理。2021年7月接有混合基金经理。2021年7月起来经验证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证   |     |     |          |   |    | 富通新内需混合基金经理。                            |
| 荣混合基金经理。2017 年 4 月至2018 年 1 月兼任海富通 旅盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至2019 年 10 月兼任海富通富會混合(现海宫通沪深300 增强)基金经理。2018 年 3 月至2019 年 10 月兼任海富通富有股大数据混合基金经理。2018 年 4 月至2018 年 4 月至2018 年 4 月至2020 年 10 月兼任海富通量化前锋股票、海宫通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至2020年 10 月兼任海富通量化前锋股票、海宫通成合的基金经理。2019 年 6 月至2019 年 10 月兼任海富通配益混合、海宫通化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月 表任海富通研究 1月至2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 1月至2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强、原海富通中证 500 增强、原海富通中证 500 增强、原海高通中证 500 增强、多。经理。2020 年 7 月兼任海富通常查经理。2020 年 6 月起兼任海富通常基金经理。2020 年 7 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 7 月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海宫通宫  |     |     |          |   |    |   |
| 月至 2018 年 1 月兼任海富通<br>於盛定开混合基金经理。2017<br>年 5 月至 2019 年 10 月兼任海<br>富通富睿混合(现海富通沪深<br>300 增强)基金经理。2018 年<br>3 月至 2018 年 7 月兼任海<br>高萬祥混合基金经理。2018<br>年 4 月至 2018 年 7 月兼任海<br>富通家财大数据混合基金经<br>理。2018 年 4 月起兼任海<br>富通阿尔法对冲混合、海富通创<br>业板增强的基金经理。2018<br>年 4 月至 2020 年 10 月兼任海<br>富通量化前锋股票、海富通稳<br>固收益债券。海富通欣享混合<br>的基金经理。2019 年 10 月兼任海<br>高通量化多因子。2019 年 6 月至<br>2019 年 10 月兼任海富通研院<br>奇的基金经理。2019 年 6 月至<br>2020 年 10 月兼任海富通研究<br>精选混合基金经理。2020 年 1<br>月至 2022 年 8 月兼任海富通<br>安益对冲混合基金经理。2020<br>年 3 月至 2021 年 7 月兼任海<br>富通中证 500 增强(原海富通<br>中证内地低碳指数)基金经<br>理。2020 年 4 月至 2021 年 7<br>月兼任海富通富盈混合基金经理。<br>2020 年 6 月起兼任海富通富<br>泽混合基金经理。2021 年 7<br>月起兼任海富通富<br>泽混合基金经理。2021 年 7<br>月起兼任海富通富利三个月<br>持有混合基金经理。2021 年 7   |     |     |          |   |    | , , , , - , , , , , , , , , , , , , , , |
| 欣盛定开混合基金经理。2017年5月至2019年10月兼任海宫通宫睿混合、现海宫通沪深300增强)基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海宫通宫常产品。基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海宫通东财大数据混合基金经理。2018年4月至2018年4月至2020年10月兼任海宫通量化前锋股票、海宫通创业板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海宫通量化前锋股票、海宫通合的基金经理。2018年4月至2019年10月兼任海宫通后全经理。2019年6月至2020年10月兼任海宫通行查验经理。2019年6月至2020年10月兼任海宫通安益对冲混合基金经理。2020年1月至2020年7月兼任海宫通宁证为增强(原海宫通中证为地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海宫通中证为地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海宫通常盈混合基金经理。2020年5月起兼任海宫通宫盈混合基金经理。2020年7月起兼任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫和三个月持有混合基金经理。2021年7月  |     |     |          |   |    | ,,                                      |
| 年5月至2019年10月兼任海富通富客混合(现海富通沪深300增强)基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海富通富祥混合基金经理。2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2020年10月兼任海富通量化前锋股票、海富通配量优新客。通量优务财产。海高通配量优务财产。海高通配量优多因子混合的基金经理。2019年10月兼任海富通所交益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至2020年10月兼任海富通研究精选混合基金经理。2022年8月至2022年8月至2020年1月至2022年8月来任海富通安益对冲混合基金经理。2020年4月至2021年7月来任海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月来任海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年5月起兼任海富通富混合基金经理。2020年5月起兼任海富通富强合基金经理。2021年7月起来任海富通富和三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海富通言利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海富通言利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | , |
| 富通富睿混合(现海宫通沪深 300 增强)基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海宫通宫祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海宫通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 4 月至 2018 年 4 月至 2019 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海宫通量化前锋股票、海宫通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海宫通广设益、混合、海宫通量化多因子混合的基金经理。2019 年 10 月兼任海宫通研究潜途混合基金经理。2020 年 10 月兼任海宫通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海宫通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海宫通中证 500 增强(原海宫通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海宫通宫盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海宫通宫盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海宫通宫科三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    |   |
| 300 增强)基金经理。2018年3月至2019年10月兼任海宫通富祥混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海宫通东财大数据混合基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海宫通知收益债券、海宫通船、海宫通量化前锋股票、海宫通稳的基金经理。2018年4月至2019年10月兼任海宫通欣益混合、海宫通量化多因子混合的基金经理。2019年10月兼任海宫通研究精选混合基金经理。2019年10月兼任海宫通研究精选混合基金经理。2020年10月至2022年8月兼任海宫通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海宫通中证500增强(原海宫通中证内地低碳指数2)基金经理。2020年4月至2020年4月至2020年5月表任海宫通宫上中7月兼任海宫通宫盈混合基金经理。2020年5月起兼任海宫通宫盈混合基金经理。2020年6月起兼任海宫通宫泽混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。2021年7月起来任海宫通宫利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | , |
| 3月至2019年10月兼任海富通高祥混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海富通社债券、海高通除享混合的基金经理。2018年4月至2019年10月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至2020年10月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020年1月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼后海市证500增强(原海高通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年5月起兼任海富通高混合基金经理。2020年5月起兼任海富通高温合基金经理。2021年7月起兼任海富通高利三个月持有混合基金经理。2021年7月起兼任海富通高利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | 富通富睿混合(现海富通沪深                           |
| 通富祥混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海富通量优前锋股票、海宫通路查经理。2018年4月至2019年10月兼任海富通水益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至2020年10月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年1月至2021年7月兼任海富通中证为地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通中证为地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年5月起兼任海富通高温混合基金经理。2021年7月起兼任海富通高温和合基金经理。2021年7月起兼任海富通高利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 300 增强) 基金经理。2018 年                     |
| 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通配除亳混合的基金经理。2018 年 4 月至2019 年 10 月兼任海富通所总混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至2021 年 7 月兼任海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月至2021 年 7 月兼任海富通高温混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | 3月至2019年10月兼任海富                         |
| 富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣亭混合的基金经理。2018 年 4 月至2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月至2021 年 7 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 通富祥混合基金经理。2018                          |
| 富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣亭混合的基金经理。2018 年 4 月至2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月至2021 年 7 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 年4月至2018年7月兼任海                          |
| 理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通配除空混合的基金经理。2018 年 4 月至2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年 3 月至 2021年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年 4 月至 2021年 7 月兼任海富通常添鑫收益债券基金经理。2020年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年 7 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    |   |
| 通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018年4月至2020年10月兼任海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通税专限会产。2019年10月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至2020年10月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020年1月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年1月至2021年7月兼任海富通中证500增强(原海富通中证为00增强(原海富通中证为00增强(原海富通中证为00增强(原海富通中证为00增强(原海富通中证为00增强(原海富通中证为00增强(原海富通中证为00增强(原海富通中证为00增强(原海富通平2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    |   |
| 业板增强的基金经理。2018<br>年4月至2020年10月兼任海<br>富通量化前锋股票、海富通稳<br>固收益债券、海富通欣享混合<br>的基金经理。2018年4月至<br>2019年10月兼任海富通欣益<br>混合、海富通量化多因子混合<br>的基金经理。2019年6月至<br>2020年10月兼任海富通研究<br>精选混合基金经理。2020年1<br>月至2022年8月兼任海富通<br>安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海<br>富通中证500增强(原海富通<br>中证内地低碳指数)基金经<br>理。2020年4月至2021年7月兼任海富通添鑫收益债券<br>基金经理。2020年5月起兼<br>任海富通高盈混合基金经理。<br>2020年6月起兼任海富通富<br>泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富<br>泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月<br>持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | , |
| 年4月至2020年10月兼任海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018年4月至2019年10月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至2020年10月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020年1月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海富通中证500增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通高盈混合基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富  |     |     |          |   |    | _, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,  |
| 富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年 3 月至2021年 7 月兼任海富通中证为地低碳指数)基金经理。2020年 4 月至2021年 7 月兼任海富通流鑫收益债券基金经理。2020年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    |   |
| 固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年 3 月至2021年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年 4 月至2021年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    |   |
| 的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年 3 月至 2021年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年 4 月至 2021年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年 7 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | / · · · · · · · · · · · · · · · · · · · |
| 2019年10月兼任海富通欣益<br>混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至<br>2020年10月兼任海富通研究<br>精选混合基金经理。2020年1<br>月至2022年8月兼任海富通<br>安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海<br>富通中证500增强(原海富通<br>中证内地低碳指数)基金经<br>理。2020年4月至2021年7<br>月兼任海富通添鑫收益债券<br>基金经理。2020年5月起兼<br>任海富通富盈混合基金经理。<br>2020年6月起兼任海富通富<br>泽混合基金经理。2021年7<br>月起兼任海富通富利三个月<br>持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    |   |
| 混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月至2020年10月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020年1月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海富通中证500增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通高盈混合基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | 的基金经理。2018 年 4 月至                       |
| 的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究 精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通 安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | 2019 年 10 月兼任海富通欣益                      |
| 2020年10月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020年1月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海富通中证为地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通流鑫收益债券基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 混合、海富通量化多因子混合                           |
| 精选混合基金经理。2020年1月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海富通中证500增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通富盈混合基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | 的基金经理。2019年6月至                          |
| 精选混合基金经理。2020年1月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海富通中证500增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通富盈混合基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | 2020年10月兼任海富通研究                         |
| 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年 3 月至 2021年 7 月兼任海富通中证 500增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年 4 月至 2021年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    |   |
| 安益对冲混合基金经理。2020<br>年 3 月至 2021 年 7 月兼任海<br>富通中证 500 增强(原海富通<br>中证内地低碳指数)基金经<br>理。2020 年 4 月至 2021 年 7<br>月兼任海富通添鑫收益债券<br>基金经理。2020 年 5 月起兼<br>任海富通富盈混合基金经理。<br>2020 年 6 月起兼任海富通富<br>泽混合基金经理。2021 年 7<br>月起兼任海富通富利三个月<br>持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    |   |
| 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强 (原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | , |
| 富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | > · · · · · · · · · · · · · · · · · · · |
| 中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | , |
| 理。2020年4月至2021年7月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    |   |
| 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    |   |
| 基金经理。2020年5月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020年6月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    |   |
| 任海富通富盈混合基金经理。<br>2020 年 6 月起兼任海富通富<br>泽混合基金经理。2021 年 7<br>月起兼任海富通富利三个月<br>持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | / · · / · · · · · · · · · · · · · · · · |
| 2020 年 6 月起兼任海富通富<br>泽混合基金经理。2021 年 7<br>月起兼任海富通富利三个月<br>持有混合基金经理。   |     |     |          |   |    | 基金经理。2020年5月起兼                          |
| 泽混合基金经理。2021 年 7<br>月起兼任海富通富利三个月<br>持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 任海富通富盈混合基金经理。                           |
| 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 2020 年 6 月起兼任海富通富                       |
| 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    | 泽混合基金经理。2021 年 7                        |
| 持有混合基金经理。  |     |     |          |   |    |   |
|  |     |     |          |   |    | , = . ,                                 |
| <u> </u>   |     |     |          |   |    |   |
|  | 复妍妍 | 本基  | 2020-05- | - | 8年 | 上海交通大学经济学帧士,持                           |

| λ ,,  |    |                    |
|-------|----|--------------------|
| 金的 金的 | 20 | 有基金从业人员资格证书。历      |
| 基金    |    | 任西门子金融服务集团西门       |
| 经理    |    | 子管理培训生,西门子财务租      |
|       |    |                    |
|       |    | 财务分析师,2014年加入海     |
|       |    | 富通基金管理有限公司,历任      |
|       |    | 固定收益投资部固定收益分       |
|       |    | 析师、基金经理助理。2018     |
|       |    | 年 1 月起任海富通欣益混合     |
|       |    | 基金经理。2018 年 4 月起兼  |
|       |    | 任海富通一年定期开放债券       |
|       |    | 基金经理。2018年4月至2021  |
|       |    | 年 5 月任海富通融丰定开债     |
|       |    | 券基金经理。2019 年 5 月起  |
|       |    | 兼任海富通安颐收益混合基       |
|       |    | 金经理。2019年10月起兼任    |
|       |    | 海富通聚合纯债、海富通富祥      |
|       |    | 混合的基金经理。2019 年 10  |
|       |    | 月至 2021 年 9 月任海富通瑞 |
|       |    | 合纯债基金经理。2019 年 10  |
|       |    | 月至2020年11月任海富通瑞    |
|       |    | 丰债券基金经理。2020 年 5   |
|       |    | 月起兼任海富通富盈混合基       |
|       |    | 金经理。2021 年 5 月起兼任  |
|       |    | 海富通美元债 (QDII) 基金经  |
|       |    | 理。2021 年 8 月起兼任海富  |
|       |    | 通瑞兴 3 个月定开债券基金     |
|       |    | 经理。2022 年 7 月起兼任海  |
|       |    | 富通策略收益债券基金经理。      |
|       |    |                    |

注: 1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准: 自参加证券行业的相关工作开始计算。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有 关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产, 没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,确保本公司管理的不

同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节 得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易,保证公平 交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析,并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的 T 分布检验,结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明,报告期内公司对旗下各投资组合公平对待,不存在利益输送的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,A股市场与全球范围内其他主要股市都经历了一轮显著的调整。以万得全A指数来看,当季度跌幅12.61%。分市场看,沪深300指数下跌15.16%、中证500指数下跌11.47%、科创创业50指数下跌16.01%、创业板综下跌15.79%、中小综指下跌12.93%。分行业看,申万一级行业除煤炭以外均告下跌。

三季度影响 A 股市场的主要因素来自于国内和国外两个方向。海外因素方面,最主要的拖累项来自于美联储持续大幅的加息以及地缘冲突的久拖不决。美联储本轮加息操作经历了一个由慢到快的过程且持续性显著超市场预期,尤其是美联储高官对于未来加息的指引令市场倍感压力。本轮美联储的连续加息带来了广泛的"传染"效应,一是美债收益率连续大幅上行,二是美元指数大幅超预期上行。由此,带来全球几乎所有金融资产重新定价。而地缘冲突一方面加剧了投资者对于基础能源和原材料通胀的担忧,另一方面导致欧元疲软,间接助推美元指数的强势表现。

国内因素方面,大致包括了盈利增速下滑和估值中枢下行两方面。7-8 月份市场经历了中报季的业绩大考。A股市场的中报全市场业绩增速,营业收入同比增速为8.40%,归母净利润同比增速为3.30%。不论是营业收入的增速还是归母净利润的增速同比均大幅放缓。在A股市场估值和定价的诸因子中,业绩增速不但权重大,而且敏感度很高。这是拖累市场表现的内生性原因,也比较能说明为何国内同期利率水平一再下行,而A股的估值不升反降。从交易层面来看,这轮反弹结束的时点也大致同步于中报业绩披露的结束期。

报告期内,本基金在控制回撤的基础上,力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时,本基金积极参与新股申购,以增强投资收益。

本基金的投资思路将在控制风险的基础上,积极地捕捉市场的结构性机会,力争跑 赢市场。同时,基金依然会积极参与新股申购,努力增厚收益。本基金也将利用动态的 仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

固定收益方面,3季度国内经济呈现弱修复格局。投资方面,制造业投资仍有支撑, 在高技术行业方面表现出色;基建投资在专项债资金与政策性金融工具的支持下维持高 位;地产投资遭遇"烂尾断供"的危机模式,投资增速仍在进一步恶化。消费在面临外部 冲击下修复路径并不通畅。出口增速拐点初现,但结构上仍有亮点。通胀方面,猪肉价 格明显回升,油价高位震荡,在服务业价格压制下 CPI 小幅回升; PPI 受到基数的影响 同比回落。货币政策方面,3季度流动性维持宽松,央行调降 MLF与 OMO 利率 10bp, 带动 1 年期与 5 年期 LPR 利率分别调降 5bp 与 15bp。财政政策方面,地方政府专项债 发行额度新增 5000 亿,政策性金融工具配套基建贷款加速落地。对应债市而言,流动 性宽松与基本面偏弱支撑债市收益率向下,但随后稳增长发力与汇率的贬值压力导致收 益率再度上行。全季来看,10年期国债收益率累计下行6bp。信用债方面,受地产贷款 风波等影响, 利率大幅下行, 资金成本持续低位, 信用债配置力量增强, 信用债收益率 和利差明显压缩。地产行业仍在艰难磨底,地产债依然面临一级发行不畅、二级市场价 格连锁下跌的困局,尾部风险担忧仍存。城投方面,部分城市发生信用相关负面舆情, 再度引发市场对弱区域城投债的关注,政府强烈的支持意愿短期内或可提振市场对核心 平台公开债券的信心,但考虑到地方政府协调资源能力有限,中长期对于弱区域的谨慎 态度预计仍将维持。可转债方面,3季度中证转债指数先跟随权益市场上涨,而后一路 下探, 总体下跌 3.82%。主要受国内疫情反复, 经济衰退预期增强, 叠加海外局势动荡 和美联储加息的影响,权益市场风险偏好持续降低。

三季度,本基金债券部分视市场情况调整持仓结构,精选信用债个券,以求获得稳定较好的票息收益。

四季度,本基金债券部分配置以高等级债券为主。同时,积极关注利率债的交易性机会,并配合股票部分投资策略,做好流动性管理。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通富盈混合 A 净值增长率为-3.30%,同期业绩比较基准收益率为-2.70%,基金净值跑输业绩比较基准 0.60 个百分点。海富通富盈混合 C 净值增长率为-3.40%,同期业绩比较基准收益率为-2.70%,基金净值跑输业绩比较基准 0.70 个百分点。报告期内股票市场波动较大,导致基金跑输基准。

### 4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### **%** 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                     | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|------------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资                   | 44,619,751.68  | 23.35        |
|    | 其中: 股票                 | 44,619,751.68  | 23.35        |
| 2  | 固定收益投资                 | 129,814,919.95 | 67.93        |
|    | 其中:债券                  | 129,814,919.95 | 67.93        |
|    | 资产支持证券                 | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资                  | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资                | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产               | 2,997,177.71   | 1.57         |
|    | 其中: 买断式回购的买入返售金<br>融资产 | -              | ŀ            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计           | 12,072,243.31  | 6.32         |
| 7  | 其他资产                   | 1,591,767.45   | 0.83         |
| 8  | 合计                     | 191,095,860.10 | 100.00       |

注:本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为23,008.95元,占资产净值比例为0.01%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别              | 公允价值 (元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业          | 753,173.20    | 0.40         |
| В  | 采矿业               | 3,913,700.68  | 2.06         |
| C  | 制造业               | 28,885,914.75 | 15.19        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供 应业 | 1,995,568.00  | 1.05         |
| Е  | 建筑业               | 1,257,044.00  | 0.66         |
| F  | 批发和零售业            | 849,076.48    | 0.45         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业       | 1,200,920.00  | 0.63         |
| Н  | 住宿和餐饮业            | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业   | 799,314.98    | 0.42         |

| J | 金融业           | 2,096,661.98  | 1.10  |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业          | 1,845,733.00  | 0.97  |
| L | 租赁和商务服务业      | 551,796.00    | 0.29  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 289,819.66    | 0.15  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 11,872.00     | 0.01  |
| О | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 141,162.00    | 0.07  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 4,986.00      | 0.00  |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 44,596,742.73 | 23.46 |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 占基金资产净值比例(%) |
|------|-----------|--------------|
| 原材料  | 23,008.95 | 0.01         |
| 合计   | 23,008.95 | 0.01         |

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产<br>净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|------------------|
| 1  | 600048 | 保利发展 | 76,900  | 1,384,200.00 | 0.73             |
| 2  | 600938 | 中国海油 | 84,004  | 1,295,341.68 | 0.68             |
| 3  | 600522 | 中天科技 | 57,600  | 1,294,272.00 | 0.68             |
| 4  | 601012 | 隆基绿能 | 19,730  | 945,264.30   | 0.50             |
| 5  | 600803 | 新奥股份 | 50,300  | 933,568.00   | 0.49             |
| 6  | 601225 | 陕西煤业 | 39,300  | 894,861.00   | 0.47             |
| 7  | 300316 | 晶盛机电 | 11,207  | 757,817.34   | 0.40             |
| 8  | 002984 | 森麒麟  | 24,800  | 717,712.00   | 0.38             |
| 9  | 601668 | 中国建筑 | 137,600 | 708,640.00   | 0.37             |
| 10 | 600153 | 建发股份 | 50,600  | 700,810.00   | 0.37             |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号    | 债券品种 | 公允价值 (元) | 占基金资产净 |
|-------|------|----------|--------|
| 11, 3 | 一    |          | 值比例(%) |

| 1  | 国家债券       | 25,300,413.70  | 13.31 |
|----|------------|----------------|-------|
| 2  | 央行票据       | -              | 1     |
| 3  | 金融债券       | 30,755,276.71  | 16.18 |
|    | 其中: 政策性金融债 | 20,196,526.03  | 10.62 |
| 4  | 企业债券       | 40,602,610.96  | 21.36 |
| 5  | 企业短期融资券    | 5,043,006.85   | 2.65  |
| 6  | 中期票据       | 20,404,904.66  | 10.73 |
| 7  | 可转债 (可交换债) | 2,749,938.45   | 1.45  |
| 8  | 同业存单       | 4,958,768.62   | 2.61  |
| 9  | 其他         | -              | -     |
| 10 | 合计         | 129,814,919.95 | 68.29 |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称             | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资<br>产净值比<br>例(%) |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|----------------------|
| 1  | 220210    | 22 国开 10         | 200,000 | 20,196,526.03 | 10.62                |
| 2  | 019666    | 22 国债 01         | 150,000 | 15,243,246.58 | 8.02                 |
| 3  | 2120046   | 21 广州银行<br>二级    | 100,000 | 10,558,750.68 | 5.55                 |
| 4  | 102000187 | 20 中化工<br>MTN003 | 100,000 | 10,228,655.34 | 5.38                 |
| 5  | 163617    | 20 藏投 01         | 100,000 | 10,197,946.85 | 5.36                 |

# 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

- **5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细** 本基金本报告期末未持有贵金属。
- **5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细** 本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码     | 名称            | 持仓量   | 合约市值<br>(元)   | 公允价值变<br>动(元) | 风险说明 |
|--------|---------------|-------|---------------|---------------|------|
| IC2212 | IC2212        | -5.00 | -5,685,400.00 | 515,000.00    | -    |
| IM2212 | IM2212        | -2.00 | -2,412,320.00 | 7,560.00      | -    |
| 公允价值变动 | 公允价值变动总额合计(元) |       |               |               |      |
| 股指期货投资 | 635,169.51    |       |               |               |      |
| 股指期货投资 | 872,120.00    |       |               |               |      |

注: 股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的。本基金管理人将充分 考虑股指期货的流动性及风险收益特征,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行 多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

### 5.11 投资组合报告附注

- 5.11.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
- 5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称    | 金额 (元)       |   |
|----|-------|--------------|---|
| 1  | 存出保证金 | 1,198,945.80 | ) |

| 2 | 应收证券清算款 | 386,649.13   |
|---|---------|--------------|
| 3 | 应收股利    | -            |
| 4 | 应收利息    | -            |
| 5 | 应收申购款   | 6,172.52     |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 其他      | -            |
| 8 | 合计      | 1,591,767.45 |

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值(元)      | 占基金资产净<br>值比例(%) |
|----|--------|----------|--------------|------------------|
| 1  | 132022 | 20 广版 EB | 2,636,347.21 | 1.39             |
| 2  | 113641 | 华友转债     | 29,749.00    | 0.02             |

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分<br>的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限<br>情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|--------------|--------------|
| 1  | 600938 | 中国海油 | 1,295,341.68       | 0.68         | 新股流通受<br>限   |

## % 开放式基金份额变动

单位: 份

| 项目            | 海富通富盈混合A      | 海富通富盈混合C       |
|---------------|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 96,015,148.14 | 178,102,087.12 |
| 本报告期基金总申购份额   | 149,153.85    | 462,083.02     |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 12,536,196.87 | 83,117,106.01  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -             | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 83,628,105.12 | 95,447,064.13  |

### 87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 88 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

|        | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                    |                       |       |                   | 报告期末持有基金情<br>况 |          |
|--------|----------------|------------------------------------|-----------------------|-------|-------------------|----------------|----------|
| 投资者 类别 | 序号             | 持有基金份额<br>比例达到或者<br>超过20%的时<br>间区间 | 期初份额                  | 申购 份额 | 赎回份 额             | 持有份额           | 份额占<br>比 |
| 机构     | 1              | 2022/7/1-2022/8 /31                | 59,91<br>2,359.<br>81 | -     | 59,912,3<br>59.81 | -              | -        |

产品特有风险

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险:
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险,基金管理人可能 无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法 及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后,可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于 5000万元的风险,基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同 等情形。
- 4、其他可能的风险。

另外,当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时,本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注:报告期内单一投资者申购赎回份额包含基金转换份额。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月,是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始,海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2022 年 9 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模约 1380 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人,是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010年12月,海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012年9月,中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014年8月,海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业,获准开展特定客户资产管理服务。2016年12月,海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月,海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月,海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业"金基金"奖——金基金•灵活配置型基金奖(三年期)。同时,海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业"金基金"奖——金基金•成长基金管理公司奖。

2020年3月,由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓,海富通基金管理有限公司荣获"金牛进取奖",海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获"五年期开放式混合型持续优胜金牛基金"奖项。2020年7月,由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓,海富通基金管理有限公司荣获"金基金•股票投资回报基金管理公司奖",海富通内需热点混合型证券投资基金荣获"金基金•偏股混合型基金三年期奖"。

2021年7月,海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联"金基金•偏股混合型基金三年期奖"。2021年9月,由《中国证券报》主办的第十八届"中国基金业金牛奖"揭晓,海富通内需热点混合型证券投资基金荣获"三年期开放式混合型持续优胜金牛基金"。

2022 年 7 月,海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的"五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖"。2022 年 8 月,海富通内需热点混合

型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的"五年期开放式混合型持续优胜金牛基金",海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获"三年期开放式混合型持续优胜金牛基金"。2022 年 9 月,海富通基金管理有限公司荣获"IAMAC 推介•2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司"。

### **89** 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通富盈混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富盈混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富盈混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层本基金管理人办公地址。

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司 二〇二二年十月二十六日