

海富通收益增长证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 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贵金属投资明细.....	47
7.9 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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	49
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通收益增长证券投资基金
基金简称	海富通收益增长混合
基金主代码	519003
交易代码	519003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 3 月 12 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	860,725,933.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	建立随时间推移非负增长的收益增长线，运用优化组合保险机制实现风险预算管理，力争基金份额净值高于收益增长线水平。在此基础上，通过精选证券和适度主动地把握市场时机，将中国经济的高速成长转化为基金资产的长期稳定增值。
投资策略	整体投资策略分为三个层次：第一层次，以优化投资组合保险策略为核心，并结合把握市场时机，确定和调整基金资产在债券和股票间的配置比例，实现风险预算管理、降低系统性风险，保证基金投资目标的实现；第二层次，采用自上而下的策略，以久期管理为核心，从整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次进行积极主动的债券投资管理，保证基金份额净值超越收益增长线；第三层次，从定价指标、盈利预测指标和流动性指标三个方面，积极主动精选个股和构建分散化的股票组合，控制非系统性风险，充分获取股市上涨收益。
业绩比较基准	40%MSCI China A+60%上证国债
风险收益特征	属于证券投资基金中风险较低的产品，追求在风险预算目标下基金资产增值的最大化。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66594319
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

注册地址	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	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址	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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	236,535,279.56
本期利润	266,645,299.68
加权平均基金份额本期利润	0.3111
本期加权平均净值利润率	13.56%
本期基金份额净值增长率	14.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	1,265,358,566.52
期末可供分配基金份额利润	1.4701
期末基金资产净值	2,126,084,500.07
期末基金份额净值	2.470
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	748.95%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.48%	0.95%	-0.20%	0.34%	4.68%	0.61%
过去三个月	11.46%	0.90%	3.06%	0.38%	8.40%	0.52%
过去六个月	14.92%	1.22%	2.22%	0.51%	12.70%	0.71%
过去一年	48.21%	1.22%	11.75%	0.54%	36.46%	0.68%
过去三年	161.96%	1.30%	29.32%	0.55%	132.64%	0.75%
自基金合同生效起至今	748.95%	1.33%	196.81%	0.67%	552.14%	0.66%

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

海富通收益增长证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年3月12日至2021年6月30日)



注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。本基金自 2007 年 8 月 7 日至 2007 年 11 月 1 日为持续营销后建仓期。建仓期满至今本基金的各项投资比例已达到基金合同有关投资范围的规定。

2、为了能更公允地体现基金投资业绩，海富通基金管理有限公司自 2007 年 1 月 1 日起调整海富通收益增长混合基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为 MSCI China A 指数，相应的基准权重不变。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 87 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富

通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金 (LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金 (FOF)、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通

中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周雪军	本基金的基金经理；公募权益投资部总监。	2015-06-09	-	13 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任北京金融街控股股份有限公司职员、天治基金管理有限公司研究员，2012 年 6 月至 2015 年 2 月任天治财富增长混合基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 2 月兼任天治趋势精选混合基金经理。2015 年 2 月加入海富通基金管理有限公司，历任公募权益投资部总经理，现任公募权益投资部总监。2015 年 6 月起任海富通收益增长混合基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通改革驱动混合基金经理。2018 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通中小盘混合基金经理。2018 年 12 月起兼任海富通沪港深混合基金经理。2021 年 1 月起兼任海富通均衡甄选混合基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通惠睿精选混合基金经理。

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，全球各大经济体从疫情中逐渐复苏，虽然路径有所曲折但经济活力显著增加。由于全球供应链还在恢复中，全球流动性释放充分，大宗商品价格涨幅最为显著。海外需求强劲但海运费用涨幅惊人，出口企业盈利增长受到相当制约。相对外需，国内需求稍显疲弱，日益上涨的原材料压缩中游制造业利润。消费服务业复苏态势确立但强度较弱，新经济（新消费）增长态势显著高于旧经济。资本市场担忧的全球货币紧缩在上半年没有得到应验。

市场整体走势如同 N 字型态势，风格出现明显变化。春节前，核心资产为主的“茅指数”领涨，春节后担心美债利率上行和货币政策转向，核心资产领跌。五月以来，十年期国债利率继续下行带来成长股反弹。尤其是降准以来，市场风格向成长板块继续偏移。上半年 A 股主要指数方面，上证指数上涨 3.40%，沪深 300 上涨 0.24%，中证 800 上涨 1.72%，中小综指上涨 5.19%，创业板指上涨 17.22%。分行业看，周期和医药行业领涨，钢铁、化工、煤炭、综合和医药分别上涨 26.34%、19.12%、18.33%、16.93% 和 16.10%；非银金融和军工通信明显落后，非银金融、国防军工、农林牧渔、通信和综合金融分别下跌 11.02%、8.46%、7.84%、3.35% 和 2.88%。

从上半年市场内部的结构看，周期和成长交相呼应成为市场两条主线。周期主线在一季度演绎

得淋漓尽致，尤其在碳达峰的政策预期下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。同样是业绩靓丽的电动车产业链和半导体，五月以来行情同样演绎得如火如荼。消费领域除了医药 CXO 和次高端白酒，整体表现较弱。市场上半年赚钱效应明显，小盘股表现优于大盘股，核心资产相对疲弱。市场交易集中度有所下降，双创指数表现靓丽。整个市场反映出经济结构转型带来的红利，中国优势供应链成为市场配置热点。

在上半年的操作中，本基金较好把握住了市场的节奏变化和结构转换，在科技成长、周期金融等细分行业内加大个股精选，总体取得了较显著的超额受益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金净值增长率为 14.92%，同期基金业绩比较基准收益率为 2.22%，基金净值跑赢业绩比较基准 12.70 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济复苏态势或依然延续，政策工具箱已经提前打开。经济韧性依旧，出口与地产投资扩张趋势或可延续。货币政策预期可能更加平稳，对整个市场的影响或弱于上半年。当然，信用风险事件可能还会持续发生，流动性条件或与上半年相仿。

不管是周期还是成长，上半年的主线就是业绩（分子端）。上游原材料价格压力下半年依然明显，上游盈利或依然强于中游。产业趋势变化将是权益市场的主要驱动力。经济结构变化带来的红利较为确定，电动车、半导体、光伏等受益于政策导向的行业投资机会，或更加容易把握。行业格局较为良好的周期板块或可享受业绩增长带来的收益。

对于下半年，本基金将继续聚焦业绩（分子端）景气，同时注意规避可能存在估值泡沫或价值陷阱的领域，努力获取基金净值的良好表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本

基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2020 年 12 月 31 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2021 年 1 月 11 日完成权益登记，单位分红金额为 0.01 元，符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通收益增长证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通收益增长证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	25,272,714.48	11,213,721.48
结算备付金		2,020,923.44	4,301,088.11
存出保证金		284,653.35	301,429.49
交易性金融资产	6.4.7.2	2,098,357,224.11	1,753,328,350.73
其中：股票投资		1,675,796,138.61	1,399,121,449.83
基金投资		-	-
债券投资		422,561,085.50	354,206,900.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,888,704.89	21,558,148.50
应收利息	6.4.7.5	4,913,368.09	5,187,761.25
应收股利		-	-
应收申购款		1,249,993.30	769,499.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,142,987,581.66	1,796,659,998.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,016,802.28	6,578,422.49
应付赎回款		4,613,992.85	4,601,580.67
应付管理人报酬		2,511,207.93	2,257,853.74
应付托管费		418,534.68	376,308.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,242,951.71	1,516,760.07
应交税费		0.70	10.79

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,591.44	196,738.52
负债合计		16,903,081.59	15,527,675.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	860,725,933.55	825,023,484.31
未分配利润	6.4.7.10	1,265,358,566.52	956,108,839.20
所有者权益合计		2,126,084,500.07	1,781,132,323.51
负债和所有者权益总计		2,142,987,581.66	1,796,659,998.73

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.470 元，基金份额总额 860,725,933.55 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通收益增长证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		288,993,730.32	392,366,635.86
1.利息收入		6,913,807.65	4,582,131.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	77,150.94	105,864.82
债券利息收入		6,836,656.71	4,476,266.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		251,825,688.97	285,363,200.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	240,746,149.89	279,217,666.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-347,210.75	300,065.07
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	11,426,749.83	5,845,468.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	30,110,020.12	102,035,612.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	144,213.58	385,691.44
减：二、费用		22,348,430.64	18,968,696.84
1. 管理人报酬		14,641,059.67	10,179,384.28

2. 托管费		2,440,176.68	1,696,564.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,134,483.80	6,954,423.79
5. 利息支出		11,944.18	-
其中：卖出回购金融资产支出		11,944.18	-
6.税金及附加		0.26	1.80
7. 其他费用	6.4.7.20	120,766.05	138,322.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		266,645,299.68	373,397,939.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		266,645,299.68	373,397,939.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通收益增长证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	825,023,484.31	956,108,839.20	1,781,132,323.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	266,645,299.68	266,645,299.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	35,702,449.24	50,731,869.83	86,434,319.07
其中：1.基金申购款	132,159,989.35	175,699,073.63	307,859,062.98
2.基金赎回款	-96,457,540.11	-124,967,203.80	-221,424,743.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-8,127,442.19	-8,127,442.19
五、期末所有者权益（基金净值）	860,725,933.55	1,265,358,566.52	2,126,084,500.07
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	917,045,001.99	266,074,850.32	1,183,119,852.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	373,397,939.02	373,397,939.02

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-43,219,412.76	-35,561,243.77	-78,780,656.53
其中: 1.基金申购款	273,889,837.84	98,115,138.49	372,004,976.33
2.基金赎回款	-317,109,250.60	-133,676,382.26	-450,785,632.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-14,651,856.28	-14,651,856.28
五、期末所有者权益(基金净值)	873,825,589.23	589,259,689.29	1,463,085,278.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 任志强, 主管会计工作负责人: 胡光涛, 会计机构负责人: 胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通收益增长证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第 8 号《关于同意海富通收益增长证券投资基金设立的批复》核准, 由海富通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《海富通收益增长证券投资基金基金契约》(后更名为《海富通收益增长证券投资基金基金合同》)发起, 并于 2004 年 3 月 12 日募集成立。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 13,066,513,423.19 元, 已经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第 38 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通收益增长证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下, 本基金投资组合的基本范围为: 股票资产 0-80%, 债券资产 20-100%, 权证投资 0-3%, 并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: MSCI China A 指数×40%+上证国债指数×60%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通收益增长证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2008] 1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012] 85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2016] 36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017] 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增

值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	活期存款	25,272,714.48
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	25,272,714.48	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,469,958,853.32	1,675,796,138.61	205,837,285.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	202,530,251.64	200,683,085.50	-1,847,166.14
	银行间市场	222,296,500.00	221,878,000.00	-418,500.00
	合计	424,826,751.64	422,561,085.50	-2,265,666.14
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,894,785,604.96	2,098,357,224.11	203,571,619.15

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,765.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	818.55
应收债券利息	4,909,219.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	449.97
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	115.29
合计	4,913,368.09

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,242,176.71
银行间市场应付交易费用	775.00
合计	1,242,951.71

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,851.59
应付证券出借违约金	-
预提费用	91,739.85
合计	99,591.44

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	825,023,484.31	825,023,484.31
本期申购	132,159,989.35	132,159,989.35
本期赎回（以“-”号填列）	-96,457,540.11	-96,457,540.11
本期末	860,725,933.55	860,725,933.55

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,047,553,227.85	-91,444,388.65	956,108,839.20
本期利润	236,535,279.56	30,110,020.12	266,645,299.68
本期基金份额交易产生的变动数	47,683,505.79	3,048,364.04	50,731,869.83
其中：基金申购款	181,310,756.91	-5,611,683.28	175,699,073.63
基金赎回款	-133,627,251.12	8,660,047.32	-124,967,203.80
本期已分配利润	-8,127,442.19	-	-8,127,442.19
本期末	1,323,644,571.01	-58,286,004.49	1,265,358,566.52

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	43,010.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22,836.26
其他	11,304.65
合计	77,150.94

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	2,023,966,325.89
减：卖出股票成本总额	1,783,220,176.00
买卖股票差价收入	240,746,149.89

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	166,091,620.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	163,873,955.04
减：应收利息总额	2,564,876.19
买卖债券差价收入	-347,210.75

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,426,749.83
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,426,749.83

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	30,110,020.12
——股票投资	30,760,275.88
——债券投资	-650,255.76
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	30,110,020.12

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	141,933.47
转换费收入	2,280.11
合计	144,213.58

注：本基金赎回费收入、转换费收入归入基金财产部分具体见本基金基金合同、招募说明书（更新）等法律文件规定。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	5,133,458.80

银行间市场交易费用	1,025.00
合计	5,134,483.80

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,426.20
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	120,766.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
海通证券	312,325,876.55	7.82%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
海通证券	865,524.00	0.56%	-	-

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的 比例
海通证券	224,591.73	8.23%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的 比例
海通证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,641,059.67	10,179,384.28
其中：支付销售机构的客户维护费	1,682,969.34	1,076,377.68

注：1、支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

2、根据《海富通收益增长证券投资基金基金合同》的规定，如果本基金份额净值低于收益增长线，基金管理人将从下一日开始暂停收取管理人报酬，直至基金份额净值不低于收益增长线。

收益增长线为基金管理人通过风险预算管理和组合保险策略，建立的一条随时间推移呈现非负增长的安全收益增长曲线。收益增长线按日历计算的每 180 天调整一次，每期期初按照上期基金份额资产净值增长率的 60%和上期期末日的收益增长线水平来确定当期期末日的收益增长线水平。当期任何一天的收益增长线水平为上期期末和当期期末的收益增长线水平的线性插值。如果上期基金份额资产净值为零增长或负增长，则当期收益增长线保持上期期末水平。如果当期基金分红，收益增长线水平在分红除权日(含分红除权日)扣除分红额度向下调整。收益增长线从本基金开放日起计算，第一期收益增长线水平固定为 0.920 元。

3、本基金在本半年度未发生基金份额净值低于收益增长线水平的情况，管理人报酬均按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提(2020 年上半年度：同)。本基金截至 2021 年 6 月 30 日止的累计基金份额净值 4.120 元(2020 年 6 月 30 日：3.314 元)，高于累计收益增长线水平 1.429 元(2020 年 6 月 30 日：1.381 元)。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,440,176.68	1,696,564.03

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期

2021年1月1日至2021年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	30,271,869.84	-	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	25,272,714.48	43,010.03	12,565,739.70	67,103.20

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2021-01-11	2021-01-11	0.100	5,987,964.37	2,139,477.82	8,127,442.19	-
合计			0.100	5,987,964.37	2,139,477.82	8,127,442.19	-

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002623	亚玛顿	2021-06-29	2021-12-30	非公开发行流通受限	25.60	39.00	56,720	1,452,032.00	2,212,080.00	-
300067	安诺其	2021-04-29	2021-11-01	非公开发行流通受限	3.63	4.08	5,509,642	20,000,000.46	22,479,339.36	-
30070	天宇	2021-0	2021-0	非公	80.95	34.49	400,24	17,999	13,804	5

2	股份	1-18	7-20	开发 行流 通受 限			6	,961.0 5	,484.5 4	
30091 9	中伟 股份	2020-1 2-15	2021-0 7-02	新股 锁定	24.60	163.00	610	15,006 .00	99,430 .00	-
30092 7	江天 化学	2020-1 2-29	2021-0 7-07	新股 锁定	13.39	30.10	217	2,905. 63	6,531. 70	-
30092 9	华骐 环保	2021-0 1-12	2021-0 7-21	新股 锁定	13.87	29.55	183	2,538. 21	5,407. 65	-
30093 0	屹通 新材	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新股 锁定	13.11	24.48	322	4,221. 42	7,882. 56	-
30093 1	通用 电梯	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新股 锁定	4.31	13.11	672	2,896. 32	8,809. 92	-
30093 7	药易 购	2021-0 1-20	2021-0 7-27	新股 锁定	12.25	53.71	244	2,989. 00	13,105 .24	-
30094 1	创识 科技	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 锁定	21.31	49.94	399	8,502. 69	19,926 .06	-
30094 2	易瑞 生物	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 锁定	5.31	28.52	443	2,352. 33	12,634 .36	-
30094 3	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 锁定	9.79	23.01	255	2,496. 45	5,867. 55	-
30094 5	曼卡 龙	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 锁定	4.56	18.88	474	2,161. 44	8,949. 12	-
30094 8	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	新股 锁定	13.00	27.42	324	2,808. 00	8,884. 08	6
30095 0	德固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	新股 锁定	8.41	39.13	219	1,841. 79	8,569. 47	-
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 锁定	11.72	27.08	340	3,984. 80	9,207. 20	-
30095 5	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	新股 锁定	16.53	46.07	232	3,834. 96	10,688 .24	-
30095 6	英力 股份	2021-0 3-16	2021-0 9-27	新股 锁定	12.85	25.80	371	4,767. 35	9,571. 80	-
30095 8	建工 修复	2021-0 3-18	2021-0 9-29	新股 锁定	8.53	27.22	300	2,559. 00	8,166. 00	-
30096 0	通业 科技	2021-0 3-22	2021-0 9-29	新股 锁定	12.08	23.06	234	2,826. 72	5,396. 04	-
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 锁定	3.40	16.37	576	1,958. 40	9,429. 12	-
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 锁定	12.13	22.49	283	3,432. 79	6,364. 67	-
30096 7	晓鸣 股份	2021-0 4-02	2021-1 0-13	新股 锁定	4.54	11.54	507	2,301. 78	5,850. 78	-

300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股未上市并锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-

301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股未上市并锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688113	联测科技	2021-04-26	2021-01-08	新股锁定	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
688131	皓元医药	2021-06-01	2021-02-08	新股锁定	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
688191	智洋创新	2021-03-30	2021-00-08	新股锁定	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688200	华峰测控	2021-05-14	2021-01-15	询价转让锁定流通受限	260.10	428.15	54,000	14,045,400.00	23,120,100.00	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-00-13	新股锁定	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
688625	呈和科技	2021-05-31	2021-02-07	新股锁定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688639	华恒生物	2021-04-14	2021-00-22	新股锁定	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	老股东配债	100.00	100.00	2,645	264,500.00	264,500.00	-

注：1、根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股

份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

5、[300702]天宇股份于 2021 年 1 月 18 日非公开定增买入数量 679,432 股，成本 55,000,020.40 元；于 2021 年 6 月 18 日送股，数量 543,546 股。因此总数量 1,222,978 股，总成本 55,000,020.40 元。

6、[300948]冠中生态于 2021 年 2 月 18 日中签新股数量 2,153 股，其中锁定流通受限数量 216 股，成本 2,808.00 元；于 2021 年 6 月 4 日送股，数量 108 股。因此总数量 324 股，总成本 2,808.00 元。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.01%(2020 年 12 月 31 日：0.03%)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	59,691,000.00	69,895,000.00
合计	59,691,000.00	69,895,000.00

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	264,500.00	498,000.00
未评级	362,605,585.50	283,813,900.90
合计	362,870,085.50	284,311,900.90

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 2.98%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,272,714.48	-	-	-	25,272,714.48
结算备付金	2,020,923.44	-	-	-	2,020,923.44
存出保证金	284,653.35	-	-	-	284,653.35
交易性金融资产	257,670,244.00	164,626,341.50	264,500.00	1,675,796,138.61	2,098,357,224.11
应收证券清算款	-	-	-	10,888,704.89	10,888,704.89
应收利息	-	-	-	4,913,368.09	4,913,368.09
应收申购款	-	-	-	1,249,993.30	1,249,993.30
资产总计	285,248,535.27	164,626,341.50	264,500.00	1,692,848,204.89	2,142,987,581.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,016,802.28	8,016,802.28
应付赎回款	-	-	-	4,613,992.85	4,613,992.85
应付管理人报酬	-	-	-	2,511,207.93	2,511,207.93
应付托管费	-	-	-	418,534.68	418,534.68
应付交易费用	-	-	-	1,242,951.71	1,242,951.71
应交税费	-	-	-	0.70	0.70
其他负债	-	-	-	99,591.44	99,591.44
负债总计	-	-	-	16,903,081.59	16,903,081.59

利率敏感度缺口	285,248,535.27	164,626,341.50	264,500.00	1,675,945,123.30	2,126,084,500.07
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,213,721.48	-	-	-	11,213,721.48
结算备付金	4,301,088.11	-	-	-	4,301,088.11
存出保证金	301,429.49	-	-	-	301,429.49
交易性金融资产	184,816,483.00	168,892,417.90	498,000.00	1,399,121,449.83	1,753,328,350.73
应收证券清算款	-	-	-	21,558,148.50	21,558,148.50
应收利息	-	-	-	5,187,761.25	5,187,761.25
应收申购款	-	-	-	769,499.17	769,499.17
资产总计	200,632,722.08	168,892,417.90	498,000.00	1,426,636,858.75	1,796,659,998.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,578,422.49	6,578,422.49
应付管理人报酬	-	-	-	2,257,853.74	2,257,853.74
应付托管费	-	-	-	376,308.94	376,308.94
应付交易费用	-	-	-	1,516,760.07	1,516,760.07
应付赎回款	-	-	-	4,601,580.67	4,601,580.67
应付税费	-	-	-	10.79	10.79
其他负债	-	-	-	196,738.52	196,738.52
负债总计	-	-	-	15,527,675.22	15,527,675.22
利率敏感度缺口	200,632,722.08	168,892,417.90	498,000.00	1,411,109,183.53	1,781,132,323.51

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-935,525.04	-1,026,968.78
	市场利率下降 25 个基点	941,062.57	1,033,877.12

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产及存托凭证 0%-80%、债券资产 20%-100%、权证投资 0%-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	1,675,796,138. 61	78.82	1,399,121,449 .83	78.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,675,796,138. 61	78.82	1,399,121,449 .83	78.55

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	80,552,529.24	78,503,910.19
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-80,552,529.24	-78,503,910.19

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,675,796,138.61	78.20
	其中：股票	1,675,796,138.61	78.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	422,561,085.50	19.72
	其中：债券	422,561,085.50	19.72
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,293,637.92	1.27
8	其他各项资产	17,336,719.63	0.81
9	合计	2,142,987,581.66	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	12,858,515.64	0.60
B	采矿业	16,884,972.00	0.79
C	制造业	1,386,894,253.57	65.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	313,068.39	0.01
E	建筑业	14,916,270.00	0.70
F	批发和零售业	46,404.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	15,474,520.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,224.92	0.01
J	金融业	177,329,533.08	8.34
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	23,922,766.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	7,502,852.70	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	22,457.73	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,523,300.00	0.92
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,675,796,138.61	78.82

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	138,376	74,003,484.80	3.48
2	000830	鲁西化工	3,270,100	61,248,973.00	2.88
3	601233	桐昆股份	2,445,365	58,908,842.85	2.77
4	002541	鸿路钢构	973,249	56,789,079.15	2.67
5	300035	中科电气	2,066,600	50,528,370.00	2.38
6	601818	光大银行	12,892,127	48,732,240.06	2.29
7	601939	建设银行	6,651,300	44,231,145.00	2.08
8	300408	三环集团	1,022,100	43,357,482.00	2.04
9	002436	兴森科技	3,421,400	37,635,400.00	1.77
10	603987	康德莱	1,380,091	35,882,366.00	1.69
11	002332	仙琚制药	2,610,972	32,741,588.88	1.54
12	601398	工商银行	6,167,100	31,883,907.00	1.50
13	600219	南山铝业	8,750,030	31,500,108.00	1.48
14	601689	拓普集团	815,825	30,536,329.75	1.44
15	600031	三一重工	1,035,646	30,106,229.22	1.42
16	002409	雅克科技	370,896	30,042,576.00	1.41
17	002645	华宏科技	1,751,000	27,980,980.00	1.32
18	603113	金能科技	1,530,165	27,634,779.90	1.30
19	002408	齐翔腾达	2,210,338	27,452,397.96	1.29
20	000157	中联重科	2,965,322	27,399,575.28	1.29
21	688200	华峰测控	62,844	27,306,230.52	1.28
22	002353	杰瑞股份	593,954	26,549,743.80	1.25
23	688005	容百科技	214,881	26,043,577.20	1.22
24	002709	天赐材料	233,330	24,868,311.40	1.17
25	600563	法拉电子	155,371	24,604,551.56	1.16
26	000887	中鼎股份	2,036,700	24,603,336.00	1.16
27	300067	安诺其	5,509,642	22,479,339.36	1.06
28	300630	普利制药	412,925	21,637,270.00	1.02
29	300358	楚天科技	1,134,700	21,230,237.00	1.00
30	600110	诺德股份	1,708,300	20,807,094.00	0.98
31	002119	康强电子	1,254,000	20,791,320.00	0.98
32	300347	泰格医药	101,000	19,523,300.00	0.92
33	300327	中颖电子	227,200	19,364,256.00	0.91
34	300207	欣旺达	557,000	18,135,920.00	0.85

35	300121	阳谷华泰	1,457,760	17,945,025.60	0.84
36	002430	杭氧股份	517,609	17,904,095.31	0.84
37	603501	韦尔股份	53,290	17,159,380.00	0.81
38	600028	中国石化	3,872,700	16,884,972.00	0.79
39	603277	银都股份	714,452	16,611,009.00	0.78
40	601128	常熟银行	2,651,900	16,441,780.00	0.77
41	601166	兴业银行	795,700	16,351,635.00	0.77
42	002539	云图控股	1,843,900	16,097,247.00	0.76
43	600166	福田汽车	4,624,300	15,953,835.00	0.75
44	603348	文灿股份	452,400	15,834,000.00	0.74
45	300982	苏文电能	266,600	14,916,270.00	0.70
46	601111	中国国航	1,862,500	14,490,250.00	0.68
47	002637	赞宇科技	927,300	14,178,417.00	0.67
48	603369	今世缘	256,632	13,899,189.12	0.65
49	300702	天宇股份	400,246	13,804,484.54	0.65
50	601888	中国中免	45,700	13,714,570.00	0.65
51	300319	麦捷科技	1,117,100	13,461,055.00	0.63
52	002714	牧原股份	211,323	12,852,664.86	0.60
53	300735	光弘科技	1,034,800	12,583,168.00	0.59
54	603180	金牌厨柜	259,008	12,352,091.52	0.58
55	000902	新洋丰	780,826	12,204,310.38	0.57
56	300680	隆盛科技	454,600	12,160,550.00	0.57
57	600808	马钢股份	2,762,500	11,851,125.00	0.56
58	300919	中伟股份	69,210	11,281,230.00	0.53
59	603279	景津环保	506,169	11,216,705.04	0.53
60	600741	华域汽车	426,200	11,196,274.00	0.53
61	300280	紫天科技	279,600	10,208,196.00	0.48
62	000932	华菱钢铁	1,529,900	10,097,340.00	0.47
63	002049	紫光国微	64,200	9,898,998.00	0.47
64	600782	新钢股份	1,727,800	9,641,124.00	0.45
65	300274	阳光电源	81,700	9,400,402.00	0.44
66	600389	江山股份	263,500	9,061,765.00	0.43
67	603808	歌力思	552,100	8,723,180.00	0.41
68	600519	贵州茅台	4,098	8,428,356.60	0.40
69	002142	宁波银行	199,200	7,762,824.00	0.37
70	000825	太钢不锈	998,500	7,478,765.00	0.35
71	002157	正邦科技	616,200	7,363,590.00	0.35
72	000930	中粮科技	794,400	7,157,544.00	0.34
73	000959	首钢股份	1,265,700	7,113,234.00	0.33
74	603259	药明康德	43,900	6,874,301.00	0.32
75	000001	平安银行	293,066	6,629,152.92	0.31
76	000858	五粮液	21,406	6,376,633.34	0.30
77	600399	抚顺特钢	328,700	5,962,618.00	0.28
78	002459	晶澳科技	107,800	5,282,200.00	0.25

79	600104	上汽集团	191,900	4,216,043.00	0.20
80	601009	南京银行	380,500	4,002,860.00	0.19
81	300171	东富龙	78,900	3,207,285.00	0.15
82	002614	奥佳华	135,400	3,064,102.00	0.14
83	601003	柳钢股份	447,400	2,639,660.00	0.12
84	603799	华友钴业	21,200	2,421,040.00	0.11
85	002623	亚玛顿	56,720	2,212,080.00	0.10
86	300114	中航电测	135,800	2,064,160.00	0.10
87	605068	明新旭腾	53,300	1,917,201.00	0.09
88	300696	爱乐达	43,960	1,829,615.20	0.09
89	601288	农业银行	415,600	1,259,268.00	0.06
90	600029	南方航空	163,500	984,270.00	0.05
91	603730	岱美股份	36,400	663,208.00	0.03
92	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.02
93	600167	联美控股	33,600	300,048.00	0.01
94	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.01
95	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.01
96	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.00
97	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
98	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.00
99	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
100	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.00
101	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
102	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
103	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
104	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
105	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
106	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
107	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
108	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
109	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
110	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
111	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
112	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
113	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
114	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
115	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
116	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
117	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
118	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
119	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
120	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
121	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
122	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00

123	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
124	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
125	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
126	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
127	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
128	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
129	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
130	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
131	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
132	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
133	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
134	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
135	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
136	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
137	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
138	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
139	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
140	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
141	601012	隆基股份	60	5,330.40	0.00
142	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
143	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
144	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
145	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
146	300822	贝仕达克	50	1,330.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000830	鲁西化工	55,372,451.55	3.11
2	600031	三一重工	54,095,898.00	3.04
3	600309	万华化学	46,783,903.90	2.63
4	002714	牧原股份	46,049,683.45	2.59
5	603113	金能科技	41,692,354.47	2.34
6	000157	中联重科	39,626,215.91	2.22
7	300408	三环集团	38,553,745.76	2.16
8	601899	紫金矿业	36,087,099.99	2.03
9	600219	南山铝业	34,531,778.59	1.94
10	002436	兴森科技	34,372,321.76	1.93
11	002044	美年健康	33,676,211.56	1.89

12	002709	天赐材料	33,244,262.60	1.87
13	603369	今世缘	29,724,671.62	1.67
14	002185	华天科技	28,641,966.06	1.61
15	002409	雅克科技	28,067,534.46	1.58
16	002645	华宏科技	25,645,252.59	1.44
17	600779	水井坊	25,265,220.22	1.42
18	601398	工商银行	24,993,074.00	1.40
19	300630	普利制药	24,400,756.50	1.37
20	000887	中鼎股份	24,233,838.00	1.36

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300014	亿纬锂能	66,013,470.29	3.71
2	002064	华峰化学	54,172,278.44	3.04
3	300433	蓝思科技	51,097,288.90	2.87
4	600309	万华化学	48,921,559.82	2.75
5	000333	美的集团	48,208,751.84	2.71
6	603501	韦尔股份	46,825,727.56	2.63
7	601012	隆基股份	45,100,503.51	2.53
8	601899	紫金矿业	41,108,691.17	2.31
9	688200	华峰测控	37,520,182.56	2.11
10	603218	日月股份	36,662,022.74	2.06
11	000100	TCL 科技	31,611,222.00	1.77
12	002984	森麒麟	29,861,126.10	1.68
13	601615	明阳智能	29,532,268.20	1.66
14	002709	天赐材料	29,282,590.08	1.64
15	002185	华天科技	27,881,224.73	1.57
16	002044	美年健康	27,672,833.00	1.55
17	600779	水井坊	27,298,100.00	1.53
18	600690	海尔智家	26,983,661.00	1.51
19	601808	中海油服	26,804,864.00	1.50
20	000661	长春高新	26,140,458.84	1.47

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,029,134,588.90
---------------	------------------

卖出股票的收入（成交）总额	2,023,966,325.89
---------------	------------------

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	230,091,585.50	10.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	192,205,000.00	9.04
	其中：政策性金融债	192,205,000.00	9.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	264,500.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	422,561,085.50	19.88

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	010303	03 国债(3)	1,017,290	103,102,341.50	4.85
2	010107	21 国债(7)	971,220	97,316,244.00	4.58
3	190207	19 国开 07	700,000	70,420,000.00	3.31
4	180204	18 国开 04	400,000	41,252,000.00	1.94
5	150204	15 国开 04	300,000	30,243,000.00	1.42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的鸿路钢构（002541），2017年9月20日因新建厂房项目发生死亡一人的生产安全责任事故，于2020年7月24日受到南京市溧水区安全生产监督管理局行政处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：近年来公司成本和费用管控能力持续加强，依靠规模化采购、细分产品专业化、管理优化等举措实现了较强的成本优势。认为随着公司产能的持续爬坡，叠加智能制造技术、配套工厂建设等举措，公司在成本和交付上的优势有望得到进一步强化。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的建设银行（601939），因存在内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；逆流程开展业务操作；本行理财产品之间风险隔离不到位；未做到理财业务与自营业务风险隔离；个人理财资金违规投资；违规为理财产品提供隐性担保；同业投资违规接受担保的违规行为，

违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的规定和相关审慎经营规则，于 2020 年 7 月 13 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款合计 3920 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国性大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的 19 国开 07（190207）的发行人，因为违规的政府购买服务项目提供融资、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况、违规变相发放土地储备贷款、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款、贷款风险分类不准确等违规行为，于 2020 年 12 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会处罚罚款 4880 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型政策性银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	284,653.35
2	应收证券清算款	10,888,704.89
3	应收股利	-
4	应收利息	4,913,368.09
5	应收申购款	1,249,993.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,336,719.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
40,892	21,048.76	377,776,471.06	43.89%	482,949,462.49	56.11%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,661.85	0.0011%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年3月12日）基金份额总额	13,073,674,692.30
本报告期期初基金份额总额	825,023,484.31
本报告期基金总申购份额	132,159,989.35
减：本报告期基金总赎回份额	96,457,540.11
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	860,725,933.55
-------------	----------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	1,355,044,691.27	33.95%	990,944.87	36.31%	-
广发证券	2	861,982,189.69	21.59%	613,130.30	22.47%	-
方正证券	2	486,259,375.85	12.18%	200,647.79	7.35%	-
中信建投	1	334,190,307.53	8.37%	237,710.06	8.71%	-
海通证券	3	312,325,876.55	7.82%	224,591.73	8.23%	-
民生证券	1	269,329,658.74	6.75%	191,575.14	7.02%	-
国泰君安	1	257,549,833.35	6.45%	188,344.42	6.90%	-
财信证券（原财富证券）	1	115,108,107.85	2.88%	81,876.70	3.00%	-

东方证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信华南(原广州证券)	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
长江证券	138,342,155.00	89.44%	38,000,000.00	100.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
海通证券	865,524.00	0.56%	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	15,465,304.00	10.00%	-	-	-	-
财信证券（原财富证券）	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信华南（原广州证券）	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
3	海富通收益增长证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-04
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-05
5	海富通收益增长证券投资基金第八次分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-07
6	海富通收益增长证券投资基金恢复大额申购和转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2021-01-12

		子披露网站	
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
8	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
9	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配天宇股份（300702）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-20
10	关于提升海富通收益增长证券投资基金收益增长线数值的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-26
11	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加浙商银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
13	海富通基金管理有限公司关于中国农业银行股份有限公司开通旗下部分基金转换业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-03
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
16	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台开通中国工商银行快捷支付业务并开展申购费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
17	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销金账户业务并实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
18	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加花旗银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-09
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
20	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配安诺其（300067）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-06
21	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加	证券时报、基金管理人网	2021-05-06

	招商银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
22	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中信银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-20
23	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021/1/1-2021/6/30	204,729,055.72	-	-	204,729,055.72	23.79%

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的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。

11.2 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 99 只公募基金。截至 2021 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1296 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。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有

限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。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”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通收益增长证券投资基金的文件
- （二）海富通收益增长证券投资基金基金合同
- （三）海富通收益增长证券投资基金招募说明书
- （四）海富通收益增长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）报告期内海富通收益增长证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 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。

12.3 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

二〇二一年八月三十一日