

**海富通股票混合型证券投资基金**  
**2021 年年度报告**  
**2021 年 12 月 31 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：二〇二二年三月三十一日

## §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。本年度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 2022 年 3 月 29 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
<b>§5 托管人报告</b>	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 审计报告</b>	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
<b>§7 年度财务报表</b>	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
<b>§8 投资组合报告</b>	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
8.6 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 .....	58
8.7 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 .....	58
8.8 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 .....	58
8.9 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 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.3 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 .....	61
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>61</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
11.2 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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>67</b>
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>69</b>
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	69
13.3 查阅方式 .....	69

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通股票混合型证券投资基金
基金简称	海富通股票混合
基金主代码	519005
交易代码	519005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 7 月 29 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	1,683,150,953.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合，分享中国经济高速成长的成果，谋求基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采用双层次的投资策略：第一层次主要通过对股票市场的系统性风险进行分析，确定股票和现金资产的配置比例；第二层次主要是通过对行业景气循环和个股的研究，精选适合本投资组合风险收益特征的股票。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股指数*80%+上证国债指数*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

### 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	姓名	岳冲	许俊

负责人	联系电话	021-38650788	010-66596688
	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	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大 楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	1,579,264,521.06	-14,137,945.59	603,799,281.09

本期利润	695,185,224.94	469,446,800.72	1,606,390,052.87
加权平均基金份额 本期利润	0.3009	0.0865	0.4072
本期加权平均净值 利润率	23.87%	7.92%	57.90%
本期基金份额净值 增长率	27.07%	24.56%	81.59%
<b>3.1.2 期末数据和 指标</b>	<b>2021 年末</b>	<b>2020 年末</b>	<b>2019 年末</b>
期末可供分配利润	866,324,822.43	213,581,224.66	-186,931,882.43
期末可供分配基金 份额利润	0.5147	0.0553	-0.0435
期末基金资产净值	2,549,475,775.43	4,600,953,215.67	4,114,560,215.04
期末基金份额净值	1.5147	1.1920	0.9570
<b>3.1.3 累计期末指 标</b>	<b>2021 年末</b>	<b>2020 年末</b>	<b>2019 年末</b>
基金份额累计净值 增长率	573.01%	429.63%	325.21%

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)。

4、本基金管理人于 2021 年 12 月 7 日发布公告,自 2021 年 12 月 7 日起提高本基金份额净值精确位数至小数点后 4 位,小数点后第 5 位四舍五入。

## 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
过去三个 月	-4.01%	1.95%	1.76%	0.60%	-5.77%	1.35%
过去六个	16.69%	2.69%	-1.73%	0.78%	18.42%	1.91%

月						
过去一年	27.07%	2.47%	0.90%	0.90%	26.17%	1.57%
过去三年	187.42%	2.41%	63.00%	1.04%	124.42%	1.37%
过去五年	164.35%	2.23%	34.47%	0.97%	129.88%	1.26%
自基金合同生效起至今	573.01%	1.90%	398.93%	1.34%	174.08%	0.56%

### 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

海富通股票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  
(2005 年 7 月 29 日至 2021 年 12 月 31 日)



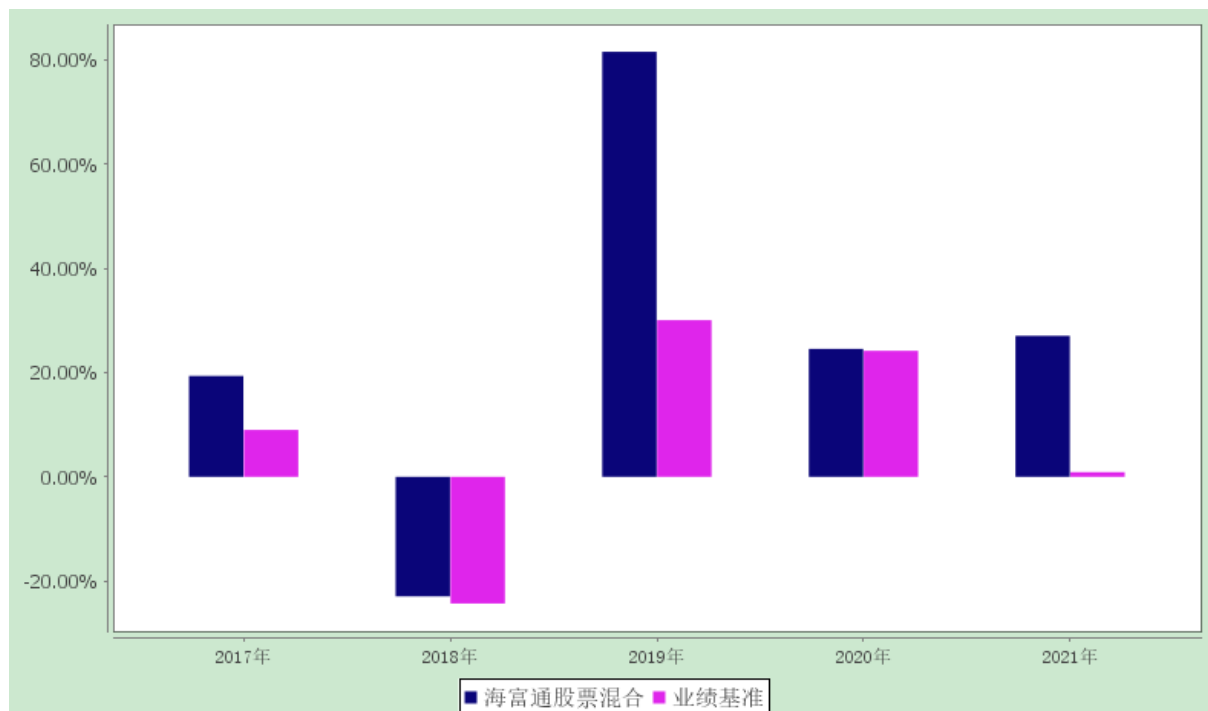
注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。本基金自 2007 年 8 月 22 日至 2007 年 11 月 23 日为持续营销后建仓期。建仓期满至今本基金的各项投资比例已达到基金合同第 14 章（二）关于投资范围的规定；同时满足第 14 章（七）有关投资组合限制的各项比例要求。

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 日起调整海富通股票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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



海富通股票混合型证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2021年	-	-	-	-	-
2020年	-	-	-	-	-
2019年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未实施利润分配。

## §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 12 月 31 日,本基金管理人共管理 91 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、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、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

#### 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		
吕越超	本基金的基金经理；公募权益投资部副总监。	2016-11-25	-	11 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任长江证券研究所分析师，泰达宏利基金管理有限公司研究员、基金经理。2014 年 11 月至 2016 年 7 月任泰达宏利周期混合基金经理，2015 年 6 月至 2016 年 7 月兼任泰达宏利创益混合基金经理。2016 年 11 月起任海富通股票混合基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通先进制造股票基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通科技创新混合基金经理。2020 年 9 月起兼任海富通成长甄选混合基金经理。
杨宁嘉	本基金的基金经理助理。	2020-12-10	2021-09-01	7 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任海通国际证券集团有限公司首席分析师助理、光大证券股份有限公司行业研究员。2017 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、

					高级股票分析师、基金经理助理。2021 年 9 月起任海富通电子信息传媒产业股票基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.3 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

回顾 2021 年，受益于全球流动性的宽松，整体的风险偏好有所提升。宏观经济逐步下行，需求收缩、供给冲击，但中国疫情控制较好，在全球供应链的分工中有所受益，因此外需贡献了主要支撑力量，带动制造业下半年走高。映射到市场，2021 年市场指数分化较大，以结构性机会为主。大盘蓝筹和港股通跌幅较大，中小盘指数全年有较好的涨幅。具体来看，沪深 300 指数、中证 800、创业板指、中证 1000 和恒生港股通等主要指数当年涨跌幅分别为-5.20%、-0.76%、12.02%、20.52%和-11.06%。

就行业表现而言，31 个申万一级行业表现两极分化尤为显著。全年涨幅居于前五位的行业分别是电力设备、有色金属、煤炭、基础化工和钢铁，全年涨幅在 34%-48%之间。另一边，家用电器、非银金融、房地产、社会服务和食品饮料是跌幅前五的行业，全年跌幅在-6%到-20%之间。全年行情的主线集中在成长和周期两个方向，基本围绕碳中和。一方面，成长板块中新能源车、光伏、风电、电网设备和新能源运营等板块有明显超额。此外，在传统周期中，受益于全球资源品价格上涨和能源短缺瓶颈的上游原材料、煤炭等板块也有明显超额。而终端消费品板块，一方面下游需求低迷，另一方面受到原材料对毛利率的挤压，总体表现都比较低迷。

从业绩的角度来看，全行业业绩在 2021 年 2 季度业绩增速出现逐季收窄，周期和中游制造板块增收有增利，消费板块的盈利能力出现明显下滑。预计本轮 A 股净利润增速收窄还要延续到 2022 年下半年。

一级市场融资表现比较活跃。随着科创板对公司盈利条件的放松，注册制试点的不断深入，一批高新技术和战略性新兴产业股票发行上市，从万得统计数据来看，全年 A 股市场的权益融资规模，包括 IPO、再融资、优先股、可转债等合计超过 1.8 万亿元，仅次于 2016 年；2021 年的 IPO 数量达到 524 家，处于历史最高水平。截至 2021 年年底，沪深两市的股票数量突破了 4600 支，沪深两市总市值超过 90 万亿元，与 2021 年 GDP 的比值接近 0.8。

在 2021 年的操作中，本基金把握住了泛新能源、半导体、国防军工等方向的投资机会，同时积极自下而上寻找优质成长股，总体取得了不错的超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 27.07%，同期业绩比较基准收益率为 0.90%，基金净值跑赢业绩比较基准 26.17 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

宏观经济和政策层面，2022 年海外需求可能逐步回落、通胀压力依然较强，美国依

旧处于“类滞胀”阶段，美联储缩减购债规模加速、加息预期上升，全球流动性进入收缩周期，美债收益率仍有上行压力。国内一季度经济下行压力快速抬升，PPI 增速延续回落，经济处于“类衰退”阶段，政策空间较大。随着中央经济工作会议定调“稳字当头、稳中求进、政策靠前发力”，预计将是“宽财政+稳货币+宽信用”的组合，社融增速将筑底回升。社融拐点领先于宏观经济拐点，预计 2022 年年中前后经济将触底小幅回升，届时政策宽松程度将减弱。

展望 2022 年，A 股净利润增速及 ROE 将双双下行，盈利驱动阶段结束，进入盈利下行阶段。后续政策实际放松幅度，尤其是宽信用的幅度将决定今年市场估值抬升幅度。一般而言，盈利下行阶段指数以区间震荡为主，市场以结构性机会为主。大方向上，随着上游价格见顶回落、稳增长力度逐步加大，配置逐步向中下游及政策支持方向倾斜。中期来看，偏成长的风格在估值匹配度较好的情况下，仍然是最重要的方向。

对于 2022 年的投资，本基金将密切关注海外及国内的经济运行和政策变化，积极把握能源技术变革和信息技术变革带动的新兴产业投资机会，同时继续挖掘和优化个股，努力获取基金净值的良好表现。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项稽核等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度，健全内控体系，落实内控责任。

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化及公司管理需要，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。优化督察稽核部合规、审计部门架构，增设投资、销售、运营条线专职合规人员，完善了公司内部控制三层控制体系，强化了各项内控职责，为公司各项业务合规开展及基金持有人利益最大化提供有力的保障。

二、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施。

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计，同时积极配合外部机构对公司开展审计和内控评估等工作，通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作。

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度及流程，组织多场反洗钱专项培训、考试和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展全面的客户信息

核查清理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，持续优化系统和监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了 2020 年度的洗钱风险自评估工作。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，提升员工的合规及风险意识。

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并组织全体员工开展各类内外部培训，剖析风险案例，并通过结合内部考试系统多次组织了线上培训及在线考试。通过培训，增强了员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.9 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”）在海富通股票混合型证券投资基金（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 托管人对本年度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 审计报告

毕马威华振审字第 2200044 号

海富通股票混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通股票混合型证券投资基金（以下简称“海富通股票混合基金”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了海富通股票混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。



## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海富通股票混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

海富通股票混合基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括海富通股票混合基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估海富通股票混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非海富通股票混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通股票混合基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按

照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对海富通股票混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海富通股票混合基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

王国蓓 倪益

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2022 年 3 月 29 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：海富通股票混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	7.4.7.1	137,665,103.76	269,324,479.14
结算备付金	7.4.10.6	21,396,076.60	16,286,741.40
存出保证金		991,255.12	1,908,829.16
交易性金融资产	7.4.7.2	2,372,219,441.39	4,342,425,152.71
其中：股票投资		2,372,219,441.39	4,342,425,152.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		47,851,177.55	58,694,385.45
应收利息	7.4.7.5	23,724.42	35,476.00
应收股利		-	-
应收申购款		2,468,694.13	3,786,558.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,582,615,472.97	4,692,461,622.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,260,091.46	-
应付赎回款		8,972,297.57	78,821,112.39
应付管理人报酬		3,174,128.94	5,568,133.51
应付托管费		529,021.49	928,022.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,995,150.36	5,829,680.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	209,007.72	361,458.16
负债合计		33,139,697.54	91,508,406.51
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,683,150,953.00	3,859,677,244.12
未分配利润	7.4.7.10	866,324,822.43	741,275,971.55
所有者权益合计		2,549,475,775.43	4,600,953,215.67
负债和所有者权益总计		2,582,615,472.97	4,692,461,622.18

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5147 元，基金份额总额 1,683,150,953.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通股票混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>801,394,831.14</b>	<b>642,417,168.58</b>
1.利息收入		946,591.47	2,359,221.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	946,591.47	2,359,221.02
债券利息收入		-	-
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）		1,679,616,522.75	133,281,857.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,673,259,499.46	121,009,578.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	6,357,023.29	12,272,278.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-884,079,296.12	483,584,746.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	4,911,013.04	23,191,343.79
<b>减：二、费用</b>		<b>106,209,606.20</b>	<b>172,970,367.86</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	43,843,976.41	88,456,907.96
2. 托管费	7.4.10.2. 2	7,307,329.47	14,742,817.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	54,798,031.62	69,510,185.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	260,268.70	260,456.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>695,185,224.94</b>	<b>469,446,800.72</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>695,185,224.94</b>	<b>469,446,800.72</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通股票混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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)	3,859,677,244.12	741,275,971.55	4,600,953,215.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	695,185,224.94	695,185,224.94
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)	-2,176,526,291.12	-570,136,374.06	-2,746,662,665.18
其中：1.基金申购款	2,512,038,677.50	788,298,542.89	3,300,337,220.39
2.基金赎回款	-4,688,564,968.62	-1,358,434,916.95	-6,046,999,885.57
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,683,150,953.00	866,324,822.43	2,549,475,775.43
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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)	4,301,492,097.47	-186,931,882.43	4,114,560,215.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	469,446,800.72	469,446,800.72
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)	-441,814,853.35	458,761,053.26	16,946,199.91
其中：1.基金申购款	14,979,148,661.67	2,479,376,077.14	17,458,524,738.81
2.基金赎回款	-15,420,963,515.02	-2,020,615,023.88	-17,441,578,538.90
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）			
五、期末所有者权益（基金净值）	3,859,677,244.12	741,275,971.55	4,600,953,215.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

海富通股票混合型证券投资基金（原名为海富通股票证券投资基金，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[2005]85号《关于同意海富通股票证券投资基金募集申请的批复》核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通股票证券投资基金基金合同》公开募集。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 419,517,490.36 元。经向中国证监会备案，《海富通股票证券投资基金基金合同》于 2005 年 7 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 419,612,160.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,669.86 份基金份额。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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，海富通股票证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为海富通股票混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通股票混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括为国内依法发行上市的股票、存托凭证、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：股票资产及存托凭证 70%-95%，权证投资 0-3%，一年期以内的政府债券和现金的比例不低于 5%，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×80%+上证国债指数×20%。

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 2022 年 3 月 29 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。



- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投

资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业或兑付机构代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在证券实际持

有期内逐日计提。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、资产支持证券和衍生工具权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《海富通股票混合型证券投资基金基金合同》的规定，基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红登记日经除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；每一基金份额享有同等分配权；基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多六次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成。成立不满三个月，收益可不分配。分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红。法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	137,665,103.76	269,324,479.14
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	137,665,103.76	269,324,479.14

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,181,434,789.26	2,372,219,441.39	190,784,652.13
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,181,434,789.26	2,372,219,441.39	190,784,652.13
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,267,561,204.46	4,342,425,152.71	1,074,863,948.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,267,561,204.46	4,342,425,152.71	1,074,863,948.25

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	13,643.10	27,287.57
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	9,628.20	7,329.00
应收债券利息	-	-
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	7.02	0.43
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	446.10	859.00
合计	23,724.42	35,476.00

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	7,995,150.36	5,829,680.21
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,995,150.36	5,829,680.21

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	19,007.72	171,458.16
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	190,000.00	190,000.00
合计	209,007.72	361,458.16

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,859,677,244.12	3,859,677,244.12
本期申购	2,512,038,677.50	2,512,038,677.50
本期赎回（以“-”号填列）	-4,688,564,968.62	-4,688,564,968.62
本期末	1,683,150,953.00	1,683,150,953.00

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	213,581,224.66	527,694,746.89	741,275,971.55



本期利润	1,579,264,521.06	-884,079,296.12	695,185,224.94
本期基金份额交易产生的变动数	-403,917,471.44	-166,218,902.62	-570,136,374.06
其中：基金申购款	980,936,253.47	-192,637,710.58	788,298,542.89
基金赎回款	-1,384,853,724.91	26,418,807.96	-1,358,434,916.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,388,928,274.28	-522,603,451.85	866,324,822.43

#### 7.4.7.11 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12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
活期存款利息收入	688,069.31	1,965,824.05
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	231,580.42	317,250.73
其他	26,941.74	76,146.24
合计	946,591.47	2,359,221.02

#### 7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	21,778,270,237.55	25,297,472,038.04
减：卖出股票成本总额	20,105,010,738.09	25,176,462,459.45
买卖股票差价收入	1,673,259,499.46	121,009,578.59

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
股票投资产生的股利收益	6,357,023.29	12,272,278.87
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	6,357,023.29	12,272,278.87

**7.4.7.17 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12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
1.交易性金融资产	-884,079,296.12	483,584,746.31
——股票投资	-884,079,296.12	483,584,746.31
——债券投资	-	-
——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	-884,079,296.12	483,584,746.31

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	4,860,436.20	22,770,180.28
基金转换费收入	50,576.84	421,163.51
合计	4,911,013.04	23,191,343.79

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	54,798,031.62	69,510,185.54
银行间市场交易费用	-	-
合计	54,798,031.62	69,510,185.54

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	33,068.70	33,256.40
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	260,268.70	260,456.40

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海富通资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司

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，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	6,644,571,926.00	16.29%	13,952,375,070.70	27.67%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

##### 7.4.10.1.3 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

海通证券	4,797,838.08	16.35%	1,399,119.82	17.50%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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 佣金总额的 比例
海通证券	10,773,655.45	27.17%	0.00	0.00%

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、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	43,843,976.41	88,456,907.96
其中：支付销售机构的客户维护 费	18,563,653.74	24,865,949.21

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,307,329.47	14,742,817.96

注：支付基金托管人中国银行的基金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。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 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****7.4.10.4.1 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**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

**7.4.10.4.2 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**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未持有过本基金。

**7.4.10.5.2 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。

**7.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年12月31 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 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	137,665,103.76	688,069.31	269,324,479.14

注：本基金通过“中国银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 21,396,076.60 元。（2020 年 12 月 31 日：人民币 16,286,741.40 元）

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-

30104 5	天禄 科技	2021- 08-06	2022- 02-17	新股 锁定	15.81	28.37	335	5,296. 35	9,503. 95	-
30104 6	能辉 科技	2021- 08-10	2022- 02-17	新股 锁定	8.34	48.99	290	2,418. 60	14,20 7.10	-
30104 8	金鹰 重工	2021- 08-11	2022- 02-28	新股 锁定	4.13	12.96	843	3,481. 59	10,92 5.28	-
30104 9	超越 科技	2021- 08-17	2022- 02-24	新股 锁定	19.34	32.92	196	3,790. 64	6,452. 32	-
30105 3	远信 工业	2021- 08-25	2022- 03-01	新股 锁定	11.87	28.78	155	1,839. 85	4,460. 90	-
30105 5	张小 泉	2021- 08-26	2022- 03-07	新股 锁定	6.90	21.78	355	2,449. 50	7,731. 90	-
30105 6	森赫 股份	2021- 08-27	2022- 03-07	新股 锁定	3.93	11.09	572	2,247. 96	6,343. 48	-
30105 7	汇隆 新材	2021- 08-31	2022- 03-09	新股 锁定	8.03	19.02	218	1,750. 54	4,146. 36	-
30105 8	中粮 工科	2021- 09-01	2022- 03-09	新股 锁定	3.55	18.24	1,386	4,920. 30	25,28 0.64	-
30105 9	金三 江	2021- 09-03	2022- 03-14	新股 锁定	8.09	19.30	259	2,095. 31	4,998. 70	-
30106 0	兰卫 医学	2021- 09-06	2022- 03-14	新股 锁定	4.17	30.94	587	2,447. 79	18,16 1.78	-
30106 3	海锅 股份	2021- 09-09	2022- 03-24	新股 锁定	17.40	36.11	153	2,662. 20	5,524. 83	-
30106 8	大地 海洋	2021- 09-16	2022- 03-28	新股 锁定	13.98	28.38	144	2,013. 12	4,086. 72	-
30106 9	凯盛 新材	2021- 09-16	2022- 03-28	新股 锁定	5.17	44.21	539	2,786. 63	23,82 9.19	-
30107 2	中捷 精工	2021- 09-22	2022- 03-29	新股 锁定	7.46	33.41	181	1,350. 26	6,047. 21	-
30107 3	君亭 酒店	2021- 09-22	2022- 03-30	新股 锁定	12.24	32.00	144	1,762. 56	4,608. 00	-
30107 8	孩子 王	2021- 09-30	2022- 04-14	新股 锁定	5.77	12.14	756	4,362. 12	9,177. 84	-
30107 9	邵阳 液压	2021- 10-11	2022- 04-19	新股 锁定	11.92	24.82	140	1,668. 80	3,474. 80	-
30108 1	严牌 股份	2021- 10-13	2022- 04-20	新股 锁定	12.95	17.44	403	5,218. 85	7,028. 32	-
30108 2	久盛 电气	2021- 10-14	2022- 04-27	新股 锁定	15.48	21.53	915	14,16 4.20	19,69 9.95	-
30108 3	百胜 智能	2021- 10-13	2022- 04-21	新股 锁定	9.08	14.21	416	3,777. 28	5,911. 36	-
30108 7	可孚 医疗	2021- 10-15	2022- 04-25	新股 锁定	93.09	75.34	848	78,94 0.32	63,88 8.32	-



301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股锁定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股锁定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股锁定	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新股锁定	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
688303	大全能源	2021-07-15	2022-01-24	新股锁定	21.49	60.51	48,536	1,043,038.64	2,936,913.36	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算，在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配或询价转让方式受让的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金持有的上市公司非公开发行股份，减持采取集中竞价交易方式或采取大宗交易方式的根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由法规规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2021 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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以上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“风险和收益相匹配”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。

#### 7.4.13.2 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于信用良好的银行，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 12 月 31 日，本基金未持有债券投资和资产支持证券（2020 年 12 月 31 日：无）。

### 7.4.13.3 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上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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个半月以内且不计息，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。

#### 7.4.13.3.1 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时间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公司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 7.4.12。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 12 月 31 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 0.14%。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、结算备付金及存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	137,665,103.76	-	-	-	137,665,103.76
结算备付金	21,396,076.60	-	-	-	21,396,076.60
存出保证金	991,255.12	-	-	-	991,255.12
交易性金融资产	-	-	-	2,372,219,441.39	2,372,219,441.39
应收证券清算款	-	-	-	47,851,177.55	47,851,177.55
应收利息	-	-	-	23,724.42	23,724.42
应收申购款	-	-	-	2,468,694.13	2,468,694.13
资产总计	160,052,435.48	-	-	2,422,563,037.49	2,582,615,472.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,260,091.46	12,260,091.46
应付赎回款	-	-	-	8,972,297.57	8,972,297.57
应付管理人报酬	-	-	-	3,174,128.94	3,174,128.94
应付托管费	-	-	-	529,021.49	529,021.49
应付交易费用	-	-	-	7,995,150.36	7,995,150.36
其他负债	-	-	-	209,007.72	209,007.72
负债总计	-	-	-	33,139,697.54	33,139,697.54
利率敏感度缺口	160,052,435.48	-	-	2,389,423,339.95	2,549,475,775.43
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	269,324,479.14	-	-	-	269,324,479.14
结算备付金	16,286,741.40	-	-	-	16,286,741.40
存出保证金	1,908,829.16	-	-	-	1,908,829.16
交易性金融资	-	-	-	4,342,425,152.	4,342,425,152.

产				71	2.71
应收证券清算款	-	-	-	58,694,385.45	58,694,385.45
应收利息	-	-	-	35,476.00	35,476.00
应收申购款	198.22	-	-	3,786,360.10	3,786,558.32
资产总计	287,520,247.92	-	-	4,404,941,374.26	4,692,461,622.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	78,821,112.39	78,821,112.39
应付管理人报酬	-	-	-	5,568,133.51	5,568,133.51
应付托管费	-	-	-	928,022.24	928,022.24
应付交易费用	-	-	-	5,829,680.21	5,829,680.21
其他负债	-	-	-	361,458.16	361,458.16
负债总计	-	-	-	91,508,406.51	91,508,406.51
利率敏感度缺口	287,520,247.92	-	-	4,313,432,967.75	4,600,953,215.67

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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及存托凭证投资比例为基金总资产的 70%-95%。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 12 月 31 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	2,372,219,441.39	93.05	4,342,425,152.71	94.38
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	2,372,219,441.39	93.05	4,342,425,152.71	94.38

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	106,605,475.90	284,287,699.77
2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-106,605,475.90	-284,287,699.77	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 2,368,745,782.49 元，属于第二层次的余额为人民币 3,473,658.90 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 4,339,528,096.28 元，属于第二层次的余额为人民币 2,897,056.43 元，无属于第三层次的余额）。

##### (a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020 年 12 月 31 日：无)。

#### 7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行



日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	2,372,219,441.39	91.85
	其中：股票	2,372,219,441.39	91.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	159,061,180.36	6.16
8	其他各项资产	51,334,851.22	1.99
9	合计	2,582,615,472.97	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	2,478,419.00	0.10
B	采矿业	69,583,942.94	2.73
C	制造业	2,049,653,292.20	80.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	134,463,363.31	5.27

E	建筑业	246,820.00	0.01
F	批发和零售业	7,367,033.44	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,698,546.04	0.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	24,804,197.41	0.97
L	租赁和商务服务业	2,793,019.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	44,868.92	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	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	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	79,041,817.64	3.10
S	综合	-	-
	合计	2,372,219,441.39	93.05

### 8.2.2 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。

### 8.3 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	002756	永兴材料	1,628,729	241,084,466.58	9.46
2	000408	藏格矿业	3,148,600	129,092,600.00	5.06
3	600499	科达制造	5,042,400	125,152,368.00	4.91
4	605117	德业股份	409,197	112,034,046.63	4.39
5	600522	中天科技	5,264,173	89,280,374.08	3.50
6	000792	盐湖股份	2,395,275	84,768,782.25	3.32
7	002466	天齐锂业	722,084	77,262,988.00	3.03
8	688599	天合光能	971,585	76,658,056.50	3.01
9	000681	视觉中国	2,910,900	69,570,510.00	2.73
10	600456	宝钛股份	950,701	68,241,317.78	2.68
11	603606	东方电缆	1,255,322	64,222,273.52	2.52

12	300390	天华超净	750,800	60,814,800.00	2.39
13	002920	德赛西威	410,588	58,102,307.88	2.28
14	600021	上海电力	4,493,981	57,612,836.42	2.26
15	002245	蔚蓝锂芯	1,868,300	51,396,933.00	2.02
16	603596	伯特利	651,300	45,330,480.00	1.78
17	002906	华阳集团	818,941	45,008,997.36	1.77
18	000875	吉电股份	4,751,300	43,189,317.00	1.69
19	002881	美格智能	814,600	34,930,048.00	1.37
20	300438	鹏辉能源	720,702	34,045,962.48	1.34
21	603982	泉峰汽车	704,400	33,106,800.00	1.30
22	002463	沪电股份	1,867,574	30,964,376.92	1.21
23	000733	振华科技	223,100	27,726,868.00	1.09
24	002192	融捷股份	186,100	24,220,915.00	0.95
25	300034	钢研高纳	410,932	23,669,683.20	0.93
26	603786	科博达	293,200	23,543,960.00	0.92
27	002196	方正电机	1,955,200	22,836,736.00	0.90
28	600732	爱旭股份	923,200	21,565,952.00	0.85
29	300502	新易盛	493,202	19,323,654.36	0.76
30	300308	中际旭创	453,500	19,273,750.00	0.76
31	002025	航天电器	227,500	19,098,625.00	0.75
32	002128	电投能源	1,255,000	18,636,750.00	0.73
33	605123	派克新材	134,000	18,387,480.00	0.72
34	000537	广宇发展	727,900	17,542,390.00	0.69
35	688239	航宇科技	228,557	15,580,730.69	0.61
36	300604	长川科技	264,600	15,214,500.00	0.60
37	300274	阳光电源	99,600	14,521,680.00	0.57
38	000762	西藏矿业	272,438	14,474,630.94	0.57
39	300569	天能重工	964,800	14,414,112.00	0.57
40	300593	新雷能	237,536	12,917,207.68	0.51
41	300855	图南股份	182,500	12,864,425.00	0.50
42	600011	华能国际	1,316,781	12,759,607.89	0.50
43	002176	江特电机	611,100	12,686,436.00	0.50
44	601677	明泰铝业	275,000	12,124,750.00	0.48
45	300568	星源材质	326,980	12,009,975.40	0.47
46	300752	隆利科技	336,988	11,710,333.00	0.46
47	688148	芳源股份	329,850	11,541,451.50	0.45
48	688345	博力威	182,418	10,872,112.80	0.43
49	605133	嵘泰股份	367,800	10,559,538.00	0.41
50	603997	继峰股份	641,900	10,321,752.00	0.40
51	600745	闻泰科技	77,200	9,981,960.00	0.39
52	688533	上声电子	175,176	9,787,083.12	0.38
53	600765	中航重机	184,300	9,305,307.00	0.36
54	002241	歌尔股份	161,900	8,758,790.00	0.34
55	000400	许继电气	307,100	8,015,310.00	0.31

56	002180	纳思达	162,200	7,746,672.00	0.30
57	600458	时代新材	557,500	7,721,375.00	0.30
58	603198	迎驾贡酒	109,700	7,618,665.00	0.30
59	600188	兖矿能源	319,800	7,524,894.00	0.30
60	002727	一心堂	190,700	7,343,857.00	0.29
61	600048	保利发展	464,607	7,261,807.41	0.28
62	000690	宝新能源	1,203,300	7,123,536.00	0.28
63	002039	黔源电力	330,100	6,958,508.00	0.27
64	603131	上海沪工	249,000	6,785,250.00	0.27
65	688800	瑞可达	43,799	6,100,324.72	0.24
66	002384	东山精密	224,200	6,075,820.00	0.24
67	002389	航天彩虹	206,700	5,746,260.00	0.23
68	600995	文山电力	277,800	5,519,886.00	0.22
69	688162	巨一科技	55,499	5,494,401.00	0.22
70	300088	长信科技	406,100	5,393,008.00	0.21
71	300251	光线传媒	408,300	5,246,655.00	0.21
72	002738	中矿资源	72,900	5,129,244.00	0.20
73	603348	文灿股份	87,200	5,093,352.00	0.20
74	300373	扬杰科技	75,400	5,065,372.00	0.20
75	603197	保隆科技	85,900	5,016,560.00	0.20
76	002036	联创电子	204,400	4,958,744.00	0.19
77	601168	西部矿业	347,300	4,726,753.00	0.19
78	600741	华域汽车	162,800	4,607,240.00	0.18
79	300035	中科电气	148,500	4,492,125.00	0.18
80	300432	富临精工	146,500	4,307,100.00	0.17
81	600580	卧龙电驱	218,000	3,987,220.00	0.16
82	002291	星期六	190,500	3,802,380.00	0.15
83	600110	诺德股份	234,400	3,738,680.00	0.15
84	300860	锋尚文化	43,600	3,695,536.00	0.14
85	688005	容百科技	30,643	3,541,717.94	0.14
86	688311	盟升电子	44,333	3,340,934.88	0.13
87	600884	杉杉股份	95,700	3,136,089.00	0.12
88	002402	和而泰	110,100	3,020,043.00	0.12
89	688303	大全能源	48,536	2,936,913.36	0.12
90	000887	中鼎股份	128,500	2,802,585.00	0.11
91	600416	湘电股份	127,600	2,793,164.00	0.11
92	300058	蓝色光标	260,300	2,793,019.00	0.11
93	000768	中航西飞	76,300	2,784,950.00	0.11
94	300699	光威复材	31,900	2,694,912.00	0.11
95	300679	电连技术	48,800	2,562,000.00	0.10
96	300919	中伟股份	16,700	2,530,217.00	0.10
97	002041	登海种业	96,100	2,478,419.00	0.10
98	002709	天赐材料	21,600	2,476,440.00	0.10
99	300360	炬华科技	198,900	2,454,426.00	0.10

100	603690	至纯科技	39,600	1,906,740.00	0.07
101	300286	安科瑞	56,200	1,864,716.00	0.07
102	300769	德方纳米	3,700	1,817,292.00	0.07
103	002897	意华股份	27,200	1,539,792.00	0.06
104	603078	江化微	57,100	1,517,718.00	0.06
105	688123	聚辰股份	20,703	1,404,905.58	0.06
106	601012	隆基股份	15,400	1,327,480.00	0.05
107	688668	鼎通科技	18,044	1,271,741.12	0.05
108	600487	亨通光电	76,500	1,156,680.00	0.05
109	300496	中科创达	8,100	1,121,202.00	0.04
110	688388	嘉元科技	8,753	1,098,939.15	0.04
111	600452	涪陵电力	53,600	1,079,504.00	0.04
112	300893	松原股份	27,600	1,058,460.00	0.04
113	603529	爱玛科技	15,000	683,550.00	0.03
114	601877	正泰电器	12,600	679,014.00	0.03
115	603678	火炬电子	8,329	630,088.85	0.02
116	600973	宝胜股份	103,900	616,127.00	0.02
117	002271	东方雨虹	10,600	558,408.00	0.02
118	300413	芒果超媒	9,100	520,702.00	0.02
119	002139	拓邦股份	22,300	416,787.00	0.02
120	688682	霍莱沃	2,015	328,404.70	0.01
121	002371	北方华创	900	312,318.00	0.01
122	603801	志邦家居	9,900	301,158.00	0.01
123	002438	江苏神通	14,600	299,446.00	0.01
124	002013	中航机电	15,100	274,518.00	0.01
125	600702	舍得酒业	1,200	272,760.00	0.01
126	002273	水晶光电	14,400	250,416.00	0.01
127	688619	罗普特	11,414	248,939.34	0.01
128	603960	克来机电	6,800	247,384.00	0.01
129	600039	四川路桥	20,500	246,820.00	0.01
130	603707	健友股份	5,600	235,200.00	0.01
131	300118	东方日升	7,000	227,290.00	0.01
132	300122	智飞生物	1,800	224,280.00	0.01
133	600821	金开新能	23,200	220,168.00	0.01
134	603260	合盛硅业	1,600	211,152.00	0.01
135	601702	华峰铝业	16,800	206,976.00	0.01
136	600399	抚顺特钢	7,486	185,428.22	0.01
137	300850	新强联	1,000	178,510.00	0.01
138	300638	广和通	3,200	174,400.00	0.01
139	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
140	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
141	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
142	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
143	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00

144	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
145	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
146	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
147	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
148	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
149	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
150	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
151	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
152	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
153	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
154	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
155	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
156	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
157	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
158	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
159	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
160	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
161	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
162	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
163	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
164	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
165	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
166	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
167	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
168	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
169	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
170	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
171	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
172	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
173	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
174	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
175	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
176	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
177	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
178	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
179	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
180	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
181	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
182	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	002466	天齐锂业	509,836,511.65	11.08
2	300390	天华超净	440,587,767.34	9.58
3	603026	石大胜华	369,151,172.10	8.02
4	002756	永兴材料	362,658,421.54	7.88
5	600188	兖矿能源	326,250,529.29	7.09
6	002176	江特电机	319,191,942.41	6.94
7	002459	晶澳科技	273,980,649.68	5.95
8	600111	北方稀土	259,184,959.83	5.63
9	002192	融捷股份	255,298,623.02	5.55
10	300568	星源材质	247,127,318.92	5.37
11	000733	振华科技	245,218,937.67	5.33
12	603799	华友钴业	221,865,165.24	4.82
13	002340	格林美	210,940,239.62	4.58
14	300726	宏达电子	205,687,910.89	4.47
15	601865	福莱特	205,027,905.08	4.46
16	300598	诚迈科技	190,350,487.65	4.14
17	002291	星期六	190,340,682.99	4.14
18	000807	云铝股份	189,440,521.32	4.12
19	300671	富满微	182,122,907.70	3.96
20	600522	中天科技	178,698,320.05	3.88
21	688599	天合光能	178,175,494.33	3.87
22	000762	西藏矿业	170,637,857.75	3.71
23	000792	盐湖股份	170,137,912.10	3.70
24	600997	开滦股份	169,153,637.52	3.68
25	002240	盛新锂能	164,242,075.59	3.57
26	601699	潞安环能	163,691,398.41	3.56
27	002759	天际股份	160,827,852.00	3.50
28	600499	科达制造	155,188,317.06	3.37
29	002185	华天科技	154,309,077.04	3.35
30	300458	全志科技	150,140,388.49	3.26
31	600760	中航沈飞	149,335,399.59	3.25
32	603678	火炬电子	145,849,225.39	3.17
33	002245	蔚蓝锂芯	142,745,946.72	3.10
34	601666	平煤股份	141,815,378.23	3.08
35	600346	恒力石化	138,958,995.29	3.02
36	000933	神火股份	134,027,653.17	2.91
37	600546	山煤国际	133,650,772.97	2.90
38	300379	东方通	130,152,457.20	2.83
39	603267	鸿远电子	130,108,075.97	2.83

40	000408	藏格矿业	128,723,449.06	2.80
41	688005	容百科技	124,371,854.79	2.70
42	600048	保利发展	124,111,235.53	2.70
43	600021	上海电力	118,171,304.21	2.57
44	300659	中孚信息	116,802,465.15	2.54
45	002812	恩捷股份	114,631,473.58	2.49
46	600740	山西焦化	111,338,848.12	2.42
47	605117	德业股份	109,337,900.06	2.38
48	300750	宁德时代	105,088,742.38	2.28
49	601877	正泰电器	104,385,164.63	2.27
50	603987	康德莱	102,875,625.04	2.24
51	300122	智飞生物	98,680,463.65	2.14
52	002594	比亚迪	98,262,654.22	2.14
53	002013	中航机电	97,179,256.38	2.11
54	300693	盛弘股份	96,970,270.75	2.11
55	601101	昊华能源	96,763,803.68	2.10
56	000683	远兴能源	95,372,251.58	2.07
57	000725	京东方 A	95,105,458.00	2.07
58	000831	五矿稀土	94,335,030.40	2.05
59	601015	陕西黑猫	92,286,557.30	2.01

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。

#### 8.4.2 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	000733	振华科技	676,950,431.61	14.71
2	603026	石大胜华	641,937,124.80	13.95
3	603267	鸿远电子	565,467,605.20	12.29
4	603678	火炬电子	547,356,351.73	11.90
5	300379	东方通	457,144,872.20	9.94
6	300659	中孚信息	426,385,118.73	9.27
7	002466	天齐锂业	422,047,043.47	9.17
8	300390	天华超净	390,681,482.41	8.49
9	300671	富满微	385,441,534.80	8.38
10	688005	容百科技	343,741,950.43	7.47
11	300726	宏达电子	331,595,267.12	7.21
12	300568	星源材质	327,691,414.39	7.12
13	603799	华友钴业	318,632,460.46	6.93
14	688111	金山办公	317,201,786.88	6.89



15	600111	北方稀土	308,547,361.86	6.71
16	300598	诚迈科技	308,167,372.62	6.70
17	300014	亿纬锂能	291,244,014.95	6.33
18	002459	晶澳科技	288,806,672.27	6.28
19	002049	紫光国微	279,368,067.25	6.07
20	600188	兖矿能源	279,069,762.44	6.07
21	002340	格林美	276,451,271.21	6.01
22	002176	江特电机	267,445,257.95	5.81
23	002192	融捷股份	234,172,502.09	5.09
24	600399	抚顺特钢	213,938,770.66	4.65
25	601865	福莱特	198,517,099.62	4.31
26	002756	永兴材料	198,181,014.05	4.31
27	002709	天赐材料	192,853,134.05	4.19
28	000762	西藏矿业	191,936,376.43	4.17
29	002812	恩捷股份	182,289,910.99	3.96
30	002240	盛新锂能	180,419,369.77	3.92
31	600997	开滦股份	180,396,585.07	3.92
32	605117	德业股份	177,643,402.15	3.86
33	000807	云铝股份	173,494,165.91	3.77
34	002291	星期六	171,820,521.85	3.73
35	688122	西部超导	168,469,032.31	3.66
36	601699	潞安环能	162,773,609.05	3.54
37	300458	全志科技	153,564,273.74	3.34
38	002185	华天科技	150,349,411.65	3.27
39	002759	天际股份	138,287,366.95	3.01
40	600760	中航沈飞	134,731,530.34	2.93
41	600346	恒力石化	133,588,848.21	2.90
42	300343	联创股份	127,086,966.53	2.76
43	000933	神火股份	124,343,813.44	2.70
44	600316	洪都航空	123,263,347.40	2.68
45	000066	中国长城	120,057,832.87	2.61
46	002245	蔚蓝锂芯	119,144,180.71	2.59
47	601877	正泰电器	114,795,580.13	2.50
48	600048	保利发展	112,201,180.97	2.44
49	601015	陕西黑猫	111,469,464.50	2.42
50	603987	康德莱	111,016,325.80	2.41
51	603906	龙蟠科技	110,130,168.22	2.39
52	688599	天合光能	109,540,371.11	2.38
53	300750	宁德时代	107,601,746.00	2.34
54	601666	平煤股份	105,571,718.45	2.29
55	600740	山西焦化	104,420,736.78	2.27
56	000831	五矿稀土	104,163,237.62	2.26
57	000009	中国宝安	103,630,959.33	2.25
58	600546	山煤国际	102,174,045.76	2.22

59	601101	昊华能源	101,554,337.78	2.21
60	002594	比亚迪	100,681,952.66	2.19
61	600522	中天科技	98,401,710.36	2.14
62	000725	京东方 A	94,160,175.00	2.05
63	002371	北方华创	92,790,021.91	2.02
64	300693	盛弘股份	92,260,778.00	2.01

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	19,018,884,322.89
卖出股票的收入（成交）总额	21,778,270,237.55

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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投资。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 报告期内本基金投资的藏格矿业（000408），因存在控股股东非经营性资金占用未及时履行信息披露义务、公司对外担保未及时履行信息披露义务、未披露 2019 年度业绩预告等违规行为，违反了《上市公司信息披露管理办法》，于 2021 年 4 月 1 日收到中国证券监督管理委员会青海证监局出具的《关于对藏格控股股份有限公司及相关责任人采取出具警示函措施的决定》。

对该证券的投资决策程序的说明：藏格控股是国内钾肥第二大生产企业，生产地与盐湖股份同在察尔汗盐湖。拥有钾肥 200 万吨/年的生产能力。由于公司的管理机制和较低的财务负担，藏格控股业绩表现优异。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盐湖股份（000792），因销售钾肥产品时，在其生产成本未发生显著变化的情况下，大幅度上调销售价格，违反了《中华人民共和国价格法》有关规定，被国家市场监督管理总局责令立即改正，并处以 160 万元罚款。公司全资子公司青海盐湖能源有限公司因于 2013 年至 2014 年期间在未取得相关探矿证、采矿证的情况下，对青海省天峻县木里煤田聚乎更矿区七号井煤炭资源实施开采，涉嫌非法采矿罪，收到海西蒙古族藏族自治州公安局出具的《关于对青海盐湖能源有限公司涉嫌非法采矿罪的告知函》，其中要求为降低青海盐湖能源有限公司涉嫌非法采矿产生的社会影响及法律影响，可及时将非法采矿产生非法所得及收入主动退缴至公安机关。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是国内最大的氯化钾生产企业，盐湖股份具有得天独厚的战略资源优势。除了对盐湖中钾、镁、锂、钠等资源规模化开发利用外，公司未来还将探索硼、溴、铷、铯等稀有元素开发利用。开发潜力巨大，为盐湖股份从传统提钾转向提锂等新能源、新材料战略型新兴产业提供了广阔的发展空间。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。

其余八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。

**8.12.2** 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。

**8.12.3 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	991,255.12
2	应收证券清算款	47,851,177.55
3	应收股利	-
4	应收利息	23,724.42
5	应收申购款	2,468,694.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,334,851.22

**8.12.4 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。

**8.12.5 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未存在流通受限情况。

**§9 基金份额持有人信息**

**9.1 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
148,390	11,342.75	94,448,446.94	5.61%	1,588,702,506.06	94.39%

**9.2 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	368,146.86	0.0219%

**9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2005年7月29日)基金份额总额	419,612,160.22
本报告期期初基金份额总额	3,859,677,244.12
本报告期基金总申购份额	2,512,038,677.50
减：本报告期基金总赎回份额	4,688,564,968.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,683,150,953.00

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§11 重大事件揭示****11.1 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。

## 11.2 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

2021 年 7 月 7 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三十六次临时会议审议通过，王智慧先生不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 70,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 2 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

报告期内，上海证监局对我公司进行检查，对公司出具了责令改正的行政监管措施，并对存在问题负有责任的时任副总经理王智慧采取了出具警示函的监管措施。我公司高度重视，已按法律法规和监管要求及时进行了整改，并已提交了整改报告。

报告期内，本基金的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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
海通证券	2	6,644,571,926.00	16.29%	4,797,838.08	16.35%	-
光大证券	1	4,962,979,790.2	12.17%	3,530,181.80	12.03%	-

		5				
长江证券	2	4,080,528,593.01	10.01%	2,919,410.73	9.95%	-
中银国际	1	3,924,981,281.69	9.62%	2,870,335.39	9.78%	-
民生证券	2	3,182,644,089.64	7.80%	2,280,669.99	7.77%	-
国金证券	1	2,875,471,552.92	7.05%	2,045,327.57	6.97%	-
兴业证券	2	2,515,189,660.07	6.17%	1,800,437.47	6.13%	-
安信证券	1	2,496,691,049.10	6.12%	1,825,828.80	6.22%	-
天风证券	2	2,167,542,740.30	5.32%	1,552,300.40	5.29%	-
东方证券	2	1,914,675,865.15	4.70%	1,373,399.76	4.68%	-
招商证券	1	1,518,415,248.54	3.72%	1,080,052.98	3.68%	-
中信建投	1	1,246,682,744.94	3.06%	911,694.38	3.11%	-
中金财富	1	755,034,554.96	1.85%	552,154.66	1.88%	-
国元证券	1	588,384,414.91	1.44%	418,520.24	1.43%	-
国泰君安	1	513,125,046.38	1.26%	375,248.34	1.28%	-
国信证券	2	507,756,233.50	1.25%	371,316.59	1.27%	-
长城证券	1	457,395,400.91	1.12%	334,490.75	1.14%	-
东北证券	1	283,054,419.85	0.69%	206,995.13	0.71%	-
东吴证券	2	145,801,333.23	0.36%	103,709.18	0.35%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内退租中金财富 1 只交易单元。

## 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。

### 11.7.2 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
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	证券日报、基金管理	2021-01-01



	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	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
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	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-05
4	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
5	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30
6	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
7	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-17
9	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
10	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
11	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
12	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监	2021-04-09

	定额投资费率优惠活动的公告	会基金电子披露网站	
13	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
14	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-06
15	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-20
16	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-30
17	海富通基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-07
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-19
19	海富通基金管理有限公司关于瑞银证券有限责任公司终止办理旗下部分基金相关销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-30
20	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-13
21	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-30
22	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-02
23	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加江苏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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-17

		站	
24	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国光大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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-29
25	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加华夏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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-19
26	海富通基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下公募基金开展费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-13
27	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加上海利得基金销售有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-23
28	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国民生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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-01
29	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-03
30	海富通基金管理有限公司关于提高旗下部分基金基金份额净值精度并修改基金合同及托管协议的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-07
31	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华林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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-08
32	海富通基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-20

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## 12.2 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 106 只公募基金。截至 2021 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超 1653 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”。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通股票混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通股票混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通股票混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通股票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

### 13.2 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。

### 13.3 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  
二〇二二年三月三十一日