

海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）

2020 年年度报告

2020 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

送出日期：二〇二一年三月三十一日

§ 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 2021 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 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况	11
§4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
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	19
§6	审计报告	19
6.1	审计意见	19
6.2	形成审计意见的基础	19
6.3	管理层对财务报表的责任	19
6.4	注册会计师的责任	20
§7	年度财务报表	21
7.1	资产负债表	21
7.2	利润表	23
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4	报表附注	26
§8	投资组合报告	52
8.1	期末基金资产组合情况	52
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	55
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	57

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12	投资组合报告附注	60
§9	基金份额持有人信息	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2	期末上市基金前十名持有人	62
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.4	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	63
§10	开放式基金份额变动	63
§11	重大事件揭示	63
11.1	基金份额持有人大会决议	63
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	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4	基金投资策略的改变	64
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8	其他重大事件	66
§12	影响投资者决策的其他重要信息	69
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	70
§13	备查文件目录	70
13.1	备查文件目录	70
13.2	存放地点	71
13.3	查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	海富通中证 100 指数（LOF）	
场内简称	海富 100	
基金主代码	162307	
交易代码	162307	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 10 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	
报告期末基金份额总额	58,924,669.34 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2010 年 1 月 8 日	
下属分级基金的基金简称	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	162307	010224
报告期末下属分级基金的份额总额	58,924,471.18 份	198.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段，控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度，实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证 100 指数×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

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 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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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	2020 年		2019 年		2018 年	
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
本期已 实现收 益	42,631,118. 36	18.82	35,129,588.1 5	-	3,443,534.67	-
本期利 润	40,678,799. 96	20.93	55,044,225.1 2	-	-16,936,900.1 6	-
加权平 均基金 份额本 期利润	0.3671	0.1181	0.3574	-	-0.2305	-
本期加 权平均 净值利 润率	29.16%	7.64%	29.55%	-	-18.96%	-
本期基 金份额 净值增 长率	38.73%	5.95%	45.75%	-	-17.97%	-
3.1.2 期末 数据和指 标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
期末可 供分配 利润	36,559,433. 44	122.77	43,672,968.3 7	-	4,903,674.67	-
期末可 供分配 基金份 额利润	0.6204	0.6195	0.2556	-	0.0675	-

期末基金资产净值	95,483,904.62	320.93	214,546,312.28	-	77,497,824.24	-
期末基金份额净值	1.620	1.620	1.256	-	1.068	-
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
基金份额累计净值增长率	115.96%	5.95%	55.66%	-	6.80%	-

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。

4、海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 于 2020 年 11 月 09 日发布公告,自 2020 年 11 月 10 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。该类别仅开通场外申购赎回业务,收取销售服务费,不收取申购费。

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

海富通中证 100 指数 A

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	16.46%	0.91%	14.90%	0.91%	1.56%	0.00%
过去六个月	35.91%	1.26%	26.22%	1.26%	9.69%	0.00%
过去一年	38.73%	1.32%	22.88%	1.33%	15.85%	-0.01%

过去三年	65.86%	1.26%	29.90%	1.27%	35.96%	-0.01%
过去五年	99.96%	1.16%	55.35%	1.16%	44.61%	0.00%
自基金合同生效起至今	115.96%	1.38%	65.41%	1.37%	50.55%	0.01%

海富通中证 100 指数 C

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
自基金合同生效起至今	5.95%	0.86%	5.15%	0.86%	0.80%	0.00%

3.2.2 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

海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

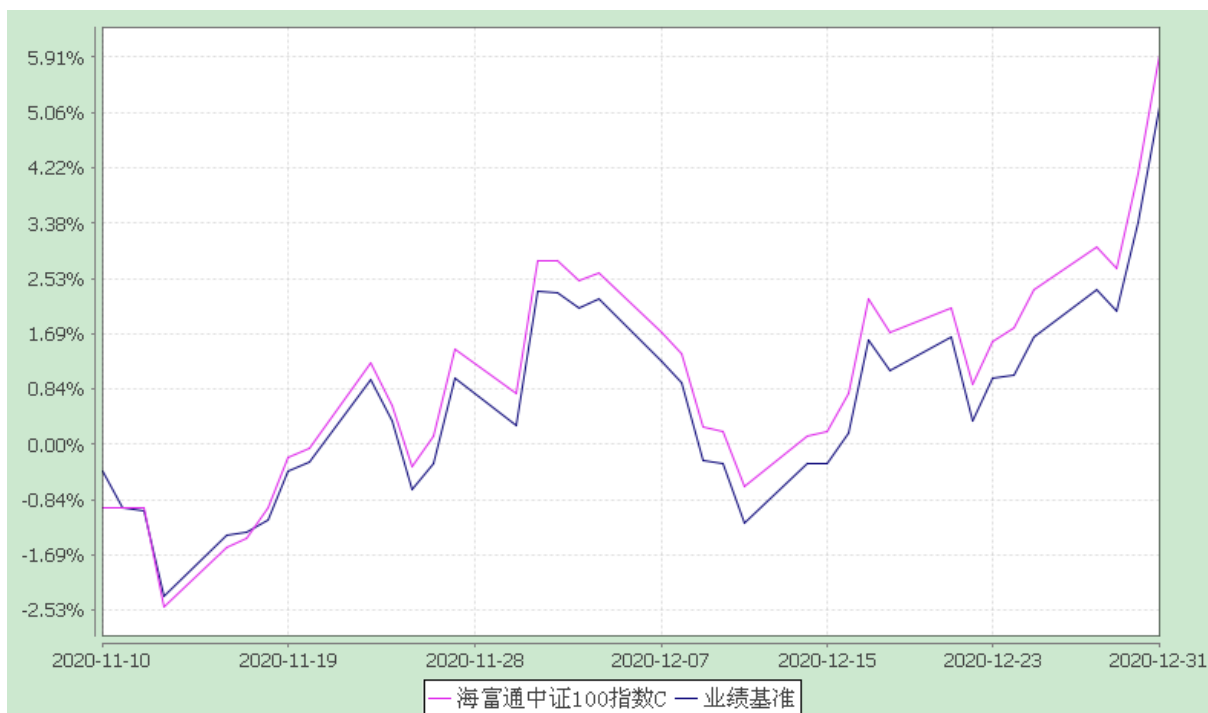
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 31 日)

海富通中证 100 指数 A



海富通中证 100 指数 C

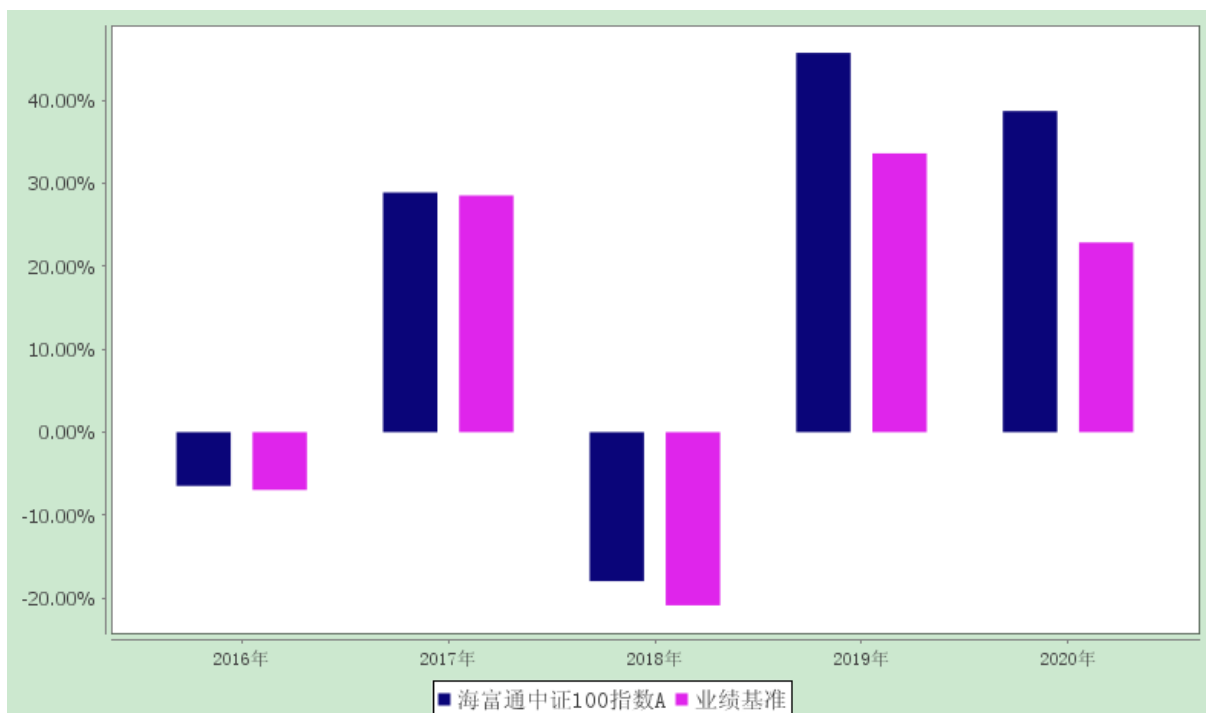


注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十五条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

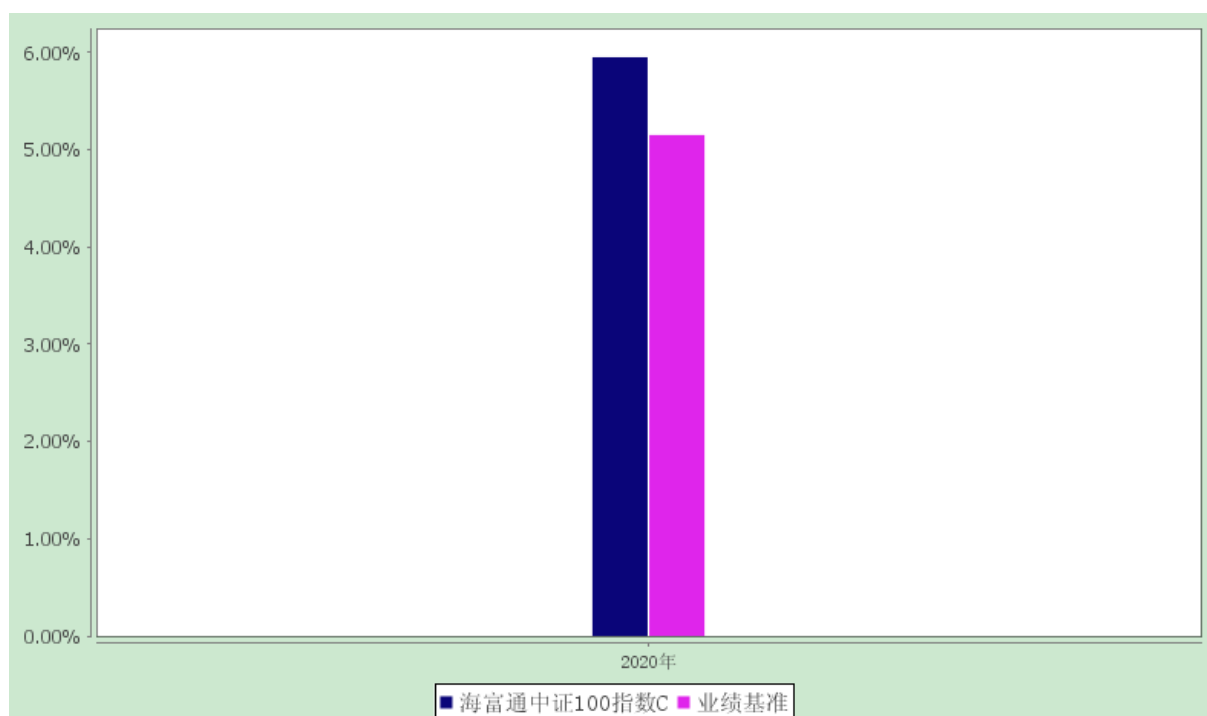
3.2.3 基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）
基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

海富通中证 100 指数 A



海富通中证 100 指数 C



注：图中列示的海富通中证 100 指数 C 份额 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 11 月 10 日（新增 C 类份额日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通中证 100 指数 A

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
2020年	0.800	5,554,132.48	5,987,176.45	11,541,308.93	-
2019年	2.640	31,685,844.04	3,123,613.28	34,809,457.32	-
2018年	-	-	-	-	-
合计	3.440	37,239,976.52	9,110,789.73	46,350,766.25	-

2、海富通中证 100 指数 C

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
2020	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 于 2020 年 11 月 09 日发布公告，自 2020 年 11

月 10 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。2020 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 2020 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 81 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、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、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。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

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		
江勇	本基金的基金经理; 海富通上证非周期 ETF 基金经理; 海富通上证非周期 ETF 联接基金经理; 海富通上证周期 ETF 基金经理; 海富通上证周期 ETF 联接基金经理; 海富通中证长三角领先 ETF 基金经理; 海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理; 海富通稳固收益债券基金经理。	2018-07-25	-	9 年	经济学硕士, 持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师, 资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月起任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通上证非周期 ETF 联接、海富通中证 100 指数

					(LOF)基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证 500 增强 (原海富通中证内地低碳指数) 基金经理。2020 年 8 月起兼任海富通中证长三角领先 ETF、海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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交易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。

4.3.3 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 2020 年, A 股市场不但经受住了突发疫情的冲击,而且经受住了特朗普政府对华摩擦带来的外部冲击。二季度之后,在经济基本面率先回升与政策面呵护之下,成为全球主要股市中表现最亮眼的市场之一。具体来看,沪深 300 指数、科创 50 指数、中小板指、创业板指等主要指数当年涨幅分别达到 27.21%、39.30%、43.91%、64.96%。

就行业表现而言,28 个申万一级行业表现两极分化显著。全年涨幅居于前五位的行业分别是休闲服务、电气设备、食品饮料、国防军工和医药生物,全年涨幅均超过 50%。与之相比,房地产、通信、建筑装饰、纺织服装、银行等五个表现最差的行业全年跌幅 3%-10%不等。全年行情的主线集中于消费和成长两个方向,既包括了以白酒、免税服务为代表的消费升级板块,也包括了新能源车、光伏、CXO 与创新药、半导体与 5G 等中国经济转型升级的板块。而传统经济集中的相关行业除大炼化等少数细分领域之外,虽然也有过脉冲式的上涨,但是总体表现低迷。与结构性牛市相伴的是 A 股 4000 多支股票在 2020 年超过一半是下跌或者持平的。

从业绩的角度来看,跌幅居于前五位的行业当中,除通信和纺织服装之外的其余三个行业万得一致预期的行业利润增速都是下滑的。而行业盈利增速预期前五位的行业除电气设备之外,不论是传统经济的有色金属、农林牧渔、机械设备,还是偏成长的计算机,均未进入年度涨幅前五位。

与二级市场不断走高相应的则是热络的一级市场。在推行股票发行注册制的环境之下,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 1.6 万亿元,仅次于 2016 年和 2015 年。截至 2020 年年底,沪深两市的股票数量突破了 4000 支。沪深两市总市值接近 80 万亿元,与当年 GDP 的比值接近 0.8。

报告期内,本基金完成了年末的指数成分股调整。作为指数基金,在操作上我们严格遵守基金合同,应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金 A 份额净值增长率为 38.73%,同期业绩比较基准收益率为 22.88%;C 份额净值增长率为 5.95%,同期业绩比较基准收益率为 5.15%。

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 2021 年,随着全球主要经济体财政与货币刺激政策的落地,疫苗接种率的不断提升,疫情

的外部冲击的边际钝化，经济回升的方向是比较确定的。而 2020 年以来，从农产品到石油以外的矿产品出现的广泛价格上升将抬升全球的 PPI 和 CPI。若不再出现加深全球结构对立与冲突的因素，那么 2021 年的宏观环境将会是偏暖的。

映射到 A 股市场，实体经济的回升和外部环境的缓和可能对于全市场的盈利增速和估值中枢带来正好相反的影响。对于盈利增速，存量部分的传统经济由负转正是大概率，这就决定了全年的利润增速同比上行的趋势。而对于估值部分则可能正好相反，边际流动性持续宽松的概率非常小，那么由其带来的估值扩张也基本到头。由此带来的结构性行情将更多地是由企业季度经营业绩的逐季连续变化来决定，即哪些细分行业的龙头公司能够保持经营业绩的逐季提升与扩张，哪些公司的股价表现则会更坚挺。那些需要把 2025 年乃至 2030 年的市场空间与市占率预期折现到当前的公司，股价可能存在着估值消化的压力。

未来，本基金将继续严格按照基金合同的要求，秉承指数化投资策略，提高组合与指数的拟合度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 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、现场检查、系统监控、人员访谈、重点抽查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、持续完善公司的规章制度，健全内部控制体系，落实内控责任。

根据法律法规和监管政策的发展和变化以及股东方针对公司内部风险管理的要求，自上而下地推动了内部控制机制的梳理和完善工作，组织各部门对多项内部制度和流程进行了更新，健全了公司内部控制制度体系，强化了各项内控职责，提升了公司内部控制环境建设，为公司各项业务合规开展提供有效的制度保障，为基金持有人利益最大化提供有力的保障。

二、加强对公司和基金日常运作的合规管理。

本报告期内，坚持以法律法规和公司管理制度为依据，对公司和基金日常运作的各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，对新产品和新业务进行合规性审核，确保了基金运作的诚信和合法合规性。此外，督察稽核部根据法规、监管要求并结合公司内部控制的需要，对公司各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计，对检查中发现的问题向公司经营管理层汇报，并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，加强并完善公司的内部控制状况。同时，根据法规、股东方等要求，公司聘请会计师事务所、律师事务所等对公司内部控制管理、合规有效

性、反洗钱风险等开展了专项评估。通过事前、事中、事后的全方位合规审核及内部审计，公司对治理结构、投资交易、销售及客户服务体系、信息安全控制、基金运营控制、分支机构管理及人力资源管理等方面的内部规章制度和各项业务流程予以了完善，强化了现有规章制度的执行力度。

三、有效推进反洗钱工作。

本报告期内，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和考试；重点开展全面的直销客户信息核查清理工作，对于直销投资者身份信息资料不完整、不准确、未在合理期限内补充完善的客户予以限制交易；梳理高风险业务清单并更新业务流程，针对机构洗钱风险评估发现的问题进行整改和优化；稳步推进代销模式洗钱风险管理工作，督促代销机构签署反洗钱补充协议；牵头持续对反洗钱系统进行升级改造，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 2019 年度的反洗钱分类评级自评工作。

四、加强投资者教育，培养投资者风险意识和投资理念。

本报告期内，公司为鼓励投资者进行长期投资，持续不断的和投资者进行沟通，并利用网络互动平台、主流媒体专栏及举办投资者交流会等多种渠道、多种媒介积极推进投资者教育工作，努力倡导“长期持有、理性投资”的投资理念，培养广大投资者的风险意识、切实加强保护了广大基金份额持有人的合法权益。

五、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，及时将新颁布的各项法律法规进行解读和落实，并组织全体员工开展各类内外部培训，剖析风险案例，培训内容主要包括新法规政策落实、监管精神传达、投资交易、市场销售业务、信息技术管理、廉洁从业管理、宣传推介合规管理、员工行为管理、反洗钱、子公司资管业务合规风险等方面，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及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，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、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。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对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，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计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，本基金收益分配每年至多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2020 年 3 月 20 日本基金的可供分配利润为基准，于 2020 年 3 月 31 日完成权益登记，单位分红金额为 0.08 元，合计利润分配金额 11,541,308.93 元。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”）在对海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)（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”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

普华永道中天审字(2021)第 21058 号

海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“海富通中证 100 指数基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了海富通中证 100 指数基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海富通中证 100 指数基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层对财务报表的责任

海富通中证 100 指数基金的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

层负责按照企业会计准则和中国证监会、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中证 100 指数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，除非基金管理人管理层计划清算海富通中证 100 指数基金、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中证 100 指数基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师的责任

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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 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。

(四) 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中证 100 指数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中证 100 指数基金不能持续经营。

(五) 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

薛竞 沈兆杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,310,677.29	5,211,285.23
结算备付金		39,847.54	149,879.76
存出保证金		46,922.87	55,720.02
交易性金融资产	7.4.7.2	90,803,892.64	210,285,398.38
其中：股票投资		89,619,992.64	203,026,360.88
基金投资		-	-
债券投资		1,183,900.00	7,259,037.50
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		98,281.08	-
应收利息	7.4.7.5	22,661.99	109,077.15

应收股利		-	-
应收申购款		188,731.47	46,876.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		96,511,014.88	215,858,237.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债:			
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		-	-
应付赎回款		653,075.72	752,396.80
应付管理人报酬		54,947.64	166,849.81
应付托管费		9,419.58	28,602.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	27,404.70	102,010.86
应交税费		0.41	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	281,941.28	262,064.89
负债合计		1,026,789.33	1,311,925.17
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	58,924,669.34	170,873,343.91
未分配利润	7.4.7.10	36,559,556.21	43,672,968.37
所有者权益合计		95,484,225.55	214,546,312.28
负债和所有者权益总计		96,511,014.88	215,858,237.45

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 58,924,669.34 份，其中海富通中证 100A 类份额 58,924,471.18 份，海富通中证 100C 类份额 198.16 份。A 类份额净值 1.620 元，C 类份额净值 1.620 元。

7.2 利润表

会计主体：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		42,655,812.85	57,532,446.64
1.利息收入		154,640.95	244,267.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	31,924.99	85,477.94
债券利息收入		122,715.96	158,619.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	170.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		44,221,762.55	37,133,823.24
其中：股票投资收益	7.4.7.12	41,065,176.77	33,046,943.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	22,767.15	65,452.48
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	3,133,818.63	4,021,427.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,952,316.29	19,914,636.97
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	231,725.64	239,718.56

减：二、费用		1,976,991.96	2,488,221.52
1. 管理人报酬		986,431.45	1,299,504.57
2. 托管费		169,102.42	222,772.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	365,489.23	528,394.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.18	0.15
7. 其他费用	7.4.7.20	455,968.68	437,549.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,678,820.89	55,044,225.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,678,820.89	55,044,225.12

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	170,873,343.91	43,672,968.37	214,546,312.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,678,820.89	40,678,820.89
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）	-111,948,674.57	-36,250,924.12	-148,199,598.69
其中：1.基金申购款	38,621,729.84	9,259,080.63	47,880,810.47

2.基金赎回款	-150,570,404.41	-45,510,004.75	-196,080,409.16
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）	-	-11,541,308.93	-11,541,308.93
五、期末所有者权益（基金净值）	58,924,669.34	36,559,556.21	95,484,225.55
项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	72,594,149.57	4,903,674.67	77,497,824.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,044,225.12	55,044,225.12
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）	98,279,194.34	18,534,525.90	116,813,720.24
其中：1.基金申购款	253,655,967.56	51,558,908.91	305,214,876.47
2.基金赎回款	-155,376,773.22	-33,024,383.01	-188,401,156.23
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）	-	-34,809,457.32	-34,809,457.32
五、期末所有者权益（基金净值）	170,873,343.91	43,672,968.37	214,546,312.28

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

海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF) (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”)证监许可[2009]第 879 号《关于核准海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》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《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。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 2,086,432,233.85 元, 业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 (2009)第 226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 10 月 30 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,087,148,875.30 份基金份额, 其中认购资金利息折合 716,641.45 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《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》并报中国证监会备案, 自 2020 年 11 月 10 日起, 本基金根据申购费用、赎回费用及销售服务费用收取方式的不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用, 不收取销售服务费的, 称为 A 类基金份额; 不收取前端申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费的, 称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存, 由于基金费用的不同, 本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值, 计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额, 但各类别基金份额之间不能相互转换。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 205 号文审核同意, 本基金 107,647,812.00 份基金份额于 2010 年 1 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括中证 100 指数成份股及备选成份股、新股(首次公开发行股票或增发)、存托凭证、固定收益产品、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 90%-95%, 投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%, 现金、固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%, 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 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

基金的基金管理人力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数×95%+活期存款利率(税后)×5%。

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 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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》、《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应

收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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。由于申购和赎回引起的实收基金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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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 分部报告综述

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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和债券投资公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 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。

(2)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。

(3)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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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:

(1) 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	5,310,677.29	5,211,285.23
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	5,310,677.29	5,211,285.23

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		64,533,458.84	89,619,992.64	25,086,533.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,183,100.00	1,183,900.00	800.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,183,100.00	1,183,900.00	800.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		65,716,558.84	90,803,892.64	25,087,333.80
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		175,977,857.78	203,026,360.88	27,048,503.10
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	7,267,890.51	7,259,037.50	-8,853.01
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,267,890.51	7,259,037.50	-8,853.01
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		183,245,748.29	210,285,398.38	27,039,650.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末未持有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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	601.75	3,580.31
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	17.90	67.50
应收债券利息	22,021.18	105,404.22
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	0.06	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	21.10	25.10
合计	22,661.99	109,077.15

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	27,404.70	102,010.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	27,404.70	102,010.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,941.28	2,064.89
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
预提费用	230,000.00	210,000.00
合计	281,941.28	262,064.89

7.4.7.9 实收基金

海富通中证 100 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	170,873,343.91	170,873,343.91
本期申购	38,621,531.68	38,621,531.68
本期赎回（以“-”号填列）	-150,570,404.41	-150,570,404.41
本期末	58,924,471.18	58,924,471.18

海富通中证 100 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	198.16	198.16
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	198.16	198.16

注：1、截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金 A 类份额于深交所上市的基金份额为 1,853,081.00 份 (2019 年 12 月 31 日: 2,628,622.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 57,071,390.18 份 (2019 年 12 月 31 日: 168,244,721.91 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

2、根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2020 年 11 月 09 日《关于海富通中证 100 指数

证券投资基金 (LOF) 增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》的规定, 经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案, 自 2020 年 11 月 10 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额, 新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额, 并对 C 级份额收取销售服务费。

7.4.7.10 未分配利润

海富通中证 100 指数 A

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	55,405,870.11	-11,732,901.74	43,672,968.37
本期利润	42,631,118.36	-1,952,318.40	40,678,799.96
本期基金份额交易产生的变动数	-45,189,574.60	8,938,548.64	-36,251,025.96
其中: 基金申购款	15,183,229.28	-5,924,250.49	9,258,978.79
基金赎回款	-60,372,803.88	14,862,799.13	-45,510,004.75
本期已分配利润	-11,541,308.93	-	-11,541,308.93
本期末	41,306,104.94	-4,746,671.50	36,559,433.44

海富通中证 100 指数 C

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	-	-	-
本期利润	18.82	2.11	20.93
本期基金份额交易产生的变动数	119.88	-18.04	101.84
其中: 基金申购款	119.88	-18.04	101.84
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	138.70	-15.93	122.77

7.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	28,523.62	73,961.34
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	317.12	3,206.19
其他	3,084.25	8,310.41
合计	31,924.99	85,477.94

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	180,542,876.96	180,889,084.78
减：卖出股票成本总额	139,477,700.19	147,842,141.51
买卖股票差价收入	41,065,176.77	33,046,943.27

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成交总额	7,691,279.93	10,091,678.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期 兑付）成本总额	7,445,090.51	9,874,266.32
减：应收利息总额	223,422.27	151,959.77
买卖债券差价收入	22,767.15	65,452.48

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,133,818.63	4,021,427.49
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,133,818.63	4,021,427.49

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	-1,952,316.29	19,914,636.97
——股票投资	-1,961,969.30	19,918,898.06
——债券投资	9,653.01	-4,261.09
——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	-1,952,316.29	19,914,636.97

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
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	231,634.35	239,683.14
基金转换费收入	91.29	35.42
合计	231,725.64	239,718.56

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
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	365,489.23	528,394.61
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	365,489.23	528,394.61

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
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	50,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	7,968.68	9,549.96
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	455,968.68	437,549.96

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露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)	基金管理人的股东

Management BE Holding)	
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。

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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	116,578,854.11	58.22%	-	-

7.4.10.1.2 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。

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 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	84,566.96	62.13%	569.65	2.08%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
-	-	-	-	-

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。

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	986,431.45	1,299,504.57
其中：支付销售机构的客户维护费	29,812.50	172,130.15

注：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 0.7% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.7\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	169,102.42	222,772.23

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 0.12% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.12\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

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。

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固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固有资金投资本基金。

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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	5,310,677.29	28,523.62	5,211,285.23	73,961.34

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。相关的关联交易事项如下：

(1)于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有 148,576 股中国银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 605,400.45 元，估值总额为人民币 472,471.68 元，占基金资产净值的比例为 0.49%(2019 年 12 月 31 日：本基金持有 439,476 股中国银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,790,726.44 元，估值总额为人民币 1,621,666.44 元，占基金资产净值的比例为 0.76%)。

(2)于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有 63,962 股海通证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 922,526.99 元，估值总额为人民币 822,551.32 元，占基金资产净值的比例为 0.86%(2019 年 12 月 31 日：本基金持有 168,062 股海通证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,423,966.29 元，估值总额为人民币 2,598,238.52 元，占基金资产净值的比例为 1.21%)。

7.4.11 利润分配情况

海富通中证 100 指数 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注

		场内	场外	份额分 红数				
1	2020-03-31	2020-04-01	2020-03-31	0.800	5,554,132.48	5,987,176.45	11,541,308.93	-
合计				0.800	5,554,132.48	5,987,176.45	11,541,308.93	-

注：基金的基金管理人于 2020 年 3 月 27 日宣告 2020 年度第 1 次分红，向截至 2020 年 3 月 31 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.80 元。

海富通中证 100 指数 C

海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 于 2020 年 11 月 09 日发布公告，自 2020 年 11 月 10 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。本类份额本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末 (2020 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
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688057	金达莱	2020-11-04	2021-05-11	新股锁定流通受限	25.84	28.71	3,321	85,814.64	95,345.91	-
688165	埃夫特	2020-07-07	2021-01-15	新股锁定流通受限	6.35	13.10	14,996	95,224.60	196,447.60	-

688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	368	27,401.28	27,401.28	-
7.4.12.1.2 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
113044	大秦转债	2020-12-14	2021-01-15	老股东配债	100.00	100.00	1,810	181,000.00	181,000.00	-
113616	韦尔转债	2020-12-28	2021-01-22	老股东配债	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-

注：1、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。

2、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。

7.4.12.2 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。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

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

本基金是采用指数化操作的股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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 2020 年 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.19%（2019 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券）。

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。

7.4.13.2.1 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	999,900.00	-
合计	999,900.00	-

注：未评级部分为国债。

7.4.13.2 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	181,000.00	-
AAA 以下	3,000.00	-
未评级	-	7,259,037.50
合计	184,000.00	7,259,037.50

注：未评级部分为政策性金融债。

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 2020 年 12 月 31 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。

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上市公司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 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 2020 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 0.55%。

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 2020 年 12 月 31 日,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、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 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	5,310,677.29	-	-	-	5,310,677.29
结算备付金	39,847.54	-	-	-	39,847.54
存出保证金	46,922.87	-	-	-	46,922.87
交易性金融资产	999,900.00	-	184,000.00	89,619,992.64	90,803,892.64
应收证券清算款	-	-	-	98,281.08	98,281.08
应收申购款	-	-	-	188,731.47	188,731.47
应收利息	-	-	-	22,661.99	22,661.99
资产总计	6,397,347.70	-	184,000.00	89,929,667.18	96,511,014.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	54,947.64	54,947.64
应付托管费	-	-	-	9,419.58	9,419.58
应付交易费用	-	-	-	27,404.70	27,404.70
应交税费	-	-	-	0.41	0.41
应付赎回款	-	-	-	653,075.72	653,075.72
其他负债	-	-	-	281,941.28	281,941.28
负债总计	-	-	-	1,026,789.33	1,026,789.33
利率敏感度缺口	6,397,347.70	-	184,000.00	88,902,877.85	95,484,225.55
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	5,211,285.23	-	-	-	5,211,285.23
结算备付金	149,879.76	-	-	-	149,879.76
存出保证金	55,720.02	-	-	-	55,720.02
交易性金融资产	7,259,037.50	-	-	203,026,360.88	210,285,398.38
应收申购款	-	-	-	46,876.91	46,876.91
应收利息	-	-	-	109,077.15	109,077.15
资产总计	12,675,922.51	-	-	203,182,314.94	215,858,237.45
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	166,849.81	166,849.81
应付托管费	-	-	-	28,602.81	28,602.81
应付交易费用	-	-	-	102,010.86	102,010.86
应付赎回款	-	-	-	752,396.80	752,396.80
其他负债	-	-	-	262,064.89	262,064.89
负债总计	-	-	-	1,311,925.17	1,311,925.17
利率敏感度缺口	12,675,922.51	-	-	201,870,389.77	214,546,312.28

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予以分类。

7.4.13.4.1.2 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-2,667.19	-10,397.13
市场利率下降 25 个基点	2,711.62	10,437.57	

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的股票，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。

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 90%-95%，投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%。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。

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 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	89,619,992.64	93.86	203,026,360.88	94.63
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	89,619,992.64	93.86	203,026,360.88	94.63

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	4,378,768.24	10,026,763.17
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-4,378,768.24	-10,026,763.17

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 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 89,279,008.31 元, 属于第二层次的余额为 1,524,884.33 元, 无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日: 第一层次 198,563,711.32 元, 属于第二层次的余额为 11,721,687.06 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券, 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, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据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, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末, 本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具(2019 年 12 月 31 日: 同)。

于 2020 年度, 无第三层次变动(于 2019 年度, 本基金转出第三层次的金额为 501,427.08 元, 计入损益的损失为 26,409.94 元; 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值采用市场法及相关估值技术确定, 不可观察输入值为最近交易价格)。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日: 同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债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相差很小。

(2)其他

除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	89,619,992.64	92.86
	其中: 股票	89,619,992.64	92.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,183,900.00	1.23
	其中: 债券	1,183,900.00	1.23
	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	5,350,524.83	5.54
7	其他各项资产	356,597.41	0.37
8	合计	96,511,014.88	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	1,375,983.36	1.44
B	采矿业	2,464,707.69	2.58
C	制造业	41,650,931.36	43.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,417,677.68	1.48
E	建筑业	1,516,945.78	1.59
F	批发和零售业	257,160.99	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,953,798.71	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	860,918.60	0.90
J	金融业	30,659,616.96	32.11
K	房地产业	2,954,186.60	3.09
L	租赁和商务服务业	2,544,112.62	2.66
M	科学研究和技术服务业	1,163,980.80	1.22
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	189,702.00	0.20
Q	卫生和社会工作	176,740.40	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	89,186,463.55	93.40

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	319,466.94	0.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,716.24	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	95,345.91	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	433,529.09	0.45

8.2.3 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

8.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	4,048	8,087,904.00	8.47
2	601318	中国平安	80,956	7,041,552.88	7.37
3	600036	招商银行	86,813	3,815,431.35	4.00
4	000333	美的集团	36,707	3,613,437.08	3.78
5	600276	恒瑞医药	27,807	3,099,368.22	3.25
6	600887	伊利股份	53,200	2,360,484.00	2.47
7	601166	兴业银行	112,588	2,349,711.56	2.46
8	000651	格力电器	35,980	2,228,601.20	2.33
9	601888	中国中免	6,919	1,954,271.55	2.05
10	600030	中信证券	59,806	1,758,296.40	1.84
11	002475	立讯精密	30,608	1,717,720.96	1.80
12	300059	东方财富	51,107	1,584,317.00	1.66
13	601012	隆基股份	16,900	1,558,180.00	1.63
14	000002	万科 A	52,400	1,503,880.00	1.58
15	000858	五粮液	5,076	1,481,430.60	1.55
16	600031	三一重工	41,700	1,458,666.00	1.53
17	000001	平安银行	68,119	1,317,421.46	1.38
18	600900	长江电力	67,648	1,296,135.68	1.36
19	002594	比亚迪	6,576	1,277,716.80	1.34
20	002415	海康威视	26,197	1,270,816.47	1.33
21	000568	泸州老窖	5,334	1,206,337.44	1.26
22	000725	京东方 A	200,700	1,204,200.00	1.26
23	600048	保利地产	75,300	1,191,246.00	1.25
24	601288	农业银行	376,400	1,181,896.00	1.24
25	603259	药明康德	8,640	1,163,980.80	1.22
26	600309	万华化学	12,500	1,138,000.00	1.19
27	603288	海天味业	5,660	1,135,056.40	1.19
28	601688	华泰证券	58,559	1,054,647.59	1.10
29	600585	海螺水泥	19,200	991,104.00	1.04
30	601899	紫金矿业	105,452	979,649.08	1.03
31	002304	洋河股份	4,054	956,703.46	1.00
32	601328	交通银行	194,195	869,993.60	0.91
33	600690	海尔智家	29,728	868,354.88	0.91
34	600016	民生银行	166,847	867,604.40	0.91
35	002352	顺丰控股	9,801	864,742.23	0.91
36	601601	中国太保	22,200	852,480.00	0.89

37	601668	中国建筑	169,824	844,025.28	0.88
38	600837	海通证券	63,962	822,551.32	0.86
39	600000	浦发银行	84,493	817,892.24	0.86
40	600999	招商证券	33,552	783,103.68	0.82
41	002714	牧原股份	9,800	755,580.00	0.79
42	002142	宁波银行	20,530	725,530.20	0.76
43	600104	上汽集团	28,221	689,721.24	0.72
44	600809	山西汾酒	1,700	637,993.00	0.67
45	601211	国泰君安	36,157	633,832.21	0.66
46	300498	温氏股份	34,032	620,403.36	0.65
47	600009	上海机场	7,978	603,615.48	0.63
48	002027	分众传媒	59,761	589,841.07	0.62
49	600346	恒力石化	19,800	553,806.00	0.58
50	601766	中国中车	100,931	535,943.61	0.56
51	601398	工商银行	105,276	525,327.24	0.55
52	601818	光大银行	129,951	518,504.49	0.54
53	600406	国电南瑞	19,400	515,458.00	0.54
54	601628	中国人寿	13,415	515,001.85	0.54
55	000063	中兴通讯	15,200	511,480.00	0.54
56	601169	北京银行	104,600	506,264.00	0.53
57	601088	中国神华	28,044	505,072.44	0.53
58	000538	云南白药	4,333	492,228.80	0.52
59	601229	上海银行	60,626	475,307.84	0.50
60	601988	中国银行	148,576	472,471.68	0.49
61	600028	中国石化	115,067	463,720.01	0.49
62	000661	长春高新	1,000	448,910.00	0.47
63	601336	新华保险	7,375	427,528.75	0.45
64	603501	韦尔股份	1,800	415,980.00	0.44
65	600019	宝钢股份	63,151	375,748.45	0.39
66	000895	双汇发展	7,800	366,132.00	0.38
67	601390	中国中铁	64,550	340,178.50	0.36
68	300122	智飞生物	2,200	325,402.00	0.34
69	601225	陕西煤业	33,589	313,721.26	0.33
70	601186	中国铁建	37,800	298,620.00	0.31
71	600050	中国联通	65,860	293,735.60	0.31
72	601006	大秦铁路	41,700	269,382.00	0.28
73	601989	中国重工	63,625	266,588.75	0.28
74	600015	华夏银行	37,564	234,775.00	0.25
75	601857	中国石油	48,806	202,544.90	0.21
76	601138	工业富联	13,900	190,291.00	0.20
77	002607	中公教育	5,400	189,702.00	0.20
78	601933	永辉超市	26,400	189,552.00	0.20
79	300015	爱尔眼科	2,360	176,740.40	0.19
80	600606	绿地控股	25,057	146,082.31	0.15

81	601658	邮储银行	29,200	139,576.00	0.15
82	600018	上港集团	28,700	131,159.00	0.14
83	003816	中国广核	43,100	121,542.00	0.13
84	001979	招商蛇口	8,501	112,978.29	0.12
85	002736	国信证券	8,277	112,898.28	0.12
86	601998	中信银行	21,130	107,974.30	0.11
87	600745	闻泰科技	1,000	99,000.00	0.10
88	601816	京沪高铁	15,000	84,900.00	0.09
89	000776	广发证券	4,400	71,632.00	0.08
90	002024	苏宁易购	8,769	67,608.99	0.07
91	000166	申万宏源	9,988	52,736.64	0.06
92	002938	鹏鼎控股	1,000	49,670.00	0.05
93	600588	用友网络	1,000	43,870.00	0.05
94	601800	中国交建	4,700	34,122.00	0.04
95	000876	新希望	1,000	22,400.00	0.02
96	600918	中泰证券	1,000	18,500.00	0.02
97	603160	汇顶科技	100	15,555.00	0.02
98	601360	三六零	500	7,855.00	0.01
99	601066	中信建投	100	4,200.00	0.00
100	601319	中国人保	100	657.00	0.00

8.3.2 期末积极投资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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688165	埃夫特	14,996	196,447.60	0.21
2	688057	金达莱	3,321	95,345.91	0.10
3	688658	悦康药业	1,610	39,235.70	0.04
4	688617	惠泰医疗	368	27,401.28	0.03
5	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.02
6	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.02
7	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.02
8	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
9	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
10	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01

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	002714	牧原股份	1,679,692.00	0.78
2	002475	立讯精密	1,539,908.00	0.72
3	601012	隆基股份	1,273,919.00	0.59
4	600900	长江电力	917,653.00	0.43
5	002352	顺丰控股	728,082.00	0.34
6	600346	恒力石化	677,435.00	0.32
7	601888	中国中免	655,432.00	0.31
8	600809	山西汾酒	550,468.00	0.26
9	600030	中信证券	541,665.00	0.25
10	601688	华泰证券	540,855.00	0.25
11	600519	贵州茅台	447,483.00	0.21
12	000002	万科 A	430,980.00	0.20
13	601138	工业富联	425,138.00	0.20
14	603501	韦尔股份	414,972.00	0.19
15	300015	爱尔眼科	412,961.00	0.19
16	603259	药明康德	410,565.00	0.19
17	000661	长春高新	378,700.00	0.18
18	002415	海康威视	365,329.20	0.17
19	600036	招商银行	352,990.00	0.16
20	600585	海螺水泥	351,009.00	0.16

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	601318	中国平安	12,717,525.71	5.93
2	600519	贵州茅台	10,161,056.75	4.74
3	000858	五粮液	7,547,434.00	3.52
4	600036	招商银行	5,886,582.80	2.74
5	600276	恒瑞医药	4,681,671.61	2.18
6	000333	美的集团	4,426,597.70	2.06
7	000651	格力电器	4,195,404.00	1.96
8	600030	中信证券	3,993,812.00	1.86
9	601166	兴业银行	3,875,449.00	1.81
10	600887	伊利股份	2,984,009.86	1.39
11	000002	万科 A	2,774,802.26	1.29
12	002475	立讯精密	2,472,942.81	1.15
13	002415	海康威视	2,271,373.74	1.06

14	601328	交通银行	2,153,097.00	1.00
15	601888	中国中免	2,128,769.99	0.99
16	600016	民生银行	2,110,660.00	0.98
17	000001	平安银行	2,086,828.00	0.97
18	300059	东方财富	2,011,246.20	0.94
19	601398	工商银行	1,953,302.00	0.91
20	600900	长江电力	1,929,739.21	0.90

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

买入股票成本（成交）总额	28,103,111.93
卖出股票收入（成交）总额	180,542,876.96

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

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	999,900.00	1.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	184,000.00	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,183,900.00	1.24

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

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	019627	20 国债 01	10,000	999,900.00	1.05
2	113044	大秦转债	1,810	181,000.00	0.19
3	113616	韦尔转债	30	3,000.00	0.00

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。

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兴业银行 (601166)，作为债务融资工具主承销商，因在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议，于 2020 年 5 月 15 日被中国银行间市场交易商协会责令整改。因同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权等违规行为，于 2020 年 8 月 31 日被中国银保监会福建监管局没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。因为无证机构提供转接清算服务、为支付机

构超范围经营提供支付服务、违规连通上下游支付机构提供转接清算服务等，且上述违规行为未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等行为，于 2020 年 9 月 4 日被中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金系指数型基金，对上述证券的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

其余九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	46,922.87
2	应收证券清算款	98,281.08
3	应收股利	-
4	应收利息	22,661.99
5	应收申购款	188,731.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	356,597.41

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允	占基金资产净	流通受限情况说明
----	------	------	-----------	--------	----------

			价值 (元)	值比例 (%)	
1	688165	埃夫特	196,447.60	0.21	新股锁定流通受限
2	688057	金达莱	95,345.91	0.10	新股锁定流通受限
3	688617	惠泰医疗	27,401.28	0.03	新股未上市

§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

份额级别	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
海富通中证 100 指数 A	4,138	14,239.84	1,927,889.92	3.27%	56,996,581.26	96.73%
海富通中证 100 指数 C	2	99.08	-	-	198.16	100.00%
合计	4,140	14,233.01	1,927,889.92	3.27%	56,996,779.42	96.73%

9.2 期末上市基金前十名持有人

海富通中证 100 指数 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	齐齐哈尔中通公共交通有限责任公司	500,030.00	26.98%
2	何小娥	384,511.00	20.75%
3	单世扬	100,003.00	5.40%
4	葛光亚	92,007.00	4.97%
5	杨凯	87,000.00	4.69%
6	北京鸿愿非凡装饰材料有限公司	70,000.00	3.78%
7	许海龙	66,208.00	3.57%
8	王方	64,280.00	3.47%
9	李瑶琼	50,001.00	2.70%
10	柴璟	40,000.00	2.16%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	海富通中证 100 指数 A	141,728.19	0.2405%
	海富通中证 100 指数 C	198.16	100.0000%
	合计	141,926.35	0.2409%

9.4 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	份额级别	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	海富通中证 100 指数 A	10~50
	海富通中证 100 指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通中证 100 指数 A	0
	海富通中证 100 指数 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
基金合同生效日 (2009 年 10 月 30 日) 基金份额总额	2,087,148,875.30	-
本报告期期初基金份额总额	170,873,343.91	-
本报告期基金总申购份额	38,621,531.68	198.16
减：本报告期基金总赎回份额	150,570,404.41	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	58,924,471.18	198.16

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

1、2020 年 5 月 26 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次会议审议通过，陶网雄先生由公司副总经理转任首席信息官。

2、2020 年 6 月 24 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次会议审议通过，聘请王智慧先生担任公司副总经理职务。

3、2020 年 7 月 25 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次会议审议通过，分别聘请孙海忠先生、胡光涛先生担任公司副总经理职务。

4、2020 年 8 月 11 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四次会议审议通过，奚万荣先生不再担任公司督察长职务，并决定由公司董事长杨仓兵先生代为履行督察长职务，代为履行督察长职务的期限不超过 90 日。

5、2020 年 8 月 22 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四次会议审议通过，聘请岳冲先生担任公司督察长职务，公司董事长杨仓兵先生不再代行督察长职务。

6、2020 年 11 月 11 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二十七次临时会议审议通过，孙海忠先生不再担任公司副总经理职务。

7、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 50,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 12 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

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。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
海通证券	2	116,578,854.11	58.22%	84,566.96	62.13%	-
申万宏源	2	29,578,346.59	14.77%	12,543.63	9.22%	-
华西证券	1	24,783,664.17	12.38%	18,124.02	13.32%	-
国盛证券	2	16,627,085.32	8.30%	12,159.14	8.93%	-
天风证券	2	11,672,442.87	5.83%	8,302.70	6.10%	-
华创证券	1	992,792.70	0.50%	408.33	0.30%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增海通证券2个交易单元、国泰君安证券2个交易单元、招商证券2个交易单元、太平洋证券2个交易单元、开源证券2个交易单元、野村东方国际证券1个交易单元、西南证券2个交易单元、民生证券2个交易单元。

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	4,843,226.00	95.34%	-	-	-	-
申万宏源	158,199.00	3.11%	-	-	-	-
华西证券	58,122.60	1.14%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	20,435.52	0.40%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-02
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购、基金组合购买、基金定投申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-04
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-07
4	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台银联支付渠道新增部分银行卡并开展申购费	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2020-03-02

	率优惠的公告	金电子披露网站	
5	海富通基金管理有限公司关于参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-04
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华安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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-25
7	海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 第二次分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-27
8	海富通基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售 (大连) 有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-24
9	海富通基金管理有限公司关于开展海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 直销中心赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-15
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投期货有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
11	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
12	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
13	海富通基金管理有限公司关于延迟和耕传承基金销售有限公司代销旗下基金的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
14	海富通基金管理有限公司关于变更直销中心交易传真号码的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-06
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-17
16	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-30
18	海富通基金管理有限公司关于开展海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 直销中心赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-02
19	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员	上海证券报、基金管理	2020-07-25

	变更的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
20	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-07-25
21	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-11
22	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-08-22
23	海富通基金管理有限公司关于网上直销开通汇款交易业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-17
24	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-19
25	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-24
26	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旗下招赢通平台申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-09-26
27	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-24
28	海富通基金管理有限公司关于网上直销汇款交易业务开展费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-29
29	海富通基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-10-30
31	关于海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF) 增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-09
32	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-11-11
33	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01
34	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-01

35	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-05
36	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-18
37	海富通基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-18
38	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售(深圳)有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-12-24

§ 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

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	2020/7/3-2020/7/7	17,026,971.13	9,858,747.76	26,885,718.89	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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。 <p>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。</p>							

注：报告期内单一投资者申购份额包含红利再投资确认份额。

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 92 只公募基金。截至 2020 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1251 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”。

§ 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中证 100 指数证券投资基金（LOF）的文件
- （二）海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同
- （三）海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书

（四）海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）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）报告期内海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）在指定报刊上披露的各项公告

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

二〇二一年三月三十一日