

海富通富盈混合型证券投资基金
2021 年第 4 季度报告
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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十二日

§1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通富盈混合
基金主代码	009154
交易代码	009154
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 20 日
报告期末基金份额总额	448,575,693.19 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金以在风险可控下寻求稳定的超额收益作为投资理念，采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。股票投资方面，本基

	金将采用量化选股方法构建股票组合，以价值投资作为核心理念，通过量化模型构建多因子 alpha 模型。债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。另外，本基金投资策略还包括资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略、股票期权投资策略。	
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
下属两级基金的交易代码	009154	009155
报告期末下属两级基金的份额总额	229,835,745.24 份	218,739,947.95 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
1.本期已实现收益	2,975,231.64	2,833,347.98
2.本期利润	4,959,405.01	5,537,473.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0219	0.0202
4.期末基金资产净值	257,269,149.89	243,263,018.82
5.期末基金份额净值	1.1194	1.1121

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、海富通富盈混合 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.95%	0.20%	0.41%	0.15%	1.54%	0.05%
过去六个月	3.18%	0.25%	-0.70%	0.20%	3.88%	0.05%
过去一年	6.07%	0.33%	0.24%	0.22%	5.83%	0.11%
自基金合同生效起至今	11.94%	0.28%	3.04%	0.22%	8.90%	0.06%

2、海富通富盈混合 C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.84%	0.20%	0.41%	0.15%	1.43%	0.05%
过去六个月	2.96%	0.25%	-0.70%	0.20%	3.66%	0.05%
过去一年	5.64%	0.33%	0.24%	0.22%	5.40%	0.11%
自基金合同生效起至今	11.21%	0.28%	3.04%	0.22%	8.17%	0.06%

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

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

1. 海富通富盈混合 A

(2020 年 5 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日)



2. 海富通富盈混合 C

(2020 年 5 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜晓海	本基金的基金经理； 总经理助理兼 量化投资部总	2020-05-20	-	21年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公

	监。				<p>司总经理助理兼量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。</p>
夏妍妍	本基	2020-05-	-	7 年	上海交通大学经济学硕士，持

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

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年四季度，国内经济延续下行趋势，其中房地产投资、销售、新开工全线下滑，基建投资与消费继续疲软，出口及制造业投资链条仍是少数亮点。价格指数方面，CPI 走势相对温和，PPI 在创出历史新高后开始回落。在需求下滑及政策“保供顺价”背景下，能源领域的供需错配暂时告一段落。海外经济方面，美国商品消费向服务消费切换的速度慢于预期。商品消费仍然高于趋势水平，服务需求仍低于趋势水平。货币政策方面，美联储加速缩减购债规模，同时加息预期开始升温。

四季度国内权益市场延续上行，科技成长板块表现较好，消费板块延续分化，周期板块显著调整。A 股主要指数方面，上证指数上涨 2.01%，沪深 300 上涨 1.52%，中证 800 上涨 2.01%，中小 100 指上涨 6.21%，创业板指上涨 2.40%，中证 500 上涨 3.60%。以中信行业分类看，成长板块显著上涨，四季度涨幅前五的行业为传媒、国防军工、通信、综合金融、轻工制造，分别上涨 22.72%、17.48%、14.59%、12.58% 和 12.21%，其中大部分为成长性板块；周期板块显著回调，跌幅前五的行业为煤炭、石油石化、钢铁、消费者服务、银行，分别下跌 12.61%、9.51%、7.17%、6.4% 和 0.94%。从四季度 A 股内部结构看，成长板块表现较好，与流动性充裕下的中小盘风格发散有关；消费板块表现分化，一方面与国内消费数据疲弱相符，另一方面则与部分消费品提价有关；而周期板块大幅调整，则与政策“保供顺价”密切相关。

市场结构方面，四季度市场结构延续了前三季度情况，在资金存量博弈行情下，行业、风格轮动较快，周期、成长交相成为市场主线，消费阶段性有所表现。业绩增速高且确定性强的新能源汽车产业链引领整个成长板块。消费领域受部分产品提价及提价预期影响有所表现。在板块裂口短期过大情况下，风格分化在四季度陆续有所收敛，部分消费品和“核心资产”触底反弹，而周期和成长则开始回调。

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

展望 1 季度，本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

固定收益方面，四季度国内经济有所走弱，债券收益率呈现震荡小幅下行。具体而言，10 月以来限电、能耗双控等不利因素消退，国内生产有所反弹，PMI 指标重新回到 50% 以上。但投资方面受到“贷款双集中”、“三道红线”监管、集中供地等政策的影响，同时以恒大为代表的风险事件在房地产行业发酵蔓延，地产投资增速大幅回落，单月同比增速转负；同时基建投资增速在缺乏项目与年内缺乏托底经济的动力的情况下维持低位；制造业投资在中游出口需求较好、高技术产业投资旺盛的带动下表现强势。四季度消费在国内疫情局部反复的情况下表现较为疲软，尤其是线下消费与餐饮相关的行业受损严重。出口受到海外经济复苏的支撑维持较好的韧性，其中机电产品出口表现亮眼。通胀方面，四季度 CPI 在猪肉价格企稳、蔬菜价格受极端天气影响的背景下有所上行，PPI 在煤炭保供限价的政策组合下见顶回落。在这种经济环境下，四季度货币政策继续维持宽松，12 月央行年度第 2 次降准 50bp，释放中长期资金约 1.2 万亿，此外还陆续推出碳减排支持工具、下调支农支小再贷款利率等结构性政策。对应债市而言，10 月宽货币落空而宽信用预期升温，债券到期收益率上行，最高达到 3.04% 的水平。11 月新冠变异毒株欧米克戎对资本市场的影响开始发酵，债券到期收益率震荡下行。12 月随着经济基本面走弱被进一步确认，在降准的带动下降息预期逐渐升温，10 年期国债到期收益率年底下行至 2.79% 的水平。整个四季度 10 年期国债收益率下行 10.2BP。信用债方面，四季度信用债收益率总体波动下行。当前信用债收益率整体处于历史 1/5 分位数以下，信用利差继续分化。城投方面，广东、上海于 10 月先后宣布启动全域无隐性债务试点，同时，土地市场热度下降，引发市场对地方财政收入下滑、可协调资源减少以及城投偿债能力弱化的担忧，城投偿债政策整体呈现“管两头”的特征；地产方面，下半年房地产融资、拿地、销售受到全面管控，信用风险事件和异常成交频发，行业利差大幅攀升，虽 11 月以来针对地产的政策导向缓和，但改善的背后行业内部分化加剧。可转债方面，4 季度中证转债指数上涨 7.0%，转债表现依旧亮眼。转债受到市场资金热捧，整体估值水平也处于历史高位。

四季度，本基金债券部分配置秉承绝对收益的思路，适度参与利率交易。整体来看，获得了稳定较好收益。

2022 年一季度，本基金债券部分将在严格控制风险的基础上，精选中高等级信用债个券进行配置，并争取获得较高稳定收益。同时，配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富盈混合 A 份额净值增长率为 1.95%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.54 个百分点。海富通富盈混合 C 份额净值增

长率为 1.84%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.43 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	146,443,462.70	28.92
	其中：股票	146,443,462.70	28.92
2	固定收益投资	331,872,380.51	65.53
	其中：债券	331,872,380.51	65.53
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,906,976.96	3.93
7	其他资产	8,234,768.63	1.63
8	合计	506,457,588.80	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为1,603,518.00元，占资产净值比例为0.32%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为46,799.42元，占资产净值比例为0.01%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	391,941.60	0.08
B	采矿业	3,328,060.00	0.66

C	制造业	104,865,695.07	20.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,597,259.00	0.72
E	建筑业	141,726.00	0.03
F	批发和零售业	1,252,268.94	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	73,872.00	0.01
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	5,742,810.94	1.15
J	金融业	15,879,515.28	3.17
K	房地产业	2,962,606.50	0.59
L	租赁和商务服务业	1,687,249.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	1,749,790.11	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	590,135.91	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	649,302.62	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,876,304.31	0.37
S	综合	-	-
	合计	144,793,145.28	28.93

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	46,799.42	0.01
金融	457,038.40	0.09
信息技术	488,769.46	0.10
通信服务	657,710.14	0.13
合计	1,650,317.42	0.33

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	2,700	5,535,000.00	1.11
2	002142	宁波银行	127,930	4,897,160.40	0.98
3	600036	招商银行	98,000	4,773,580.00	0.95
4	300059	东方财富	124,920	4,635,781.20	0.93
5	600887	伊利股份	79,000	3,275,340.00	0.65
6	000858	五粮液	13,700	3,050,442.00	0.61
7	600900	长江电力	131,800	2,991,860.00	0.60
8	600309	万华化学	29,415	2,970,915.00	0.59
9	600690	海尔智家	92,400	2,761,836.00	0.55
10	300014	亿纬锂能	23,117	2,731,967.06	0.55

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,911,211.60	12.37
	其中：政策性金融债	31,229,211.60	6.24
4	企业债券	136,691,000.00	27.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	120,964,000.00	24.17
7	可转债（可交换债）	12,306,168.91	2.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	331,872,380.51	66.30

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	163617	20 藏投 01	300,000	30,339,000.00	6.06
2	190202	19 国开 02	300,000	30,012,000.00	6.00
3	2120092	21 徽商银行二级 01	200,000	20,364,000.00	4.07
4	101752014	17 金地 MTN001	200,000	20,260,000.00	4.05

5	101900731	19 豫高管 MTN002	200,000	20,164,000.00	4.03
---	-----------	------------------	---------	---------------	------

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IF2203	IF2203	-12.00	-17,822,160.0 0	-325,080.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-325,080.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,836,240.0 0
股指期货投资本期公允价值变动(元)					797,940.00

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,167,295.31
2	应收证券清算款	561,123.94
3	应收股利	-
4	应收利息	5,504,766.45
5	应收申购款	1,582.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,234,768.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	132022	20 广版 EB	2,622,950.00	0.52
2	110064	建工转债	1,711,537.00	0.34
3	110068	龙净转债	1,454,050.00	0.29
4	127016	鲁泰转债	1,271,023.60	0.25
5	113532	海环转债	1,213,955.70	0.24
6	113519	长久转债	1,056,735.60	0.21

7	113530	大丰转债	594,600.00	0.12
8	128132	交建转债	435,440.00	0.09
9	123004	铁汉转债	404,781.57	0.08
10	128083	新北转债	352,530.00	0.07
11	110052	贵广转债	329,280.00	0.07
12	113021	中信转债	325,860.00	0.07
13	128124	科华转债	218,660.00	0.04
14	127019	国城转债	215,020.00	0.04
15	113596	城地转债	98,400.00	0.02
16	123111	东财转 3	1,345.44	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富盈混合A	海富通富盈混合C
本报告期期初基金份额总额	157,116,309.49	315,548,943.55
本报告期基金总申购份额	95,057,888.62	1,208,338.19
减：本报告期基金总赎回份额	22,338,452.87	98,017,333.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	229,835,745.24	218,739,947.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021/12/17-2021/12/31	-	90,982,622.15	-	90,982,622.15	20.28%

产品特有风险

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

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

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 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”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二二年一月二十二日