海富通大中华精选混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 34
7.1 期末基金资产组合情况 34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 35
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 41
7.10 投资组合报告附注 41
§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 42
§9 开放式基金份额变动 42
§10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 43
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 50
§12 备查文件目录 51
12.1 备查文件目录 51
12.2 存放地点 52
12.3 查阅方式 52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通大中华精选混合型证券投资基金
基金简称	海富通大中华混合（QDII）
基金主代码	519602
交易代码	519602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 27 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	14,404,979.57 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于在海外证券市场交易的大中华公司的优质股票,追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对全球宏观经济和大中华地区区域经济的基本面分析，采用自上而下的策略对资产进行有效资产配置；对股票的选择采用自下而上的“三站式”精选策略，挖掘定价合理，具备竞争优势的上市公司股票进行投资，并有效控制下行风险。
业绩比较基准	MSCI 金龙净总收益指数
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。同时，本基金投资的目标市场是海外市场，除了需要承担市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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	北京西城区复兴门内大街1号

	桥路66 号东亚银行金融大厦36-37层	
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	2,383,334.86
本期利润	3,659,269.09
加权平均基金份额本期利润	0.2228
本期加权平均净值利润率	17.10%
本期基金份额净值增长率	18.81%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2020 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	6,200,717.64
期末可供分配基金份额利润	0.4305
期末基金资产净值	21,653,379.58
期末基金份额净值	1.503

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	50.30%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	10.11%	1.43%	8.18%	1.10%	1.93%	0.33%
过去三个月	29.79%	1.46%	15.30%	1.22%	14.49%	0.24%
过去六个月	18.81%	2.03%	1.92%	1.59%	16.89%	0.44%
过去一年	31.38%	1.60%	13.18%	1.24%	18.20%	0.36%
过去三年	47.79%	1.44%	28.71%	1.09%	19.08%	0.35%
自基金合同生效起至今	50.30%	1.44%	79.47%	1.08%	-29.17%	0.36%

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

海富通大中华精选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历史走势对比图

(2011 年 1 月 27 日至 2020 年 6 月 30 日)

注：1、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，截至建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围、（九）投资限制中规定的各项比例；

2、本基金按照全球投资表现标准（GIPS）计算和表述投资业绩。

§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 6 月 30 日，本基金管理人共管理 74 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、海富通季季增利理财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、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、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）、海富通量化前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。

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	证券从业	说明

		理）期限		年限	
		任职日期	离任日期		
高峥	本基金的基金经理；海富通沪港深混合基金经理；海富通中国海外混合(QDII)基金经理。	2018-09-21	-	12 年	经济学硕士。持有基金从业人员资格证书。历任德勤华永会计师事务所审计部职员，光大证券股份有限公司行业研究员，中金公司研究部执行总经理、化工行业研究团队负责人。2017 年 3 月加入海富通基金管理有限公司，历任权益投资部基金经理助理。2017 年 8 月起任海富通沪港深混合的基金经理。2018 年 9 月起兼任海富通大中华混合(QDII)、海富通中国海外混合(QDII)的基金经理。
陶意非	本基金的基金经理；海富通中国海外混合(QDII)基金经理。	2019-01-30	-	14 年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任花旗集团证券（日本）策略分析师、瑞穗证券(Mizuho Securities)交易员、顶峰资产管理有限公司（ASSET MANAGEMENT ONE Co., Ltd）基金经理、汇丰晋信基金管理有限公司首席港股策略师。2018 年 12 月加入海富通基金管理有限公司。2019 年 1 月任海富通大中华混合(QDII)、海富通中国海外混合(QDII)的基金经理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

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

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2020 年上半年，包括港股和台股的大中华股票市场下跌。截至 2020 年 6 月 30 日，恒生指数累计下跌 13.35%，恒生国企指数下跌 12.62%，MSCI 中国指数则小幅上涨 2.01%，台湾加权指数下跌 3.13%；相比同期，沪深 300 指数、中小板指和创业板指则分别上涨 1.64%、20.85%和 35.60%。

回顾上半年走势，疫情导致市场呈现“过山车”式行情，三重负面因素导致大中华股票市场表现落后全球其它市场。整体来看，受多种因素影响，大中华股票市场出现三次回调，导致年初至今表现显著落后全球其它股市。具体而言： 1）1 月中旬至 1 月底，国内新冠疫情的爆发导致市场大幅下挫，但此后在疫情防控政策推动下，市场逐步反弹；2）2 月中旬以来，海外疫情波及面明显更广，而且程度更为严重，引发更多恐慌，导致海外市场大幅下挫。由于风险偏好恶化、尤其是美元流动性紧张，大中华股票市场大幅下挫，跌幅超过 A 股市场，主要是由于大中华股票市场受全球投资情

绪和资金流动影响较大。不过，此后在全球积极的政策应对推动下，流动性开始出现改善，3 月底风险偏好逐步回升；3）从 5 月份开始，中美争端再次浮出水面，尤其是围绕香港和美国上市中概股方面的中美摩擦导致投资者猝不及防。但其影响较为短暂，在国内外持续复工推动下，风险偏好改善，市场出现反弹。

同时，关注个别行业，受封城影响较小、甚至从中受益的板块（例如在线服务、医疗保健、日常消费和科技）表现好于其它板块。与之相反，可选消费和工业等其它板块因疫情而遭受更大影响，但在复工取得更大进展后出现强劲反弹。另外，在所有板块中，能源板块表现最差，房地产、金融、原材料和公用事业板块也对市场表现构成拖累。

报告期内基金仍依据业绩及估值表现，寻求具有长期投资价值的股票，除了继续超配 5G、教育相关股票以外，买入受益于疫情影响的医药股票；同时继续低配银行保险等金融板块。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 18.81%，同期业绩比较基准收益率为 1.92%，基金净值超过业绩比较基准 16.89 个百分点。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历了今年上半年的"过山车"行情且依然大幅落后于全球其它市场后，展望下半年，我们预计大中华股票市场有望逐步摆脱困境，尽管外部不确定性仍存。

中国经济复苏在途。在力度空前的各项政策支持下，我们预计全球经济将从疫情冲击的极端底部渐进修复。虽然海外经济的重启进程可能因疫情存在反复，但国内复工复产正在有序推进并将进一步深化。

政策支持继续，改革进一步深化。在货币政策有望维持相对宽松的同时，财政刺激力度有望加大，为下半年增长修复提供更多支撑。更重要的是，我们认为更多改革性举措有望进一步出台，例如新型城镇化改革、新基建和进一步资本市场开放等举措，这将有望重新激发中国经济的长期增长潜力和中国资产的吸引力。

新经济板块继续领跑。虽然大中华股票市场整体在上半年表现低迷，但市场中完全不乏领跑者。实际上，在经济增长面临冲击和市场出现大幅波动的环境下，新经济板块继续大放异彩，进一步拉大了与老经济板块之间的差距，这也契合我们持续看好中国消费和产业升级长期趋势的判断。

行业方面，继续关注 5G 相关股以及教育股等具有长期投资价值的行业，此外受益于疫情以及长期社会发展需要的医药板块和具有较高成长确定性的物业板块也具有很好的投资价值。

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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于可供分配利润的 20%。

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

本基金自 2018 年 6 月 25 日至 2020 年 6 月 30 日，已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人拟通过基金转型的方式解决。解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。

§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")在对海富通大中华精选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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,158,239.01	1,816,956.41
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	19,060,745.91	22,297,285.49
其中：股票投资		19,060,745.91	22,297,285.49
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		841,815.26	1,289,848.35
应收利息	6.4.7.5	115.95	302.64
应收股利		21,059.25	-
应收申购款		389,103.34	14,235.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		**23,471,078.72**	**25,418,628.76**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,701,604.01	576,547.02
应付管理人报酬		32,086.09	37,987.23
应付托管费		5,347.71	6,331.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	78,661.33	101,288.43
负债合计		**1,817,699.14**	**722,153.87**
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	14,404,979.57	19,521,362.73
未分配利润	6.4.7.10	7,248,400.01	5,175,112.16
所有者权益合计		**21,653,379.58**	**24,696,474.89**
负债和所有者权益总计		**23,471,078.72**	**25,418,628.76**

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.503 元，基金份额总额 14,404,979.57 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		**4,018,973.62**	**4,694,022.58**
1.利息收入		4,244.60	5,179.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,244.60	5,179.63
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）		2,705,499.64	2,564,388.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,617,561.52	2,273,253.02
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	87,938.12	291,135.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,275,934.23	2,166,059.52
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		17,587.48	-49,618.75
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,707.67	8,013.87
减：二、费用		**359,704.53**	**622,138.44**
1．管理人报酬		192,619.00	280,241.50
2．托管费		32,103.16	46,706.86
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.18	106,725.79	195,424.06
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	6.4.7.19	28,256.58	99,766.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**3,659,269.09**	**4,071,884.14**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**3,659,269.09**	**4,071,884.14**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	19,521,362.73	5,175,112.16	24,696,474.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,659,269.09	3,659,269.09
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）	-5,116,383.16	-1,585,981.24	-6,702,364.40
其中：1.基金申购款	9,321,333.79	3,227,641.12	12,548,974.91
2.基金赎回款	-14,437,716.95	-4,813,622.36	-19,251,339.31
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	14,404,979.57	7,248,400.01	21,653,379.58

净值）			
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,773,636.22	261,476.94	31,035,113.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,071,884.14	4,071,884.14
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）	-7,412,553.80	-967,432.40	-8,379,986.20
其中：1.基金申购款	2,666,890.06	324,023.53	2,990,913.59
2.基金赎回款	-10,079,443.86	-1,291,455.93	-11,370,899.79
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）	23,361,082.42	3,365,928.68	26,727,011.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通大中华精选混合型证券投资基金(原名为海富通大中华精选股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1760 号文核准，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《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》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 821,474,865.11 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(2011)第 15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 821,766,293.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 291,428.86 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。境外资产托管人为中国银行(香港)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》，海富通大中华精选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为海富通大中华精选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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通大中华精选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，包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金(ETF)等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以全球除内地股票市场以外的具有“大中华概念”上市公司为主要投资对象。“大中华概念”的股票需满足以下三个条件之一：1)上市公司注册在大中华区域(中国内地、香港、台湾、澳门)；2)上市公司中最少百分之三十股权(占总股本)由大中华区域的股东持有；3)公司最近一个会计年度至少百分之五十之营业额来自大中华区域。本基金的投资比例为：股票及其他权益类证券占基金资产的 60％-95%；现金、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—40%，其中基金保留的现金的比例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。本基金的业绩比较基准为：MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

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 2020 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2020 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关境内外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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	3,158,239.01
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,158,239.01

注：于 2020 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为：港币活期存款 896,883.21（折合人民币 819,249.00 元）；台币活期存款 59,483.00（折合人民币 14,250.36 元）；美金活期存款 4,273.22（折合人民币 30,252.26 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		14,870,956.41	19,060,745.91	4,189,789.50
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		14,870,956.41	19,060,745.91	4,189,789.50

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	115.95
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	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	115.95

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末应付交易费用无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,798.31
应付证券出借违约金	-
预提费用	74,863.02
合计	78,661.33

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,521,362.73	19,521,362.73
本期申购	9,321,333.79	9,321,333.79

本期赎回（以“-”号填列）	-14,437,716.95	-14,437,716.95
本期末	14,404,979.57	14,404,979.57

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,315,803.61	-140,691.45	5,175,112.16
本期利润	2,383,334.86	1,275,934.23	3,659,269.09
本期基金份额交易产生的变动数	-1,498,420.83	-87,560.41	-1,585,981.24
其中：基金申购款	3,177,434.28	50,206.84	3,227,641.12
基金赎回款	-4,675,855.11	-137,767.25	-4,813,622.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,200,717.64	1,047,682.37	7,248,400.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,244.60
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	-
其他	-
合计	4,244.60

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	30,899,553.55
减：卖出股票成本总额	28,281,992.03
买卖股票差价收入	2,617,561.52

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未投资债券。

6.4.7.13.2 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未投资债券。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	87,938.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	87,938.12

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	1,275,934.23
——股票投资	1,275,934.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	1,275,934.23

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	15,707.67
合计	15,707.67

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

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	106,725.79
银行间市场交易费用	-
合计	106,725.79

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	-
其他	418.74
银行汇划费	2,974.82
合计	28,256.58

6.4.7.20 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2关联方报酬

6.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	192,619.00	280,241.50
其中：支付销售机构的客户维护费	89,867.29	109,597.35

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.8% / 当年天数。

6.4.10.2.2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6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	32,103.16	46,706.86

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,294,822.27	4,243.18	1,904,737.45	5,178.25
中国银行(香港)	820,161.24	-	1,311,454.97	1.38

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，其中由中国银行保管的银行存款按适用利率计息，由中银香港保管的银行存款不计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。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，使本基金在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

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本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。

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，使本基金在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行以及境外次托管行中银香港，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2020 年 6 月 30 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月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的 20%（在基金托管账户的存款可以不受上述限制），本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限的资产。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,323,827.41	-	-	834,411.60	3,158,239.01
交易性金融资产	-	-	-	19,060,745.91	19,060,745.91
应收证券清算款	-	-	-	841,815.26	841,815.26
应收利息	-	-	-	115.95	115.95
应收股利	-	-	-	21,059.25	21,059.25
应收申购款	-	-	-	389,103.34	389,103.34
资产总计	2,323,827.41	-	-	21,147,251.31	23,471,078.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,701,604.01	1,701,604.01
应付管理人报酬	-	-	-	32,086.09	32,086.09
应付托管费	-	-	-	5,347.71	5,347.71
其他负债	-	-	-	78,661.33	78,661.33
负债总计	-	-	-	1,817,699.14	1,817,699.14

利率敏感度缺口	2,323,827.41	-	-	19,329,552.17	21,653,379.58
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
资产					
银行存款	1,102,945.77	-	-	714,010.64	1,816,956.41
交易性金融资产	-	-	-	22,297,285.49	22,297,285.49
应收证券清算款	-	-	-	1,289,848.35	1,289,848.35
应收利息	-	-	-	302.64	302.64
应收申购款	-	-	-	14,235.87	14,235.87
资产总计	1,102,945.77	-	-	24,315,682.99	25,418,628.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	576,547.02	576,547.02
应付管理人报酬	-	-	-	37,987.23	37,987.23
应付托管费	-	-	-	6,331.19	6,331.19
其他负债	-	-	-	101,288.43	101,288.43
负债总计	-	-	-	722,153.87	722,153.87
利率敏感度缺口	1,102,945.77	-	-	23,593,529.12	24,696,474.89

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2019 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(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	30,252.26	819,249.00	14,250.36	863,751.62
交易性金融资产	8,737.80	19,052,008.11	-	19,060,745.91
应收股利	-	20,289.75	-	20,289.75
应收证券清算款	-	841,815.26	-	841,815.26
资产合计	38,990.06	20,733,362.12	14,250.36	20,786,602.54
项目	上年度末 2019年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	30,223.34	698,856.94	13,835.77	742,916.05
交易性金融资产	-	22,297,285.49	-	22,297,285.49
应收证券清算款	-	1,289,848.35	-	1,289,848.35
资产合计	30,223.34	24,285,990.78	13,835.77	24,330,049.89
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	30,223.34	24,285,990.78	13,835.77	24,330,049.89

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	1,038,315.64	1,216,502.49
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-1,038,315.64	-1,216,502.49

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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其他价格风险。

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其他权益类证券占基金资产的 60%-95%，银行存款及现金等高流动性资产占基金资产的 5%-40%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 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	19,060,745.91	88.03	22,297,285.49	90.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	19,060,745.91	88.03	22,297,285.49	90.29

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	1,067,454.90	883,476.74
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-1,067,454.90	-883,476.74

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	19,060,745.91	81.21
	其中：普通股	19,052,008.11	81.17
	存托凭证	8,737.80	0.04
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,158,239.01	13.46
8	其他各项资产	1,252,093.80	5.33
9	合计	23,471,078.72	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	19,052,008.11	87.99
美国	8,737.80	0.04
合计	19,060,745.91	88.03

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
医疗保健	6,741,919.61	31.14
非日常生活消费品	5,310,420.44	24.52
信息技术	3,213,603.41	14.84
能源	1,707,595.70	7.89
金融	1,484,793.07	6.86
房地产	306,550.46	1.42
工业	295,863.22	1.37
合计	19,060,745.91	88.03

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Semiconductor Manufacturing Internatio	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	香港交易所	中国香港	82,079	2,024,304.53	9.35

	nal Corporation							
2	CanSino Biologics Inc.	康希诺生物股份公司	6185 HK	香港交易所	中国香港	9,600	1,874,817.33	8.66
3	China International Capital Corporation Limited	中国国际金融股份有限公司	3908 HK	香港交易所	中国香港	106,800	1,484,793.07	6.86
4	Hope Education Group Co.,Ltd.	希望教育集团有限公司	1765 HK	香港交易所	中国香港	528,000	1,278,085.25	5.90
5	Shanghai Junshi Biosciences Co.,Ltd.	上海君实生物医药科技股份有限公司	1877 HK	香港交易所	中国香港	25,000	1,275,390.60	5.89
6	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港交易所	中国香港	10,500	1,189,298.88	5.49
7	Q Technology (Group) Company Limited	丘钛科技(集团)有限公司	1478 HK	香港交易所	中国香港	111,000	1,024,057.58	4.73
8	China Yuhua Education Corporation Limited	中国宇华教育集团有限公司	6169 HK	香港交易所	中国香港	172,000	999,230.28	4.61
9	Anton Oilfield Services Group	安东油田服务集团	3337 HK	香港交易所	中国香港	1,690,000	710,108.26	3.28
10	China New	中国新高教集团有	2001 HK	香港交易所	中国香港	143,000	668,784.23	3.09

	Higher Education Group Limited	限公司						
11	Wuxi Biologics (Cayman) Inc.	药明生物技术有限公司	2269 HK	香港交易所	中国香港	5,000	647,628.96	2.99
12	Edvantage Group Holdings Limited	中汇集团控股有限公司	382 HK	香港交易所	中国香港	116,000	644,230.96	2.98
13	Innovent Biologics, Inc.	信达生物制药	1801 HK	香港交易所	中国香港	9,500	498,966.60	2.30
14	WuXi AppTec Co., Ltd.	无锡药明康德新药开发股份有限公司	2359 HK	香港交易所	中国香港	5,180	476,474.05	2.20
15	Sino Biopharmaceutical Ltd.	中国生物制药有限公司	1177 HK	香港交易所	中国香港	33,000	440,095.39	2.03
16	Pharmaron Beijing Co., Ltd.	康龙化成(北京)新药技术股份有限公司	3759 HK	香港交易所	中国香港	5,700	416,528.64	1.92
17	China Oilfield Services Limited	中海油田服务股份有限公司	2883 HK	香港交易所	中国香港	64,000	406,882.71	1.88
18	BeiGene, Ltd.	百济神州有限公司	6160 HK	香港交易所	中国香港	3,700	383,599.13	1.77
19	Genscript Biotech Corporation	金斯瑞生物科技股份有限公司	1548 HK	香港交易所	中国香港	22,000	320,325.14	1.48
20	China Kepei Education Group Limited	中国科培教育集团有限公司	1890 HK	香港交易所	中国香港	54,000	307,792.74	1.42
21	SPT Energy Group	华油能源集团有限公司	1251 HK	香港交易所	中国香港	1,048,000	306,331.24	1.41

	Inc.							
22	Honghua Group Limited	宏华集团有限公司	196 HK	香港交易所	中国香港	1,286,000	284,273.49	1.31
23	Huali University Group Limited	华立大学集团有限公司	1756 HK	香港交易所	中国香港	83,000	278,242.96	1.28
24	Akeso,Inc.	康方生物科技(开曼)有限公司	9926 HK	香港交易所	中国香港	8,000	271,108.99	1.25
25	Hainan Meilan International Airport Company Limited	海南美兰国际空港股份有限公司	357 HK	香港交易所	中国香港	21,000	208,319.13	0.96
26	Poly Property Services Co., Ltd.	保利物业服务股份有限公司	6049 HK	香港交易所	中国香港	2,200	156,746.30	0.72
27	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业集团有限公司	2669 HK	香港交易所	中国香港	20,000	149,804.16	0.69
28	Peijia Medical Limited	沛嘉医疗有限公司	9996 HK	香港交易所	中国香港	4,000	128,246.98	0.59
29	Fosun Tourism Group	复星旅游文化集团	1992 HK	香港交易所	中国香港	18,000	109,996.44	0.51
30	Ever Sunshine Lifestyle Services Group Limited	永升生活服务集团有限公司	1995 HK	香港交易所	中国香港	8,000	87,544.09	0.40
31	Legend Biotech Corporation	-	LEGN US	美国纳斯达克交易所	美国	29	8,737.80	0.04

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	1,842,579.24	7.46
2	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	1,595,279.18	6.46
3	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	3908 HK	1,404,197.73	5.69
4	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 HK	1,134,475.32	4.59
5	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	1877 HK	1,081,120.89	4.38
6	LI NING CO LTD	2331 HK	1,051,624.16	4.26
7	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1478 HK	1,050,300.30	4.25
8	POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	6049 HK	1,026,368.75	4.16
9	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	964,343.19	3.90
10	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1818 HK	823,182.33	3.33
11	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	622,769.20	2.52
12	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	602,566.13	2.44
13	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	573,767.37	2.32
14	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	539,468.02	2.18
15	CHINA TOWER CORP LTD-H	788 HK	517,533.95	2.10
16	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	3759 HK	505,252.87	2.05
17	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	2001 HK	496,531.57	2.01
18	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	2869 HK	447,297.57	1.81
19	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	443,677.21	1.80
20	HAINAN MEILAN	357 HK	408,024.84	1.65

	INTERNATIONA-H			

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

7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	2,590,848.09	10.49
2	ZTE CORP-H	763 HK	2,117,581.04	8.57
3	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	1,592,037.44	6.45
4	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	1765 HK	1,276,789.47	5.17
5	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	1,221,677.57	4.95
6	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 HK	1,076,388.29	4.36
7	LI NING CO LTD	2331 HK	1,069,052.41	4.33
8	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	1,063,449.44	4.31
9	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	1,050,883.62	4.26
10	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	938,286.10	3.80
11	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	905,983.03	3.67
12	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	892,590.40	3.61
13	POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	6049 HK	874,330.44	3.54
14	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1818 HK	831,502.12	3.37
15	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	749,364.28	3.03
16	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1478 HK	743,965.83	3.01
17	ANTON OILFIELD SERVICES GP	3337 HK	711,799.36	2.88
18	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	624,780.24	2.53
19	CHINA XINHUA EDUCATION GROUP	2779 HK	596,826.82	2.42
20	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	6169 HK	561,434.50	2.27
21	CHINA TOWER CORP LTD-H	788 HK	521,763.30	2.11

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

7.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	23,769,518.22
卖出收入（成交）总额	30,899,553.55

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内本基金投资的中金公司（3908）因公司管理 11 只私募资管计划,投资于同一资产的资金均超过该资产管理计划资产净值的 25%，违反了《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等相关规定，于 2020 年 4 月 21 日被中国证监会北京监管局采取出具警示函的行政监督管理措施。

对该证券的投资决策程序的说明：公司注重自营投资业务风险控制，继续推进固收业务，提升综合服务客户能力，稳步推进 IT 系统建设；投行业务继续保持领先优势，排名中资企业全球股本融资承销规模第一位。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。

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

7.10.3 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	-
2	应收证券清算款	841,815.26
3	应收股利	21,059.25
4	应收利息	115.95
5	应收申购款	389,103.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,252,093.80

7.10.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,080	3,530.63	0.00	0.00%	14,404,979.57	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,309.42	0.0716%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 1 月 27 日）基金份额总额	821,766,293.97
本报告期期初基金份额总额	19,521,362.73
本报告期基金总申购份额	9,321,333.79
减：本报告期基金总赎回份额	14,437,716.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,404,979.57

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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、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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
BOCOM International Securities Limited	-	508,635.83	2.14%	762.96	3.61%	-
CCB International	-	1,143,360.13	4.81%	1,715.04	8.12%	-

Securities Limited						
China International Capital Corp.HK	-	504,151.29	2.12%	630.18	2.98%	-
China Industrail Securities	-	356,465.06	1.50%	427.76	2.02%	-
CITIC Securities International Company Limited	-	464,129.60	1.95%	556.96	2.64%	-
China Merchants Sec (HK) Co Ltd	-	396,757.54	1.67%	396.75	1.88%	-
Daiwa Capital Markets HK Ltd	-	6,067,827.71	25.53%	3,033.92	14.36%	-
Haitong International Securities Group Limited	-	7,019,002.98	29.53%	7,019.01	33.22%	-
ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	1,080,276.92	4.55%	1,080.28	5.11%	-
Mizuho Securities Asia Limited	-	1,596,886.42	6.72%	798.45	3.78%	-
UBS Securities Asia Limited	-	3,589,789.99	15.10%	3,589.83	16.99%	-
UOB Kay Hian (HongKong) Limited	-	1,042,234.75	4.38%	1,116.66	5.29%	-
GOLDMAN SACHS (ASIA)	-	-	-	-	-	-

SECURITIES LIMITED						
MasterLink Securities Corp.	-	-	-	-	-	-
SINOLINK SECURITIES(HK)	-	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIES (HONG KONG)COMPANY LIMITED	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金未新增交易单元。

2、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打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

3、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，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
BOCOM International Secur	-	-	-	-	-	-	-	-

ities Limited								
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corp. HK	-	-	-	-	-	-	-	-
China Industrail Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Sec (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

Daiwa Capital Markets HK Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UOB Kay Hian	-	-	-	-	-	-	-	-

(HongKong) Limited								
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
MasterLink Securities Corp.	-	-	-	-	-	-	-	-
SINOLINK SECURITIES(HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIES (HONG KONG)COMPANY LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-02
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金 2020 年因境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的提示	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-02
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-07
4	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
5	海富通基金管理有限公司调整旗下基金 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放日期、基金分红等相关事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-31
6	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-26
7	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台通联支付渠道新增部分银行卡并开展申购费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-02
8	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-04
9	海富通基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-27
10	海富通基金管理有限公司关于海富通大中华精选混合型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-30
11	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-31
12	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-07
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京植信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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-08
14	海富通基金管理有限公司关于暂停泰诚财富	证券时报、基金管理人网	2020-04-24

	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	站及中国证监会基金电子披露网站	
15	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-27
16	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
17	海富通大中华精选混合型证券投资基金调整大额申购业务金额限额的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
18	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
19	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
20	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
21	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-02
22	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-06
23	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-17
24	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
25	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-29
26	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 83 只公募基金。截至 2020 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1338 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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准设立海富通大中华精选混合型证券投资基金的文件

（二）海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同

（三）海富通大中华精选混合型证券投资基金招募说明书

（四）海富通大中华精选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）报告期内海富通大中华精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二〇年八月三十一日