海富通领先成长混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通领先成长混合
基金主代码	519025
交易代码	519025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月30日
报告期末基金份额总额	84,897,559.78份
投资目标	从具有领先发展的行业中,精选出具有高度成长性的股票,在控制风险并保持资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金运用已经得到市场检验和认可的国际先进投资理念,通过上市公司基本面的分析和研究,坚持寻找价值"洼地"和长线投资,来获得超额收益。在投资组合构建和管理的过程中,本基金采取"自上而下"与"自下而上"相结合的方法,在具有领先发展的行业中,精选出具有高度成长性的股票。
业绩比较基准	MSCI China A指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高风险水平的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,530,454.01
2.本期利润	-6,692,839.54
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0786
4.期末基金资产净值	90,993,857.60
5.期末基金份额净值	1.072

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

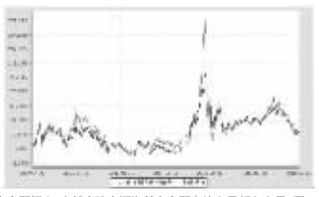
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.78%	1.56%	-3.28%	1.09%	-3.50%	0.47%

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

海富通领先成长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

(2009年4月30日至2018年9月30日)



注:按照基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2009年4月30日至2009年10月29日。建仓期结束时本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(二)、(七)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§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		
李志	本基金的基金经理	2017-05-15	-	8年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任上海申银万国证券研究所有限公司助理分析师,汇丰晋信基金管理有限公司研究员,2015年12月加入海富通基金管理有限公司,历任股票相对收益组合部分析师、基金经理助理。2017年5月起任海富通领先成长混合基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准为: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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》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。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、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。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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

2018年三季度,受到宏观经济下行预期和中美贸易摩擦内外双重因素的影响,A股市场总体表现较弱,且内部结构分化明显。两个市场表现为沪强深弱,其中上证50指数当期涨幅超过5%,领先两市各主要指数;受到油价上涨、鸡价上涨、基建加码预期的影响,与宏观实体经济表现更紧密的石油石化、农业、建筑、银行等表现良好,而与居民支出相关的家电、医药、纺织服装等消费板块以及计算机、电子等成长性行业调整比较显著。

具体来说,全市场主要指数当中,上证50收于2606.67点,涨幅5.11%;上证综指收于2821.35点,跌幅-0.92%;沪深300收于3438.86点,跌幅-2.05%;深成指收于8401.09点,跌幅-10.43%;创业板指收于1411.34点,跌幅-12.16%;中小板指收于5750.77点,跌幅-11.22%;中证800收于3662.11点,跌幅-3.54%;万得全A收于3674.76点,跌幅-4.81%。

行业方面,三季度在中信证券29个一级行业分类中,银行、石油石化和非银分别上涨12.41%、11.60%和5.46%,分别前三位。下跌前三位的行业则包括家电、纺织服装和电子,分别下跌17.34%、15.34%和14.91%。

三季度,本基金严格按既定的框架与策略执行,整体仓位保持较低水平,结构上未作明显变动,仍保持了大消费与金融类资产的核心持仓,以及地产类的重点配置。具体操作上,坚守主线、严控节奏,7月初进一步降低大消费配置比例,特别是白酒类资产的配置比例,相应增加银行与地产类资产的配置比例;9月份则略微降仓银行类资产,增加大消费类个股的配置比例。

展望2018年四季度,市场的担忧难以大幅缓解,大的股市投资环境不确定性仍然较大。短期视角下,经济下行压力的担忧难消,利率与汇率的平衡难度大;中期视角下,国内金融去杠杆的进程或有反复,中美关系走势与影响仍难明确判断;长期视角下,市场对改革与转型的信心亟待提升。复杂的投资大环境下,减少预测加强应对、控制好投资行为,是长期保持生命力之道。

但企业视角来看,真正优质的企业在困难中往往把握机会,进一步强化自身的市场地位。

四季度,本基金仍将延续既定策略,加强风险控制,强调业绩持续性与确定性的资产选择原则,强调长期估值合理性的评估,自下而上选择核心资产。相比三季度,四季度本基金将从优质企业角度,进一步突出个股性的中长期投资机会,降低短期策略性行为。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为-6.78%,同期业绩比较基准收益率为-3.28%,基金净值跑赢业绩比较基准3.5个百分点。跑输比较基准的主要原因是重仓的科技板块在三季度先扬后抑,在9月份有较大幅度调整。

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	79,327,239.74	86.65
	其中:股票	79,327,239.74	86.65
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	12,160,669.25	13.28
7	其他资产	62,941.62	0.07
8	合计	91,550,850.61	100.00

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	-	-
B	采矿业	6,444,008.00	7.08
C	制造业	44,913,391.63	49.36
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	807,401.34	0.89
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	11,998,550.19	13.19
J	金融业	6,643,361.79	7.30
K	房地产业	8,520,526.79	9.36
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	-	-
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	79,327,239.74	87.18

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	601398	工商银行	752,113	4,339,692.01	4.77
2	603986	兆易创新	44,010	3,905,007.30	4.29
3	300037	新宙邦	163,800	3,870,594.00	4.25
4	300316	晶盛机电	342,470	3,849,362.80	4.23
5	600438	通威股份	497,405	3,317,691.35	3.65
6	600048	保利地产	269,479	3,279,559.43	3.60
7	600583	海油工程	466,200	3,151,512.00	3.46
8	001979	招商蛇口	156,394	2,923,003.96	3.21
9	603690	至纯科技	135,347	2,878,830.69	3.16
10	002371	北方华创	61,100	2,875,366.00	3.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

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	57,048.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,623.47
5	应收申购款	3,269.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,941.62

5.11.4 报告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。

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

本报告期期初基金份额总额	85,374,456.57
本报告期基金总申购份额	865,521.77
减:本报告期基金总赎回份额	1,332,418.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	84,897,559.78

§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

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。

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61只公募基金。截至2018年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过733.55亿元人民币。

2004年末开始,海富通及子公司为QFII(合格境外机构投资者)及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问,截至2018年9月30日,海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过28亿元人民币。

作为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,截至2018年9月30日,海富通为近80家企业超过407亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2018年9月30日,海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过411亿元。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2月,海富通资产管理(香港)有限公司已募集发行了首只RQFII产品。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。

2016年3月,国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通基金管理有限公司"固定收益投资金牛基金公司"。2018年3月,国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三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。

§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领先成长混合型证券投资基金的文件

(二)海富通领先成长混合型证券投资基金基金合同

(三)海富通领先成长混合型证券投资基金招募说明书

(四)海富通领先成长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)报告期内海富通领先成长混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

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

二〇一八年十月二十六日

海富通内需热点混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十六日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通内需热点混合
基金主代码	519056
交易代码	519056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月19日
报告期末基金份额总额	36,635,265.72份
投资目标	本基金将从受益于国家扩大内需促进经济发展政策的热点行业中,精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极投资,同时利用灵活的资产配置,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等,对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控,在投资范围内确定相应大类资产配置比例;其次通过对受益于内需增长的热点行业及个股进行定量与定性相结合的分析,精选具有良好基本面和成长潜力的上市公司进行投资。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高风险水平的投资品种。
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

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,770,294.89
2.本期利润	-137,073.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0038
4.期末基金资产净值	44,435,154.90
5.期末基金份额净值	1.213

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

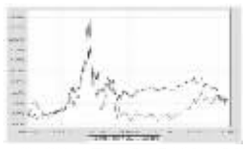
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.16%	1.20%	-3.28%	1.09%	3.12%	0.11%

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

海富通内需热点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

(2013年12月19日至2018年9月30日)



注: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		
黄峰	本基金的基金经理	2014-12-17	-	8年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任大公国际资信评估公司信用分析部分析师、深圳九富投资顾问有限公司项目部员工、大连獐子岛渔业集团股份有限公司证券部负责人、证券事务代表、华创证券有限责任公司研究所高级研究员,2011年5月加入海富通基金管理有限公司,历任股票分析师、基金经理助理。2014年12月至2017年6月任海富通股票混合、海富通中小盘混合和海富通领先成长混合的基金经理。2014年12月起担任海富通内需热点混合的基金经理。

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为: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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》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。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、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。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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

2018年三季度,受到宏观经济下行预期和中美贸易摩擦内外双重因素的影响,A股市场总体表现较弱,且内部结构分化明显。两个市场表现为沪强深弱,其中上证50指数当期涨幅超过5%,领先两市各主要指数;受到油价上涨、鸡价上涨、基建加码预期的影响,与宏观实体经济表现更紧密的石油石化、农业、建筑、银行等表现良好,而与居民支出相关的家电、医药、纺织服装等消费板块以及计算机、电子等成长性行业调整比较显著。

具体来说,全市场主要指数当中,上证50收于2606.67点,涨幅5.11%;上证综指收于2821.35点,跌幅-0.92%;沪深300收于3438.86点,跌幅-2.05%;深成指收于8401.09点,跌幅-10.43%;创业板指收于1411.34点,跌幅-12.16%;中小板指收于5750.77点,跌幅-11.22%;中证800收于3662.11点,跌幅-3.54%;万得全A收于3674.76点,跌幅-4.81%。

行业方面,三季度在中信证券29个一级行业分类中,银行、石油石化和非银分别上涨12.41%、11.60%和5.46%,分别前三位。下跌前三位的行业则包括家电、纺织服装和电子,分别下跌17.34%、15.34%和14.91%。

三季度,本基金严格按既定的框架与策略执行,整体仓位保持较低水平,结构上未作明显变动,仍保持了大消费与金融类资产的核心持仓,以及地产类的重点配置。具体操作上,坚守主线、严控节奏,7月初进一步降低大消费配置比例,特别是白酒类资产的配置比例,相应增加银行与地产类资产的配置比例;9月份则略微降仓银行类资产,增加大消费类个股的配置比例。

展望2018年四季度,市场的担忧难以大幅缓解,大的股市投资环境不确定性仍然较大。短期视角下,经济下行压力的担忧难消,利率与汇率的平衡难度大;中期视角下,国内金融去杠杆的进程或有反复,中美关系走势与影响仍难明确判断;长期视角下,市场对改革与转型的信心亟待提升。复杂的投资大环境下,减少预测加强应对、控制好投资行为,是长期保持生命力之道。

但企业视角来看,真正优质的企业在困难中往往把握机会,进一步强化自身的市场地位。

四季度,本基金仍将延续既定策略,加强风险控制,强调业绩持续性与确定性的资产选择原则,强调长期估值合理性的评估,自下而上选择核心资产。相比三季度,四季度本基金将从优质企业角度,进一步突出个股性的中长期投资机会,降低短期策略性行为。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为-0.16%,同期业绩比较基准收益率为-3.28%,基金净值跑赢业绩比较基准3.12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

本基金自2018年6月19日至2018年9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	29,987,396.74	67.03
	其中:股票	29,987,396.74	67.03
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	14,664,549.03	32.78
7	其他资产	85,432.75	0.19
8	合计	44,737,378.52	100.00

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,469,623.64	28.06
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	775,956.24	1.75
J	金融业	9,728,904.13	21.89
K	房地产业	7,012,912.73	15.78
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	-	-
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	29,987,396.74	67.49

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	5,821	4,254,440.00	9.57
2	000002	万科A	163,225	3,966,367.50	8.93
3	601398	工商银行	679,166	3,918,787.82	8.82
4	000568	泸州老窖	80,125	3,806,738.75	8.57
5	000651	格力电器	80,823	3,249,084.60	7.31
6	601939	建设银行	429,421	3,109,058.72	7.00
7	600036	招商银行	88,011	2,701,057.59	6.08
8	600048	保利地产	216,652	2,636,654.84	5.93
9	300577	开润股份	27,288	900,504.00	2.03
10	002544	杰赛科技	65,097	775,956.24	1.75

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基本金合同,本基金不参与股指期货交易。

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

根据基本金合同,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

根据基本金合同,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	164,639.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,462,891.16
5	应收申购款	1,988.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,629,518.39

5.11.4 报告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。

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

本报告期期初基金份额总额	39,014,394.01
本报告期基金总申购份额	2,938,411.45
减:本报告期基金总赎回份额	5,317,539.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	36,635,265.72

§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

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。

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61只公募基金。截至2018年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过733.55亿元人民币。

2004年末开始,海富通及子公司为QFII(合格境外机构投资者)及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问,截至2018年9月30日,投资咨询及海外业务规模超过28亿元人民币。

作为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,截至2018年9月30日,海富通为近80家企业超过407亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2018年9月30日,海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过411亿元。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2月,海富通资产管理(香港)有限公司已募集发行了首只RQFII产品。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。

2016年3月,国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通基金管理有限公司"固定收益投资金牛基金公司"。2018年3月,国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三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。

§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内需热点混合型证券投资基金的文件

(二)海富通内需热点混合型证券投资基金基金合同

(三)海富通内需热点混合型证券投资基金招募说明书

(四)海富通内需热点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)报告期内海富通内需热点混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

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

二〇一八年十月二十六日

海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金
基金主代码	519130
交易代码	519130
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2014年11月27日
报告期末基金份额总额	47,214,899.85份
投资目标	本基金将从受益于国家扩大内需促进经济发展政策的热点行业中,精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极