

信息披露

海富通精选贰号混合型基金证券投资

2018年年度报告摘要

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
报告公告日期:二〇一九年三月三十一日

1.1 重要提示

本基金的董事会、董事对所披露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法律责任。基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,于2019年3月28日复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配事项、财务会计报告相关内容,保证报告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,也不保证最低收益。基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证,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。本年度报告摘要摘自年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。本报告自2018年1月1日起至12月31日止。

的关联交易在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和风险控制等环节,对关联交易严格执行按照法律、法规和公司制度进行关联交易,履行必要审批程序并执行披露。

报告期内,对公司旗下所有投资组合的整体收益差异、分投资组合的收益差异进行了分析,并采集了连续四个季度期间内,不同时间窗口(如下月、3日内、5日内)的业绩表现不同投资组合的样本,对存在7.9%置信区间,假设置信率为0.7%分布检验,结合该期间内组合之间相关的模拟收益数据、涨跌幅、交易占比等指标检验判断是否存在不公平交易或利益输送的情况,结果表明,报告期内公司旗下各投资组合未进行不公平交易或利益输送的行为。

4.3.2 关联交易专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人报告期内基金的业绩表现和业绩比较基准的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年,A股市场大幅下挫,所有指数均有较大幅度下跌。2018年指数中表现最好的是上证50,全年下跌19.83%;而表现最弱的是中小板综指,全年下跌37.75%,上证综指、沪深300、中证800、创业板综指分别下跌24.59%、25.3%,27.38%、28.24%。

中美贸易战是2018年A股市场最重要的政策变量,另外,降杠杆的举措也在全年持续发酵,1月份之后市场持续下跌,部分公允价值计量金融资产减值风险,拖累整体业绩。

回顾全年的走势,年初以来,在地产、银行等权重股的带动下,沪指在短一个月内上冲至3687点,随后,受股债联动1月底至2月上旬上证综指暴跌12%。后续随着中美贸易战开始和持续发酵,市场开始调整,下跌至年底,全年没有10%以上的反弹。此外,在公允价值计量金融资产减值风险、监管趋严等压力下,市场开始以CDR发行预期,成长股大幅回调。而1月份,消费数据表现较好,部分消费股进一步报涨回调,叠加避险情绪,消费价值股迎来一波反弹。二季度受宏观经济下行、银行等权重表现良好,而与居民支出相关的医药、纺织服装等消费板块以及计算机、电子等行业业绩继续比较疲弱,四季度经济数据超预期,国内春节期间美元兑人民币贬值,在一定程度上修复之后再次下跌,最终上证综指收于2933.90点,深证成指收于7220.70点,中小板综指和创业板综指分别收于4703.03点和1260.53点。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

回顾报告期内,本基金取得了较好的收益,重点配置了业绩持续性有确定性优势的金融地产类股票,同时增持了具有消费属性且过去两年连续跑赢大盘的医药等行业。随后在高位适度减持了部分短期涨幅过快的板块,并在二季度减持了金融地产类股票,增持了医药、电子、家电等行业。整体仓位,下半年在政策趋紧以及监管力度加大和科技股难以可控性提升的预期,增加了金融、建筑建材、有色金属、计算机等行业配置,整体仓位因此有所上升。同时,预期经济下行可能对消费产生不利影响,整体减持了消费行业的配置。年底基于对明年一季左右经济数据超预期,增持了医药、电子等行业配置,降低了与消费相关的行业配置,调低了整体仓位,同时增加周期股的配置。

4.4.3 报告期内基金的投资组合

4.4.3.1 报告期内基金资产组合情况

截至2018年12月31日,本基金资产组合如下表所示:

项目	本期	上期
	2018年12月31日	2017年12月31日
一、报告期内基金资产组合		
(基本净值)	547,464,143.27	-28,159,034.17
二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-9,066,321.73	-9,066,321.73
三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-48,110,399.76	-2,831,822.04
四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	4,666,526.67	-309,108.72
五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-52,167,926.43	3,228,936.96
六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	499,362,743.51	-118,985,538.86
八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
一百、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-

4.4.3.2 报告期内基金行业配置情况

截至2018年12月31日,本基金资产组合如下表所示:

项目	本期	上期
	2018年12月31日	2017年12月31日
一、报告期内基金资产组合		
(基本净值)	547,464,143.27	-28,159,034.17
二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-9,066,321.73	-9,066,321.73
三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-48,110,399.76	-2,831,822.04
四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	4,666,526.67	-309,108.72
五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-52,167,926.43	3,228,936.96
六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	499,362,743.51	-118,985,538.86
八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
二十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
三十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
四十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
五十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
六十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
七十九、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十一、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十二、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十三、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十四、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十五、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十六、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十七、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-
八十八、报告期内基金资产组合		
(公允价值)	-	-