海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

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:二〇一九年四月二十日

§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2019年4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通创业板综指
基金主代码	005287
交易代码	005287
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2018年4月8日
报告期末基金份额总额	25,124,898.62份
投资目标	本基金为增强型股票指数基金,通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票,力争将本基金净值增长率与业绩基准跟踪目标偏离度控制在0%以内,年化跟踪误差控制在7.9%以内,同时力求使基金的业绩超越创业板综合指数表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分将采用抽样复制和的指数投资方法,利用成熟的量化技术模型实现对创业板综合指数的紧密跟踪。本基金对主动投资部分采取积极配置策略,力争在跟踪误差控制范围内,优基金的业绩超越创业板综合指数表现。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较高预期收益和较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	中国工商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	海富通创业板综指A / 海富通创业板综指C
下属两级基金的交易代码	005288 / 005287
报告期末下属两级基金的份额总额	18,239,661.85份 / 6,885,236.77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(2019年1月1日-2019年3月31日)	
	海富通创业板综指A	海富通创业板综指C
1.本期已实现收益	799,269.25	266,005.29
2.本期利润	4,433,787.96	1,606,475.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.2296	0.2235
4.期末基金资产净值	18,447,755.72	6,938,100.85
5.期末基金份额净值	1.0114	1.0077

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.海富通创业板增强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	29.20%	1.66%	31.75%	1.84%	-2.55%	-0.18%

2.海富通创业板增强C:

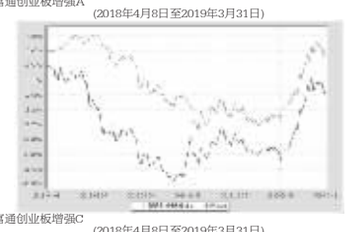
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	29.04%	1.66%	31.75%	1.84%	-2.71%	-0.18%

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的比较

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金
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

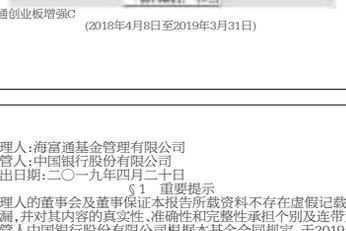
1. 海富通创业板增强A

(2018年4月8日至2019年3月31日)



2. 海富通创业板增强C

(2018年4月8日至2019年3月31日)



注:1.本基金合同于2018年4月8日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.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;海富通聚焦优选股票基金的基金经理;海富通稳健优益债券基金的基金经理;海富通安享混合基金经理;海富通新兴动力混合基金经理;海富通改革红利混合基金经理;海富通稳健回收益债券基金经理;海富通稳健增益债券基金的基金经理;海富通量化多因子混合基金经理;量化投资部总监	2018-04-09	-	18年	硕士,持有基金从业资格证书,历任Man-Drapeur Research金融工程师、American Beauxes Corporation中国区总经理、海富通基金管理有限公司量化分析师、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司量化投资部总监。2016年4月起任海富通新兴动力混合和海富通安享混合(原海富通华夏股息混合)基金经理。2016年9月起兼任海富通改革红利混合基金经理。2017年5月起兼任海富通聚焦优选股票基金经理。2017年4月起兼任海富通稳健回收益债券基金经理。2018年3月起兼任海富通稳健增益债券基金的基金经理。2018年4月起兼任海富通量化多因子混合基金经理。2018年4月起兼任海富通稳健回收益债券基金、海富通稳健增益债券基金、海富通改革红利混合、海富通聚焦优选股票基金、海富通量化多因子混合的基金经理。

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
2019年一季度整体市场出现了大幅反弹。截至2019年3月29日,上证综指收于3090.76点,上涨23.93%,深证成指收于9906.86点,涨幅为36.84%。中小板指收于6379.98点,上涨35.66%,创业板上涨35.43%,报1693.55点。
具体来看,元旦假期之后市场风险偏好依旧较低,延续了去年底的阴跌态势。但从1月4日上证综指盘中触及近三年新低2440.91点之后,市场便开始温和反弹,一直延续到月底,1月份上证综指涨幅3.64%。板块上,家电、食品饮料、保险、银行等价值权重板块率先企稳反弹,涨幅居前。进入2月份之后,随着困扰2018年的几大利空因素的缓解:中美贸易摩擦的积极向好谈判、监管层对去杠杆告一段落等,同时叠加1月份社融数据大幅超预期(有春节因素)、部分传统经济领域的数据超预期,大家对宏观经济下滑的担忧被打消了很多,市场做多热情被点燃。2月份上证综指涨幅达到13.79%,单月涨幅居2015年牛市以来新高。板块上看,TMT等科技板块受市场热捧,申万电子、计算机、通信、传媒指数当月涨幅均超过25%。同时随着2月末市场总成交量放大到万亿、融资余额回到8000亿以上,市场风险偏好大幅上升。趋势延续到3月,当月上证综指上涨5.09%,表现依旧不错。同时随着行情持续演绎,一些景气度反转的板块备受青睐,例如猪鸡产业链、光伏、科创板块(半导体、边缘计算等)、传统工程机械板块、消费品(高端白酒)等,也走出了很强的独立行情。

行业方面,在申万28个一级行业分类中,一季度板块几乎都有不错表现。其中计算机(48.46%)、农林牧渔(48.42%)、食品饮料(43.58%)、非银(42.65%)、电子(41.06%)涨幅排名前五,且涨幅都超过了40%;而银行(16.85%)、公用事业(17.80%)、建筑装饰(18.3%)涨幅相对靠后。
本报告期,基金积极投资股票市场,力争在风险可控的基础上,跑赢市场。
下一季度,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。
4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内,海富通创业板增强A净值增长率为29.2%,同期业绩比较基准收益率为31.75%,基金净值跑输业绩比较基准2.55个百分点。海富通创业板增强C净值增长率为29.04%,同期业绩比较基准收益率为31.75%,基金净值跑输业绩比较基准2.71个百分点。本季度股票市场波动较大,主流指数大幅度上涨,一些偏博弈的板块涨幅巨大,导致基金跑输基准。
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	23,900,481.28	92.21
	其中:股票	23,900,481.28	92.21
2	固定收益投资	1,166,116.60	4.50
	其中:债券	1,166,116.60	4.50
	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	778,404.11	3.00
7	其他资产	74,864.81	0.29
8	合计	25,919,866.80	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	898,055.00	3.54
B	采矿业	278,896.00	1.10
C	制造业	16,326,117.28	64.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,076.00	0.38
E	建筑业	197,269.00	0.78
F	批发和零售业	192,717.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	205,228.00	0.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,308,953.00	13.03
J	金融业	40,338.00	0.16
K	房地产业	163,416.00	0.64
L	租赁和商务服务业	29,512.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	134,800.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	118,523.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	735,040.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	1,176,541.00	4.63
S	综合	-	-
	合计	23,900,481.28	94.15

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投资股票。
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	300498	温氏股份	21,200	860,720.00	3.39
2	300258	精锻科技	63,500	834,390.00	3.29
3	300144	宋城演艺	34,500	800,400.00	3.15
4	300450	先导智能	19,475	724,275.25	2.85
5	300203	聚光科技	25,600	704,000.00	2.77
6	300233	金城医药	37,700	700,089.00	2.76
7	300271	华宇软件	32,800	697,656.00	2.75
8	300146	汤臣倍健	30,100	687,785.00	2.71
9	300059	东方财富	34,400	666,672.00	2.63
10	300723	一品红	16,800	631,680.00	2.49

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	1,166,116.60	4.59
	其中:政策性金融债	1,166,116.60	4.59
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,166,116.60	4.59

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	018005	国开1701	11,660	1,166,116.60	4.59

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	-
2	应收证券清算款	9,418.98
3	应收股利	-
4	应收利息	43,700.54
5	应收申购款	21,745.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,864.81

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不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	海富通创业板综指A	海富通创业板综指C
报告期期初基金份额总额	19,006,950.74	7,376,783.89
报告期基金总申购份额	3,173,314.54	2,571,896.87
减:本报告期基金总赎回份额	3,940,603.43	3,063,443.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,239,661.85	6,885,236.77

§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

单位:份

项目	海富通创业板综指A	海富通创业板综指C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,250.22	-
本报告期买入/申购总份额	-	-
本报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,002,250.22	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	54.84	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,250.22	39.81%	10,002,250.22	39.81%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,250.22	39.81%	10,002,250.22	39.81%	-

注:本基金募集期间,本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计1,000.10万元认购了本基金,其中,认购费用为1,000.00元,符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于3年。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2019/01/01-2019/03/31	10,002,250.22	-	-	10,002,250.22	39.81%

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30%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不得及时赎回持有的全部基金份额;
3.基金合同生效满三年后继续存续的,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个十工作日低于5000万元的风险,本基金可能会面临终止基金合同的情形。
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的50%或者接受某笔或者某几笔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,本基金管理人可能暂停有人对本基金基金份额做出的申购及转换转入申请。

9.2 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68只公募基金。截至2019年3月31日,海富通管理的公募基金资产规模约730亿元人民币。
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2019年3月31日,海外业务规模超过24亿元人民币。
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2019年3月31日,海富通为近80家企业超过428亿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2019年3月31日,海富通管理的特定客户资产管理业务规模约380亿元。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。
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。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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准设立海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金的文件
(二)海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同
(三)海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金招募说明书
(四)海富通创业板综指增强型发起式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)报告期内海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

10.2 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。

10.3 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
二〇一九年四月二十日

海富通精选贰号混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:二〇一九年四月二十日

§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2019年4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通精选贰号混合
基金主代码	519035
交易代码	519035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月9日
报告期末基金份额总额	488,763,102.71份
投资目标	本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行资产配置的投资策略、实施全程风险管理,在所证资产良好流动性的前提下,在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金的投资策略分两个层次:第一层次为适度主动的资产配置,以控制或规避市场系统性风险;第二层次为积极主动的精选证券,以分散或规避个券风险。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。
业绩比较基准	MSCI China A指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险较适中的品种。
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(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	27,445,881.87
2.本期利润	94,033,972.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.1897
4.期末基金资产净值	467,800,787.84
5.期末基金份额净值	0.957

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	24.61%	1.29%	19.55%	1.08%	5.06%	0.24%

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

海富通精选贰号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
(2007年4月9日至2019年3月31日)

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的各项投资比例已达到基金合同有关投资范围的规定,即股票投资50%-80%,债券投资20%-50%,权证投资0-3%;并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。同时满足第14章(七)有关投资组合限制的各项比例要求。

§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		
王智慧	本基金的基金经理;海富通精选混合基金经理;海富通股息精选混合基金经理;海富通风格优势混合基金经理;海富通新兴动力混合基金经理;海富通改革红利混合基金经理;海富通稳健回收益债券基金经理;海富通稳健增益债券基金的基金经理;海富通量化多因子混合基金经理;基金经理助理	2016-04-11	-	16年	管理学博士,持有基金从业资格证书,曾在华宝兴业基金管理有限公司、中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团股份有限公司、国元证券有限责任公司从事投资研究及管理工作。2012年1月至2015年11月任华宝兴业精选混合基金经理。2012年2月至2015年11月任华宝兴业行业混合基金经理。2013年2月至2015年11月任华宝兴业多策略股票基金经理。2015年11月加入海富通基金管理有限公司,任总经理助理。2016年4月起兼任海富通精选混合和海富通安享混合(原海富通华宝股息混合)基金经理。2016年9月起兼任海富通改革红利混合基金经理。2017年5月起兼任海富通聚焦优选股票基金经理。2017年4月起兼任海富通稳健回收益债券基金经理。2018年3月起兼任海富通稳健增益债券基金的基金经理。2018年4月起兼任海富通量化多因子混合基金经理。2016年11月起兼任海富通沪深混合基金经理。

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。
4.4 公平交易专项说明
4.4.1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。
4.4.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析
在美国及全球经济增长放缓的预期下,3月美联储议息会议释放了今年年内计算机(48.46%)、农林牧渔(48.42%)、食品饮料(43.58%)、非银(42.65%)、电子(41.06%)涨幅排名前五,且涨幅都超过了40%;而银行(16.85%)、公用事业(17.80%)、建筑装饰(18.3%)涨幅相对靠后。
一季度,本基金整体仓位相对于上季度末有显著提升,相对业绩基准实现了超额收益。基于景气度提升的逻辑,超配的猪禽产业链、半导体设备、通信、医药等板块贡献了显著的超额收益,同时低配的交运、公用事业、银行等低弹性行业也扩大了超额收益。遗憾的是,基于财政政策逆周期扩张托底经济的逻辑超配了建筑装饰行业未能创造超额收益,同时也错过了电子、食品饮料以及光伏等板块的超额收益机会。
4.5报告期内基金的业绩表现
报告期内本基金净值增长率为24.61%,同期业绩比较基准收益率为19.55%,基金净值跑赢业绩比较基准5.06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	352,660,451.65	75.08
	其中:股票	352,660,451.65	75.08
2	固定收益投资	94,814,452.20	20.18
	其中:债券	94,814,452.20	20.18
	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	20,729,567.70	4.41
7	其他资产	1,532,535.71	0.33
8	合计	469,737,007.26	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	6,020,980.00	1.29
B	采矿业	11,066,842.08	2.37
C	制造业	208,626,768.79	44.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	39,944,968.00	8.54
F	批发和零售业	11,566,403.04	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	5,248,378.00	1.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,136,063.90	4.09
J	金融业	15,843,854.52	3.39
K	房地产业	5,896,072.00	1.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,627,049.32	3.13
N	水利、环境和公共设施管理业	1,523,552.00	0.33
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	13,159,520.00	2.81
S	综合	-	-
	合计	352,660,451.65	75.39

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	000063	中兴通讯	655,186	18,234,357.20	3.90
2	002124	天邦股份	1,016,200	17,763,176.00	3.80
3	600276	恒瑞医药	199,356	13,041,869.52	2.79
4	601186	中国铁建	1,119,200	12,881,992.00	2.75
5	603939	益丰药房	199,352	11,566,403.04	2.47
6	300400	劲拓股份	509,600	11,236,680.00	2.40
7	600547	山东黄金	356,076	11,066,842.08	2.37
8	600519	贵州茅台	11,800	10,077,082.00	2.15
9	300284	苏交科	758,300	9,607,661.00	2.05
10	600068	葛洲坝	1,270,750	9,225,645.00	1.97

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	44,758,452.20	9.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,056,000.00	10.70
	其中:政策性金融债	50,056,000.00	10.70
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	94,814,452.20	20.27

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	010107	21国债(7)	433,790	44,758,452.20	9.57
2	180410	18农发10	300,000	30,024,000.00	6.42
3	180209	18国开09	100,000	10,027,000.00	2.14
4	180207	18国开07	100,000	10,005,000.00	2.14

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