海富通货币市场证券投资基金

2019年第二季度报告

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：二〇一九年七月十七日

§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7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通货币	
基金主代码	519505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年1月4日	
报告期末基金份额总额	13,494,053,529.57份	
投资目标	在力争本金安全和资产充分流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	根据宏观经济指标（主要包括：利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率），决定债券组合的剩余期限（长/中/短）和比例分布。根据各类资产的流动性特征（主要包括：平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量、分拆转换进程），决定组合中各类资产的投资比例。根据债券的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别。	
业绩比较基准	税后一年期银行定期存款利率	
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的证券投资基金品种。	
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	
下属两级基金的基金简称	海富通货币A	海富通货币B
下属两级基金的交易代码	519505	519506
报告期末下属两级基金的份额总额	241,496,333.49份	13,252,557,196.08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4月1日-2019年6月30日)	
	海富通货币A	海富通货币B
1. 本期已实现收益	1,426,009.28	121,913,623.19
2. 本期利润	1,426,009.28	121,913,623.19
3. 期末基金资产净值	241,496,333.49	13,252,557,196.08

注：（1）本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

（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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 海富通货币A：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5819%	0.0006%	0.3719%	0.0000%	0.2100%	0.0006%

2. 海富通货币B：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6420%	0.0006%	0.3719%	0.0000%	0.2701%	0.0006%

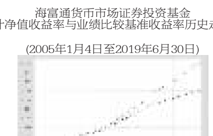
注：本基金于2019年5月16日发布公告，自2019年5月21日起，本基金的收益分配由按月结转份额改为按日结转份额。

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

海富通货币市场证券投资基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

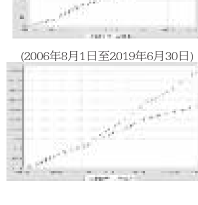
1. 海富通货币A

(2005年1月4日至2019年6月30日)



2. 海富通货币B

(2006年8月1日至2019年6月30日)



注：本基金合同于2005年1月4日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起3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十五条（二）投资范围、（六）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		
陈轶平	本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通上证城投债ETF基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通一年定开债券基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通瑞丰债券基金经理；海富通美元债（QDII）基金经理；海富通上证周期产业债ETF基金经理；海富通瑞利债券基金经理；海富通瑞合纯债基金经理；海富通睿祥混合基金经理；海富通瑞福债券基金经理；海富通瑞祥一年定开债券基金经理；海富通恒丰定开债券基金经理；海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理；海富通弘丰定开债券基金经理；海富通上清所短融债券基金经理；固定收益投资副总监。	2013-08-29	-	10年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资副总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF（现为海富通上证城投债ETF）基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月至2018年6月兼任海富通富源债券基金经理。2017年3月起兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月起兼任海富通睿祥混合基金经理。2017年7月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017年7月至2018年12月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018年10月起兼任海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理。2018年11月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019年1月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通季季通利理财债券基金经理。	2016-02-26	-	14年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005年4月至2014年6月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年7月至2015年10月任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015年1月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015年4月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016年2月起任海富通货币基金经理。2016年4月至2017年6月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016年4月起兼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9月起兼任海富通欣益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017年2月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017年3月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017年3月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年7月起兼任海富通季季通利理财债券基金经理。
何谦	本基金的基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通双福债券基金经理；海富通集利债券基金经理；海富通添益货币基金经理；海富通聚丰纯债债券基金经理；海富通稳健添利债券基金经理。	2016-05-06	-	8年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任平安银行资金交易员，华安基金管理有限公司债券交易员，2014年6月加入海富通基金管理有限公司，任海富通货币基金经理助理。2016年5月至2017年10月兼任海富通双利债券基金经理。2016年5月起任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）及海富通货币基金经理。2016年9月起兼任海富通集利债券基金经理。2017年8月起兼任海富通添益货币基金经理。2018年11月起兼任海富通聚丰纯债债券基金经理。2019年4月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。

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为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

二季度债券市场、货币市场呈现较大的波动性。4月公布的一季度GDP同比增长6.4%，较去年四季度持平，增强了市场对上半年经济企稳的预期；同时基数效应叠加猪周期的启动，3月CPI跳升0.8个百分点至2.3%，引发市场对通胀的担忧。在经济企稳和通胀中枢上行的预期下，4月央行亦进入政策观察期，资金面边际收紧，带来4月利率的明显上行。而5月以来，中美贸易摩擦又起波澜，同时国内经济数据再度走弱，其中1-5月固定资产投资、社会消费品零售总额同比增长5.6%和 8.1%，较去年同期下降0.5和1.4个百分点；5月份，包商银行被托管事件引起债市巨大震动，导致同业存单发行受阻，资金市场大幅波动，央行为此大幅投放跨季资金，平复了市场波动。隔夜资金利率一度跌破2%，5月以来利率呈震荡下行态势。整体看，二季度1年期国开债收益率上行17BP，10年期国开债收益率上行3BP，期限利差有所收窄。资金面方面，3个月SHIBOR下行9.2bp，但其间最高为上行14bp，270天AAA短融收益率上行5bp，但其间最高为上行31bp。包商银行事件对货币基金的运作带来冲击，低评级银行存单发行难以为续，二级市场收益大幅上升，部分机构投资者也大幅赎回货币应对流动性冲击。

鉴于今年以来货币市场资产收益率整体处于偏低水平，期限利差较低，本基金一直控制组合久期，降低存单投资比例，严控信用风险，从而避免了包商银行事件对低评级存单收益率的冲击，稳妥应对了5月底、6月底的流动性需求。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通货币A类基金净值收益率为0.5819%，同期业绩比较基准收益率为0.3719%；海富通货币B类基金净值收益率为0.6420%，同期业绩比较基准收益率为0.3719%。

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	固定收益投资	2,645,681,124.80	19.39
	其中：债券	2,645,681,124.80	19.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,689,812,274.71	19.71
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	8,179,050,962.15	59.93
4	其他资产	132,233,413.44	0.97
5	合计	13,646,777,775.10	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	1.22
	其中：买断式回购融资	-

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	100,006,830.00	0.74
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	52.53	0.74
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.15	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	10.81	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	7.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	15.26	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.15	0.74

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	359,931,637.84	2.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	710,221,464.25	5.26
	其中：政策性金融债	710,221,464.25	5.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	460,336,069.07	3.41
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,115,191,953.64	8.26
8	其他	-	-
9	合计	2,645,681,124.80	19.61
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	120412	12农发12	4,000,000	400,168,945.62	2.97
2	111916156	19上海银行CD156	3,000,000	299,543,468.38	2.22
3	160016	16附息国债16	2,400,000	240,012,414.22	1.78
4	111909175	19浦发银行CD175	2,000,000	198,811,812.90	1.47
5	180209	18国开09	1,300,000	130,031,384.10	0.96
6	160420	16农发20	1,300,000	130,030,295.05	0.96
7	071900022	19国信证券CP004	1,000,000	100,000,214.75	0.74
8	111818289	18华夏银行CD289	1,000,000	99,908,291.79	0.74
9	111910188	19兴业银行CD188	1,000,000	99,817,065.49	0.74
10	111808278	18中信银行CD278	1,000,000	99,683,947.98	0.74

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0135%
报告期内偏离度的最低值	0.0035%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0071%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

2007 年7 月1 日基金实施新会计准则后，本基金所持有的债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.9.2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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	122,005,601.44
4	应收申购款	10,227,812.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	132,233,413.44

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通货币A	海富通货币B
本报告期期初基金份额总额	245,520,934.85	16,055,557,625.01
本报告期基金总申购份额	152,291,906.01	21,363,880,949.69
减：本报告期基金总赎回份额	156,316,507.37	24,166,881,378.62
本报告期期末基金份额总额	241,496,333.49	13,252,557,196.08

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2019-04-15	-26,000,000.00	-26,056,172.57	-
2	赎回	2019-05-22	-13,000,000.00	-13,000,880.11	-
3	赎回	2019-05-23	-42,000,000.00	-42,002,842.68	-
4	赎回	2019-05-28	-880,000.00	-880,054.89	-
合计			-81,880,000.00	-81,939,950.25	

§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69只公募基金。截至2019年6月30日，海富通管理的公募基金资产规模约780亿元人民币。

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6月30日，海外业务规模约23亿元人民币。

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6月30日，海富通为近80家企业约438亿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6月30日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约388亿元。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。

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。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。

§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货币市场证券投资基金的文件
（二）海富通货币市场证券投资基金基金合同
（三）海富通货币市场证券投资基金招募说明书
（四）海富通货币市场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）报告期内海富通货币市场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
二〇一九年七月十七日

海富通精选贰号混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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：二〇一九年七月十七日

§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7月16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4月1日起至6月30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	519015
交易代码	519015
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	475,087,954.08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，在保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度适中的品种。
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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,166,434.81
2.本期利润	-10,121,960.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0211
4.期末基金资产净值	444,834,151.86
5.期末基金份额净值	0.936

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	-2.19%	1.43%	-1.19%	1.01%	-1.00%	0.42%

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6月30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；海富通沪港深混合基金经理；总经理助理	2016-04-11	-	16年	管理学博士。持有基金从业人员资格证书。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月任华宝大盘精选混合基金经理，2012年2月至2015年11月任华宝医药生物混合型基金经理，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精选贰号混合基金经理。2016年11月起兼任海富通沪港深混合基金经理。
黄峰	本基金的基金经理；海富通内需热点混合基金经理；海富通精选混合的基金经理。	2019-06-03	-	9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。2019年6月起兼任海富通精选贰号混合和海富通精选混合的基金经理。

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年二季度，整体市场普遍出现了回调，上证综指、深证成指、中小板指、创业板在单二季度分别下跌3.62%、7.35%、10.99%、10.75%。

具体来看，4月份上证综指下跌0.4%。一季度市场大幅上涨，而4月份宏观政策出现了小幅微调，因此市场出现了一定的调整压力。分板块看，由于一季报超预期以及外资持续流入，食品饮料、家电、银行等价值防御板块涨幅居前，同时，禽畜产业链也因为猪价企稳上涨而有不错的表现。

进入5月份，随着中美贸易谈判陷入僵局，国内宏观经济下行压力加大，市场出现较大回调，5月份上证综指下跌5.84%，深证成指下跌7.77%。分板块看，以黄金为代表的有色板块涨幅2.2%，其他板块悉数下跌，其中禽畜产业链、食品饮料等相对跌幅较少，而TMT板块、券商等高弹性板块跌幅居前。

6月份市场有所舒缓，虽然4、5月份的宏观经济数据没有改善，但在中美G20重启贸易谈判的预期推动下，风险偏好有所回升，市场逐步筑底向上，单6月上证综指上涨2.77%。板块上看，食品饮料、家电、休闲服务等泛消费类，以及非银、通信（5G产业链）为代表的弹性板块也涨幅居前，整体机会增多，市场较为活跃。

二季度，申万28个一级行业的内部分化非常明显。其中，食品饮料（12.14%）、家电（2.54%）、银行（1.26%）、非银（0.82%）、休闲服务（0.60%）涨幅排名前五，这五个行业也是二季度少数几个涨幅为正的板块，而传媒（-15.79%）、轻工制造（-14.71%）、钢铁（-13.17%）等行业跌幅居前。

二季度，本基金整体仓位相对于上季度末基本持平，相对业绩基准未能实现超额收益。4月份我们基于经济复苏超预期的判断而增持了汽车股，然而5月份公布的数据表明经济依然低迷，加上部分地区汽车排放标准升级，汽车销量持续下滑，汽车股因此大幅度调整。同时，1季度末2季度初基于房地产竣工面积逐步转好而增持的定制家具、厨电等板块也因为预期未能兑现而跑输市场。6月份，本基金操作思路进行了较大调整，将主要仓位转向了食品饮料、医药、白色家电等消费龙头，组合业绩显著改善。

展望三季度，市场整体环境或将反复，但波动不会太大；核心指标股的估值已明显修复，短期吸引力降低但长期仍有吸引力，部分资产的估值问题需要开始警惕。三季度，龙头企业的股价变化仍将是驱动市场的主要变量。

综上，三季度本基金将恪守能力圈、守住中长期视角下的优质企业类核心资产，同时重点对已配置的成长类资产加大跟踪与控制力度。相比上半年，在核心龙头资产的收益与风险权衡中，三季度需要加大回撤控制的跟踪与防范。

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-2.19%，同期业绩比较基准收益率为-1.19%，基金净值跑输业绩比较基准1.00个百分点。跑输原因主要是汽车与地产产业链类资产拖累，以及消费类资产配置比例略低所致。

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	343,492,972.44	76.95
	其中：股票	343,492,972.44	76.95
2	固定收益投资	89,762,364.80	20.11
	其中：债券	89,762,364.80	20.11
	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	9,978,097.67	2.24
7	其他资产	3,150,235.64	0.71
8	合计	446,383,670.55	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	247,832.60	0.06
C	制造业	343,188,163.30	77.15
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	-	-
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	343,492,972.44	77.22

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	000568	泸州老窖	514,600	41,595,118.00	9.35
2	000858	五粮液	343,400	40,504,030.00	9.11
3	600519	贵州茅台	40,600	39,950,400.00	8.98
4	000333	美的集团	605,500	31,401,230.00	7.06
5	300014	亿纬锂能	1,008,200	30,709,772.00	6.90
6	600779	水井坊	584,400	29,699,208.00	6.68
7	000596	古井贡酒	245,600	29,106,056.00	6.54
8	300630	普利制药	444,626	25,619,350.12	5.76
9	600521	华海药业	1,155,300	16,289,730.00	3.66
10	600176	中国巨石	1,541,480	14,690,304.40	3.30

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	49,738,364.80	11.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,024,000.00	9.00
	其中：政策性金融债	40,024,000.00	9.00
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	89,762,364.80	20.18

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)	483,460	49,738,364.80	11.18
2	180410	18农发10	300,000	30,021,000.00	6.75
3	180209	18国开09	100,000	10,003,000.00	2.25

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华海药业（600521）于2018年7月9日公告称，由于发现公司在提供给欧洲市场的部分缬沙坦制剂的原料药（API）中有一种亚硝基二甲胺（NDMA）的杂质，欧洲药品管理局（EMA）正在审查含有公司提供的缬沙坦原料药的制剂。在审查期间，欧盟相关国家的政府也正在召回含有公司提供的缬沙坦原料药的制剂。

对该证券的投资决策程序的说明：公司已形成中间体、原料药、制剂一体化的完整产业链。通过国际合作学习原研药厂技术，公司把握原研专利药到期机遇整合产业上下游业务，拥有稳定供应链及相应成本优势。欧美业务恢复的节奏明确后，股价具备修复空间。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	150,486.42
2	应收证券清算款	1,324,611.29
3	应收股利	-
4	应收利息	1,674,051.52
5	应收申购款	1,086.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,150,235.64

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

本基金期末前十名股票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	488,763,102.71
本报告期基金总申购份额	415,981.26
减：本报告期基金总赎回份额	14,091,129.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	475,087,954.08

§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69只公募基金。截至2019年6月30日，海富通管理的公募基金资产规模约780亿元人民币。

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6月30日，海外业务规模约23亿元人民币。

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6月30日，海富通为近80家企业约438亿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6月30日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约388亿元。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。

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。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。

§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精选贰号混合型证券投资基金的文件
（二）海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同
（三）海富通精选贰号混合型证券投资基金招募说明书
（四）海富通精选贰号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）报告期内海富通精选贰号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
二〇一九年七月十七日

海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）

2019年第二季度报告

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：二〇一九年七月十七日

§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7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通聚优精选混合FOF
基金主代码	005220
交易代码	005220
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年11月6日
报告期末基金份额总额	911,300,871.77份
投资目标	在合理控制投资组合风险的前提下，优选基金投资组合，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要投资于开放式股票型及混合型基金，构建本基金的核心组合，具体策略如下：首先，本基金在历届获得"中国基金业金牛奖"单只基金奖项的基金中筛选出所有开放式股票型基金和开放式混合型基金。然后，从收益能力、稳定性、风险水平和管理人角度对基金进行评分做二次筛选。最后，基金经理在金牛基金库中按照本基金的投资决策程序审核精选出一定数量的基金，并持续跟踪基金组合情况进行必要调整。另外，在管理人判断市场是否具有明显的趋势性投资机会的基础上，本基金可以适度投资其他类型基金，从而努力获取超额收益或降低组合风险。基于流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的固定收益类资产。在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%＋上证国债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为基金中基金，不同于股票型基金、混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的预期收益和风险水平低于股票型FOF，高于债券型FOF与货币型FOF，属于较高风险、较高收益的基金品种。
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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	45,120,204.05
2.本期利润	-7,626,570.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0081
4.期末基金资产净值	886,819,656.46
5.期末基金份额净值	0.9731

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	-0.96%	1.45%	-0.53%	1.07%	-0.43%	0.38%

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

海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）
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
(2017年11月6日至2019年6月30日)

注：本基金合同于2017年11月6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		
姜萍	本基金的基金经理；海富通稳健养老目标一年持有期混合FOF基金经理。	2017-11-15	-	16年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任交通银行哈尔滨分行信贷业务科长、兴安证券研究发展部研究员、机构业务部高级项目经理、证券投资部投资经理助理，中信建投证券资产管理部FOF投资顾问、研究发展部基金分析师。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，2017年11月起任海富通聚优精选混合FOF基金经理。2019年4月起兼任海富通稳健养老目标一年持有期混合FOF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

在一季度强劲反弹之后，受货币政策边际收紧及贸易冲突加剧影响，本季度市场宽幅震荡整理。股债资产估值均趋于历史中位，鉴于一致预期趋同性反复，市场风险偏好极不稳定，大类资产呈现"高波低趋"，相关性大幅提升。

我们总体判断是，忽略总量偏弱的数据，专注于结构性机会。政府重现对冲政策托底，而龙头公司业绩继续保持快于行业的稳健增长，行业集中度在持续提升，而估值合理甚至低估，优质股权资产仍具有吸引力。而债券市场则相反，短期加大震荡，能否回到去年牛市还需看经济前景变化。黄金，受避险情绪影响及美国降息预期抬升，下半年仍有反弹机会。

我们依然延续策略观点：保持仓位总体稳定，FOF结构仍以消费、蓝筹风格为主，持有以内需为主、业绩稳定、估值安全、有竞争优势的行业龙头的基金为投资产品，基本面业绩稳定，仅进行结构微调。

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-0.96%，同期业绩比较基准收益率为-0.53%，基金净值跑输业绩比较基准0.43个百分点。跑输的原因是短期受行业事件压抑的医药ETF，表现落后于大盘所致。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	785,096,100.96	87.18
3	固定收益投资	93,027,748.40	10.33
	其中：债券	93,027,748.40	10.33
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,695,948.37	2.41
8	其他各项资产	713,040.28	0.08
9	合计	900,532,838.01	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	34,904,054.40	3.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	58,123,694.00	6.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	93,027,748.40	10.49

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	019611	19国债01	349,320	34,904,054.40	3.94
2	110049	海尔转债	184,190	22,161,740.80	2.50
3	113011	光大转债	202,080	21,905,472.00	2.47
4	113013	国君转债	124,130	14,056,481.20	1.59

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	171,203.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	478,910.17
5	应收申购款	62,927.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	713,040.28

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	110049	海尔转债	22,161,740.80	2.50
2	113011	光大转债	21,905,472.00	2.47
3	113013	国君转债	14,056,481.20	1.59

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	110011	易方达中小盘	契约型开放式	30,976,841.59	153,899,144.39	17.35%	否
2	166005	中欧价值发现混合A	契约型开放式	99,294,801.76	152,874,276.79	17.24%	否
3	159938	广发中证全指医药卫生ETF	交易型开放式	80,573,800.00	99,347,495.40	11.20%	否
4	163412	兴全轻资产混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	27,635,394.38	93,379,997.61	10.53%	否
5	450002	国富弹性市值混合	契约型开放式	75,835,624.23	81,470,211.11	9.19%	否
6	512010	易方达沪深300医药ETF	交易型开放式	42,583,017.00	69,623,232.80	7.85%	否
7	070032	嘉实优化红利混合	契约型开放式	38,054,201.00	60,468,125.39	6.82%	否
8	481001	工银核心价值混合A	契约型开放式	119,286,022.28	34,533,303.45	3.89%	否
9	159915	易方达创业板ETF	交易型开放式	15,579,200.00	22,698,894.40	2.56%	否
10	159939	广发中证全指信息技术ETF	交易型开放式	17,798,114.00	16,801,419.62	1.89%	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	518,211.34	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	103.06	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,519,735.74	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	429,108.98	-
当期交易基金产生的交易费（元）	18,287.51	-
当期交易基金产生的转换费 (元)	298,505.57	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,042,161,133.56
本报告期基金总申购份额	9,415,839.52
减：本报告期基金总赎回份额	140,276,101.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	911,300,871.77

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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。

8.2 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。

§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

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。

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69只公募基金。截至2019年6月30日，海富通管理的公募基金资产规模约780亿元人民币。

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6月30日，海外业务规模约23亿元人民币。

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6月30日，海富通为近80家企业约438亿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6月30日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约388亿元。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。

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。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。

§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聚优精选混合型基金中基金（FOF）的文件
（二）海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）基金合同
（三）海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）招募说明书
（四）海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）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）报告期内海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）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
二〇一九年七月十七日