海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十八日

1 重要提示

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。本半年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	海富通创业板增强	
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	
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	
报告期末基金份额总额	23,550,557.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C
下属分级基金的交易代码	005288	005287
报告期末下属分级基金的份额总额	17,339,039.29份	6,211,517.90份

2.2 基金产品说明

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涨跌幅的日均偏离度控制在0.5%以内、年化跟踪误差控制在7.5%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标的指数投资方法,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,使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预期风险水平的投资品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	郭明
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

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(2019年1月1日至2019年6月30日)	
	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C
本期已实现收益	1,484,303.18	522,755.13
本期利润	3,400,615.96	1,277,034.75
加权平均基金份额本期利润	0.1867	0.1926
本期基金份额净值增长率	20.94%	20.75%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C
期末可供分配基金份额利润	-0.0566	-0.0604
期末基金资产净值	16,414,381.98	5,856,903.97
期末基金份额净值	0.9467	0.9429

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

海富通创业板增强A

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	3.69%	1.44%	1.30%	1.51%	2.39%	-0.07%
过去三个月	-6.40%	1.69%	-8.84%	1.89%	2.44%	-0.20%
过去六个月	20.94%	1.69%	20.10%	1.88%	0.84%	-0.19%
过去一年	-4.62%	1.60%	-4.80%	1.78%	0.18%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-5.33%	1.48%	-18.24%	1.75%	12.91%	-0.27%

海富通创业板增强C

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	3.65%	1.44%	1.30%	1.51%	2.35%	-0.07%
过去三个月	-6.43%	1.69%	-8.84%	1.89%	2.41%	-0.20%
过去六个月	20.75%	1.69%	20.10%	1.88%	0.65%	-0.19%
过去一年	-4.82%	1.60%	-4.80%	1.78%	-0.02%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-5.71%	1.48%	-18.24%	1.75%	12.53%	-0.27%

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6月30日)

2. 海富通创业板增强C
(2018年4月8日至2019年6月30日)

注:本基金合同于2018年4月8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2019年6月30日,本基金管理人共管理61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、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、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、海富通双福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、海富通富睿混合型证券投资基金、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、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、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)。

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(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杜晓海	本基金的基金经理;海富通安颐收益混合基金经理;海富通新内需混合基金经理;海富通欣荣混合基金经理;海富通富睿混合基金经理;海富通富祥混合基金经理;海富通阿尔法对冲混合基金经理;海富通创业板增强基金经理;海富通稳固收益债券基金经理;海富通欣享混合基金经理;海富通欣益混合基金经理;海富通量化多因子混合基金经理;海富通研究精选混合基金经理;量化投资部总监	2018-04-09	-	19年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任Man-Drapeau Research金融工程师,American Bourses Corporation中国区总经理,海富通基金管理有限公司定量分析师、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6月起任海富通新内需混合和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月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017年4月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2018年3月起兼任海富通富祥混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合、海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019年6月起兼任海富通研究精选混合基金经理。

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,海富通基金管理有限公司认真遵循《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年A股市场出现了明显涨幅。截至2019年6月30日,上证综指收于2978.88点,上半年上涨19.45%,深证成指收于9178.31点,上涨幅度为26.78%。中小板指收于5678.75点,上涨20.75%,创业板上涨20.87%,报1511.51点。

具体来看,自从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,随着困扰2018年的几大利空因素均有所缓解: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,2月份上证综指涨幅达到13.79%,创近几年新高。同时随着2月末两市单日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。进入二季度,一季度大幅上涨之后,4月份存在一定的调整压力。因此在月初上证综指触及短期新高3288.45点之后,便开始区间震荡。同时月底贸易谈判陷入僵局,指数也开始出现回调。4月份上证综指下跌0.4%。5月月初随着中美贸易谈判陷入僵局,以及对国内宏观经济下行压力的预期,市场出现了大幅回调,单5月份上证综指下跌5.84%,深证成指下跌7.77%。板块上看,仅有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。进入6月份之后,虽然4-5月份的宏观经济数据依旧没有改善预期,但随着对中美G20重启贸易谈判的预期,市场逐步开始筑底回升,风险偏好有所提升,单6月上证综指上涨2.77%。

行业方面,在申万28个一级行业分类中,上半年均录得涨幅,单板块间差异巨大。其中食品饮料(61.01%)、非银金融(43.83%)、农林牧渔(41.96%)、家电(37.82%)、计算机(32.77%)涨幅排名前五,且都涨幅超过30%。而建筑装饰(4.16%)、钢铁(5.04%)、传媒(7.79%)、纺织服装(9.27%)、汽车(10.03%)涨幅靠后。

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。

4.4.2 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20.94%,同期业绩比较基准收益率为20.10%,基金净值跑赢业绩比较基准0.84个百分点。海富通创业板增强C净值增长率为20.75%,同期业绩比较基准收益率为20.10%,基金净值跑赢业绩比较基准0.65个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年初,市场对经济的担忧有所缓解。外部中美贸易摩擦暂缓,并貌似朝着达成协议的方向演进。内部政策宽松,降准、地方债发行前置、信贷周期回暖,资产价格预期企稳。2019年4月中旬,国内外不确定性上升。4月中旬起国内政策边际收紧,5月初中美局势恶化,5月24日包商银行被接管,中小银行结构性去杠杆。市场风险偏好显著回落。2019年6月中旬,中美领导人通电话,确定G20见面,市场预期谈判重启;美联储6月议息会议释放鸽派信号;证监会就修改《上市公司重大资产重组管理办法》征求意见,市场风险偏好迅速提升。上半年的行情基本上来源于估值修复。

下半年,国内宏观经济增长压力仍在。一季度在信贷及社融扩张提振下,经济增长体现一定韧性,但随着外部中美贸易摩擦带来的负面效果更大范围地显现,内部房地产市场可能逐步降温、基建增速制约重重、中小银行去杠杆对实体经济的影响尚未完全体现等,中国经济增长在2019年下半年仍将面临压力。同时,从政策角度看,下半年宏观政策倾向将维持宽松,尤其是三季度将在边际上较二季度宽松。但在高杠杆环境以及结构性去杠杆政策背景制约下,政策效果有待验证。同时,包商银行事件后,流动性出现分层,中小银行及非银机构融资困难程度及成本上升,为避免出现局部风险,预计货币政策将采取进一步措施缓解结构性流动性压力。

从中期角度,我们依旧对下半年的资本市场保持相对乐观。我们认为估值的变化依然是核心变量,仍存在修复机会。估值端来自无风险利率下行带来的修复机会较为确定,风险偏好短期将出现抬升,但后续存在不确定性,整体上市场环境好于二季度,策略上更加积极,但需留意市场可能会阶段性对业绩下滑做出负面反应。从行业角度看,我们认为科技、消费、金融等板块有望持续跑出超额收益,包括计算机、半导体、5G、食品饮料、医药、券商、银行等。

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,通过在各行各业中精选估值合理的优质个股,力争在跟踪误差较小的情况下稳健跑赢市场。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、本基金本报告期内无应分配的收益。

二、已实施的利润分配:无。

三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.8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

本基金本报告期无需要说明的情形。

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,本基金托管人在对海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末2019年6月30日	上年度末2018年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	413,524.27	324,536.49
结算备付金		32,893.73	29,536.33
存出保证金		5,812.42	12,293.91
交易性金融资产	6.4.7.2	21,935,399.74	20,470,337.47
其中:股票投资		21,064,097.34	19,408,567.87
基金投资		-	-
债券投资		871,302.40	1,061,769.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	33,778.21
应收利息	6.4.7.5	9,191.24	39,360.15
应收股利		-	-
应收申购款		24,758.49	22,223.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		22,421,579.89	20,932,066.05
负债和所有者权益	附注号	本期末2019年6月30日	上年度末2018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		21,399.78	-
应付赎回款		9,805.14	16,366.00
应付管理人报酬		20,890.79	21,316.96
应付托管费		3,481.81	3,552.82
应付销售服务费		1,797.12	1,953.39
应付交易费用	6.4.7.7	13,597.06	9,470.41
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	79,322.24	240,000.00
负债合计		150,293.94	292,659.58
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	23,550,557.19	26,383,734.63
未分配利润	6.4.7.10	-1,279,271.24	-5,744,328.16
所有者权益合计		22,271,285.95	20,639,406.47
负债和所有者权益总计		22,421,579.89	20,932,066.05

注:1、报告截止日2019年6月30日,A类基金份额净值0.9467元,C类基金份额净值0.9429元,基金份额总额23,550,557.19份,其中A类基金份额17,339,039.29份,C类基金份额6,211,517.90份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体:海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年4月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入		5,038,387.08	679,402.26
1.利息收入		16,635.65	121,111.96
其中:存款利息收入	6.4.7.11	3,279.55	22,574.84
债券利息收入		13,356.10	40,122.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	58,414.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,321,551.79	738,091.37
其中:股票投资收益	6.4.7.12	2,106,819.95	603,365.37
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-5,823.93	-3,199.10
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	220,555.77	137,925.10
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	2,670,592.40	-203,174.86
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.19	29,607.24	23,373.79
减:二、费用		360,736.37	330,931.65
1. 管理人报酬		135,264.15	93,242.65
2. 托管费		22,544.02	15,540.41
3. 销售服务费		12,001.28	10,964.25
4. 交易费用	6.4.7.20	61,295.81	54,865.85
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	6.4.7.21	129,631.11	156,318.49
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		4,677,650.71	348,470.61
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		4,677,650.71	348,470.61

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	26,383,734.63	-5,744,328.16	20,639,406.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,677,650.71	4,677,650.71
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)	-2,833,177.44	-212,593.79	-3,045,771.23
其中:1.基金申购款	8,885,402.63	-579,759.69	8,305,642.94
2.基金赎回款	-11,718,580.07	367,165.90	-11,351,414.17
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)	23,550,557.19	-1,279,271.24	22,271,285.95
项目	上年度可比期间 2018年4月8日(基金合同生效日)至2018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)	39,787,405.14	-	39,787,405.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	348,470.61	348,470.61
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)	-13,381,777.48	-557,673.65	-13,939,451.13
其中:1.基金申购款	2,688,158.26	89,857.18	2,778,015.44
2.基金赎回款	-16,069,935.74	-647,530.83	-16,717,466.57
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)	26,405,627.66	-209,203.04	26,196,424.62

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:陶网雄,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

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2017]1237号文《关于准予海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册,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《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为发起式股票型证券投资基金,运作方式为契约型开放式,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39,773,225.86元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0254号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》于2018年4月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为39,787,405.14份,A类基金份额23,917,653.02份,C类基金份额15,869,752.12份,其中认购资金利息折合A基金份额8,924.90份,认购资金利息折合C基金份额5,254.38份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金为发起式基金,基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为1,000万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《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》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%;本基金在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如以后法律法规或监管机构日后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为: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)。

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2019年8月27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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《海富通创业板综指增强型发起式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。

本财务报表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2019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2019年6月30日的财务状况以及2019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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年4月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	135,264.15	93,242.65
其中:支付销售机构的客户维护费	45,190.96	38,428.93

注:支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%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 1.2% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间2018年4月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	22,544.02	15,540.41

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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 0.2% /当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 海富通创业板增强A	海富通创业板增强C	合计
工商银行	-	9,098.41	9,098.41
海通证券	-	109.41	109.41
海富通基金	-	0.23	0.23
合计	-	9,208.05	9,208.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年4月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 海富通创业板增强A	海富通创业板增强C	合计
工商银行	-	10,325.62	10,325.62
海通证券	-	64.75	64.75
海富通基金	-	0.04	0.04
合计	-	10,390.41	10,390.41

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C 类份额对应的基金资产净值的年费率0.40%计提,逐日累计至每月月底,按月支付给海富通基金管理有限公司,再由海富通基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日C 类份额对应的基金资产净值 X 0.40 % / 当年天数。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期2019年1月1日至2019年6月30日 海富通创业板增强A	海富通创业板增强C	上年度可比期间2018年4月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日 海富通创业板增强A	海富通创业板增强C
基金合同生效日(2018年4月8日)持有的基金份额	-	-	10,002,250.22	-
报告期初持有的基金份额	10,002,250.22	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,250.22	-	10,002,250.22	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	57.69%	-	51.71%	-

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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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2019年1月1日至2019年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间2018年4月8日(基金合同生效日)至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国工商银行	413,524.27	2,883.70	2,639,127.21	21,855.10

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	21,064,097.34	93.95
	其中:股票	21,064,097.34	93.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	871,302.40	3.89
	其中:债券	871,302.40	3.89
	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	446,418.00	1.99
8	其他各项资产	39,762.15	0.18
9	合计	22,421,579.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1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	749,423.26	3.36
B	采矿业	169,183.00	0.76
C	制造业	13,869,810.11	62.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	51,175.00	0.23
F	批发和零售业	134,744.40	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	25,134.00	0.11
H	住宿和餐饮业	35,960.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,484,047.81	15.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	213,578.70	0.96
L	租赁和商务服务业	65,778.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	364,314.00	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	28,842.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	750,800.40	3.37
R	文化、体育和娱乐业	1,121,306.66	5.03
S	综合	-	-
	合计	21,064,097.34	94.58

7.2.2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。

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300144	宋城演艺	37,967	878,556.38	3.94
2	300498	温氏股份	19,941	715,084.26	3.21
3	300271	华宇软件	35,900	682,100.00	3.06
4	300450	先导智能	20,275	681,240.00	3.06
5	300146	汤臣倍健	31,300	607,220.00	2.73
6	300015	爱尔眼科	18,720	579,758.40	2.60
7	300383	光环新网	30,300	508,131.00	2.28
8	300628	亿联网络	4,400	471,108.00	2.12
9	300258	精锻科技	38,746	469,214.06	2.11
10	300014	亿纬锂能	13,100	399,026.00	1.79

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300203	聚光科技	575,550.00	2.79
2	300470	日机密封	483,740.00	2.34
3	300230	永利股份	456,384.00	2.21
4	300294	博雅生物	445,161.27	2.16
5	300207	欣旺达	361,439.00	1.75
6	300400	劲拓股份	310,963.00	1.51
7	300166	东方国信	306,141.36	1.48
8	300326	凯利泰	304,856.00	1.48
9	300059	东方财富	301,281.00	1.46
10	300233	金城医药	297,714.00	1.44
11	300476	胜宏科技	287,331.00	1.39
12	300673	佩蒂股份	285,315.00	1.38
13	300569	天能重工	281,999.00	1.37
14	300284	苏交科	277,265.00	1.34
15	300144	宋城演艺	267,908.00	1.30
16	300383	光环新网	246,760.00	1.20
17	300628	亿联网络	234,560.00	1.14
18	300408	三环集团	226,504.00	1.10
19	300196	长海股份	223,259.00	1.08
20	002475	立讯精密	222,238.20	1.08

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300741	华宝股份	1,149,486.36	5.57
2	300233	金城医药	888,781.82	4.31
3	300408	三环集团	873,282.00	4.23
4	300723	一品红	729,222.00	3.53
5	300170	汉得信息	635,199.00	3.08
6	300319	麦捷科技	621,369.00	3.01
7	300133	华策影视	609,787.97	2.95
8	300203	聚光科技	594,379.84	2.88
9	300037	新宙邦	536,145.00	2.60
10	300498	温氏股份	528,623.70	2.56
11	300628	亿联网络	402,604.00	1.95
12	300059	东方财富	382,872.00	1.86
13	300258	精锻科技	312,325.92	1.51
14	300119	瑞普生物	300,648.00	1.46
15	300673	佩蒂股份	287,735.48	1.39
16	300373	扬杰科技	280,392.00	1.36
17	300230	永利股份	270,097.00	1.31
18	300383	光环新网	254,016.00	1.23
19	300316	晶盛机电	252,465.00	1.22
20	300470	日机密封	236,992.00	1.15

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	21,617,890.17
卖出股票的收入(成交)总额	24,737,740.12

注:"买入股票成本"、"卖出股票收入"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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	871,302.40	3.91
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	871,302.40	3.91

7.6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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019611	19国债01	8,720	871,302.40	3.91

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同,本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金暂不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1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。

7.12.2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。

7.12.3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	5,812.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,191.24
5	应收申购款	24,758.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,762.15

7.12.4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。

7.12.5 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未存在流通受限情况。

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

份额级别	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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
海富通创业板增强A	299	57,990.10	10,002,250.22	57.69%	7,336,789.07	42.31%
海富通创业板增强C	327	18,995.47	0.00	0.00%	6,211,517.90	100.00%
合计	626	37,620.70	10,002,250.22	42.47%	13,548,306.97	57.53%

注:本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,A、C级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	海富通创业板增强A	-	-
	海富通创业板增强C	1,001.03	0.0161%
	合计	1,001.03	0.0043%

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	份额级别	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	海富通创业板增强A	0
	海富通创业板增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通创业板增强A	0
	海富通创业板增强C	0
	合计	0

8.4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	42.47%	10,002,250.22	42.47%	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	42.47%	10,002,250.22	42.47%	-

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开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C
基金合同生效日(2018年4月8日)基金份额总额	23,917,653.02	15,869,752.12
本报告期期初基金份额总额	19,006,950.74	7,376,783.89
本报告期基金总申购份额	4,402,832.15	4,482,570.48
减:本报告期基金总赎回份额	6,070,743.60	5,647,836.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,339,039.29	6,211,517.90

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

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、2019年3月29日,海富通基金管理有限公司发布公告,因第五届董事会任期届满,经公司2019年第一次临时股东会审议通过,选举杨仓兵先生、吴淑琨先生、芮政先先生、任志强先生、Ligia TORRES (陶乐斯)女士、Alexandre WERNO (韦历山)先生、张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士担任公司第六届董事会董事,其中张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士为独立董事。原第五届董事会成员张文伟先生、杨明先生、杨国平先生、Marc Bayot(巴约特)先生、郑国汉(Leonard K. CHENG)先生不再担任公司董事职务。

2、2019年3月29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一次会议审议通过,张文伟先生不再担任公司董事长职务,并决定由公司总经理任志强先生代为履行董事长职务,代为履行董事长职务的期限不超过90日。

3、2019年4月29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一次会议审议通过,聘请杨仓兵先生担任公司董事长职务。自杨仓兵先生任董事长职务之日起,公司总经理任志强先生不再代行董事长职务。

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

报告期无涉及基金管理人、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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
方正证券	1	21,104,372.12	45.54%	19,232.24	59.28%	-
申万宏源	2	16,757,898.68	36.16%	6,911.97	21.30%	-
中泰证券(原齐鲁)	2	4,694,956.21	10.13%	3,433.56	10.58%	-
东北证券	1	2,970,936.50	6.41%	2,113.22	6.51%	-
华泰证券	1	810,592.00	1.75%	754.79	2.33%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注:1、报告期内本基金退租方正证券二个交易单元。

2、(1)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。

(2)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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	95,036.60	4.81%	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	1,272,366.80	64.40%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	608,277.60	30.79%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2019/01/01-2019/06/30	10,002,250.22	-	-	10,002,250.22	42.47%

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20%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剧烈波动的风险;

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无法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六十个工作日低于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些申购或转换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,本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换入申请。

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。

海富通基金管理有限公司
二〇一九年八月二十八日