海富通聚利纯债债券型证券投资基金 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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	海富通聚利债券
基金主代码	519220
交易代码	519220
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年9月22日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,708,356,232.83份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,追求基金资产长期稳定增值,力争实现高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下,本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	陆志俊
	联系电话	021-38650891	95559
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216

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)
本期已实现收益	47,914,386.07
本期利润	55,504,822.97
加权平均基金份额本期利润	0.0205
本期基金份额净值增长率	2.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0320
期末基金资产净值	2,801,270,205.09
期末基金份额净值	1.0343

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)。

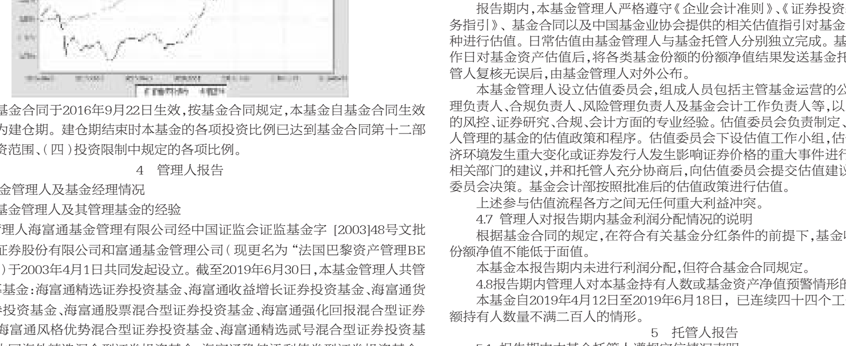
3.2 基金净值表现

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

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	0.44%	0.02%	0.57%	0.03%	-0.13%	-0.01%
过去三个月	0.83%	0.03%	0.63%	0.06%	0.20%	-0.03%
过去六个月	2.02%	0.03%	2.07%	0.06%	-0.05%	-0.03%
过去一年	4.61%	0.03%	6.46%	0.06%	-1.85%	-0.03%
自基金合同生效起至今	10.66%	0.03%	9.04%	0.08%	1.62%	-0.05%

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

海富通聚利纯债债券型证券投资基金
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
(2016年9月22日至2019年6月30日)



注:本基金合同于2016年9月22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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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;海富通稳健添利债券基金经理;海富通货币基金经理;海富通安颐收益混合基金经理;海富通欣益混合基金经理;海富通新内需混合基金经理;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。	2016-09-22	-	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月起兼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。
刘田	本基金的基金经理助理;海富通瑞丰一年定开债券基金经理助理;海富通集利债券基金经理助理;海富通瑞利债券基金经理助理;海富通瑞合纯债基金经理助理;海富通添益货币基金经理助理;海富通融丰定开债券基金经理助理;海富通弘丰定开债券基金经理助理;海富通鼎丰定开债券基金经理助理;海富通聚丰纯债基金经理助理。	2016-09-27	-	3年	管理学学士,持有基金从业人员资格证书。曾任上海银行同业客户经理,2016年4月加入海富通基金管理有限公司,2016年8月至2017年11月任海富通瑞益债券的基金经理助理。2016年8月起任海富通瑞丰一年定开债券的基金经理助理。2016年9月起兼任海富通聚利债券的基金经理助理。2016年12月起兼任海富通集利债券的基金经理助理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券的基金经理助理。2017年4月起兼任海富通瑞合纯债的基金经理助理。2017年11月起兼任海富通添益货币的基金经理助理。2018年2月起兼任海富通融丰定开债券的基金经理助理。2018年12月起兼任海富通弘丰定开债券、海富通鼎丰定开债券、海富通聚丰纯债的基金经理助理。
陆丛凡	本基金的基金经理助理;海富通上证可质押城投债ETF基金经理助理;海富通美元债(QDII)基金经理助理;海富通上证周期产业债ETF基金经理助理;海富通富睿混合基金经理助理;海富通恒丰定开债券基金经理助理;海富通上证10年期地方政府债ETF的基金经理助理;海富通上清所短融债券的基金经理助理。	2016-09-27	2019-07-03	7年	硕士,持有基金从业人员资格证书。曾任瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益定量分析师,2015年4月加入海富通基金管理有限公司。2015年6月至2019年7月任海富通固定收益部基金经理助理。2019年7月起任海富通上证城投债ETF、海富通上证10年期地方政府债ETF、海富通上清所短融债券的基金经理。

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:自参加证券行业的相关工作开始计算。

3、本公司于2019年7月3日发布公告,自2019年7月3日起,陆丛凡先生不再担任本基金的基金经理助理。

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、勤勉尽责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

回顾上半年,债券收益率先经历了较长时间的震荡调整,而后又逐步下行,总体呈现区间震荡格局。年初,逆周期调节政策密集出台,中美贸易谈判进展顺利,天量信贷的投放和社融增速的反弹引发宽信用预期,带动股市单边走强、风险偏好修复;而一季度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涨幅跃升0.8个百分点至2.3%,引发市场对通胀的担忧。在宽信用初见成效、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。由此,1至4月利率呈震荡上行的态势。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,其中上半年固定资产投资、社会消费品零售总额累计同比增长5.8%和8.4%,较去年同期下降0.2和1个百分点;此外,央行在实施定向降准的同时积极呵护资金面,短期内弱化了包商事件的冲击,隔夜资金利率一度跌破2%。由此,5月以来利率呈下行态势。整体看,上半年1年期国开债收益率下行2BP,10年期国开债收益率下行3BP,期限利差小幅收窄。信用债方面,上半年信用债收益率普遍下行,信用利差平均收窄20BP左右,其中短期限表现更佳。值得注意的是5月底包商事件引发同业收缩及结构化发行风险,6月中低等级信用利差上行15BP左右,而高等级仅上行6BP,信用分化仍较明显,中低等级净融资额占比较低,其信用利差绝对值亦处于历史较高水平。可转债方面,上半年转债市场先扬后抑,与股市表现一致,中证转债指数累计上涨13.3%。

本基金上半年主要配置于利率债、中高评级信用债,规避了信用风险,获得了稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为2.02%,同期业绩比较基准收益率为2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,预计整体经济或承压,而通胀大概率先下后上。工业方面,整体需求回落或带来生产端疲软的表现;投资方面,房地产投资或平稳回落,制造业投资仍面临下行压力,而在政策支持下基建投资增速大概率继续温和回升,但难以完全对冲整体投资的下行;消费或平稳走弱;出口方面,全球经济放缓风险加大,出口大概率难以改善。通胀方面,基数效应下PPI和CPI大概率先下后上,但在内外需疲软前提下通胀不存在显著风险。总体看下半年国内经济仍存下行压力,而四季度面临阶段性的通胀压力。货币政策方面,在国内经济未见企稳迹象和海外央行协同趋松的背景下,下半年央行或将延续稳健偏松,不排除会有降准和下调政策工具利率的操作。在上述判断下,我们认为下半年利率易下难上,可择机参与利率债交易,同时需关注未来政策逆周期调节的力度、通胀预期和资金面的变化以及中微观基本面的情况,谨防政策加码背景下四季度经济企稳和通胀回升的或有风险。信用债方面,信用风险仍处于高发期,银行打破刚兑对市场的预期影响仍在,负债端不够稳定的中小银行存在缩表可能,资产端或被动紧信用,市场潜在信用风险上升,信用利差存在走阔压力。可转债方面,下半年不确定性仍较多,中美对抗既是长期大背景,其中的各种突发事件亦是短中期扰动市场的重要因素之一,而企业盈利修复暂时未见其可持续性,因此权益市场仍然任重道远;转债目前绝对价格吸引力并不高,下半年建议挖掘潜在的主题性机会,例如国产替代等相关板块。

下半年,本基金将持续配置以中高等级信用债、商业银行金融债为主的资产;同时,择机进行利率债交易,在控制风险的基础上获得更高的配置收益。

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

根据基金合同的规定,在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配,但符合基金合同规定。

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

本基金自2019年4月12日至2019年6月18日，已连续四十四个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

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

2019年上半年度,基金托管人在海富通聚利纯债债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2019年上半年度,海富通基金管理有限公司在海富通聚利纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2019年上半年度,由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通聚利纯债债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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:海富通聚利纯债债券型证券投资基金
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	8,775,658.60	10,368,129.13
结算备付金		11,258,865.75	2,364,872.85
存出保证金		112,145.06	1,810.73
交易性金融资产	6.4.7.2	3,500,941,600.00	2,439,269,840.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,396,921,600.00	2,292,909,840.00
资产支持证券投资		104,020,000.00	146,360,000.00
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	19,000,148.50	263,183,034.78
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	53,609,018.21	32,138,115.84
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,593,697,436.12	2,747,325,803.33
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		790,862,548.71	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20.02	-
应付管理人报酬		688,828.43	698,575.62
应付托管费		229,609.44	232,858.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,561.45	19,709.50
应交税费		189,673.01	209,544.41
应付利息		321,034.87	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,955.10	390,000.00
负债合计		792,427,231.03	1,550,688.05
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,708,356,232.83	2,708,365,740.60
未分配利润	6.4.7.10	92,913,972.26	37,409,374.68
所有者权益合计		2,801,270,205.09	2,745,775,115.28
负债和所有者权益总计		3,593,697,436.12	2,747,325,803.33

注:1、报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0343元,基金份额总额2,708,356,232.83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,投资者欲了解相应附注的内容,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:海富通聚利纯债债券型证券投资基金
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1月1日至2018年6月30日
一、收入		70,380,861.98	79,452,280.20
1.利息收入		61,711,202.19	58,898,707.39
其中:存款利息收入	6.4.7.11	196,577.18	528,758.23
债券利息收入		58,267,045.36	57,195,041.92
资产支持证券利息收入		2,870,686.76	688,111.52
买入返售金融资产收入		376,892.89	486,795.72
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以"-"填列)		1,079,222.62	9,466,883.86
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	939,379.29	9,420,666.70
资产支持证券投资收益		139,843.33	46,217.16
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	7,590,436.90	11,086,685.73
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	0.27	3.22
减:二、费用		14,876,039.01	10,165,488.35
1. 管理人报酬		4,128,678.41	4,064,409.79
2. 托管费		1,376,226.10	1,354,803.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	15,442.98	19,838.75
5. 利息支出		9,073,795.89	4,355,265.78
其中:卖出回购金融资产支出		9,073,795.89	4,355,265.78
6.税金及附加		138,640.87	150,035.85
7. 其他费用	6.4.7.20	143,254.76	221,134.87
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		55,504,822.97	69,286,791.85
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		55,504,822.97	69,286,791.85

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通聚利纯债债券型证券投资基金
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)	2,708,365,740.60	37,409,374.68	2,745,775,115.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	55,504,822.97	55,504,822.97
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)	-9,507.77	-225.39	-9,733.16
其中:1.基金申购款	7,846.90	197.48	8,044.38
2.基金赎回款	-17,354.67	-422.87	-17,777.54
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)	2,708,356,232.83	92,913,972.26	2,801,270,205.09

项目	上年度可比期间 2018年1月1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)	2,708,402,485.21	4,456,830.25	2,712,859,315.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	69,286,791.85	69,286,791.85
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)	-41,861.50	-143.11	-42,004.61
其中:1.基金申购款	12,942.26	132.37	13,074.63
2.基金赎回款	-54,803.76	-275.48	-55,079.24
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)	-	-30,605,018.34	-30,605,018.34
五、期末所有者权益(基金净值)	2,708,360,623.71	43,138,460.65	2,751,499,084.36

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

海富通聚利纯债债券型证券投资基金(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[2016]第1688号《关于准予海富通聚利纯债债券型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《海富通聚利纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集210,294,572.35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(2016)第1196号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通聚利纯债债券型证券投资基金基金合同》于2016年9月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,304,140.94份,其中认购资金利息折合9,568.59份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通聚利纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或监管机构以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。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

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》、《海富通聚利纯债债券型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
交通银行股份有限公司("交通银行")	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

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未有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1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,128,678.41	4,064,409.79
其中:支付销售机构的客户维护费	38.08	55.04

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0.30%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 0.30% / 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1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,376,226.10	1,354,803.31

注:支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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X0.10%/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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末2019年6月30日		上年度末2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
交通银行	2,708,311,089.43	100.00%	2,708,311,089.43	100.00%

注:于2019年6月30日，交通银行持有的基金份额占基金总份额的比例实际为99.9983%(2018年12月31日:99.9980%)。

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		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	8,775,658.60	161,926.30	10,726,708.41	113,031.42

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,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须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无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

截至本报告期末2019年06月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额540,862,548.71元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1722028	17浦银租赁债	2019-07-10	102.52	2,000,000	205,040,000.00
190301	19进出01	2019-07-10	99.84	5,000	499,200.00
101660082	16光明MTN003	2019-07-04	100.76	1,000,000	100,760,000.00
101800526	18中金集MTN001BC	2019-07-03	102.37	613,000	62,752,810.00
101751041	17汇金MTN001	2019-07-05	102.89	1,040,000	107,005,600.00
1280003	12中石油02	2019-07-10	103.17	100,000	10,317,000.00
011802188	18鲁黄金SCP018	2019-07-03	100.58	1,000,000	100,580,000.00
合计				5,758,000	586,954,610.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款总额250,000,000.00元,其中250,000,000.00元上海交易所正回购于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,500,941,600.00	97.42
	其中:债券	3,396,921,600.00	94.52
	资产支持证券	104,020,000.00	2.89
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	19,000,148.50	0.53
	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	20,034,524.35	0.56
8	其他各项资产	53,721,163.27	1.49
9	合计	3,593,697,436.12	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未买入股票。

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

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	845,351,000.00	30.18
	其中:政策性金融债	845,351,000.00	30.18
4	企业债券	683,701,600.00	24.41
5	企业短期融资券	200,580,000.00	7.16
6	中期票据	1,667,289,000.00	59.52
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,396,921,600.00	121.26

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	101751041	17汇金MTN001	2,000,000	205,780,000.00	7.35
2	1722028	17浦银租赁债	2,000,000	205,040,000.00	7.32
3	130310	13进出10	2,000,000	202,160,000.00	7.22
4	100228	10国开28	2,000,000	197,000,000.00	7.03
5	101801150	18中建材MTN002	1,300,000	132,444,000.00	4.73

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1889086	18建元8A1_BC	2,000,000	104,020,000.00	3.71

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合约。

7.10.2 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。

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	112,145.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	53,609,018.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,721,163.27

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
305	8,879,856.50	2,708,311,089.43	100.00%	45,143.40	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,742.08	0.0001%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2016年9月22日)基金份额总额	210,304,140.94
本报告期期初基金份额总额	2,708,365,740.60
本报告期基金总申购份额	7,846.90
减:本报告期基金总赎回份额	17,354.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,708,356,232.83

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注:1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	1,221,028,156.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	5,221,300,000.00	100.00%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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					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	2019/01/01-2019/06/30	2,708,311,089.43	-	-	2,708,311,089.43	100.00%

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、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,基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

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,本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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