海富通研究精选混合型证券投资基金 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：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29日（基金合同生效日）起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	海富通研究精选混合	
基金主代码	006556	
交易代码	006556	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年1月29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	2,872,253.06份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通研究精选混合A	海富通研究精选混合C
下属分级基金的交易代码	006557	006556
报告期末下属分级基金的份额总额	965,159.86份	1,907,093.20份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金依托基金管理人的研究平台和研究优势，通过对企业基本面全面、深入的研究，精选具有投资价值的上市公司股票构建投资组合，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为混合型基金，对股票资产的投资比例不低于基金资产的60%。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、市场风险收益特征及市场行为因素等进行评估分析，对股票资产和固定收益类资产等的预期风险收益进行动态跟踪，从而构建本基金的投资组合。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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29日（基金合同生效日）至2019年6月30日）	
	海富通研究精选混合A	海富通研究精选混合C
本期已实现收益	443,274.05	823,999.24
本期利润	261,228.54	1,103,318.19
加权平均基金份额本期利润	0.0588	0.0205
本期基金份额净值增长率	0.71%	-0.90%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	海富通研究精选混合A	海富通研究精选混合C
期末可供分配基金份额利润	0.0071	-0.0090
期末基金资产净值	971,997.14	1,889,993.86
期末基金份额净值	1.0071	0.9910

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）。

4、本基金合同生效日为2019年1月29日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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

海富通研究精选混合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	2.02%	1.17%	3.52%	0.95%	-1.50%	0.22%
过去三个月	-2.02%	1.41%	-2.68%	1.25%	0.66%	0.16%
自基金合同生效起至今	0.71%	1.37%	15.43%	1.33%	-14.72%	0.04%

海富通研究精选混合C

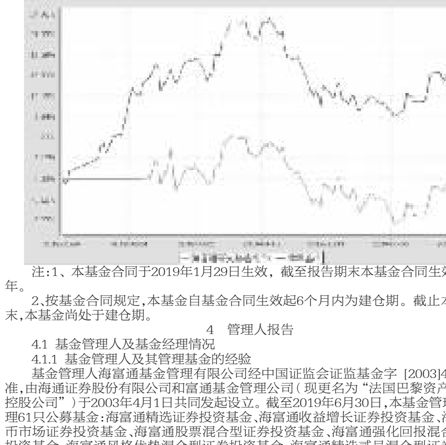
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	1.94%	1.17%	3.52%	0.95%	-1.58%	0.22%
过去三个月	-2.75%	1.42%	-2.68%	1.25%	-0.07%	0.17%
自基金合同生效起至今	-0.90%	1.37%	15.43%	1.33%	-16.33%	0.04%

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

海富通研究精选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

1. 海富通研究精选混合A
(2019年1月29日至2019年6月30日)

2. 海富通研究精选混合C
(2019年1月29日至2019年6月30日)



注：1、本基金合同于2019年1月29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。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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	任本基金的基金经理（助理）期限：离任日期	证券从业年限	说明
王金祥	本基金的基金经理；海富通风格优势混合基金经理；研究部总监。	2019-01-29	-	15年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2004年2月至2005年5月任东莞证券有限责任公司分析师，2005年6月至2006年4月任新疆证券有限责任公司分析师，2006年5月至2009年9月任兴业证券股份有限公司研发中心行业二部副经理。2009年9月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、高级股票分析师、基金经理助理、研究副总监。现任海富通基金管理有限公司研究部总监。2018年11月起兼任海富通风格优势混合基金经理。2019年1月起兼任海富通研究精选混合基金经理。
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；海富通量化前锋股票基金经理；量化投资部总监。	2019-06-25	-	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，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 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

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了95%置信区间，假设溢价率为0的T分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

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。

上半年本基金采用相对均衡的配置思路，适当超配食品饮料、农业、医药、机械、TMT等行业，在个股选择上偏向自下而上挖掘性价比高的成长股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通研究精选混合A基金净值增长率为0.71%，同期基金业绩比较基准收益率为15.43%，跑输业绩比较基准14.72个百分点；海富通研究精选混合C基金净值增长率为-0.90%，同期基金业绩比较基准收益率为15.43%，跑输业绩比较基准16.33个百分点。由于本基金建仓时间相对较晚，一季度成长股的行情未充分受益，导致本基金上半年负超额收益较明显。

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。

预计下半年市场仍积极可为，本基金仓位将继续维持在较高水平，食品饮料、农业、医药、机械、TMT等行业仍是超配置的方向，个股选择仍偏向挖掘性价比高的优质成长股，组合整体仍维持偏成长的风格。

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，基金管理人可对本基金进行基金分红，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3月5日至2019年6月30日，已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

本基金自2019年3月8日至2019年6月18日，已连续超过六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人拟通过基金转型的方式解决，解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。

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研究精选混合型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，海富通研究精选混合型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研究精选混合型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，海富通研究精选混合型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研究精选混合型证券投资基金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：海富通研究精选混合型证券投资基金
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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	639,223.93
结算备付金		13,832.36
存出保证金		15,654.34
交易性金融资产	6.4.7.2	2,280,558.56
其中：股票投资		2,280,558.56
基金投资		-
债券投资		-
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		-
应收利息	6.4.7.5	126.78
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		2,949,395.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30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		-
应付赎回款		109.96
应付管理人报酬		3,415.28
应付托管费		569.20
应付销售服务费		1,200.80
应付交易费用	6.4.7.7	4,928.89
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	77,180.85
负债合计		87,404.97
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,872,253.06
未分配利润	6.4.7.10	-10,262.06
所有者权益合计		2,861,991.00
负债和所有者权益总计		2,949,395.97

注：1、报告截止日2019年6月30日，A类基金份额净值1.0071元，C类基金份额净值0.9910元，基金份额总额2,872,253.06份，其中A类基金份额965,159.86份，C类基金份额1,907,093.20份。

2、基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

3、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：海富通研究精选混合型证券投资基金
本报告期：2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
一、收入		2,192,224.27
1.利息收入		683,392.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	387,673.03
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		295,719.28
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以"-"填列）		1,358,023.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,336,867.91
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
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	21,155.49
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	6.4.7.18	97,273.44
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	53,535.12
减：二、费用		827,677.54
1. 管理人报酬		402,000.05
2. 托管费		67,000.03
3. 销售服务费		198,637.44
4. 交易费用	6.4.7.20	80,268.23
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	79,771.79
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		1,364,546.73
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		1,364,546.73

注：本财务报表的实际编制期间为2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日，上年度可比期间无比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通研究精选混合型证券投资基金
本报告期：2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）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）	263,880,805.88	-	263,880,805.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,364,546.73	1,364,546.73
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）	-261,008,552.82	-1,374,808.79	-262,383,361.61
其中：1.基金申购款	159,775.75	2,585.95	162,361.70
2.基金赎回款	-261,168,328.57	-1,377,394.74	-262,545,723.31
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）	2,872,253.06	-10,262.06	2,861,991.00

注：基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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

海富通研究精选混合型证券投资基金(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[2018]856号文《关于准予海富通研究精选混合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《海富通研究精选混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为混合型证券投资基金，运作方式为契约型开放式，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币263,852,845.94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(2019)第0013号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通研究精选混合型证券投资基金基金合同》于2019年1月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为263,880,805.88份，A类基金份额14,892,110.25份，C类基金份额248,988,695.63份，其中认购资金利息折合A基金份额918.54份，认购资金利息折合C基金份额27,041.40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。

根据《海富通研究精选混合型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《海富通研究精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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、同业存单、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的0-50%；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，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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。法律法规或监管机构日后允许本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：中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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》、《海富通研究精选混合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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2019年6月30日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元且连续60个工作日基金份额持有人数量不满200人的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间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1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

6.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货投资) 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易，基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金，基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	402,000.05
其中：支付销售机构的客户维护费	114,643.30

注：1、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1.5%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 1.5% / 当年天数。

2、基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,000.03

注：1、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0.25%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 0.25% /当年天数。

2、基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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29日（基金合同生效日）至2019年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费：海富通研究精选混合A	海富通研究精选混合C	合计
工商银行	-	43,026.07	43,026.07
海通证券	-	7,672.20	7,672.20
海富通基金	-	20,871.87	20,871.87
合计	-	71,570.14	71,570.14

注：1、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0.80%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X0.80%/当年天数。

2、基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金，基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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

1、本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

2、基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日：期末余额	当期利息收入
中国工商银行	639,223.93	25,995.43

注：1、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。

2、基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项，基金合同成立于2019年1月29日，上年度可比期间无比较数据。

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	2,280,558.56	77.32
	其中：股票	2,280,558.56	77.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	653,056.29	22.14
8	其他各项资产	15,781.12	0.54
9	合计	2,949,395.97	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	122,784.00	4.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,565,383.63	54.70
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	69,990.00	2.45
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	139,141.65	4.86
J	金融业	120,058.00	4.19
K	房地产业	150,503.28	5.26
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	55,080.00	1.92
N	水利、环境和公共设施管理业	57,618.00	2.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,280,558.56	79.68

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	300014	亿纬锂能	3,000	91,380.00	3.19
2	000651	格力电器	1,400	77,000.00	2.69
3	002371	北方华创	1,099	76,105.75	2.66
4	600276	恒瑞医药	1,100	72,600.00	2.54
5	000977	浪潮信息	3,000	71,580.00	2.50
6	000063	中兴通讯	2,200	71,566.00	2.50
7	600570	恒生电子	1,041	70,944.15	2.48
8	603939	益丰药房	1,000	69,990.00	2.45
9	603160	汇顶科技	500	69,400.00	2.42
10	300525	博思软件	3,150	68,197.50	2.38

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002124	天邦股份	644,065.00	22.50
2	300012	华测检测	637,806.50	22.29
3	002299	圣农发展	637,744.00	22.28
4	000401	冀东水泥	634,241.00	22.16
5	300498	温氏股份	632,439.00	22.10
6	300316	晶盛机电	630,926.00	22.05
7	000977	浪潮信息	629,224.00	21.99
8	002230	科大讯飞	626,887.00	21.90
9	300037	新宙邦	626,524.00	21.89
10	300146	汤臣倍健	626,518.00	21.89
11	002371	北方华创	624,017.00	21.80
12	603160	汇顶科技	619,482.00	21.65
13	600048	保利地产	618,995.00	21.63
14	300400	劲拓股份	618,382.00	21.61
15	000002	万科A	617,839.00	21.59
16	603939	益丰药房	615,682.00	21.51
17	002531	天顺风能	615,406.64	21.50
18	002035	华帝股份	615,203.00	21.50
19	300760	迈瑞医疗	613,856.00	21.45
20	601336	新华保险	612,972.00	21.42
21	000651	格力电器	612,341.00	21.40
22	300133	华策影视	611,396.00	21.36
23	001979	招商蛇口	610,845.00	21.34
24	600136	当代明诚	609,722.00	21.30
25	600073	上海梅林	609,561.77	21.30
26	000333	美的集团	608,489.00	21.26
27	601688	华泰证券	608,144.00	21.25
28	000063	中兴通讯	608,098.00	21.25
29	603018	中设集团	607,850.80	21.24
30	603026	石大胜华	607,114.00	21.21
31	600570	恒生电子	606,750.00	21.20
32	601933	永辉超市	606,198.00	21.18
33	600030	中信证券	606,105.00	21.18
34	601818	光大银行	605,572.00	21.16
35	002643	万润股份	605,161.00	21.14
36	601668	中国建筑	604,764.00	21.13
37	600276	恒瑞医药	604,572.00	21.12
38	000538	云南白药	604,538.00	21.12
39	002798	帝欧家居	604,132.00	21.11
40	601166	兴业银行	603,926.00	21.10
41	002229	鸿博股份	603,826.50	21.10
42	300261	雅本化学	603,759.00	21.10
43	300388	龙净环保	603,240.22	21.08
44	002353	杰瑞股份	602,361.00	21.05
45	000768	中航飞机	602,086.00	21.04
46	600104	上汽集团	598,626.00	20.92
47	002716	金贵银业	597,404.98	20.87
48	603886	元祖股份	597,004.00	20.86
49	300014	亿纬锂能	591,939.00	20.68
50	600547	山东黄金	588,683.00	20.57
51	603801	志邦家居	171,816.00	6.00
52	300525	博思软件	162,479.24	5.68
53	600383	金地集团	161,965.00	5.66
54	002422	科伦药业	161,461.00	5.64
55	603588	高能环境	159,911.00	5.59
56	000661	长春高新	153,250.00	5.35
57	603985	恒润股份	153,045.00	5.35
58	002717	岭南股份	127,336.50	4.45

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002124	天邦股份	884,177.56	30.89
2	600136	当代明诚	809,904.00	28.30
3	002371	北方华创	735,629.30	25.70
4	002531	天顺风能	678,252.00	23.70
5	603018	中设集团	673,132.48	23.52
6	000977	浪潮信息	661,543.04	23.11
7	002798	帝欧家居	651,665.22	22.77
8	300498	温氏股份	644,604.55	22.52
9	603160	汇顶科技	638,395.32	22.31
10	002035	华帝股份	629,523.00	22.00
11	603026	石大胜华	628,952.00	21.98
12	002643	万润股份	626,197.00	21.88
13	002230	科大讯飞	625,121.00	21.84
14	300133	华策影视	620,151.00	21.67
15	600388	龙净环保	617,577.42	21.58
16	000002	万科A	609,806.00	21.31
17	002229	鸿博股份	604,380.92	21.12
18	300012	华测检测	600,169.00	20.97
19	600547	山东黄金	595,228.00	20.80
20	601668	中国建筑	594,561.00	20.77
21	000538	云南白药	593,368.48	20.73
22	601933	永辉超市	592,901.00	20.72
23	300014	亿纬锂能	592,798.08	20.71
24	300760	迈瑞医疗	591,392.99	20.66
25	300261	雅本化学	589,585.30	20.60
26	300037	新宙邦	589,314.44	20.59
27	300146	汤臣倍健	589,025.28	20.58
28	000401	冀东水泥	588,929.00	20.58
29	300316	晶盛机电	586,378.72	20.49
30	601688	华泰证券	584,317.00	20.42
31	002353	杰瑞股份	581,537.94	20.32
32	601818	光大银行	580,655.08	20.29
33	002716	金贵银业	580,500.59	20.28
34	600073	上海梅林	580,190.65	20.27
35	601166	兴业银行	577,861.00	20.19
36	300400	劲拓股份	577,696.95	20.19
37	000768	中航飞机	575,883.56	20.12
38	600048	保利地产	575,244.20	20.10
39	603886	元祖股份	565,808.00	19.77
40	001979	招商蛇口	557,279.00	19.47
41	000651	格力电器	556,900.00	19.46
42	603939	益丰药房	553,951.00	19.36
43	002299	圣农发展	550,312.80	19.23
44	601336	新华保险	548,930.73	19.18
45	000333	美的集团	546,911.36	19.11
46	000063	中兴通讯	537,841.00	18.79
47	600030	中信证券	537,131.00	18.77
48	600570	恒生电子	531,313.53	18.56
49	600276	恒瑞医药	530,346.56	18.53
50	600104	上汽集团	489,722.14	17.11
51	603985	恒润股份	142,341.00	4.97
52	002717	岭南股份	130,741.00	4.57
53	603588	高能环境	110,162.00	3.85
54	600383	金地集团	108,836.00	3.80
55	002422	科伦药业	105,982.00	3.70
56	603801	志邦家居	104,510.00	3.65
57	000661	长春高新	91,629.71	3.20
58	300525	博思软件	80,066.00	2.80

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	31,883,682.15
卖出股票的收入（成交）总额	31,037,264.94

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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，本基金不参与国债期货交易。

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，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1报告期内本基金投资的恒生电子（600570）于2018年7月21日公告称，公司控股子公司恒生网络于2018年7月19日收到北京市西城区人民法院出具的《失信决定书》和《限制消费令》。截至2018年7月20日，恒生网络已缴付所涉罚没款人民币23,121,028.61元，尚未缴付人民币416,346,462.07元，目前恒生网络已无法正常持续运营，处于净资产不足以偿付《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（[2016]123号）所涉罚没款的状态。

对该证券的投资决策程序的说明：公司深耕金融IT市场，全产品线高市场占有率下，预收账款占营业收入的比重逐年提升。随着金融监管政策的日趋明朗，公司有望受益于沪伦通CDR、科创板、券商结算模式转换和MOM产品的推广等带来对金融IT的需求敞口。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、处罚的情况。

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	15,654.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	126.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,781.12

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	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
海富通研究精选混合A	40	24,129.00	0.00	0.00%	965,159.86	100.00%
海富通研究精选混合C	263	7,251.30	0.00	0.00%	1,907,093.20	100.00%
合计	303	9,479.38	0.00	0.00%	2,872,253.06	100.00%

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	海富通研究精选混合A	1,996.08	0.2068%
	海富通研究精选混合C	10,827.33	0.5677%
	合计	12,823.41	0.4465%

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	海富通研究精选混合A	0
	海富通研究精选混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通研究精选混合A	0
	海富通研究精选混合C	0
	合计	0

9开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通研究精选混合A	海富通研究精选混合C
基金合同生效日（2019年1月29日）基金份额总额	14,892,110.25	248,988,695.63
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	32,755.02	127,020.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	13,959,705.41	247,208,623.16
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	965,159.86	1,907,093.20

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

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。

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
中泰证券(原齐鲁)	2	43,498,118.56	69.13%	35,130.28	80.48%	-
申万宏源	2	18,363,867.56	29.19%	7,553.18	17.30%	-
方正证券	1	1,058,960.97	1.68%	965.00	2.21%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	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
中泰证券(原齐鲁)	-	-	305,000,000.00	49.07%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	316,500,000.00	50.93%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

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	序号	报告期内持有基金份额变化情况：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
个人	1	2019/03/13-2019/04/03	3,000,300.00	0.00	3,000,300.00	0.00	0.00%
个人	2	2019/04/29-2019/05/07	670,080.40	0.00	420,000.00	250,080.40	8.71%
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。							

注：本基金合同生效日为2019年1月29日，期初份额指基金合同生效日持有份额。

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