# 海富通内需热点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 | 海富通内需热点混合 |
| 基金主代码 | 519056 |
| 交易代码 | 519056 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年12月19日 |
| 报告期末基金份额总额 | 175,773,739.75份 |
| 投资目标 | 本基金将从受益于国家扩大内需促进经济发展政策的热点行业中,精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极投资,同时辅以适度的资产配置,力争实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等,对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控,在投资范围内确定相应大类资产配置比例;其次通过对受益于内需增长的热点行业及个股进行定量与定性相结合的分析,精选具有良好基本面和成长潜力的上市公司进行投资。 |
| 业绩比较基准 | MSCI中国A股指数×80%+上证国债指数×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高风险水平的投资品种。 |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§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 | 780,854.89 |
| 2.本期利润 | 19,817,727.87 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2118 |
| 4.期末基金资产净值 | 288,942,753.47 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.644 |

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。

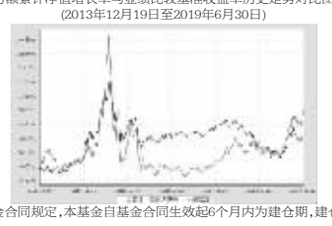
3.2 基金净值表现

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 | 7.94% | 1.91% | -1.67% | 1.25% | 9.61% | 0.66% |

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

海富通内需热点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
(2013年12月19日至2019年6月30日)



注: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、(五)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 | | |
| 黄峰 | 本基金的基金经理;海富通精选成长混合基金经理;海富通精选混合型基金经理。 | 2014-12-17 | - | 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部分析师,深圳九富投资顾问有限公司项目部员工,大连垠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成长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 管理人对投资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22.2%,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,本基金严格遵守既定框架,基本按计划操作。仓位略有波动,但始终保持在偏高水平以上,未刻意做仓位管理。结构上继续强化优质消费龙头资产的主导性配置比例。五一前后,分别因为龙头资产挖掘难度明显加大,以及投资大环境明显边际恶化,显著降低了确定性不强或者能力圈偏弱的尾部资产,结构上进一步向头部的消费龙头资产集中。

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,三季度本基金仍将恪守能力圈、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7.94%,同期业绩比较基准收益率为-1.67%,基金净值跑赢业绩比较基准9.61个百分点。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 263,274,324.72 | 86.99 |
| | 其中:股票 | 263,274,324.72 | 86.99 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 37,661,390.05 | 12.44 |
| 7 | 其他资产 | 1,703,487.96 | 0.56 |
| 8 | 合计 | 302,639,202.63 | 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 | 95,051.25 | 0.03 |
| C | 制造业 | 263,116,563.11 | 91.06 |
| 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 | 39,603.76 | 0.01 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 263,274,324.72 | 91.12 |

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 | 341,657 | 27,616,135.31 | 9.56 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 229,922 | 27,119,299.90 | 9.39 |
| 3 | 300014 | 亿纬锂能 | 878,100 | 26,746,926.00 | 9.26 |
| 4 | 600779 | 水井坊 | 524,500 | 26,655,090.00 | 9.23 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 26,998 | 26,566,032.00 | 9.19 |
| 6 | 300630 | 普利制药 | 415,158 | 23,921,403.96 | 8.28 |
| 7 | 000333 | 美的集团 | 457,761 | 23,739,485.46 | 8.22 |
| 8 | 000596 | 古井贡酒 | 175,826 | 20,837,139.26 | 7.21 |
| 9 | 002304 | 洋河股份 | 108,900 | 13,237,884.00 | 4.58 |
| 10 | 600521 | 华海药业 | 887,600 | 12,515,160.00 | 4.33 |

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的。

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、处罚的情况。

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 | 67,080.59 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,136,858.40 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,256.87 |
| 5 | 应收申购款 | 488,292.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,703,487.96 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中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 | 57,050,035.98 |
| 本报告期基金总申购份额 | 150,009,039.40 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 31,285,335.63 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 175,773,739.75 |

§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

| 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 | 2019/6/20-2019/06/30 | - | 65,145,928.34 | - | 65,145,928.34 | 37.06% |

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内需热点混合型证券投资基金的文件
(二)海富通内需热点混合型证券投资基金基金合同
(三)海富通内需热点混合型证券投资基金招募说明书
(四)海富通内需热点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)报告期内海富通内需热点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

# 海富通双福债券型证券投资基金

## 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 | 海富通双福债券 |
| 基金主代码 | 519059 |
| 交易代码 | 519059 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年5月6日 |
| 报告期末基金份额总额 | 6,788,764.67份 |
| 投资目标 | 本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上,积极把握信用类债券的投资机会,力求获得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,对债券类资产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 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 |
| 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 | -111,579.28 |
| 2.本期利润 | -100,146.89 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0207 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,536,364.13 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.816 |

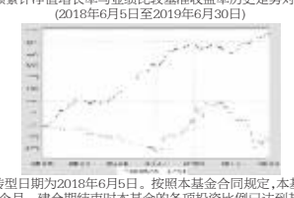
3.2 基金净值表现

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 | -2.63% | 0.17% | 0.63% | 0.06% | -3.26% | 0.11% |

3.2.2 自基金转型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

海富通双福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
(2018年6月5日至2019年6月30日)



注:本基金转型日期为2018年6月5日。按照本基金合同规定,本基金建仓期为自基金合同生效起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分(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 | | |
| 何谦 | 本基金的基金经理;海富通纯债债券基金经理;海富通货币基金经理;海富通聚丰纯债债券基金经理;海富通添益货币基金经理;海富通聚益纯债债券基金经理。 | 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月起兼任海富通聚利债券基金经理。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 管理人对投资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

二季度债券收益率呈现先上后下的走势。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月利率的单边上行。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;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。信用债方面,二季度短期信用债收益率略有上行,中长期收益率小幅震荡,信用利差有所收窄。但值得注意的是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,信用分化较为明显,中低等级净融资额占比较低,其信用利差绝对值处于历史较高水平。可转债方面,二季度转债市场单边下行后开启震荡走势,与股市先抑后平表现一致,中证转债指数季度下跌3.56%。

二季度,本基金组合规模较小,以保持类现金操作为主。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-2.63%,同期业绩比较基准收益率为0.63%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期,本基金均存在基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本基金自2018年6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。基金管理人于2019年6月4日至2019年7月1日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议通过了《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据持有人大会通过的议案及方案说明,本基金于2019年7月4日起正式转型为海富通可转债优选债券型证券投资基金。

§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 | 固定收益投资 | 4,466,060.00 | 80.20 |
| | 其中:债券 | 4,466,060.00 | 80.20 |
| | 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 | 1,059,885.67 | 19.03 |
| 7 | 其他资产 | 42,397.43 | 0.76 |
| 8 | 合计 | 5,568,343.10 | 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 | 4,980,001.25 | 1.96 |
| C | 制造业 | 26,980,098.46 | 10.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,762,490.00 | 0.67 |
| E | 建筑业 | 6,025,050.00 | 2.37 |
| F | 批发和零售业 | 184,068.00 | 0.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 607,572.00 | 0.24 |
| H | 住宿和餐饮业 | 453,096.00 | 0.18 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,884,776.76 | 1.14 |
| J | 金融业 | 20,917,350.00 | 8.24 |
| K | 房地产业 | 6,819,985.00 | 2.69 |
| L | 租赁和商务服务业 | 53,396.00 | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,103,722.40 | 1.22 |
| 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 | 2,093,926.00 | 0.82 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 76,805,522.87 | 30.24 |

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 | 601318 | 中国平安 | 60,300 | 5,343,183.00 | 2.10 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 742,200 | 4,371,558.00 | 1.72 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 4,100 | 4,034,400.00 | 1.59 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 217,700 | 3,981,733.00 | 1.57 |
| 5 | 601668 | 中国建筑 | 691,000 | 3,398,250.00 | 1.34 |
| 6 | 600332 | 白云山 | 76,800 | 3,146,496.00 | 1.24 |
| 7 | 600259 | 广晟有色 | 35,500 | 3,077,140.00 | 1.21 |
| 8 | 601186 | 中国铁建 | 264,000 | 2,626,800.00 | 1.03 |
| 9 | 600406 | 国电南瑞 | 134,300 | 2,503,352.00 | 0.99 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 179,500 | 2,290,420.00 | 0.90 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 2,647,880.00 | 47.83 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,818,180.00 | 32.84 |
| | 其中:政策性金融债 | 1,818,180.00 | 32.84 |
| 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 | 4,466,060.00 | 80.67 |

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 | 26,500 | 2,647,880.00 | 47.83 |
| 2 | 108602 | 国开1704 | 18,000 | 1,818,180.00 | 32.84 |

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,本基金不参与国债期货交易。

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 | 1,642,351.63 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,437,788.65 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 747.09 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,080,887.37 |

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 | 110034 | 九州转债 | 409,920.00 | 0.16 |
| 2 | 113014 | 林洋转债 | 47,850.00 | 0.02 |
| 3 | 113020 | 桐昆转债 | 29,705.00 | 0.01 |
| 4 | 113522 | 旭升转债 | 207,600.00 | 0.08 |
| 5 | 132004 | 15国盛EB | 3,862,376.00 | 1.52 |
| 6 | 132006 | 16皖新EB | 209,360.00 | 0.08 |
| 7 | 132007 | 16凤凰EB | 197,800.00 | 0.08 |
| 8 | 132011 | 17新报EB | 1,010,080.00 | 0.40 |
| 9 | 132013 | 17宝武EB | 3,778,731.40 | 1.49 |
| 10 | 132015 | 18中油EB | 522,732.60 | 0.21 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中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 | 4,165,219.27 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,647,945.62 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,024,400.22 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 6,788,764.67 |

§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

| 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 | 2019/05/23-2019/06/30 | - | 1,823,905.56 | - | 1,823,905.56 | 26.87% |
| | 2 | 2019/05/23-2019/06/30 | - | 1,823,905.56 | - | 1,823,905.56 | 26.87% |
| 个人 | 1 | 2019/04/30-2019/05/27 | 659,224.62 | - | - | 659,224.62 | 9.71% |
| 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:<br>1、当基金份额持有人