

**海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金**  
**2019 年第 1 季度报告**  
**2019 年 3 月 31 日**

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：二〇一九年四月二十日

## §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 4 月 19 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                 |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 海富通阿尔法对冲混合                                                                                                      |
| 基金主代码      | 519062                                                                                                          |
| 交易代码       | 519062                                                                                                          |
| 基金运作方式     | 契约型、发起式、开放式                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2014 年 11 月 20 日                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 1,136,674,237.93 份                                                                                              |
| 投资目标       | 本基金通过灵活的投资策略，捕捉市场中的绝对收益机会，并且采用有效的风险管理措施，降低波动风险的同时，获取稳定的收益。                                                      |
| 投资策略       | 本基金将主要通过阿尔法对冲等绝对收益策略，实现组合的稳定收益。同时本基金也根据市场环境的变化，灵活运用其他绝对收益策略，提高资金利用效率。                                           |
| 业绩比较基准     | 三年期银行定期存款利率（税后）                                                                                                 |
| 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，属于中等风险水平的投资品种。<br>本基金通过多种绝对收益策略剥离市场系统风险，因此与一般的混合型基金相比，本基金的预期风险更小。 |

|       |             |
|-------|-------------|
| 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<br>(2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日) |
|----------------|-----------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | -54,756,795.38                          |
| 2.本期利润         | 31,597,169.37                           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0303                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 1,404,455,374.68                        |
| 5.期末基金份额净值     | 1.236                                   |

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

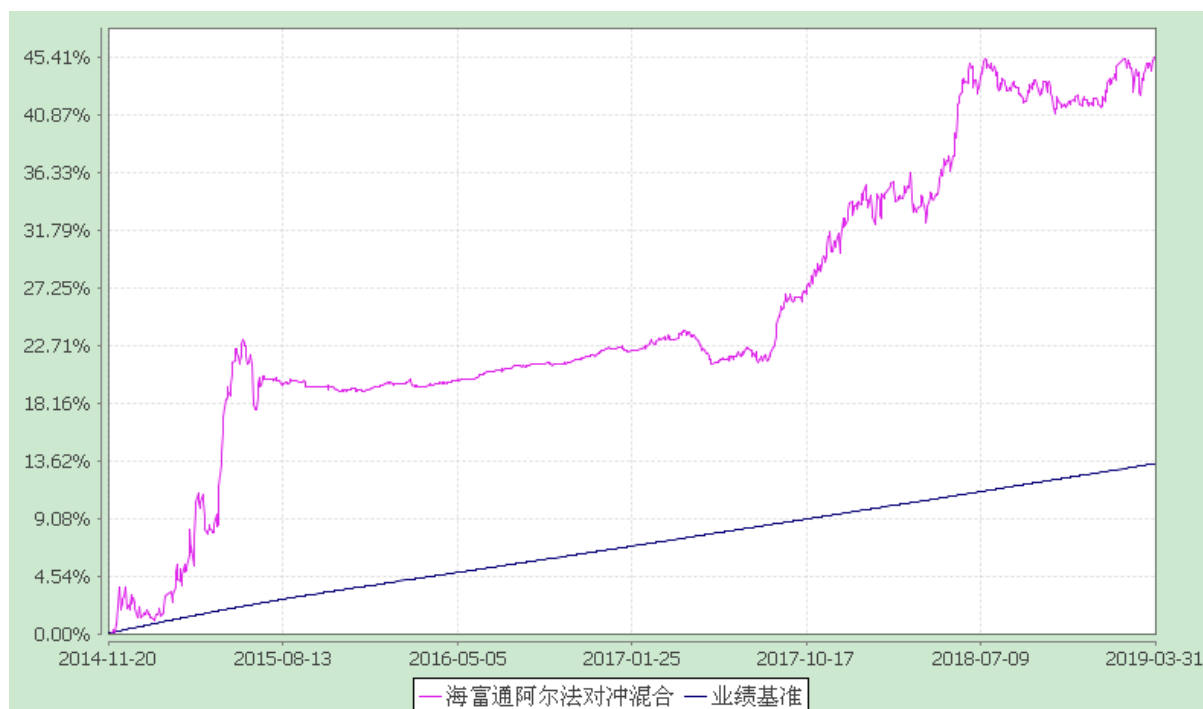
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 2.32%  | 0.34%     | 0.67%      | 0.01%         | 1.65% | 0.33% |

##### 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

海富通阿尔法对冲混合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  
 (2014 年 11 月 20 日至 2019 年 3 月 31 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、（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 |        |                                                                                                                                                    |
| 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 | 2018-04-09  | -    | 18 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 |

|  |                                                                                                 |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 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；海富通创业板增强基金经理；海富通量化先锋股票基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通欣享混合基 |  |  |  | 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、海富通量化先锋股票、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。 |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |                                        |            |   |      |                                                                                                                                               |
|-----|----------------------------------------|------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 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；量化投资部总监 |            |   |      |                                                                                                                                               |
| 朱斌全 | 本基金的基金经理                               | 2018-11-30 | - | 11 年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。 |

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合规守信情况的说明

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 年一季度整体市场出现了大幅反弹。截至 2019 年 3 月 29 日，上证综指收于 3090.76 点，上涨 23.93%，深证成指收于 9906.86 点，涨幅为 36.84%。中小板指收于 6379.98 点，上涨 35.66%，创业板上涨 35.43%，报 1693.55 点。

具体来看，元旦假期之后市场风险偏好依旧较低，延续了去年底的阴跌态势。但从 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 月份之后，随着困扰 2018 年的几大利空因素的缓解：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，同时叠加 1 月份社融数据大幅超预期（有春节因素）、部分传统经济领域的数据超预期，大家对宏观经济下滑的担忧被打消了很多，市场做多热情被点燃。2 月份上证综指涨幅达到 13.79%，单月涨幅居 2015 年牛市以来新高。板块上看，TMT 等科技板块受市场热捧，申万电子、计算机、通信、传媒指数当月涨幅均超过 25%。同时随着 2 月末市场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。同时随着行情持续演绎，一些景气度反转的板块备受青睐，例如猪鸡产业链、光伏、科创板（半导体、边缘计算等）、传统工程机械板块、消费品（高端白酒）等，也走出了很强的独立行情。

行业方面，在申万 28 个一级行业分类中，一季度板块几乎都有不错表现。其中计算机（48.46%）、农林牧渔（48.42%）、食品饮料（43.58%）、非银（42.65%）、电子（41.06%）涨幅排名前五，且涨幅都超过了 40%；而银行（16.85%）、公用事业（17.80%）、建筑装饰（18.3%）涨幅相对靠后。

本报告期，本基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

下一季度，本基金的股票现货投资将遵循长期有效的市场因子，主要投资于估值与

成长性匹配，资产负债表健康的高质量个股，均衡配置，追求长期稳定的超额收益，并通过股指期货对冲将超额收益转化为绝对收益。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通阿尔法净值增长率为 2.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.65 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              | 952,206,490.70   | 67.55        |
|    | 其中：股票             | 952,206,490.70   | 67.55        |
| 2  | 固定收益投资            | 122,594,761.17   | 8.70         |
|    | 其中：债券             | 122,594,761.17   | 8.70         |
|    | 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          | 20,000,000.00    | 1.42         |
|    | 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      | 207,190,254.58   | 14.70        |
| 7  | 其他资产              | 107,738,577.82   | 7.64         |
| 8  | 合计                | 1,409,730,084.27 | 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         | 2,339,364.00   | 0.17  |
| B | 采矿业              | 24,332,790.05  | 1.73  |
| C | 制造业              | 473,228,840.48 | 33.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,902,110.36   | 0.28  |
| E | 建筑业              | 39,485,737.20  | 2.81  |
| F | 批发和零售业           | 27,549,779.40  | 1.96  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 28,090,516.45  | 2.00  |
| H | 住宿和餐饮业           | 1,852,739.90   | 0.13  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 35,270,208.33  | 2.51  |
| J | 金融业              | 229,671,878.77 | 16.35 |
| K | 房地产业             | 43,570,259.92  | 3.10  |
| L | 租赁和商务服务业         | 8,761,776.00   | 0.62  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 10,981,534.84  | 0.78  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 3,333,600.00   | 0.24  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 2,380,000.00   | 0.17  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 17,363,155.00  | 1.24  |
| S | 综合               | 92,200.00      | 0.01  |
|   | 合计               | 952,206,490.70 | 67.80 |

### 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 | 1,087,502 | 83,846,404.20 | 5.97         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 2  | 600036 | 招商银行 | 2,000,076 | 67,842,577.92 | 4.83 |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 53,899    | 46,029,207.01 | 3.28 |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 448,094   | 21,154,517.74 | 1.51 |
| 5  | 600196 | 复星医药 | 638,017   | 19,000,146.26 | 1.35 |
| 6  | 000002 | 万科 A | 610,000   | 18,739,200.00 | 1.33 |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 750,000   | 18,585,000.00 | 1.32 |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 629,938   | 18,337,495.18 | 1.31 |
| 9  | 600585 | 海螺水泥 | 470,061   | 17,946,928.98 | 1.28 |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 270,440   | 17,692,184.80 | 1.26 |

#### 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      | 22,608,156.40  | 1.61         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 45,100,509.60  | 3.21         |
|    | 其中：政策性金融债 | 45,100,509.60  | 3.21         |
| 4  | 企业债券      | 25,638,165.70  | 1.83         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 29,247,929.47  | 2.08         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 122,594,761.17 | 8.73         |

#### 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  | 018005 | 国开 1701  | 450,960 | 45,100,509.60 | 3.21         |
| 2  | 019537 | 16 国债 09 | 130,270 | 13,027,000.00 | 0.93         |
| 3  | 143496 | 18 沪资 01 | 100,000 | 10,361,000.00 | 0.74         |
| 4  | 143091 | 17 华资 01 | 100,000 | 10,193,000.00 | 0.73         |

|   |        |          |        |              |      |
|---|--------|----------|--------|--------------|------|
| 5 | 019611 | 19 国债 01 | 84,840 | 8,480,606.40 | 0.60 |
|---|--------|----------|--------|--------------|------|

## 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

| 代码                | 名称     | 持仓量     | 合约市值<br>(元)     | 公允价值变<br>动(元)  | 风险说明            |
|-------------------|--------|---------|-----------------|----------------|-----------------|
| IF1904            | IF1904 | -46.00  | -53,510,880.00  | -1,559,304.00  | -               |
| IF1906            | IF1906 | -514.00 | -596,877,360.00 | -18,466,860.00 | -               |
| IH1906            | IH1906 | -180.00 | -153,360,000.00 | -2,339,160.00  | -               |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |         |                 |                | -22,365,324.00  |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |         |                 |                | -106,120,643.09 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |         |                 |                | -69,614,636.91  |

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金利用股指期货与股票现货组合之间进行对冲，并通过量化模型，构建市场中性阿尔法股票组合，同时采用安全有效的风险监控，在降低套利风险的同时，力争为投资者获取超额稳定的收益。

本基金投资于股指期货，通过对冲功能剥离股票现货部分的系统性风险，符合既定投资政策及投资目标。

## 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，本基金暂不投资国债期货。

### 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，本基金暂不投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的中信证券（600030）于2018年5月22日公告称，公司作为宁夏宝丰能源集团股份有限公司首次公开发行股票并上市的保荐机构，未勤勉尽责、缺少必要的职业审慎，存在对申报项目把关不严的问题；黄XXX、曾XXX在担任宁夏宝丰能源集团股份有限公司首次公开发行股票并上市保荐代表人的过程中，未勤勉尽责、缺少必要的职业审慎，存在对申报项目把关不严的问题，中国证监会对公司及相关保荐代表人出具行政监管措施决定书。

对该证券的投资决策程序的说明：公司投行实力领先，股债承销规模居行业第一；经纪业务市占率稳中有升，兼顾机构服务与转型发展；衍生品业务保持领先，海外业务表现优异。19年随着收购广州证券事项逐步推进，以及受益于金融供给侧改革以及科创板落地，公司综合实力有望持续提升。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。

报告期内本基金投资的招商银行（600036）因存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等违规行为，于2018年5月4日受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，罚没合计6573.024万元。

对该证券的投资决策程序的说明：公司基本面持续优秀，盈利增速领先股份行；净利息收入增速进一步提升，息差同比大幅提升；结构优化，不良率下行。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。

其余八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   | 80,885,514.70  |
| 2  | 应收证券清算款 | 21,503,599.03  |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 2,672,174.77   |
| 5  | 应收申购款   | 2,677,289.32   |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 107,738,577.82 |

#### 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  | 132004 | 15 国盛 EB | 5,370,050.20 | 0.38         |
| 2  | 120001 | 16 以岭 EB | 2,431,613.20 | 0.17         |
| 3  | 132006 | 16 皖新 EB | 1,838,144.00 | 0.13         |
| 4  | 132007 | 16 凤凰 EB | 1,754,983.50 | 0.12         |
| 5  | 110045 | 海澜转债     | 1,051,892.00 | 0.07         |
| 6  | 110034 | 九州转债     | 938,570.00   | 0.07         |
| 7  | 113019 | 玲珑转债     | 779,493.00   | 0.06         |
| 8  | 113011 | 光大转债     | 689,220.00   | 0.05         |
| 9  | 110041 | 蒙电转债     | 613,277.00   | 0.04         |
| 10 | 113017 | 吉视转债     | 582,216.40   | 0.04         |
| 11 | 110033 | 国贸转债     | 517,230.00   | 0.04         |
| 12 | 132012 | 17 巨化 EB | 514,500.80   | 0.04         |
| 13 | 113504 | 艾华转债     | 512,910.00   | 0.04         |
| 14 | 123003 | 蓝思转债     | 511,117.74   | 0.04         |
| 15 | 113014 | 林洋转债     | 509,618.60   | 0.04         |
| 16 | 132011 | 17 浙报 EB | 499,140.00   | 0.04         |
| 17 | 128010 | 顺昌转债     | 469,215.00   | 0.03         |

|    |        |          |            |      |
|----|--------|----------|------------|------|
| 18 | 128044 | 岭南转债     | 451,573.76 | 0.03 |
| 19 | 113515 | 高能转债     | 397,110.00 | 0.03 |
| 20 | 128020 | 水晶转债     | 335,850.00 | 0.02 |
| 21 | 113505 | 杭电转债     | 323,610.00 | 0.02 |
| 22 | 113016 | 小康转债     | 320,490.00 | 0.02 |
| 23 | 128037 | 岩土转债     | 292,337.05 | 0.02 |
| 24 | 123004 | 铁汉转债     | 235,180.00 | 0.02 |
| 25 | 128045 | 机电转债     | 234,840.00 | 0.02 |
| 26 | 128018 | 时达转债     | 213,680.00 | 0.02 |
| 27 | 132015 | 18 中油 EB | 202,949.40 | 0.01 |
| 28 | 128019 | 久立转 2    | 183,817.20 | 0.01 |
| 29 | 128021 | 兄弟转债     | 178,545.00 | 0.01 |
| 30 | 128017 | 金禾转债     | 161,160.00 | 0.01 |
| 31 | 123002 | 国祯转债     | 138,831.80 | 0.01 |
| 32 | 110042 | 航电转债     | 123,050.00 | 0.01 |
| 33 | 113518 | 顾家转债     | 122,830.00 | 0.01 |
| 34 | 113508 | 新风转债     | 106,630.00 | 0.01 |
| 35 | 113517 | 曙光转债     | 62,615.00  | 0.00 |
| 36 | 113015 | 隆基转债     | 61,240.00  | 0.00 |
| 37 | 128028 | 赣锋转债     | 42,340.00  | 0.00 |

#### 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。

### 86 开放式基金份额变动

单位：份

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 1,024,993,285.55 |
| 本报告期基金总申购份额   | 571,148,526.69   |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 459,467,574.31   |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 1,136,674,237.93 |

## §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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金总计1000.10万元认购了本基金，其中，发起资金总计人民币1000万元，认购费用为人民币1000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。截至2017年11月20日，发起份额承诺持有期限已经届满。2017年12月公司赎回所有份额。截止报告期末，公司未持有本基金份额。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 68 只公募基金。截至 2019 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 730 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 3 月 31 日，海外业务规模超过 24 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 3 月 31 日，海富通为近 80 家企业超过 428 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 3 月 31 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约 380 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，中国证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。

## **§10 备查文件目录**

### **10.1 备查文件目录**

- （一）中国证监会批准设立海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的文件
- （二）海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同
- （三）海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金招募说明书
- （四）海富通阿尔法对冲混合型发起式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）报告期内海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### **10.2 存放地点**

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

### **10.3 查阅方式**

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇一九年四月二十日