

# 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019 年第 1 号)

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

重要提示

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金经 2014 年 8 月 28 日中国证券监督管理委员会证监许可

【2014】895 号文准予注册募集。本基金的基金合同于 2014 年 11 月 20 日正式生效。本基金类型为契约型、开放

式、发起式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，

其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其

他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不

保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判

断基金的投资价值，自主做出投资决策。

本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 5 月 20 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

第一部分基金管理人

一、基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：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

办公地址：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

法定代表人：杨仓兵

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

注册资本：3 亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、法国巴黎资产管理 BE 控股公司 49%。

二、主要人员情况

杨仓兵先生，董事长。历任安徽省农业科学院计财科副科长，安徽示康药业有限公司财务部经理，海通证券

有限公司计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理，上海海振实业发展有限公司总

经理，海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自 2015 年 10 月至 2019 年 3 月任海通证券股份有限公

司资金

管理总部总经理。2016年10月起兼任海通证券资产管理有限公司董事。2018年5月至2019年3月兼任海富通基金

管理有限公司监事长。2019年3月至2019年4月任海富通基金管理有限公司董事。2019年4月起任海富通基金

管理有限公司董事长。

任志强先生，董事，总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所

综合管理部副经理，华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资有限

责任公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经

理、投资总监、副总经理，华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长。2017年6月加入海富通基金管理有限公

司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公

司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。2019年2月起兼任海富通资产管理

（香港）有限公司董事长。

吴淑琨先生，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所

长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公

司战略发展部总经理。

芮政先先生，董事，理学学士。历任上海警备区教导大队训练处教员，上海社会科学院人口与发展研究所助

理研究员，海通证券有限责任公司监察室专务、二科副科长，海通证券股份有限公司人力资源开发部劳资科科

长、干部科科长、总经理助理兼干部科科长，海通证券股份有限公司人力资源部总经理助理。2008年10月起担任

海通开元投资有限公司监事。2014年11月起至今任海通证券股份有限公司人力资源部副总经理，2015年11月

起兼任海通证券股份有限公司纪委委员，2016年11月起兼任海通创新资本管理有限公司董事。2017年12月起

兼任海通证券股份有限公司监事。

Ligia4 Torres（陶乐斯）女士，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银

行和欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部

英国地区首席执行官，2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013年7月至今任法国巴黎资

产管理公司亚太区CEO。

Alexandre4Werno(韦历山)先生，董事，法国籍，金融硕士学位。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银

行全球市场部任执行董事、中国业务开发负责人职务；2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限

公司总经理高级顾问、常务副总经理职务；2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作

总监。

张馨先生，独立董事，博士。历任厦门大学经济学院财金系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学

经济学院院长。2011年1月至今退休。

杨文斌(Philip4 YOUNG4 Wen4 Binn)4先生，独立董事，管理学硕士(MBA)。历任美国大陆银行(芝加哥，台北)放贷经理，中华开发金控(台湾)资本市场经理，国际投资信托(台湾)执行副总经理，美银信托(香港)

副总经理，日本野村资产管理(香港)投资总监，安泰人寿大中华地区投资总监，日本万通人寿投资总监及常务

董事，中国平安保险集团资产管理公司投资总监。2006年7月至2009年4月任中国太平洋人寿保险股份有限公司

与中国太平洋(集团)股份有限公司投资总监。2009年4月至2012年11月任太平洋资产管理有限公司投资总

监。

刘正东先生，独立董事，法律硕士。历任上海市人民检察院铁路运输分院助理检察员，上海市虹桥律师事务

所律师。1998年11月至2018年6月任上海市君悦律师事务所主任、高级合伙人。2018年6月起至今任上海市君悦

律师事务所首席合伙人、合伙人会议主席。

陈静女士，独立董事，硕士。历任中国海洋石油总公司财务部干部，中外运-敦豪有限公司财务部经理，华盛

顿普华会计师事务所(现普华永道)审计师，世界银行集团华盛顿总部高级会计官员、高级金融官员，中国证监

会规划委高级顾问委员兼会计部副主任，中国投资有限责任公司财务部副总监、董事总经理。2014年5月起至今

任瑞士合众集团中国董事会成员。

曹志刚先生，监事长，经济学硕士。历任海通证券股份有限公司风险控制总部(稽核部)二级部经理、稽核部

总经理助理，自2018年3月至今任稽核部副总经理。2016年11月起至今任海通吉禾股权投资基金管理有限

公司和海通创意资本管理有限公司监事。

Bruno4 Weil(魏海诺)先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国

巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行

任法国巴黎银行集团(中国)副董事长。

俞涛先生，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理(英国)有限公司。曾任

上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月加入海富通基金管理有限公司，历任产品与创新总

监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

胡正万先生，监事，硕士。先后就职于成都机车车辆厂、四川省证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。

2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任基金会计、高级注册登记专员、注册登记负责人、基金运营副总

监。2015年7月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

奚万荣先生，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理

助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理

有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

陶网雄先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海

通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至2006年4月任公司财务

部负责人，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起兼任上

海富诚海富通资产管理有限公司董事。

何树方先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加

入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

杜晓海先生，硕士。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。2019年6月起兼任海富通研究精选混合基金经理。

朱斌全先生，理学硕士，CFA。2005年7月至2006年8月任上海涅柔斯投资管理有限公司美国股票交易员。

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、量化投资部投资经理、基金经

理助理。2018年11月起任海富通阿尔法对冲混合的基金经理。

本基金历任基金经理为：陈甄璞先生，任职时间为2014年11月至2018年5月。

投资决策委员会常设委员有任志强，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；孙海忠，总经理助理

兼固定收益投资总监；杜晓海，量化投资部总监；王金祥，研究部总监；陈轶平，固定收益投资副总监；赵赫，年金

权益投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】244号

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：（010）66594942

## 第三部分相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

住所：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

办公地址：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

法定代表人：杨仓兵

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

联系人：暴潇菡

电话：021-38650797

传真：021-33830160

#### 2、销售机构

##### （1）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：陈四清

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

客户服务电话：95566

联系人：陈洪源

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

##### （2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：田国立

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

客户服务电话：95533

联系人：王嘉朔

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

##### （3）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：陈四清

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

客户服务电话：95588

联系人：陈实

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(4) 平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

客户服务电话：95511-3

联系人：赵杨

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(5) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

办公地址：上海市中山东一路 12 号

客户服务电话：95528

联系人：周志杰

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(6) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

办公地址：上海市静安区江宁路 1684 号

客户服务电话：95561

联系人：陈晓

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(7) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

办公地址：江苏省常州市和平中路 413 号

客户服务电话：0519-96005

联系人：包静

网址：[www.jnbank.com.cn](http://www.jnbank.com.cn)

(8) 招商银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

办公地址：广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

客户服务电话：95555

联系人：邓炯鹏

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(9) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

客户服务电话：95559

联系人：王菁

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(10) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

客户服务电话：95558

联系人：王晓琳

网址：[www.citicbank.com](http://www.citicbank.com)

(11) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

客户服务电话：95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(12) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

客户服务电话：95521

联系人：朱雅葳

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(13) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人：李新华

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

客户服务电话：95579 或 4008888999

联系人：奚博宇

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(14) 长城证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：曹宏

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

客户服务电话：4006666888

联系人：金夏

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(15) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：蔡一兵

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

客户服务电话：95317 或 4008835316

联系人：郭静

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

(16) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

办公地址：长春市生态大街 6666 号

客户服务电话：95360

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

(17) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：刘世安

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

客户服务电话：95511 转 8

联系人：周驰

网址：stock.pingan.com

(18) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

客户服务电话：010-66045678

联系人：谭磊

网址：jjin.txsec.com

(19) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

客户服务电话：4008209898

联系人：刘闻川

网址：www.cnhbstock.com

(20) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

客户服务电话：95321

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

(21) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

客户服务电话：95548

联系人：王一通

网址：www.cs.ecitic.com

(22) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：姜晓林

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

客户服务电话：95548

联系人：刘晓明

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(23) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

客户服务电话：95584

联系人：谢国梅

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(24) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏拉萨市北京中路 101 号

法定代表人：陈宏

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

客户服务电话：95357

联系人：付佳

网址：[www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

(25) 财达证券有限责任公司

注册地址：石家庄市自强路 35 号

法定代表人：翟建强

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23-26 层

客户服务电话：4006128888

联系人：李卓颖

网址：[www.s10000.com](http://www.s10000.com)

(26) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

法定代表人：李长伟

办公地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

客户服务电话：95397

联系人：王婧

网址：[www.tpyzq.com](http://www.tpyzq.com)

(27) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

客户服务电话：95325 或 4008608866

联系人：袁伟涛、曹新

网址：[www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

(28) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层

公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）

联系人：王少立

网址：[www.cicc.com](http://www.cicc.com)

(29) 华金证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：宋卫东

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

客户服务电话：4008211357

联系人：郑媛

网址：[www.huajinsc.cn](http://www.huajinsc.cn)

(30) 中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

客户服务电话：4009908826

联系人：刘宏莹

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

(31) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

法定代表人：余磊

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

客户服务电话：93391 或 4008005000

联系人：岑妹妹

网址：[www.tfzq.com](http://www.tfzq.com)

(32) 宏信证券有限责任公司

注册地址：成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

办公地址：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

客户服务电话：4008366366

联系人：张鋈

网址：[www.hxzq.cn](http://www.hxzq.cn)

(33) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

客户服务电话：4008001001

联系人：陈剑虹

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(34) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

客户服务电话：95525

联系人：姚巍

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(35) 华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：李晓安

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

客户服务电话：95368

联系人：范坤

网址：[www.hlzq.com](http://www.hlzq.com)

(36) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

客户服务电话：95538

联系人：许曼华

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(37) 大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市城区迎宾街 15 路桐城中央 21 层

法定代表人：董祥

办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心 12 层

客户服务电话：4007121212

联系人：薛津

网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

(38) 首创证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人：毕劲松

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

客户服务电话：4006200620

联系人：邢飞

网址：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)

(39) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

客户服务电话：95551 或 4008888888

联系人：辛国政

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(40) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：姜昧军

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

客户服务电话：4008323000

联系人：王雯

网址：[www.csco.com.cn](http://www.csco.com.cn)

(41) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

客户服务电话：95587 或 4008888108

联系人：许梦园

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(42) 中天证券股份有限公司

注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人：马功勋

办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

客户服务电话：95346

联系人：孙丹华

网址：[www.iztzq.com](http://www.iztzq.com)

(43) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：赵俊

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

客户服务电话：95531 或 4008888588

联系人：王一彦

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(44) 财通证券股份有限公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 室

法定代表人：陆建强

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716

客户服务电话：95336 或 4008696336

联系人：陶志华

网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

(45) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

客户服务电话：4008188118

联系人：黄静

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

(46) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

客户服务电话：95310

联系人：刘婧漪、贾鹏

网址：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

(47) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

客户服务电话：95565

联系人：黄婵君

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(48) 国融证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼

法定代表人：张智河

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层

客户服务电话：95385

联系人：叶密林

网址：[www.grzq.com](http://www.grzq.com)

(49) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人：刘学民

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

客户服务电话：95358

联系人：李晓伟

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(50) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16层--18层

法定代表人：冯鹤年

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

客户服务电话：95376

联系人：韩秀萍

网址：[www.msyz.com](http://www.msyz.com)

(51) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

法定代表人：周易

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

客户服务电话：95597

联系人：马艺卿

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(52) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

客户服务电话：95536

联系人：周杨网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(53) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室

法定代表人：刘建武

办公地址：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室

客户服务电话：95582

联系人：梁承华

网址：[www.west95582.com](http://www.west95582.com)

(54) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

客户服务电话：4006-788-887

联系人：童彩平

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(55) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人：陈柏青

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

客户服务电话：4000-766-123

联系人：李雁雯

网址：蚂蚁财富 APP

(56) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

联系人：单丙焯

客服电话：400-820-2899

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(57) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

法定代表人：其实

地址：上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路 88 号金座 26 楼

客户服务电话：400-1818-188

联系人：王超

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(58) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

法定代表人：王莉

地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

客户服务电话：400-920-0022

联系人：刘洋

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(59) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 32 层 3201 内 3212、3211 单元

法定代表人：闫振杰

地址：北京顺义区后沙峪镇安富街 6 号

客户服务电话：400-818-000

联系人：马林

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(60) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

法定代表人：凌顺平

地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

客户服务电话：0571-889208974、4008-773-772

联系人：董一峰

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(61) 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

法定代表人：李招弟

地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内

客户服务电话：400-876-9988

联系人：付少帅

网址：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(62) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

法定代表人：陈操

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006室

联系人：文雯

客户服务电话：400-850-7771

网站：<http://www.bdcgw.cn>

(63) 一路财富(北京)基金销售股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

法定代表人：吴雪秀

地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702

联系人：徐越

客服电话：400-001-1566

网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(64) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

法定代表人：燕斌

地址：中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

联系人：陈东

客服电话：400-118-1188

网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

(65) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

法定代表人：杨文斌

地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

客户服务电话：400-700-9665

联系人：陆敏

网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

(66) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

法定代表人：罗细安

地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

联系人：史丽丽

客服电话：400-001-8811

网址：[shill@zcvc.com.cn](mailto:shill@zcvc.com.cn)

(67) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

法定代表人：冯修敏

地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

客服电话：400-820-2819

联系人：刘洋

网址：<http://www.chinapnr.com/>

(68) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

法定代表人：赵学军

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

客服电话：400-021-8850

联系人：余永键

网址：<http://www.harvestwm.cn/>

(69) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

客服电话：400-6411-999

联系人：张晓辉

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

(70) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

客服电话：020-89629066

联系人：吴煜浩

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(71) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

客服电话：4008-980-618

联系人：王海焯

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(72) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

客服电话：400-618-0707

联系人：陈铭洲

网址：<https://www.hongdian.com>

(73) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人: 郭坚

地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

客服电话: 40084 66664 18

联系人: 程晨

网址: <https://www.lu.com>

(74) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人: 沈伟桦

地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

客服电话: 400-6099-200

联系人: 刘梦轩

网址: <http://www.yixinfund.com/>

(75) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人: 陈继武

地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

客服电话: 4000-178-000

联系人: 王哲宇

网址: [www.vstonewealth.com](http://www.vstonewealth.com)

(76) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人: 彭运年

地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

客服电话: 4008-909-998

联系人: 王莅晨

网址: <http://www.jnlc.com/>

(77) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位

法定代表人: 齐小贺

地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

客服电话: 0755-83999907

联系人: 刘娜

网址: <http://www.fujiwealth.cn>

(78) 奕丰基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人: TAN4 YIK4 KUAN

地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

客服电话: 400-684-0500

联系人: 叶健

网址: [www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(79) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：李兴春

地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

客服电话：400-921-7755

联系人：徐鹏

网址：<http://www.leadbank.com.cn>

(80) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：申健

地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 楼

客服电话：021-20219931

联系人：施燕华

网址：<https://www.gw.com.cn>

(81) 北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人：齐剑辉

地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 楼浦项中心 B 座 19 层

客服电话：400-623-6060

联系人：崔丁元

网址：<https://www.niuniufund.com/>

(82) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人：王伟刚

地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

客服电话：400-619-9059

联系人：丁向坤

网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(83) 深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：顾敏

地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

客服电话：400-999-9900

联系人：罗曦

网址：[www.webank.com](http://www.webank.com)

(84) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504

客服电话：400-918-0808

联系人：蔡之帆

网址：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

(85) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

客服电话：4006900000

联系人：吴翠

网址：<http://finance.sina.com.cn/fund/>

(86) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人：江卉

地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

客服电话：951184 / 4 400-098-8511

联系人：韩锦星

网址：[京东金融 APP](#)

(87) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

注册地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公用房

法定代表人：程刚

地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼

客服电话：400-810-5919

联系人：王鹤敏

网址：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

(88) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层

法人代表：陈姚坚

地址：深圳市南山区南山街道科苑路 18 号东方科技大厦 18F

客服电话：400-9500-888

联系人：张焯

网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

(89) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法人代表：李一梅

地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

客服电话：400-817-5666

联系人：穆文燕

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

(90) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法人代表：钱燕飞

地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

客服电话：95177

联系人：喻明明

网址：[www.snjjin.com](http://www.snjjin.com)

(91) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法人代表：钟斐斐

地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

客服电话：400-159-9288

联系人：候芳芳

网址: [www.danjuanapp.com](http://www.danjuanapp.com)

(92) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 (上海泰和经济发展区)

法定代表人: 王翔

地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 (上海泰和经济发展区)

客服电话: 400-820-5369

联系人: 李鑫

网址: [www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(93) 中民财富基金销售 (上海) 有限公司

注册地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

法人代表: 弭洪军

地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

客服电话: 400-876-5716

联系人: 黄鹏

网址: [www.cmiwm.com](http://www.cmiwm.com)

(94) 上海万得基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法人代表: 王廷富

地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

客服电话: 400-821-0203

联系人: 徐亚丹

网址: [www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(95) 北京植信基金销售有限公司

注册地址: 北京市密云县盛南路 8 号院 2 号楼 106 室

地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法人代表: 于龙

客服电话: 4006-802-123

联系人: 吴鹏

网址: [www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(96) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址: 杭州华星路 96 号互联网金融大厦 19 楼

地址: 上海陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 5 楼

法人代表: 冷飞

客服电话: 400-711-8718

联系人: 孙琦

网址: 挖财宝 APP

(97) 腾安基金销售 (深圳) 有限公司

注册地址: 深圳市南山区科技中一路腾讯大厦

地址: 深圳市南山区科技中一路腾讯大厦

法定代表人: 刘明军

客服电商: 95017 (拨通后转 1 转 8)

网址: [www.tenganxinxi.com](http://www.tenganxinxi.com)

### 3、场内销售机构

本基金可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理基金销售业务的上海证券交易所会员单位进行销

售。

基金管理人可以根据有关法律法规的要求，调整或增加其他符合要求的机构销售本基金，并按照相关规定及时公告。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-50938782

传真：010-50938907

联系人：赵亦清

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

经办注册会计师：薛竞、都晓燕

电话：(021)4 23238888

传真：(021)4 23238800

联系人：都晓燕

## 第四部分基金的名称

本基金名称：4 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

## 第五部分基金类型

基金类型：契约型、开放式、发起式

## 第六部分基金的投资目标

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。

## 第七部分基金的投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：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）、股指期货、权证、债券（国

债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、

中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以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：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其

他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合

约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

本基金每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不

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。

本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项及第（五）项的限制。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务以及通过证券金融

公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具

体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的

要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

待基金投资期权等衍生工具、同业存单的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，按照相关法律法规的规定参与期权交易

或投资同业存单，无需召开基金份额持有人大会。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 第八部分投资策略

### 一、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。

#### 1、阿尔法对冲策略

阿尔法对冲策略指通过建立股票多头，并利用股指期货等衍生工具对冲系统性风险，获取阿尔法收益。股票多头主要通过研究精选、事件驱动等策略构建精选股票组合，空头则利用市场风险中性策略匹配相应的

空头

衍生工具。

##### （1）多头股票组合构建

多头股票组合的构建主要依据海富通基金研究部的分析，以基本面分析为主，结合事件驱动策略，精选股票构建基金的多头组合。

研究部分析以上市公司的基本面分析为主要手段，重点对个股的估值水平及成长性进行判断和评级，以筛选精选股票组合。本基金的基本面分析主要对上市公司进行六个维度的分析，具体包括：公司治理结构、人力资

源管理、资产质量、估值、盈利趋势以及盈利与发展等。

事件驱动策略为多头股票的辅助策略，在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上，通过

充分把握交易时机获取超额收益。本基金将重点关注以下事件可能催生的超额收益机会，具体包括：高成长含

权、净利润增长、高管增持、分析师调研、指数成分股变动、基金重仓等因素等。

## （2）空头组合构建

空头组合的构建将主要根据多头组合的市值、行业分布、贝塔系数等因素，计算空头衍生品的数量，并进行

动态跟踪，灵活调整空头组合。本基金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构建空头组合。

## 2、其他绝对收益策略

本基金主要通过把握精选组合与衍生工具之间存在的价差，捕捉阿尔法收益机会。同时本基金也将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。其他绝对收益策略包括但不限于：

多因子套利根据多因子模型，把握各因子的套利机会

统计套利

基于历史数据，从历史交易数据找寻规律，发现两个或者两个以上的资产之间存在的套利机会

动量反转套利

根据股票的动量及反转效应，利益衍生品进行对冲，获取动量或反转收益

股指期货套利

积极发现市场上现货与期货之间的价差、不同期货合约之间的价差进行套利，获取绝对收益

股利套利积极把握股票分红时存在的套利机会

本基金将密切关注市场环境的变化，适时运用其他绝对收益策略。

## 3、债券投资策略

债券组合主要进行流动性管理及增强收益，在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。

（1）久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金资产

风险。

（2）收益率曲线策略是指在确定组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布方式，合理配置不同期限品种的配置比例。

（3）类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重，即确定债券、存款、回购以及现金等

资产的比例。

## （4）中小企业私募债的投资策略

本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿，增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析，从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负

债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。在流动性风

险控制，本基金将重点放在一级市场，并根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模，严格防

范流动性风险。

#### 4、其他衍生品投资策略

本基金将严格遵守相应的法规要求，使用股指期货、权证等衍生工具，未来，若本基金可以投资期权等其他

衍生品，本基金将按照风险对冲的原则，以有利于基金资产增值为主要目标，合理使用其他衍生工具。

## 二、投资决策依据和程序

### 1.决策依据

(1) 投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；

(2) 投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；

(3) 投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资

策略提供依据。

### 2.决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会定期或不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按

照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

(1) 投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

(2) 投资部门负责人在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3) 分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开部门例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资部门负责人授权下，根据部门例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充

分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见的基础上，进行

投资组合的资产及行业配置；之后，在证券分析师设定的证券池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特

征，构建基金组合。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 风险管理部负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 风险管理部负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

## 第九部分业绩比较基准

本基金业绩比较基准为三年期银行定期存款利率（税后）

上述三年期银行定期存款利率是指中国人民银行网站上发布的三年期金融机构人民币存款基准利率。

本基金追求绝对收益，上述业绩比较基准能够较好的反映本基金的投资目标，符合本基金的产品定位，易于广泛地被投资人理解，因而较为适当。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金可以在履行适当程序并经基金托管人同意后变更业绩

比

较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

#### 第十部分风险收益特征

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。

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。

#### 第十一部分投资组合报告

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6月18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。

本投资组合报告所载数据截止至2019年3月31日（“报告期末”）。

#### 14 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

#### 24 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 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

## 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。

## 34 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

## 44 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

## 54 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

64 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。

74 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。

84 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。

94 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.14 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(元)) 公允价值变动(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。

9.24 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。

104 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.14 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。

10.24 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。

10.34 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。

114 投资组合报告附注

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

机构进行了行政处罚。

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。

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。

#### 11.34 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

#### 11.44 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

11.54 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票中未存在流通受限情况。

第十二部分基金的业绩

基金业绩截止日为 2019 年 3 月 31 日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不

保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读

本基金的

招募说明书。

一、本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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

2014年11月20日-2014年12月31日 2.00% 0.64% 0.45% 0.01% 1.55% 0.63%

2015年1月1日-2015年12月31日 17.16% 0.49% 3.37% 0.01% 13.79% 0.48%

2016年1月1日-2016年12月31日 2.51% 0.05% 2.76% 0.01% -0.25% 0.04%

2017年1月1日-2017年12月31日 9.14% 0.25% 2.75% 0.01% 6.39% 0.24%

2018年1月1日-2018年12月31日 6.35% 0.35% 2.75% 0.01% 3.60% 0.34%

2014年11月20日（基金合同生效日）

-2019年3月31日

45.48% 0.34% 13.40% 0.01% 32.08% 0.33%

二、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(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。

第十三部分基金的费用和税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金

托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付

日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金

托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 第十四部分对招募说明书更新部分的说明

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》

及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金原招募说明书进行了

更新，主要更新的内容如下：

#### 一、“第三部分基金管理人”部分：

1.4 更新了基金管理人概况的相关信息。

2.4 更新了杨仓兵先生、任志强先生、朱斌全先生的简历。

3.4 增加了芮政先先生、杨文斌(Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士、曹志刚先生、胡正万先生的简历。

4.4 删除了张文伟先生、杨明先生、杨国平先生、Marc Bayot（巴约特）先生、郑国汉先生的简历。

二、“第四部分基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息。

三、“第五部分相关服务机构”部分：对其他销售机构的相关信息进行了更新。

四、“第九部分基金的投资”和“第十部分基金的业绩”部分，根据 2019 年第一季度报告，更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容，相关数据截止期为 2019 年 3 月 31 日。

五、“第十七部分风险揭示”部分，更新了相关信息。

六、“第十九部分基金托管协议的内容摘要”部分，更新了托管协议当事人的相关信息。

海富通基金管理有限公司

2019 年 7 月 3 日