

海富通大中华精选混合型证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 年 6 月 30 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：二〇一九年八月二十八日

§1 重要提示及目录

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	35
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	36
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	40
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	42
7.7 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.....	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
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金融衍生品投资明细.....	42
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	42

7.11 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
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	48
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通大中华精选混合型证券投资基金
基金简称	海富通大中华混合（QDII）
基金主代码	519602
交易代码	519602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 27 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
报告期末基金份额总额	23,361,082.42 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于在海外证券市场交易的大中华公司的优质股票,追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对全球宏观经济和大中华地区区域经济的基本面分析,采用自上而下的策略对资产进行有效资产配置;对股票的选择采用自下而上的“三站式”精选策略,挖掘定价合理,具备竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	MSCI 金龙净总收益指数
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。同时,本基金投资的目标市场是海外市场,除了需要承担市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	奚万荣	王永民

负责人	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1号
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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		杨仓兵	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	1,905,824.62
本期利润	4,071,884.14
加权平均基金份额本期利润	0.1428
本期加权平均净值利润率	12.97%
本期基金份额净值增长率	13.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	3,314,194.01
期末可供分配基金份额利润	0.1419
期末基金资产净值	26,727,011.10
期末基金份额净值	1.144
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	14.40%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.82%	1.25%	6.70%	0.96%	1.12%	0.29%

过去三个月	-0.78%	1.46%	0.14%	0.80%	-0.92%	0.66%
过去六个月	13.49%	1.41%	13.08%	0.86%	0.41%	0.55%
过去一年	-8.55%	1.52%	1.64%	1.07%	-10.19%	0.45%
过去三年	44.99%	1.20%	51.52%	0.93%	-6.53%	0.27%
自基金合同生效起至今	14.40%	1.42%	58.57%	1.06%	-44.17%	0.36%

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

海富通大中华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
 (2011年1月27日至2019年6月30日)



注：1、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，截至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条（三）投资范围、（九）投资限制中规定的各项比例；

2、本基金按照全球投资表现标准（GIPS）计算和表述投资业绩。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 61 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高崢	本基金的基金经理；海富通沪港深混合基金经理；海富通中国海外混合(QDII)基金经理。	2018-09-21	-	11 年	经济学硕士。持有基金从业人员资格证书。历任德勤华永会计师事务所审计部职员，光大证券股份有限公司行业研究员，中金公司研究部执行总经理、化工行业研究团队负责人。2017 年 3 月加入海富通基金管理有限公司，任权益投资部基金经理助理。2017 年 8 月起任海富通沪港深混合的基金经理。2018 年 9 月起兼任海富通大中华混合(QDII)、海富通中国海外混合(QDII)的基金经理。
陶意非	本基金的基金经理；海富通中国海外混合(QDII)基金经理。	2019-01-30	-	13 年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任花旗集团证券(日本)策略分析师、瑞穗证券(Mizuho Securities)交易员、顶峰资产管理有限公司(ASSET MANAGEMENT ONE Co., Ltd)基金经理、汇丰晋

					信基金管理有限公司首席港股策略师。2018 年 12 月加入海富通基金管理有限公司。2019 年 1 月任海富通大中华混合(QDII)、海富通中国海外混合(QDII)的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2019 年上半年，包括港股及台股等大中华市场出现了反弹。截至 2019 年 6 月 28 日，恒生指数累计上涨 10.43%，恒生国企指数则为上涨 7.48%；相比同期上证综指上涨 19.45%，深证成指和中小板指分别上涨 26.78% 和 20.75%，同时台湾加权指数上涨 10.32%。

回顾上半年走势，大中华市场表现较大波动，主要是由于以下几个原因：在第一季度，中美贸易摩擦及国内外宏观经济环境等困扰 2018 年的几大利空因素的暂时缓解促使市场在第一季度大幅上涨。但是，随后中美贸易摩擦的升级，对中国国内宏观经济下滑的担忧，以及华为事件对半导体产业的影响导致大中华市场在 5 月出现了较大幅度的下跌。而进入 6 月后，随着中美贸易谈判有缓和的迹象以及对国内外宏观政策的预期，大中华市场有了一定的反弹。

同时，关注个别行业，今年表现最佳的板块通常是去年跌幅最大的板块（尤其是在年初几个月的上涨行情中），这在市场情绪带动超跌反弹的背景下具有典型代表性。零售、保险、医疗保健和日常消费板块收益率较高，而汽车、资本品和消费品板块出现下跌。从去年 10 月份开始，大盘股与“新经济”板块跑赢其它板块，但今年 5 月份以来这一趋势出现逆转，这在一定程度上是由于美国对中国科技企业进行制裁而且对中国商品加征关税的风险再度上升导致。

报告期内基金仍依据业绩及估值表现，寻求具有价值的股票，除了继续超配 5G、教育相关股票以外，买入受益于国内页岩气等能源大开发的油服相关公司。同时继续低配银行等金融板块，并卖出行业政策趋紧的房地产公司。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 13.49%，同期业绩比较基准收益率为 13.08%，基金净值超过业绩比较基准 0.41 个百分点。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年下半年，中国经济将继续面临内外部两个方向的考验。内部考验主要来自于国内经济的下行风险，而外部考验主要来自于中美贸易争端的影响。

宏观政策方面，积极的财政政策取向不变，目前我们已经看到减税尤其是个税减税政策快速推进，我们相信未来减税政策会进一步推进至企业。此外，在经济有较大下行的压力下，相信托底经济的政策如基建以及消费刺激有可能会适时推出，以保证经济不会硬着陆。货币政策上，我们相信稳健偏积极的货币政策是 2019 年的主线，我们已经在 2018 年以来看到四次降准，2019 年年初降准 1%，后续不排除会看到持续的降准释放资金。此外，央行还创造新的票据互换工具 CBS 为宽信用创造更好条件，使得资金可以更好的传导至实体经济。

整体市场方面，2019 年下半年，我们预计市场虽然会继续有波动，但依然可以期待正收益。主要的逻辑是宏观政策的支持和中美贸易摩擦等外部环境的边际改善，此外市场估值跟全球其他权益市场相比有一定的优势。行业方面，继续关注 5G 相关股以及教

育股等具有长期投资价值的行业，此外受惠于国内页岩气等能源大开发的油服板块也具有很好的投资价值。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 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 2018 年 6 月 25 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，中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对海富通大中华精选混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益

的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：海富通大中华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	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,257,552.79	5,922,080.78
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	24,092,158.20	25,445,752.41
其中：股票投资		24,092,158.20	25,445,752.41
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		4,009,127.09	-

应收利息	6.4.7.5	377.46	150.26
应收股利		97,417.36	223.85
应收申购款		9,551.39	22,175.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		31,466,184.29	31,390,383.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,626,835.03	98,057.37
应付管理人报酬		43,675.26	48,763.50
应付托管费		7,279.19	8,127.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	61,383.71	200,321.93
负债合计		4,739,173.19	355,270.05
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	23,361,082.42	30,773,636.22
未分配利润	6.4.7.10	3,365,928.68	261,476.94
所有者权益合计		26,727,011.10	31,035,113.16
负债和所有者权益总计		31,466,184.29	31,390,383.21

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.144 元，基金份额总额 23,361,082.42 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		4,694,022.58	2,693,675.92
1.利息收入		5,179.63	15,376.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,179.63	15,376.38
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,564,388.31	6,622,206.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,273,253.02	6,297,475.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	291,135.29	324,730.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,166,059.52	-3,978,488.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-49,618.75	-13,484.14
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,013.87	48,065.52
减：二、费用		622,138.44	713,504.94
1. 管理人报酬		280,241.50	425,476.55
2. 托管费		46,706.86	70,912.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	195,424.06	107,272.97
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	6.4.7.19	99,766.02	109,842.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,071,884.14	1,980,170.98

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,071,884.14	1,980,170.98

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,773,636.22	261,476.94	31,035,113.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,071,884.14	4,071,884.14
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）	-7,412,553.80	-967,432.40	-8,379,986.20
其中：1.基金申购款	2,666,890.06	324,023.53	2,990,913.59
2.基金赎回款	-10,079,443.86	-1,291,455.93	-11,370,899.79
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）	23,361,082.42	3,365,928.68	26,727,011.10
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	42,977,639.17	7,889,003.43	50,866,642.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,980,170.98	1,980,170.98
三、本期基金份额交易产	-11,066,530.01	-1,862,051.57	-12,928,581.58

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	25,084,554.72	6,354,781.74	31,439,336.46
2.基金赎回款	-36,151,084.73	-8,216,833.31	-44,367,918.04
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）	31,911,109.16	8,007,122.84	39,918,232.00

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

海富通大中华精选混合型证券投资基金(原名为海富通大中华精选股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1760 号文核准，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《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 821,474,865.11 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 821,766,293.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 291,428.86 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，海富通大中华精选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为海富通大中华精选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金(ETF)等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以全球除内地股票市场以外的具有“大中华概念”上市公司为主要投资对象。“大中华概念”的股票需满足以下三个条件之一：1)上市公司注册在大

中华区域(中国内地、香港、台湾、澳门); 2)上市公司中最少百分之三十股权(占总股本)由大中华区域的股东持有; 3)公司最近一个会计年度至少百分之五十之营业额来自大中华区域。本基金的投资比例为: 股票及其他权益类证券占基金资产的 60%-95%; 现金、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—40%, 其中基金保留的现金的比例不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

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》、《海富通大中华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 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	3,257,552.79
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,257,552.79

注：于2019年6月30日，活期存款中包括的外币余额为：港币活期存款1,486,542.15（折合人民币1,307,651.66元）；台币活期存款59,483.00（折合人民币13,196.51元）；

美金活期存款 4,696.07（折合人民币 32,284.07 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		20,947,931.38	24,092,158.20	3,144,226.82
贵金属投资-金交所 黄金合约				
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		20,947,931.38	24,092,158.20	3,144,226.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	377.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	377.46

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末应付交易费用无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,884.17
预提费用	52,499.54
合计	61,383.71

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,773,636.22	30,773,636.22
本期申购	2,666,890.06	2,666,890.06
本期赎回（以“-”号填列）	-10,079,443.86	-10,079,443.86
本期末	23,361,082.42	23,361,082.42

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,050,532.40	-1,789,055.46	261,476.94
本期利润	1,905,824.62	2,166,059.52	4,071,884.14
本期基金份额交易产生的变动数	-642,163.01	-325,269.39	-967,432.40
其中：基金申购款	197,835.19	126,188.34	324,023.53
基金赎回款	-839,998.20	-451,457.73	-1,291,455.93
本期已分配利润	-	-	-

本期末	3,314,194.01	51,734.67	3,365,928.68
-----	--------------	-----------	--------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,179.63
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5,179.63

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	46,905,127.87
减：卖出股票成本总额	44,631,874.85
买卖股票差价收入	2,273,253.02

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	291,135.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	291,135.29

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	2,166,059.52

——股票投资	2,166,059.52
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	2,166,059.52

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	8,013.87
合计	8,013.87

注：本基金赎回费收入归入基金财产部分具体见本基金基金合同、招募说明书（更新）等法律文件规定。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	195,424.06
银行间市场交易费用	-
合计	195,424.06

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	27,704.35
其他	46,206.72
银行汇划费	1,059.76
合计	99,766.02

6.4.7.20 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外资产托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	280,241.50	425,476.55
其中：支付销售机构的客户维护费	109,597.35	152,784.17

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8% 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 1.8% / 当年天数。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,706.86	70,912.77

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,904,737.45	5,178.25	14,280,742.88	14,474.73

中国银行(香港)	1,311,454.97	1.38	4,870,195.16	1.19
----------	--------------	------	--------------	------

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，其中由中国银行保管的银行存款按适用利率计息，由中银香港保管的银行存款不计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制系统和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设立审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理

政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的多层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行以及境外次托管行中银香港，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的 20% (在基金托管账户的存款可以不受上述限制),本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。)本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。于 2019 年 6 月 30 日,本基金未持有流动性受限的资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格

因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,904,737.45	-	-	1,352,815.34	3,257,552.79
交易性金融资产	-	-	-	24,092,158.20	24,092,158.20
应收申购款	-	-	-	9,551.39	9,551.39
应收股利	-	-	-	97,417.36	97,417.36
应收利息	-	-	-	377.46	377.46
应收证券清算款	-	-	-	4,009,127.09	4,009,127.09
资产总计	1,904,737.45	-	-	29,561,446.84	31,466,184.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	43,675.26	43,675.26
应付托管费	-	-	-	7,279.19	7,279.19
应付赎回款	-	-	-	4,626,835.03	4,626,835.03
其他负债	-	-	-	61,383.71	61,383.71
负债总计	-	-	-	4,739,173.19	4,739,173.19
利率敏感度缺口	1,904,737.45	-	-	24,822,273.65	26,727,011.10
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	678,025.42	-	-	5,244,055.36	5,922,080.78
交易性金融资产	-	-	-	25,445,752.41	25,445,752.41
应收申购款	-	-	-	22,175.91	22,175.91
应收股利	-	-	-	223.85	223.85
应收利息	-	-	-	150.26	150.26
资产总计	678,025.42	-	-	30,712,357.79	31,390,383.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	48,763.50	48,763.50
应付托管费	-	-	-	8,127.25	8,127.25
应付赎回款	-	-	-	98,057.37	98,057.37
其他负债	-	-	-	200,321.93	200,321.93
负债总计	-	-	-	355,270.05	355,270.05
利率敏感度缺口	678,025.42	-	-	30,357,087.74	31,035,113.16

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	32,284.07	1,307,651.66	13,196.51	1,353,132.24
交易性金融	698,950.75	23,393,207.45	-	24,092,158.20

资产				
应收股利	-	78,697.36	-	78,697.36
应收证券清算款	-	4,009,127.09	-	4,009,127.09
资产合计	731,234.82	28,788,683.56	13,196.51	29,533,114.89
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	731,234.82	28,788,683.56	13,196.51	29,533,114.89
项目	上年度末 2018年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,413,321.27	2,409,249.45	1,421,484.64	5,244,055.36
交易性金融资产	2,896,140.00	19,359,463.76	3,190,148.65	25,445,752.41
应收股利	-	223.85	-	223.85
资产合计	4,309,461.27	21,768,937.06	4,611,633.29	30,690,031.62
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	4,309,461.27	21,768,937.06	4,611,633.29	30,690,031.62

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值	增加约 148	增加约 153

	5%		
	2. 所有外币相对人民币贬值		
	5%	减少约 148	减少约 153

注：金额为约数,精确到万元。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及其他权益类证券占基金资产的 60%-95%，银行存款及现金等高流动性资产占基金资产的 5%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票 投资	24,092,158.20	90.14	25,445,752.41	81.99
交易性金融资产—基金 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金 属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投 资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	24,092,158.20	90.14	25,445,752.41	81.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约 100	增加约 125
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约 100	减少约 125

注：金额为约数，精确到万元。

6.4.14 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	24,092,158.20	76.57
	其中：普通股	23,393,207.45	74.34
	存托凭证	698,950.75	2.22
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-

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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,257,552.79	10.35
8	其他各项资产	4,116,473.30	13.08
9	合计	31,466,184.29	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	23,393,207.45	87.53
美国	698,950.75	2.62
合计	24,092,158.20	90.14

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	6,852,331.49	25.64
信息技术	6,567,681.61	24.57
能源	2,941,380.72	11.01
工业	2,126,472.49	7.96
公共事业	1,702,784.26	6.37
金融	1,430,467.91	5.35
日常消费品	1,221,056.05	4.57
医疗保健	679,524.16	2.54
原材料	570,459.51	2.13
合计	24,092,158.20	90.14

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港交易所	中国香港	25,300	1,796,010.62	6.72
2	CHINA EDUCATION GROUP HOLDING	中国教育集团控股有限公司	839 HK	香港交易所	中国香港	165,000	1,770,755.58	6.63
3	ZTE CORP-H	中兴通讯股份有限公司	763 HK	香港交易所	中国香港	87,200	1,729,728.24	6.47
4	ANTON OILFIELD SERVICES GP	安东油田服务集团	3337 HK	香港交易所	中国香港	1,744,000	1,580,150.85	5.91
5	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	希望教育集团有限公司	1765 HK	香港交易所	中国香港	1,366,000	1,333,793.27	4.99
6	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	香港交易所	中国香港	13,600	1,284,866.58	4.81
7	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易及结算所有限公司	388 HK	香港交易所	中国香港	5,200	1,261,573.19	4.72
8	CHINA	中国铁塔	788 HK	香港交易所	中国香港	694,000	1,251,492.28	4.68

	TOWER CORP LTD-H	股份有限 公司		易所				
9	SEMIC ONDUCT OR MANUF ACTUR ING	中芯国际 集成电路 制造有限 公司	981 HK	香港交 易所	中国香港	136,000	1,040,813.71	3.89
10	BEIJIN G ENTER PRISES WATER GR	北控水务 集团有限 公司	371 HK	香港交 易所	中国香港	248,000	1,012,242.36	3.79
11	TENCE NT HOLDI NGS LTD	腾讯控股 有限公司	700 HK	香港交 易所	中国香港	3,200	992,537.97	3.71
12	CHINA RESOU RCES BEER HOLDI NG	华润啤 酒(控股) 有限公司	291 HK	香港交 易所	中国香港	26,000	848,520.04	3.17
13	CTRI P. COM INTER NATIO	阿里巴巴 集团控制 有限公司	BABA US	纽约交 易所	美国	600	698,950.75	2.62
14	CHINA POWER INTER NATIO NAL	中国电力 国际发展 有限公司	2380 HK	香港交 易所	中国香港	411,000	690,541.90	2.58
15	Q TECHN OLOGY GROUP CO LTD	丘钛科技 (集团)有 限公司	1478 HK	香港交 易所	中国香港	113,000	591,439.40	2.21
16	SPT ENERG Y GROUP INC	华油能源 集团有限 公司	1251 HK	香港交 易所	中国香港	752,000	535,818.50	2.00

17	HONG HUA GROUP	宏华集团有限公司	196 HK	香港交易所	中国香港	851,000	516,527.56	1.93
18	GENSCRIPT BIOTECH CORP	金斯瑞生物科技股份有限公司	1548 HK	香港交易所	中国香港	28,000	483,250.02	1.81
19	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	中国枫叶教育集团有限公司	1317 HK	香港交易所	中国香港	158,000	429,467.61	1.61
20	TIANLI EDUCATION INTERNATIONAL	天立教育国际控股有限公司	1773 HK	香港交易所	中国香港	132,000	399,436.01	1.49
21	CHINA XINHU A EDUCATION GROUP	中国新华教育集团有限公司	2779 HK	香港交易所	中国香港	156,000	378,746.41	1.42
22	CHINA MENG NIU DAIRY CO	中国蒙牛乳业有限公司	2319 HK	香港交易所	中国香港	14,000	372,536.01	1.39
23	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	中国海螺创业控股有限公司	586 HK	香港交易所	中国香港	14,500	352,039.93	1.32
24	CHINA YUHUA EDUCATION CORPL	中国宇华教育集团有限公司	6169 HK	香港交易所	中国香港	114,000	340,956.22	1.28
25	MINSHENG EDUCATION	民生教育集团有限公司	1569 HK	香港交易所	中国香港	248,000	322,870.41	1.21

	TION GROUP CO							
26	ASM PACIFI C TECHN OLOGY	ASM 太 平洋科技 有限公司	522 HK	香港交 易所	中国香港	4,400	309,640.32	1.16
27	SINOPE C OILFIE LD SERVIC E-H	中石化石 油工程技 术服务股 份有限公 司	1033 HK	香港交 易所	中国香港	362,000	308,883.81	1.16
28	AIR CHINA LTD-H	中国国际 航空股份 有限公司	753 HK	香港交 易所	中国香港	38,000	263,405.39	0.99
29	CHINA EASTE RN AIRLIN ES CO-H	中国东方 航空股份 有限公司	670 HK	香港交 易所	中国香港	64,000	259,534.89	0.97
30	ZHAOJI N MININ G INDUS TRY-H	招金矿业 股份有限 公司	1818 HK	香港交 易所	中国香港	30,000	230,910.75	0.86
31	LEE'S PHARM ACEUT ICAL HLDGS	李氏大药 厂控股有 限公司	950 HK	香港交 易所	中国香港	42,500	196,274.14	0.73
32	ANHUI CONCH CEMEN T CO LTD-H	安徽海螺 水泥股份 有限公司	914 HK	香港交 易所	中国香港	4,000	172,237.43	0.64
33	ZIJIN MININ G GROUP CO LTD-H	紫金矿业 集团股份 有限公司	2899 HK	香港交 易所	中国香港	60,000	167,311.33	0.63

34	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港交易所	中国香港	50,000	143,824.41	0.54
35	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港交易所	中国香港	5,000	25,070.31	0.09

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	1765 HK	1,889,062.75	6.09
2	ZTE CORP-H	763 HK	1,879,137.77	6.05
3	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	1,639,367.67	5.28
4	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	1,522,957.83	4.91
5	CHINA TOWER CORP LTD-H	788 HK	1,474,283.75	4.75
6	ANTON OILFIELD SERVICES GP	3337 HK	1,381,751.92	4.45
7	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	884 HK	1,230,791.05	3.97
8	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	1,227,590.96	3.96
9	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	1,226,624.32	3.95
10	AIR CHINA LTD-H	753 HK	1,082,103.63	3.49
11	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	670 HK	1,060,696.36	3.42
12	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	1,026,971.44	3.31
13	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	927,100.94	2.99

14	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	2001 HK	914,535.13	2.95
15	HUANENG POWER INTL INC-H	902 HK	904,918.76	2.92
16	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	892,983.80	2.88
17	CHINA POWER INTERNATIONAL	2380 HK	857,079.83	2.76
18	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	852,797.24	2.75
19	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	833,857.79	2.69
20	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	660,253.05	2.13
21	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	813 HK	643,393.37	2.07
22	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	634,303.51	2.04

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	2,678,829.36	8.63
2	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	2,436,546.85	7.85
3	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	2,271,623.09	7.32
4	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	2,100,315.76	6.77
5	AIA GROUP LTD	1299 HK	1,628,445.82	5.25
6	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	1,579,963.77	5.09
7	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	1,294,816.90	4.17
8	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	884 HK	1,271,785.93	4.10
9	GUANGDONG INVESTMENT LTD	270 HK	1,250,863.36	4.03
10	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	1,189,265.16	3.83
11	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	1,159,668.91	3.74
12	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	2001 HK	1,029,801.24	3.32
13	MINTH GROUP LTD	425 HK	1,001,165.52	3.23
14	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	935,617.05	3.01

15	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	918,465.59	2.96
16	AIR CHINA LTD-H	753 HK	892,648.05	2.88
17	HUANENG POWER INTL INC-H	902 HK	852,758.37	2.75
18	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	670 HK	852,662.66	2.75
19	GENSCRIPT BIOTECH CORP	1548 HK	843,872.65	2.72
20	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	818,483.90	2.64
21	LONGFOR PROPERTIES	960 HK	811,495.76	2.61
22	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	786,754.46	2.54
23	ZTE CORP-H	763 HK	783,373.23	2.52
24	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	717,905.73	2.31
25	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	709,569.40	2.29
26	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1347 HK	651,987.08	2.10
27	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	645,580.50	2.08
28	CHINA MOBILE LTD	941 HK	638,832.13	2.06
29	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	636,178.07	2.05
30	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	881 HK	635,488.67	2.05

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	41,112,221.12
卖出收入（成交）总额	46,905,127.87

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	4,009,127.09
3	应收股利	97,417.36
4	应收利息	377.46
5	应收申购款	9,551.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,116,473.30

7.11.4 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。

7.11.5 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不存在流通受限情况。

§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

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,219	7,257.25	-	-	23,361,082.42	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	934.17	0.0040%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放	0

式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 1 月 27 日）基金份额总额	821,766,293.97
本报告期期初基金份额总额	30,773,636.22
本报告期基金总申购份额	2,666,890.06
减：本报告期基金总赎回份额	10,079,443.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	23,361,082.42

§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。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
UBS Securities Asia Limited	-	14,292,365.42	16.24%	14,292.36	14.63%	-
CITIC Securities International Company Limited	-	4,308,132.91	4.90%	5,169.77	5.29%	-
BOCOM International Securities Limited	-	5,401,238.03	6.14%	8,101.84	8.29%	-
YUANTA SECURITIES (HONG KONG) COMPANY	-	904,908.37	1.03%	1,447.89	1.48%	-

LIMITED						
MasterLink Securities Corp.	-	2,161,382.48	2.46%	2,158.71	2.21%	-
Daiwa Capital Markets HK Ltd	-	5,331,684.98	6.06%	2,657.43	2.72%	-
China Industriail Securities	-	3,015,147.55	3.43%	3,618.16	3.70%	-
SINOLINK SECURITIES (HK)	-	3,427,548.70	3.90%	4,113.06	4.21%	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	5,945,299.37	6.76%	7,130.10	7.30%	-
China International Capital Corp.HK	-	8,312,580.18	9.45%	10,798.93	11.05%	-
UOB Kay Hian (HongKong) Limited	-	6,261,909.33	7.12%	6,261.92	6.41%	-
CCB International Securities Limited	-	6,685,963.73	7.60%	10,028.94	10.26%	-
Haitong International Securities Company Limited	-	9,561,960.22	10.87%	9,561.94	9.79%	-
ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	5,933,685.38	6.74%	5,933.68	6.07%	-
China Merchants Sec (HK) Co Ltd	-	6,452,936.96	7.33%	6,452.95	6.60%	-
Essence	-	-	-	-	-	-

International Securities Ltd						
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-
ShenYin WanGuo (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY CO. INTERNATIONAL PLC	-	-	-	-	-	-
The Bank of New York Company Inc.	-	-	-	-	-	-
BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
Fubon Bank (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities(H K) Limited	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-

J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金新增交易单元 Daiwa Capital Markets HK Ltd。

2、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。

3、交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI C Secu	-	-	-	-	-	-	-	-

rities Inter natio nal Com pany Limi ted								
BOC OM Inter natio nal Secu rities Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
YU ANT A SEC URI TIE S (HO NG KO NG) CO MPA NY LIM ITE D	-	-	-	-	-	-	-	-
Mast erLi nk Secu rities Corp .	-	-	-	-	-	-	-	-
Dai wa C apita l	-	-	-	-	-	-	-	-

Mar kets HK Ltd									
Chin a Indu strail Secu rities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SIN OLI NK SEC URI TIE S(H K)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GOL DM AN SAC HS (ASI A) SEC URI TIE S LIM ITE D	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Inter natio nal Capi tal Corp .HK	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UO B Kay Hian	-	-	-	-	-	-	-	-	-

(Hon gKo ng) Limi ted									
CCB Inter natio nal Secu rities Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Hait ong Inter natio nal Secu rities Com pany Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ICB C INT ERN ATI ON AL SEC URI TIE S LIM ITE D	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Mer chan ts Sec (HK	-	-	-	-	-	-	-	-	-

) Co Ltd								
Esse nce Inter natio nal Secu rities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shan ghai Secu rities Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
Shen Yin Wan Guo (H.K)Li mite d	-	-	-	-	-	-	-	-
Deut sche Secu rities Asia Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
Cath ay Secu rities Corp orati on	-	-	-	-	-	-	-	-
MO RG AN STA NLE Y	-	-	-	-	-	-	-	-

CO. INT ERN ATI ON AL PLC								
The Ban k of New York Com pany Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC I Secu rity Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
Cred it Suis se (Hon g Kon g) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubo n Ban k (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Pari bas Secu rities	-	-	-	-	-	-	-	-

(Asia) Ltd								
China Everbright Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Orient Securities	-	-	-	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Limited								
---------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下 QDII、FOF 基金 2018 年年度基金资产净值和基金份额净值公告	《证券时报》	2019-01-02
2	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	《证券时报》	2019-01-29
3	海富通基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司销售旗下基金业务的公告	《证券时报》	2019-01-30
4	海富通大中华精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	《证券时报》	2019-02-01
5	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	《证券时报》	2019-02-26
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行电子银行渠道申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-03-07
7	海富通基金管理有限公司关于参加中国中投证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-03-28
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-03-29
9	海富通基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	《证券时报》	2019-03-29
10	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《证券时报》	2019-03-29
11	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	《证券时报》	2019-04-02
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京百度百盈基金销售有限公司为销售机构的公告	《证券时报》	2019-04-08

13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京百度百盈基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-04-08
14	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《证券时报》	2019-04-17
15	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》	2019-04-29
16	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《证券时报》	2019-05-09
17	海富通基金管理有限公司关于开展旗下部分基金直销柜台费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-06-13
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西部证券股份有限公司为销售机构的公告	《证券时报》	2019-06-13
19	海富通基金管理有限公司关于调整旗下基金直销柜台最低申购金额的公告	《证券时报》	2019-06-18
20	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-06-26
21	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	《证券时报》	2019-06-27
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-06-28

§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

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。

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通大中华精选混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通大中华精选混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通大中华精选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）报告期内海富通大中华精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 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。

12.3 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
二〇一九年八月二十八日