

**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）**

**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 4 月 25 日（基金合同生效日）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                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 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                                | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12 |
| §5 托管人报告                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12 |
| 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 | 12 |
| 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     | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 13 |
| 6.1 资产负债表                               | 13 |
| 6.2 利润表                                 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 15 |
| 6.4 报表附注                                | 16 |
| §7 投资组合报告                               | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 37 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 37 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 37 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 38 |
| 7.7 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   | 38 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 38 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 38 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 38 |
| 7.12 本报告期投资基金情况                         | 39 |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.13 投资组合报告附注 .....                     | 40        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....               | <b>41</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 41        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 41        |
| 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 ..... | 42        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....               | 42        |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b> .....               | <b>42</b> |
| <b>§10 重大事件揭示</b> .....                 | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 43        |
| 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 .....  | 43        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 43        |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....           | 44        |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 44        |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 44        |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 44        |
| 10.9 其他重大事件 .....                       | 46        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....         | <b>47</b> |
| <b>§12 备查文件目录</b> .....                 | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 49        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 49        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                |
|------------|--------------------------------|
| 基金名称       | 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） |
| 基金简称       | 海富通稳健养老目标一年持有期混合（FOF）          |
| 基金主代码      | 007090                         |
| 交易代码       | 007090                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式、发起式                     |
| 基金合同生效日    | 2019年4月25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 | 91,632,526.07份                 |
| 基金合同存续期    | 不定期                            |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 采用成熟稳健的资产配置策略，追求养老资产的长期稳健增值，并合理控制投资组合波动风险和下行风险。   |
| 投资策略   | <p>本基金为采用目标风险策略的养老目标证券投资基金，投资于符合基金合同约定的权益类资产及其他资产的基准配置比例为20%及80%。在此基础上，本基金将采用定量分析和定性分析相结合的手段，对宏观经济环境、经济政策、产业政策、资金面、市场估值和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行综合分析，结合股票、债券、商品、现金等各类资产风险收益特征及相对变化，形成对不同类别资产表现的预测，确定基金资产在各资产间的配置比例，同时动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高组合的收益率。</p> <p>本基金将严格按照设定的目标风险预算，匹配相应的基金投资策略及投资品种构建FOF基金组合，从而使未来的投资组合满足目标风险的要求，在风险可控的基础上追求净值的稳健持续增长。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率*80%+中证800指数收益率*20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为采用目标风险策略的养老目标证券投资基金。本基金通过设定在正常市场状况下，权益类资产的基准配置比例为20%、其他资产的基准配置比例为80%，定位为稳健型的养老目标基   |

|  |   |
|--|---|
|  | 金。本基金的预期收益和风险水平低于股票型基金、股票型 FOF，高于债券型基金、货币市场基金、债券型 FOF 与货币型 FOF。 |
|--|---|

### 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<br>负责人 | 姓名   | 奚万荣                              | 王永民                  |
|             | 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 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《上海证券报》   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a> |
| 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  |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称          | 办公地址                             |
|--------|-------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 海富通基金管理有限公司 | 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 |

### §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4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日） |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 375,096.32                          |
| 本期利润          | 1,156,675.01                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0129                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.29%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.26%                               |
| 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      | 375,177.45                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0041                              |
| 期末基金资产净值      | 92,789,596.46                       |
| 期末基金份额净值      | 1.0126                              |
| 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   | 1.26%                               |

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

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

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

4、本基金合同生效日为2019年4月25日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

#### 3.2 基金净值表现

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

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 1.82%    | 0.50%       | 1.31%      | 0.23%         | 0.51% | 0.27% |

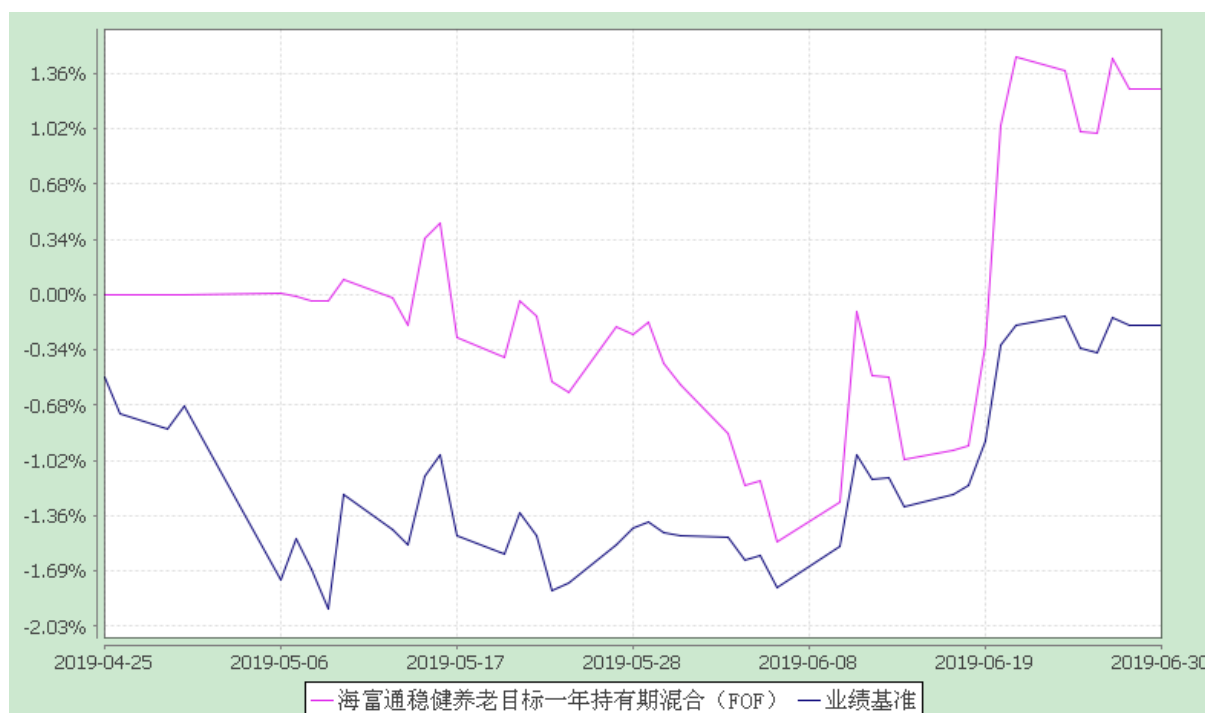
|            |       |       |        |       |       |       |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 1.26% | 0.38% | -0.19% | 0.31% | 1.45% | 0.07% |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|

### 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

海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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

(2019 年 4 月 25 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2019 年 4 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 61 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资



基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利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<br>（助理）期限 |      | 证券<br>从业<br>年限 | 说明   |
|----|------------------------|---------------------|------|----------------|--|
|    |                        | 任职日期                | 离任日期 |                |  |
| 姜萍 | 本基金的基金经理；海富通聚优精选混合 FOF | 2019-04-25          | -    | 16 年           | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任交通银行哈尔滨分行信贷业务科长、兴安证券研究发展部研究员、机 |

|  |       |  |  |  |
|--|-------|--|--|--|
|  | 基金经理。 |  |  | 构业务部高级项目经理、证券投资部投资经理助理，中信建投证券资产管理部 FOF 投资顾问、研究发展部基金分析师。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，2017 年 11 月起任海富通聚优精选混合 FOF 基金经理。2019 年 4 月起兼任海富通稳健养老目标一年持有期混合 FOF 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，债券收益率先经历了较长时间的震荡调整，而后又逐步下行，总体呈现区间震荡格局。整体看，1年期国开债收益率下行2BP，10年期国开债收益率下行3BP，期限利差小幅收窄。信用债方面，上半年信用债收益率普遍下行，信用利差平均收窄20BP左右，其中短期限表现更佳。即使发生了有控制的风险暴露事件，但央行予以积极呵护资金充裕，短期平稳过渡了冲击，信用分化提高了风险识别和风险定价，长期则有利于无风险利率下降。

股票市场，随着减税降费落实、疏通信用传导机制等效果逐步显现，增强了投资者对经济企稳预期，市场活跃度一度恢复到万亿成交，叠加海外配置资金持续流入，股票市场主要指数大幅上涨，大幅扭转了2018年末的悲观预期。基本面受益于内需消费升级、景气度高、业绩持续稳定的或超跌反弹的板块显著表现居前。虽然二季度受流动性边际收紧、中美贸易战反复等因素扰动，但在宏观数据没有大幅下台阶，上市公司的财报数据稳定的基础上，相比2018年，股债汇市场体现出较强的韧性。

本基金四月末成立，目前仍处于建仓期。五月初市场大幅调整非常有利于布局权益资产，鉴于养老FOF构建组合首要是考虑未来资产回报的确定性，以及是否具有较高的安全边际，同时一年锁定期的特点，可以淡化一些短期择时，而以中长期角度去评估风险收益比有吸引力的标的，本基金看好正股基本面良好、溢价率不高的可转债较佳的配置机会。另外，灵活配置了行业利好政策逐步落地、交易成本低的行业ETF基金，搭配历史业绩稳健，信用风险较低的高等级纯债基金，总体风险敞口可控，力求获得具有吸引力的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为1.26%，同期业绩比较基准收益率为-0.19%，基金净值跑赢业绩比较基准1.45个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们将忽略总量偏弱的数据，专注于结构性机会。三季度，全球整体流动性趋于宽松，国内重现对冲政策托底，龙头公司业绩继续保持快于行业的稳健增长，前期谨慎情绪有利于市场估值合理甚至个别板块低估，优质股权资产仍具有吸引力。而债券市场受信用分层的影响还在继续，行情比较纠结震荡，能否回到去年牛市还需看经济前景变化。黄金及商品，受美联储降息预期加强，下半年仍有反弹机会，但波动较大。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理人负责人、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §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）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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遵规守信、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：海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

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<br>2019年6月30日     |
|-------------|---------|-----------------------|
| 资产：         |         | -                     |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 15,239,051.56         |
| 结算备付金       |         | 881,673.54            |
| 存出保证金       |         | 33,048.68             |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 75,265,649.37         |
| 其中：股票投资     |         | -                     |
| 基金投资        |         | 57,277,593.57         |
| 债券投资        |         | 17,988,055.80         |
| 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 | 10,000,000.00         |
| 应收证券清算款     |         | -                     |
| 应收利息        | 6.4.7.5 | 37,216.94             |
| 应收股利        |         | 1,033.03              |
| 应收申购款       |         | 8,374.06              |
| 递延所得税资产     |         | -                     |
| 其他资产        | 6.4.7.6 | -                     |
| <b>资产总计</b> |         | <b>101,466,047.18</b> |
|             |         |                       |
| 负债和所有者权益    | 附注号     | 本期末<br>2019年6月30日     |
| 负债：         |         | -                     |
| 短期借款        |         | -                     |
| 交易性金融负债     |         | -                     |

|               |          |                |
|---------------|----------|----------------|
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3  | -              |
| 卖出回购金融资产款     |          | -              |
| 应付证券清算款       |          | 8,577,288.00   |
| 应付赎回款         |          | -              |
| 应付管理人报酬       |          | 37,571.36      |
| 应付托管费         |          | 10,089.15      |
| 应付销售服务费       |          | -              |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | -              |
| 应交税费          |          | 11,462.34      |
| 应付利息          |          | -              |
| 应付利润          |          | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 40,039.87      |
| 负债合计          |          | 8,676,450.72   |
| <b>所有者权益：</b> |          | -              |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 91,632,526.07  |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 1,157,070.39   |
| 所有者权益合计       |          | 92,789,596.46  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 101,466,047.18 |

注：1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0126 元，基金份额总额 91,632,526.07 份。

2、基金合同成立于 2019 年 4 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

## 6.2 利润表

会计主体：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）

本报告期：2019 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目          | 附注号      | 本期   |
|-------------|----------|--|
|             |          | 2019 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至<br>2019 年 6 月 30 日 |
| <b>一、收入</b> |          | <b>1,311,656.32</b>                          |
| 1.利息收入      |          | 104,735.77                                   |
| 其中：存款利息收入   | 6.4.7.11 | 46,025.48                                    |
| 债券利息收入      |          | 15,514.10                                    |
| 资产支持证券利息收入  |          | -  |

|                            |          |                     |
|----------------------------|----------|---------------------|
| 买入返售金融资产收入                 |          | 43,196.19           |
| 其他利息收入                     |          | -                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 425,341.86          |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | -                   |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.13 | 339,732.02          |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.14 | 14,019.49           |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -                   |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.15 | -                   |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.16 | -                   |
| 股利收益                       | 6.4.7.17 | 71,590.35           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.18 | 781,578.69          |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.19 | -                   |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>154,981.31</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |          | 82,642.44           |
| 2. 托管费                     |          | 23,373.20           |
| 3. 销售服务费                   |          | -                   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.20 | 5,238.03            |
| 5. 利息支出                    |          | -                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                   |
| 6.税金及附加                    |          | 1,146.93            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.21 | 42,580.71           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>1,156,675.01</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>1,156,675.01</b> |

注：本财务报表的实际编制期间为2019年4月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日，上年度可比期间无比较数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期                             |              |               |
|--|--------------------------------|--------------|---------------|
|  | 2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |              |               |
|  | 实收基金                           | 未分配利润        | 所有者权益合计       |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 91,327,666.94                  | -            | 91,327,666.94 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                              | 1,156,675.01 | 1,156,675.01  |
| 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）      | 304,859.13                     | 395.38       | 305,254.51    |
| 其中：1.基金申购款                             | 304,859.13                     | 395.38       | 305,254.51    |
| 2.基金赎回款                                | -                              | -            | -             |
| 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）                        | 91,632,526.07                  | 1,157,070.39 | 92,789,596.46 |

注：本财务报表的实际编制期间为2019年4月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日，上年度可比期间无比较数据。

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

海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]2194号《关于准予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）注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定，投资者最短持有期限为1年，即对于认购所得基金份额，自基金合同生效日的次一年对日起可申请赎回，如该对日不存在或为非



工作日的，则顺延至下一工作日。对于申购所得基金份额，自申购确认日的次一年对日起可申请赎回，如该对日不存在或为非工作日的，则顺延至下一工作日。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 91,316,671.58 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0247 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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)基金合同》于 2019 年 4 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 91,327,666.94 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,995.36 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。

本基金为发起式基金，基金募集金额不少于 1,000 万元，其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为 1,000 万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（以下简称“证券投资基金”，包括 QDII 基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)、但基金中基金除外）、香港互认基金、国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券（国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、资产支持证券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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%，投资单只基金的比例不高于本基金资产净值的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。在正常市场状况下，本基金目标是将 20% 的基金资产投资于权益类资产，将 80% 的基金资产投资于其他资产。上述权益类资产配置比例可上浮不超过 5%（即权益类资产配置比例最高可至 25%），下浮不超过 10%（即权益类资产配置比例最低可至 10%）。本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 50%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 50%。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率\*80%+中证 800 指数收益率\*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2019 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会

颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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。

本财务报表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4月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年4月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2019年4月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的基金投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

##### (2) 金融负债的分类

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

项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的基金投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵

销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **6.4.4.12分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计**

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

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

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **6.4.5.2会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **6.4.5.3差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7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<br>2019年6月30日 |
|------|-------------------|
| 活期存款 | 15,239,051.56     |
| 定期存款 | -                 |
| 其他存款 | -                 |
| 合计   | 15,239,051.56     |

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2019年6月30日 |               |               |
|-------------------|-------------------|---------------|---------------|
|                   | 成本                | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票                | -                 | -             | -             |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                 | -             | -             |
| 债券                | 交易所市场             | 18,078,338.74 | 17,988,055.80 |
|                   | 银行间市场             | -             | -             |
|                   | 合计                | 18,078,338.74 | 17,988,055.80 |
| 资产支持证券            | -                 | -             | -             |
| 基金                | 56,405,731.94     | 57,277,593.57 | 871,861.63    |
| 其他                | -                 | -             | -             |
| 合计                | 74,484,070.68     | 75,265,649.37 | 781,578.69    |

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期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**

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2019年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 10,000,000.00     | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 10,000,000.00     | -         |

**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<br>2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,041.66          |
| 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  | 357.03            |
| 应收债券利息     | 34,804.84         |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 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         | 13.41             |
| 合计         | 37,216.94         |

**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<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提费用        | 40,039.87         |
| 合计          | 40,039.87         |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |               |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                              | 账面金额          |
| 基金合同生效日       | 91,327,666.94                        | 91,327,666.94 |
| 本期申购          | 304,859.13                           | 304,859.13    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                    | -             |



|     |               |               |
|-----|---------------|---------------|
| 本期末 | 91,632,526.07 | 91,632,526.07 |
|-----|---------------|---------------|

注：1、本基金自2019年3月25日起至2019年4月19日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币91,316,671.58元。根据《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）基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币10,995.36元在本基金成立后，折算为10,995.36份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《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）基金合同》的相关规定，本基金于2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年4月28日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务自2019年4月29日起开始办理。本基金投资者最短持有期限为1年，即对于认购所得基金份额，自基金合同生效日的次一年对日起可以申请赎回，如该对日不存在或为非工作日的，则顺延至下一工作日。本基金合同自2019年4月25日起生效，本基金首个赎回起始日为2020年4月27日。对于申购所得基金份额，自申购确认日的次一年对日起可申请赎回，如该对日不存在或为非工作日的，则顺延至下一工作日。

#### 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      |
|----------------|------------|------------|--------------|
| 本期利润           | 375,096.32 | 781,578.69 | 1,156,675.01 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 81.13      | 314.25     | 395.38       |
| 其中：基金申购款       | 81.13      | 314.25     | 395.38       |
| 基金赎回款          | -          | -          | -            |
| 本期已分配利润        | -          | -          | -            |
| 本期末            | 375,177.45 | 781,892.94 | 1,157,070.39 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年<br>6月30日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入  | 44,559.58                                |
| 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 | 1,427.21                                 |

|    |           |
|----|-----------|
| 其他 | 38.69     |
| 合计 | 46,025.48 |

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年<br>6月30日 |
|-----------------|--|
| 卖出/赎回基金成交总额     | 18,825,560.06                            |
| 减：卖出/赎回基金成本总额   | 18,475,636.08                            |
| 减：基金投资收益应缴纳增值税额 | 10,191.96                                |
| 基金投资收益          | 339,732.02                               |

**6.4.7.14 债券投资收益**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |
|-------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 5,422,147.70                         |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 5,392,652.55                         |
| 减：应收利息总额                | 15,475.66                            |
| 买卖债券差价收入                | 14,019.49                            |

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月<br>30日 |
|-------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | -  |
| 基金投资产生的股利收益 | 71,590.35                                |
| 合计          | 71,590.35                                |

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月<br>30日 |
|----------------------------|--|
| 1.交易性金融资产                  | 781,578.69                               |
| ——股票投资                     | -  |
| ——债券投资                     | -90,282.94                               |
| ——资产支持证券投资                 | -  |
| ——基金投资                     | 871,861.63                               |
| ——贵金属投资                    | -  |
| ——其他                       | -  |
| 2.衍生工具                     | -  |
| ——权证投资                     | -  |
| 3.其他                       | -  |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的<br>预估增值税 | -  |
| 合计                         | 781,578.69                               |

**6.4.7.19 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 184.95                               |
| 银行间市场交易费用 | -                                    |
| 交易基金产生的费用 | 5,053.08                             |
| 其中：申购费    | 3,000.00                             |
| 交易费       | 2,053.08                             |
| 合计        | 5,238.03                             |

**6.4.7.20.1 持有基金产生的费用**

| 项目 | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |
|----|--------------------------------------|
|----|--------------------------------------|

|                      | 日         |
|----------------------|-----------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 3,908.32  |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 28,776.65 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 7,108.87  |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月<br>30日 |
|---------|--|
| 审计费用    | 13,346.40                                |
| 信息披露费   | 26,693.47                                |
| 银行划款手续费 | 2,540.84                                 |
| 合计      | 42,580.71                                |

#### 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

截至财务报表报出日，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    |
| 海通证券股份有限公司(“海通证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易，基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月<br>30日 |
|---------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费      | 82,642.44                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护<br>费 | 18,927.17                                |

注：1、本基金基金财产中投资于本基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费，支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的0.50%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扣除基金财产中本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）×0.50% / 当年天数。

2、基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月 |
|----|-----------------------------------|
|----|-----------------------------------|

|                |           |
|----------------|-----------|
|                | 30日       |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 23,373.20 |

注：1、本基金基金财产中投资于本基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的0.15%的费率计提，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扣除基金财产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）×0.15%/当年天数。

2、基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

份额单位：份

| 项目                         | 本期                             |
|----------------------------|--------------------------------|
|                            | 2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |
| 基金合同生效日（2019年4月25日）持有的基金份额 | 10,001,000.10                  |
| 报告期初持有的基金份额                | -                              |
| 报告期间申购/买入总份额               | -                              |
| 报告期间因拆分变动份额                | -                              |
| 减：期间赎回/卖出总份额               | -                              |
| 报告期末持有的基金份额                | 10,001,000.10                  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 10.91%                         |

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计1,000.10万元认购了本基金，其中，认购费用为1,000.00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。

2、基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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<br>2019年4月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |           |
|-------|--------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                                 | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 15,239,051.56                        | 44,559.58 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

2、基金成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项，基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

##### 6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期无当期交易及持有管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金在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

本基金为混合型基金中基金，其预期收益和风险水平低于股票型FOF，高于债券型

FOF 与货币型 FOF，属于较高风险、较高收益的基金品种。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。本基金在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。

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制度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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 19.39%(基金合同成立于 2019 年 4 月 25 日，上年度可比期间无比较数据)。

#### 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时间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。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，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。本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。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、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年6月30日 | 1年以内 | 1至5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|------|------|------|-----|----|
| 资产                |      |      |      |     |    |

|             |                      |                     |                     |                      |                       |
|-------------|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|
| 银行存款        | 15,239,051.56        | -                   | -                   | -                    | 15,239,051.56         |
| 结算备付金       | 881,673.54           | -                   | -                   | -                    | 881,673.54            |
| 存出保证金       | 33,048.68            | -                   | -                   | -                    | 33,048.68             |
| 交易性金融资产     | -                    | 9,485,745.40        | 8,502,310.40        | 57,277,593.57        | 75,265,649.37         |
| 买入返售金融资产    | 10,000,000.00        | -                   | -                   | -                    | 10,000,000.00         |
| 应收利息        | -                    | -                   | -                   | 37,216.94            | 37,216.94             |
| 应收股利        | -                    | -                   | -                   | 1,033.03             | 1,033.03              |
| 应收申购款       | 5,976.10             | -                   | -                   | 2,397.96             | 8,374.06              |
| <b>资产总计</b> | <b>26,159,749.88</b> | <b>9,485,745.40</b> | <b>8,502,310.40</b> | <b>57,318,241.50</b> | <b>101,466,047.18</b> |
| 负债          |                      |                     |                     |                      |                       |
| 应付证券清算款     | -                    | -                   | -                   | 8,577,288.00         | 8,577,288.00          |
| 应付管理人报酬     | -                    | -                   | -                   | 37,571.36            | 37,571.36             |
| 应付托管费       | -                    | -                   | -                   | 10,089.15            | 10,089.15             |
| 应交税费        | -                    | -                   | -                   | 11,462.34            | 11,462.34             |
| 其他负债        | -                    | -                   | -                   | 40,039.87            | 40,039.87             |
| <b>负债总计</b> | <b>-</b>             | <b>-</b>            | <b>-</b>            | <b>8,676,450.72</b>  | <b>8,676,450.72</b>   |
| 利率敏感度缺口     | 26,159,749.88        | 9,485,745.40        | 8,502,310.40        | 48,641,790.78        | 92,789,596.46         |

注：1、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。

2、基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为19.39%(基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(基金合同成立于2019年4月25日，上年度可比期间无比较数据)。

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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或银行间同业市场交易的债券和基金，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

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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于证券投资基金份额的比例不低于本基金资产的 80%，投资单只基金的比例不高于本基金资产净值的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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<br>2019年6月30日    |                  |
|--------------|----------------------|------------------|
|              | 公允价值                 | 占基金资产净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | -                    | -                |
| 交易性金融资产—基金投资 | 57,277,593.57        | 61.73            |
| 衍生金融资产—权证投资  | -                    | -                |
| <b>合计</b>    | <b>57,277,593.57</b> | <b>61.73</b>     |

注：基金合同成立于 2019 年 4 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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(附注 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<br>2019年6月30日            |
|    | 1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%       | 增加约 127                      |
|    | 2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%       | 减少约 127                      |

注：1、金额为约数,精确到万元。

2、基金合同成立于 2019 年 4 月 25 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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              | -              | -            |
|    | 其中：股票             | -              | -            |
| 2  | 基金投资              | 57,277,593.57  | 56.45        |
| 3  | 固定收益投资            | 17,988,055.80  | 17.73        |
|    | 其中：债券             | 17,988,055.80  | 17.73        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 10,000,000.00  | 9.86         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 16,120,725.10  | 15.89        |
| 8  | 其他各项资产            | 79,672.71      | 0.08         |
| 9  | 合计                | 101,466,047.18 | 100.00       |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 17,988,055.80 | 19.39        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 17,988,055.80 | 19.39        |

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 113021 | 中信转债     | 43,090 | 4,478,774.60 | 4.83         |
| 2  | 127010 | 平银转债     | 33,780 | 4,023,535.80 | 4.34         |
| 3  | 132015 | 18 中油 EB | 40,660 | 3,980,207.40 | 4.29         |
| 4  | 113011 | 光大转债     | 36,080 | 3,911,072.00 | 4.21         |
| 5  | 113019 | 玲珑转债     | 14,600 | 1,594,466.00 | 1.72         |

#### 7.7 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。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金通过定量分析和定性分析相结合的方式，重点考察风格特征稳定性、风险控制和合规运作情况，并对照业绩比较基准评价中长期收益、业绩波动和回撤情况，优选标的基金构建基金投资组合。对备选基金的收益指标、风险指标、合规情况、费率水平、基金规模和流动性等进行综合评估，并优选在同类基金中长期表现较好、投资风格稳定、风险控制能力较好的基金。本基金主要从基金管理人、基金经理对备选基金进行定性分析。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。所投资的子基金运作期内未发生转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大事项。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称          | 运作方式   | 持有份额(份)      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|---------------|--------|--------------|---------------|--------------|------------------------|
| 1  | 002969 | 易方达丰和债券       | 契约型开放式 | 8,519,938.65 | 10,145,542.94 | 10.93%       | 否                      |
| 2  | 512070 | 易方达沪深300非银ETF | 交易型开放式 | 3,393,235.00 | 7,804,440.50  | 8.41%        | 否                      |
| 3  | 000385 | 景顺长城景颐双利债券A   | 契约型开放式 | 4,500,964.63 | 7,057,512.54  | 7.61%        | 否                      |
| 4  | 004585 | 鹏扬汇利债券        | 契约型开放式 | 6,548,465.57 | 7,051,387.73  | 7.60%        | 否                      |

|    |        | A             |        |              |              |       |   |
|----|--------|---------------|--------|--------------|--------------|-------|---|
| 5  | 510880 | 华泰柏瑞上证红利ETF   | 交易型开放式 | 2,170,500.00 | 6,047,013.00 | 6.52% | 否 |
| 6  | 159939 | 广发中证全指信息技术ETF | 交易型开放式 | 5,296,900.00 | 5,000,273.60 | 5.39% | 否 |
| 7  | 000602 | 富国安益货币        | 契约型开放式 | 4,517,122.92 | 4,517,122.92 | 4.87% | 否 |
| 8  | 000141 | 富国国有企业债债券C    | 契约型开放式 | 3,598,510.27 | 3,617,582.37 | 3.90% | 否 |
| 9  | 003669 | 东方红益鑫纯债债券C    | 契约型开放式 | 2,864,686.87 | 3,020,525.84 | 3.26% | 否 |
| 10 | 510500 | 南方中证500ETF    | 交易型开放式 | 565,216.00   | 3,013,731.71 | 3.25% | 否 |
| 11 | 511010 | 国泰上证5年期国债ETF  | 交易型开放式 | 21.00        | 2,460.42     | 0.00% | 否 |

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内本基金投资的中信转债（113021）于2019年4月15日公告称，公司作为宏图高科相关债务融资工具的主承销商，存在对发行人的督导职责履行不到位，持有人会议召集公告披露不及时、会议议案披露不完整等行为，违反银行间市场自律管理规则，受到交易商协会通报批评的处分。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，综合实力极强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 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。

### 7.13.3 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 | 33,048.68 |



|   |         |           |
|---|---------|-----------|
| 2 | 应收证券清算款 | -         |
| 3 | 应收股利    | 1,033.03  |
| 4 | 应收利息    | 37,216.94 |
| 5 | 应收申购款   | 8,374.06  |
| 6 | 其他应收款   | -         |
| 7 | 待摊费用    | -         |
| 8 | 其他      | -         |
| 9 | 合计      | 79,672.71 |

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1  | 132015 | 18 中油 EB | 3,980,207.40 | 4.29         |
| 2  | 113011 | 光大转债     | 3,911,072.00 | 4.21         |
| 3  | 113019 | 玲珑转债     | 1,594,466.00 | 1.72         |

#### 7.13.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本报告期末未持有股票。

### §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  |
| 18,809   | 4,871.74  | 0.00  | 0.00%  | 91,632,526.07 | 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 | 396,995.90 | 0.4332% |
|------------------|------------|---------|

### 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0~10              |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份<br>额<br>总数    | 持有份<br>额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份<br>额<br>总数    | 发起份<br>额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份<br>额<br>承诺持有<br>期限 |
|-----------------|-------------------|--------------------------|-------------------|--------------------------|------------------------|
| 基金管理人固有资金       | 10,001,00<br>0.10 | 10.91%                   | 10,001,00<br>0.10 | 10.91%                   | 不少于 3<br>年             |
| 基金管理人高级管理<br>人员 | -                 | -                        | -                 | -                        | -                      |
| 基金经理等人员         | -                 | -                        | -                 | -                        | -                      |
| 基金管理人股东         | -                 | -                        | -                 | -                        | -                      |
| 其他              | -                 | -                        | -                 | -                        | -                      |
| 合计              | 10,001,00<br>0.10 | 10.91%                   | 10,001,00<br>0.10 | 10.91%                   | -                      |

注：本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 1,000.10 万元认购了本基金，其中，认购费用为 1,000.00 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。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2019年4月25日）基金份额总额 | 91,327,666.94 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额     | 304,859.13    |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额   | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动      | -             |

|              |               |
|--------------|---------------|
| 份额           |               |
| 本报告期期末基金份额总额 | 91,632,526.07 |

## §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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。

## 10.7 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。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 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 |    |
| 海通证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 渤海证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中金公司 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 上海证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 银河证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

#### 2、（1）交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

#### （2）交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

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

### 10.8.2 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 |
| 海通证券 | 28,915,630.73 | 100.00%      | 111,000,000.00 | 76.03%       | -    | -            | 58,539,370.76 | 100.00%      |
| 申万宏源 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 天风证券 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 中信建投 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 长江证券 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 渤海证券 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 国金证券 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 中金公司 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 上海证券 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 华创证券 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |
| 银河证券 | -             | -            | -              | -            | -    | -            | -             | -            |

|          |   |   |                   |            |   |   |   |   |
|----------|---|---|-------------------|------------|---|---|---|---|
| 中信<br>证券 | - | - | 35,000,0<br>00.00 | 23.97<br>% | - | - | - | - |
|----------|---|---|-------------------|------------|---|---|---|---|

## 10.9 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  | 海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金份额发售公告                         | 《上海证券报》 | 2019-03-20 |
| 2  | 海富通基金管理有限公司关于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）新增销售机构的公告           | 《上海证券报》 | 2019-03-22 |
| 3  | 海富通基金管理有限公司关于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）参加部分销售机构认购费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》 | 2019-03-23 |
| 4  | 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                                      | 《上海证券报》 | 2019-03-29 |
| 5  | 海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告  | 《上海证券报》 | 2019-03-29 |
| 6  | 海富通基金管理有限公司关于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）新增部分销售机构的公告         | 《上海证券报》 | 2019-04-02 |
| 7  | 海富通基金管理有限公司关于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）参加海通证券认购费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》 | 2019-04-08 |
| 8  | 海富通基金管理有限公司关于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）新增销售机构的公告           | 《上海证券报》 | 2019-04-12 |
| 9  | 海富通基金管理有限公司关于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）新增销售机构的公告           | 《上海证券报》 | 2019-04-18 |
| 10 | 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）基金合同生效公告                         | 《上海证券报》 | 2019-04-26 |
| 11 | 海富通基金管理有限公司关于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）参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》 | 2019-04-27 |
| 12 | 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）开放日常申购和定期定额投资业务公告                | 《上海证券报》 | 2019-04-27 |
| 13 | 海富通基金管理有限公司关于高级管理  | 《上海证券报》 | 2019-04-29 |

|    |   |         |            |
|----|---|---------|------------|
|    | 人员变更的公告   |         |            |
| 14 | 海富通基金管理有限公司关于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）新增销售机构的公告                        | 《上海证券报》 | 2019-04-29 |
| 15 | 海富通基金管理有限公司关于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）新增销售机构的公告                        | 《上海证券报》 | 2019-05-18 |
| 16 | 海富通基金管理有限公司关于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）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 | 《上海证券报》 | 2019-06-12 |
| 17 | 海富通基金管理有限公司关于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）新增销售机构的公告                        | 《上海证券报》 | 2019-06-12 |
| 18 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增销售机构的公告  | 《上海证券报》 | 2019-06-12 |
| 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  | 《上海证券报》 | 2019-06-18 |
| 20 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告                     | 《上海证券报》 | 2019-06-20 |
| 21 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告   | 《上海证券报》 | 2019-06-21 |
| 22 | 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                                  | 《上海证券报》 | 2019-06-26 |
| 23 | 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                                      | 《上海证券报》 | 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稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的文件
- （二）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）基金合同
- （三）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）招募说明



书

（四）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）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）报告期内海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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