

**海富通安颐收益混合型证券投资基金**  
**2019 年第 3 季度报告**  
**2019 年 9 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：二〇一九年十月二十二日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通安颐收益混合
基金主代码	519050
交易代码	519050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 29 日
报告期末基金份额总额	357,588,874.68 份
投资目标	本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，从而做出权益类资产的具体仓位选择。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+2%

风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
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	
下属两级基金的基金简称	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
下属两级基金的交易代码	519050	002339
报告期末下属两级基金的份额总额	286,683,626.05 份	70,905,248.63 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日)	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
1.本期已实现收益	13,117,731.83	2,758,569.91
2.本期利润	13,955,893.80	3,162,418.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0481	0.0448
4.期末基金资产净值	385,894,796.07	97,227,656.94
5.期末基金份额净值	1.346	1.371

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

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

（3）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）于2016年1月6日刊登公告，自2016年1月8日起增加收取销售服务费的C类份额。

#### 3.2 基金净值表现

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

##### 1、海富通安颐收益混合 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.62%	0.26%	1.18%	0.01%	2.44%	0.25%

## 2、海富通安颐收益混合 C:

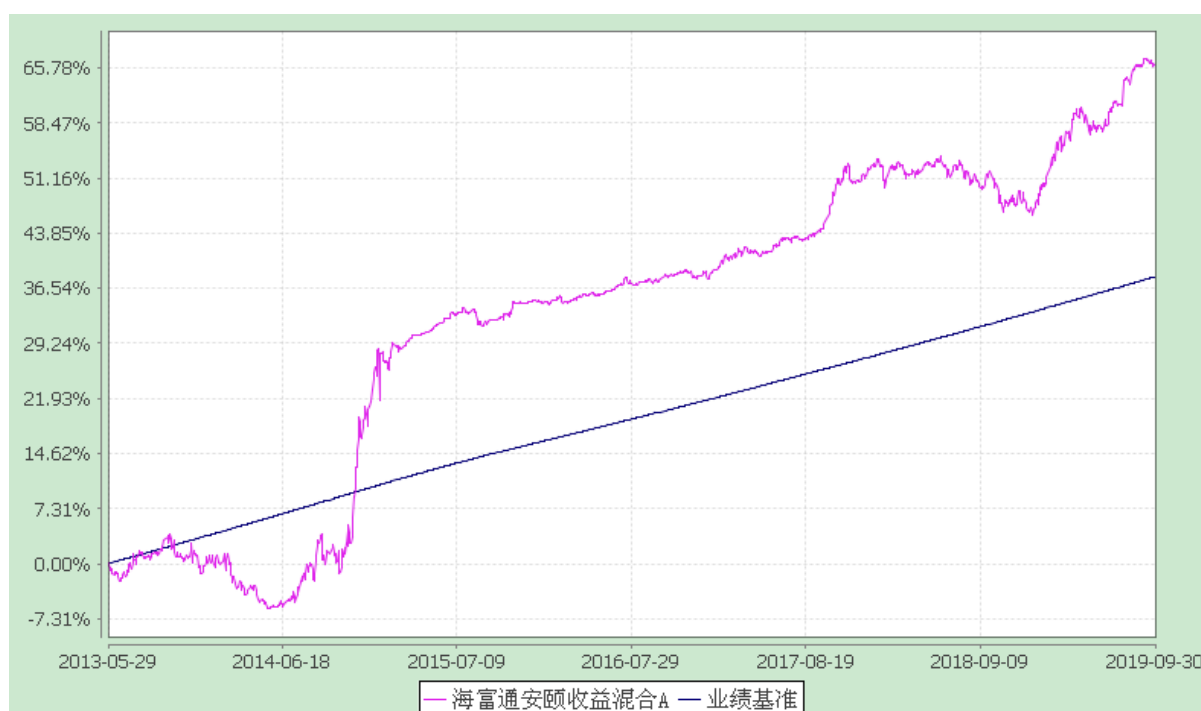
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.55%	0.27%	1.18%	0.01%	2.37%	0.26%

### 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

海富通安颐收益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的历史走势对比图

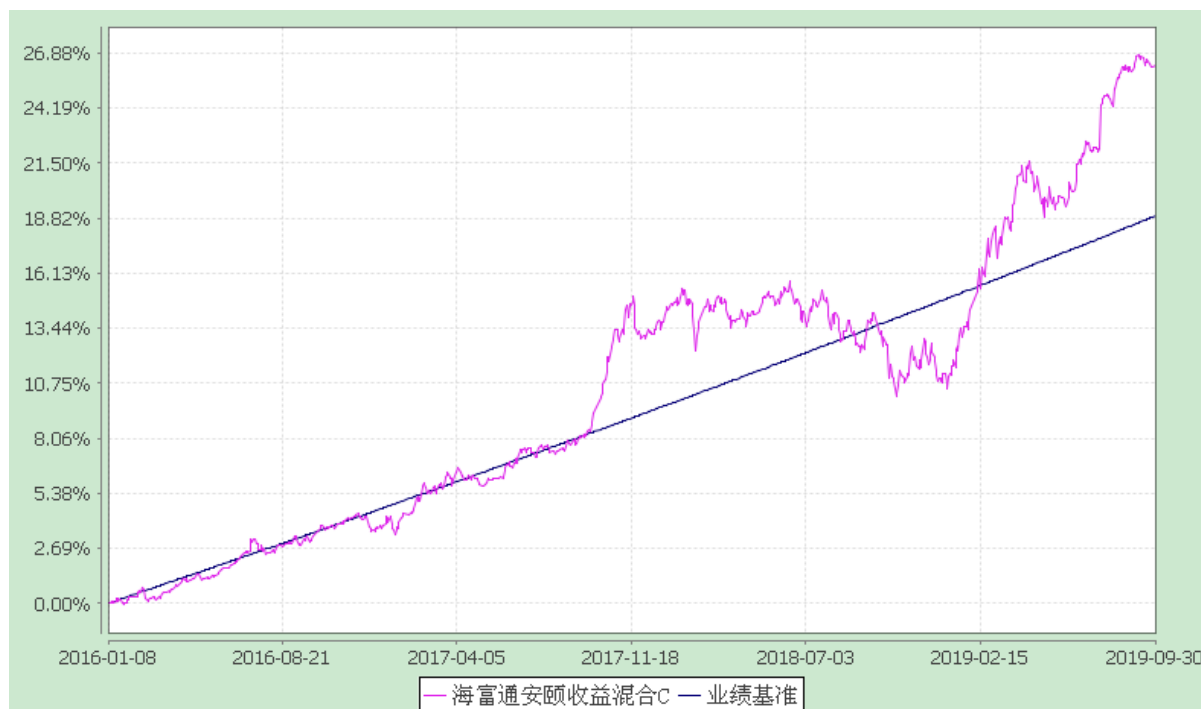
#### 1. 海富通安颐收益混合 A

(2013 年 5 月 29 日至 2019 年 9 月 30 日)



## 2. 海富通安颐收益混合 C

(2016 年 1 月 8 日至 2019 年 9 月 30 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谈云飞	本基金的基金经理；海富	2016-04-22	-	14 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金

	<p>通季季增利理财债券基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通货币基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通强化回报混</p>			<p>经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月起兼任海富通中短债债券基金经理。</p>
--	--	--	--	--

	合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通季季通利理财债券基金经理；海富通中短债债券基金经理。				
杜晓海	本基金的基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通富睿混合基金经理；	2016-06-22	-	19 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通新内需混合和海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月起兼任海富通富睿混合基金经理。2018 年 3 月起兼任海富通富祥混合基金经

	<p>海富通富祥混合基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通量化先锋股票基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通</p>			<p>理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合、海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月起兼任海富通研究精选混合基金经理。</p>
--	--	--	--	--



	量化多因子混合基金经理；海富通研究精选混合基金经理；量化投资部总监				
夏妍妍	本基金的基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通融丰定开债券基金经理；海富通一年定开债券基金经理。	2019-05-22	-	5 年	上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月起任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定开债券和海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019 年第三季度 A 股市场小幅震荡，市场分化严重，科技股为首的小盘股表现较好，而大盘股表现极弱。截至 2019 年 9 月 30 日，上证综指收于 2905.19 点，单三季度下跌 2.47%；深证成指收于 9446.24 点，上涨幅度为 2.92%；中小板指收于 5997.80 点，上涨 5.62%；创业板指上涨 7.68%，报 1627.55 点。

具体来看，7 月份上证综指小幅下跌，大小盘股票开始分化，创业板指数上涨 3.9%。板块上，农林牧渔、电子元器件、国防军工等偏逆周期和成长板块涨幅居前，而周期品有色金属、石油石化、钢铁等板块带动上证指数下跌。进入 8 月份，8 月 1 日美国总统特朗普宣布自 9 月 1 日起对剩余 3000 亿美元中国商品加征 10% 的关税，中美贸易战升级，市场快速大幅下挫。而后，市场开始企稳并迅速反弹，成长、价值股同时有所表现，周期表现依然最差。8 月 8 日，MSCI 决定上调中国大盘 A 股的纳入因子由 10% 至 15%；央行改革 LPR 形成机制，完善贷款市场报价机制，实质性降息；华为发布鸿蒙操作系统，多家科技股中报业绩超预期。最终 8 月上证小幅收跌 1.58%，创业板指涨 2.58%。本月涨幅居前的是食品饮料、医药、电子元器件、国防军工、计算机，跌幅较大的依然

是房地产、钢铁、银行、建筑等强周期板块。9 月份，市场先扬后抑，科技股带动成长板块及市场继续上扬至 9 月中旬。随后茅台现货降价传闻引发白酒板块大跌，成长股近几个月较快上涨录得较大涨幅，估值处于较高位置也开始回调。本月涨幅居前的主要是成长板块通信、电子元器件、计算机，而跌幅最大的是农林牧渔、国防军工、有色金属。

行业方面，在中信 29 个一级行业分类中，11 个行业录得涨幅，单板块间差异巨大。其中，电子元器件（18.63%）、医药（6.86%）、计算机（5.03%）、食品饮料（3.57%）、餐饮旅游（2.34%）涨幅排名前五，而钢铁（-10.51%）、有色金属（-7.04%）、商贸零售（-6.78%）、建筑（-6.73%）、石油石化（-6.24%）跌幅居前。

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

展望未来，本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

债券方面，三季度国内经济数据延续平稳走弱，其中 1-8 月工业增加值、固定资产投资和社会消费品零售总额累计同比上涨 5.6%、5.5% 和 8.2%，增幅较上半年分别收窄 0.4、0.3 和 0.2 个百分点；同时三季度流动性保持相对合理充裕，银行间债券质押式回购利率中枢落在 2.45% 的低位。虽然基本面和资金面对债市有所支撑，但通胀预期的升温、货币政策放松节奏的放缓、以及逆周期调节政策的出台对债市形成一定扰动。具体来看，快速上涨的猪价带动三季度 CPI 中枢抬升至 2.8% 左右，引发市场对年底 CPI 破 3% 的担忧；而国内货币策略显定力，央行在 8 月中旬宣布新 LPR 报价机制、9 月初公告普遍降准和定向降准操作之后，9 月下旬并未跟随美联储降息调降 MLF 利率；此外，9 月初的国务院常务会议宣布提前下达明年专项债部分新增额度，令市场对年内专项债提前发行的预期有所抬升。由此，三季度利率债收益率总体呈低位震荡的态势，10 年期国开债收益率累计小幅下行 8BP，1 年期国开债收益率基本未变，期限利差有所收窄。信用债方面，三季度信用债收益率下行 15-26BP，信用利差收窄 8-20BP，表现优于利率债。7 月中旬以来，市场投资信用债资质有所下沉，评级间利差震荡收窄，但仍未降至 5 月低位。可转债方面，尽管三季度权益市场整体处于震荡区间，但转债市场呈单边上行态势，整体估值水平一路上扬至年内高点，三季度中证转债指数累计上涨 3.62%。

本基金债券部分在三季度，维持了中等期限信用债的配置，参与了利率债的交易，债券部分收益较为稳定。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通安颐收益混合 A 净值增长率为 3.62%，同期业绩比较基准收益率为 1.18%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.44 个百分点。海富通安颐收益混合 C 净值增长率为 3.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.18%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.37 个百分点。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	98,037,268.30	19.72
	其中：股票	98,037,268.30	19.72
2	固定收益投资	329,869,895.60	66.37
	其中：债券	329,869,895.60	66.37
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	51,055,996.58	10.27
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,477,796.11	1.50
7	其他资产	10,589,142.34	2.13
8	合计	497,030,098.93	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	348,428.00	0.07
B	采矿业	857,249.00	0.18
C	制造业	48,356,370.34	10.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,841,937.00	0.80
E	建筑业	2,484,107.00	0.51

F	批发和零售业	1,424,489.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	993,201.95	0.21
H	住宿和餐饮业	384,290.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,023,171.80	0.63
J	金融业	31,064,272.41	6.43
K	房地产业	3,834,824.00	0.79
L	租赁和商务服务业	378,982.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	539,002.80	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	37,089.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	469,854.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	98,037,268.30	20.29

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	83,963	7,308,139.52	1.51
2	601398	工商银行	1,275,600	7,054,068.00	1.46
3	600519	贵州茅台	6,014	6,916,100.00	1.43
4	601939	建设银行	704,100	4,921,659.00	1.02
5	601166	兴业银行	280,300	4,913,659.00	1.02
6	600887	伊利股份	138,000	3,935,760.00	0.81
7	600036	招商银行	107,514	3,736,111.50	0.77
8	600900	长江电力	203,800	3,715,274.00	0.77
9	600048	保利地产	152,900	2,186,470.00	0.45

10	600332	白云山	62,883	2,182,040.10	0.45
----	--------	-----	--------	--------------	------

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	15,698,430.00	3.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,475,000.00	16.45
	其中：政策性金融债	79,475,000.00	16.45
4	企业债券	159,643,726.60	33.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	60,636,000.00	12.55
7	可转债（可交换债）	4,732,739.00	0.98
8	同业存单	9,684,000.00	2.00
9	其他	-	-
10	合计	329,869,895.60	68.28

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	143505	18 舟交 01	300,000	31,095,000.00	6.44
2	190205	19 国开 05	300,000	29,475,000.00	6.10
3	143598	18 陕煤 01	200,000	20,436,000.00	4.23
4	101900415	19 洛阳城投 MTN003	200,000	20,362,000.00	4.21
5	101758039	17 沪打捞 MTN001	200,000	20,296,000.00	4.20

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IF1910	IF1910	-17.00	-19,493,220.0 0	568,440.00	-
公允价值变动总额合计(元)					568,440.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,472,580.0 0
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,152,060.0 0

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值，符合既定投资政策及投资目标。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,995,849.11
2	应收证券清算款	41,018.69
3	应收股利	-
4	应收利息	6,138,543.92
5	应收申购款	2,413,730.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,589,142.34

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113014	林洋转债	754,446.00	0.16
2	110045	海澜转债	483,600.00	0.10
3	110034	九州转债	453,604.80	0.09
4	132015	18 中油 EB	346,535.00	0.07
5	113522	旭升转债	345,090.00	0.07
6	113019	玲珑转债	337,408.60	0.07
7	127005	长证转债	267,306.00	0.06
8	113508	新凤转债	210,504.20	0.04
9	113011	光大转债	203,200.80	0.04
10	110047	山鹰转债	162,375.00	0.03
11	113504	艾华转债	136,936.80	0.03
12	113020	桐昆转债	133,667.70	0.03
13	110041	蒙电转债	118,180.00	0.02



14	132014	18 中化 EB	101,700.00	0.02
15	128028	赣锋转债	101,390.00	0.02
16	128010	顺昌转债	51,115.00	0.01
17	132011	17 浙报 EB	47,950.00	0.01
18	110051	中天转债	45,846.60	0.01
19	132008	17 山高 EB	25,282.50	0.01

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票未存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
本报告期期初基金份额总额	279,017,485.90	18,610,019.10
本报告期基金总申购份额	32,280,359.36	85,713,918.97
减：本报告期基金总赎回份额	24,614,219.21	33,418,689.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	286,683,626.05	70,905,248.63

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/7/1-2019/9/30	73,745,575.22	-	-	73,745,575.22	20.62%
	2	2019/7/1-2019/9/30	118,778,196.31	-	-	118,778,196.31	33.22%

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 70 只公募基金。截至 2019 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 870 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 9 月 30 日，投资顾问及海外业务规模约 38 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 9 月 30 日，海富通为超过 80 家企业约 448 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 9 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约 326 亿元。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 2 月，海富通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。2012 年 9 月，中国证监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2018 年 3 月，国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金。2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

## 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准设立海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）的文件

（二）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）基金合同

（三）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）招募说明书

(四) 海富通安颐收益混合型证券投资基金(原海富通养老收益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) 报告期内海富通安颐收益混合型证券投资基金(原海富通养老收益混合型证券投资基金) 在指定报刊上披露的各项公告

## 9.2 存放地点

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

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇一九年十月二十二日