## 海富通富祥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:中国工商银行股份有限公司 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。

基金托管人中国工商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。

#### № 基金产品概况

基金简称	海富通富祥混合			
基金主代码	519134			
交易代码	519134			
基金运作方式	契约型、开放式			
基金合同生效日	2016年7月27日			
报告期末基金份额总额	41,063,778.98 份			
	本基金通过稳健的大类资产配置策略和个券及个股精			
投资目标	选策略,在严格控制风险的前提下,力争实现超越业			
	绩比较基准的收益。			
	本基金为混合型基金,对债券等固定收益类资产的投			
	资比例不低于基金资产的70%。在此约束下,本基金			
+几次 <del>/</del> 空 m/z	通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估			
投资策略 	值因素、市场风险收益特征及市场行为因素等进行评			
	估分析,对固定收益类资产和股票资产等的预期风险			
	收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。			
小儿。在上人,在六甘、省	中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率			
业绩比较基准	≫30%。			
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	中国工商银行股份有限公司

#### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

<b>全面财权</b> 化标	报告期		
主要财务指标	(2019年7月1日-2019年9月30日)		
1.本期已实现收益	717,630.85		
2.本期利润	632,865.31		
3.加权平均基金份额本期利润	0.0147		
4.期末基金资产净值	45,094,780.49		
5.期末基金份额净值	1.098		

- 注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- (2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增 长率①	净值增长 率标准差 ②	业绩比较基准收益率3	业绩比较基 准收益率标 准差④	1)-(3)	2-4
过去三个月	1.29%	0.17%	0.97%	0.28%	0.32%	-0.11 %

## 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

海富通富祥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 (2016年7月27日至2019年9月30日)



注:本基金合同于2016年7月27日生效,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。

#### 84 管理人报告

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

加力	田务 任本基金的基金经理期限		证券从业	说明	
姓名 ]	<b>い</b> 分	任职日期	离任日期	年限	<b>近</b>
陈轶 平	本金基经海通币金理富稳收基的金票富货基经海通固益	2016-07-27	-	10年	博士,CFA。持有基金 从业人员资格证书。历 任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分 析师、瑞银企业管理(上 海)有限公司固定收益 交易组合研究支持部副 董事,2011年10月加入 海富通基金管理有限公 司,历任债券投资经理、 基金经理、现金管理部 副总监、债券基金部总

债券		-	监,现任固定收益投资
基金		i	副总监。2013年8月起
经理;		,	任海富通货币基金经
海富			理。2014年8月至2019
通一		-	年 9 月兼任海富通季季
年定			增利理财债券基金经
开债			理。2014年11月起兼任
券基			海富通上证可质押城投
金经			债 ETF(现为海富通上
理;海			证城投债 ETF) 基金经
富通			理。2015年12月起兼
上证			任海富通稳固收益债券
址			基金经理。2015 年 12
债			月至 2017 年 9 月兼任海
ETF			富通稳进增利债券
基金			(LOF)基金经理。2016
经理;		2	年 4 月起兼任海富通一
海富			年定开债券基金经理。
通瑞			2016年7月起兼任海富
丰债			通富祥混合基金经理。
			2016年8月起兼任海富
金经			通瑞丰一年定开债券
理;海			(现为海富通瑞丰债
富通			券)基金经理。2016年
美元		1	8月至2017年11月兼任
债			海富通瑞益债券基金经
(QD			理。2016年11月起兼任
II)基			海富通美元债(QDII)
金经			基金经理。2017年1月
理;海			起兼任海富通上证周期
富通			产业债 ETF 基金经理。
上证			2017年2月起兼任海富
周期			通瑞利债券基金经理。
产业			2017年3月至2018年6
债			月兼任海富通富源债券
ETF			基金经理。2017年3月
基金			起兼任海富通瑞合纯债
经理;			基金经理。2017年5月
海富			至2019年9月兼任海富
通瑞			通富睿混合基金经理。
利债			2017年7月至2019年9
券基			月兼任海富通瑞福一年
金经			定开债券(现为海富通
理;海			瑞福债券)、海富通瑞祥
_ · · •	1		

富通
<ul> <li>・</li></ul>
基金 经理; 海
经理;       年4月起兼任海富通恒         海富       車定开债券基金经理。         2018年10月起兼任海富通上证 10年期地方政府债 ETF基金经理。       2018年11月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。         金经理;海富通       全理。2019年1月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。         10年期地方政府债       大政府债         ETF       医工厂
海富 通恒 丰定 开债券基金经理。 2018 年 10 月起兼任海 富通上证 10 年期地方 政府债 ETF 基金经理。 2018 年 11 月起兼任海 富通弘丰定开债券基金 经理。2019 年 1 月起兼 任海 富通上证 10 年 期地 方政 府债 ETF
通恒 丰定 开债 第通上证 10 年期地方 政府债 ETF 基金经理。 2018 年 11 月起兼任海 富通上证 10 年期地方 政府债 ETF 基金经理。 2018 年 11 月起兼任海 富通弘丰定开债券基金 经理。2019 年 1 月起兼 富通 上证 10 年 期地 方政 府债 ETF
丰定     富通上证 10 年期地方       开债     数府债 ETF 基金经理。       2018 年 11 月起兼任海     富通弘丰定开债券基金       经理。2019 年 1 月起兼     任海富通上清所短融债       上证     5政府债       百万     存债       ETF     ETF
开债 券基 金经 理;海 富通 上证 10年 期地 方政 府债 ETF政府债 ETF 基金经理。 2018 年 11 月起兼任海 第通弘丰定开债券基金 经理。2019 年 1 月起兼 任海富通上清所短融债 券基金经理。
券基       2018 年 11 月起兼任海         金经       理;海         富通       经理。2019 年 1 月起兼任海         任海富通上清所短融债       券基金经理。         10 年       期地         方政       府债         ETF       ETF
金经       囯;海       宫通弘丰定开债券基金         至理。2019年1月起兼       任海富通上清所短融债         大基金经理。       券基金经理。         10年       期地         方政       府债         ETF       ETF
理;海       经理。2019年1月起兼         任海富通上清所短融债       券基金经理。         10年       期地         方政       府债         ETF       经理。2019年1月起兼         任海富通上清所短融债       券基金经理。
富通     任海富通上清所短融债       上证     券基金经理。       10年     期地       方政     府债       ETF     ETF
上证 10年 期地 方政 府债 ETF
10 年 期地 方政 府债 ETF
10年       期地       方政       府债       ETF
期地 方政 府债 ETF
方政 府债 ETF
府债 ETF
ETF
基金
经理:
海富
通弘
一   千足
所短
融债
理; 固
定收
益投
总监。
本基
杜晓 金的 员资格证书。历任
基金
全型;   金融工程师, American
海富 Bourses Corporation 中

題內 國內 國內 國內 國內 國內 國內 國內 國內 國內 國	2名 /六		国区 首
益混合基金经理:海面通 特理 ( )	通安		国区总经理,海富通基
<ul> <li>金经理海富通 (本) (本) (本) (本) (本) (本) (本) (本) (本) (本)</li></ul>			
理;海 高通 新內 需混 合基 金经 理;海 高進 高進 金经 理;海 高通 高速 海富 高通 高速 海富 高速 海富 高速 海雷 高速 海雷 高速 海雷 高速 海雷 高速 海雷 高速 海雷 高速 海雷 高速 海雷 高速 海雷 高速 海雷 高速 海面 高速 海面 高速 多经理。2018 年 1 月兼任 海雷 三面富 年 2018 年 2 月 末 任 海雷 三面富 年 2018 年 4 月 至 建。 宣通富 年 4 月 之 建。 宣通富 年 4 月 基 金经理。 2018 年 4 月 互 通富 年 7 月 兼任基 金全经理。 2018 年 4 月 至 2018 年 4 月 至 通 高通 阿尔尔 法对 冲混 合。海雷量化前蜂漫票、 海富面他的蜂漫票、 海富面他的蜂漫票、 海富面他的蜂漫票、 海富面他的蜂漫票、 海富面他的身上来任 海客 一种, 高速 全经理。 2019 年 6 月 起 秦廷 是 二面。 一种。 一种。 一种。 一种。 一种。 一种。 一种。 一种。 一种。 一种	合基		定量及风险管理负责
高通 新內 需混 合基 金经 理;海 高通 高通 成荣 混合基金经理。2016年 多月起兼任經。通過於 混合基金经理。2017年 多月起東在經歷2018年 多月起東在經歷2018年 多月起東在經歷2018年 4月至2019年 6月至2018年 4月至2019年 6月至2018年 4月至201	金经		人、定量及风险管理总
新内需混合基金经理:海宫通 公司6年6月起任海宫通道实现收益处理。2016年6月起在海宫通道安通收益混混合的。原海宫通过2016年9月起来金经理。2016年9月起来金经理。2016年1月乘在基金经理。2018年1月乘在基金经理。2018年1月乘在基金经理。2018年1月乘在基金经理。2018年1月乘后基金经理。2018年1月至三通宫宿福是金经理。2018年1月至三级报告,为基本任海宫通信等和,是是是一个专项的。1018年1月,1018年1	理;海		监、多资产策略投资部
需混合基金经理;海富通新内需混合和海富通多顾收益混合(原海富通养皮管理。2016年6月起来全种富通多顾收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理。2017年6月基金经理。2017年6月基金经理。2018年1月兼任海富通商营税。2018年1月未任海富通企管理。2018年1月未经理。1018年3月基基任海富通富营税。2018年3月基基任海富通富营税。2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月起来任海富通阿尔大数据记号基金经理。2018年4月起来任海富通阿尔大数据记号基金经理。2018年4月起来记录高通阿尔法对冲混合、海面量化的设备、海面量化的设备、高速经任理。2019年6月起来证金。1019年6月起来任海富通价。1019年6月起来任海富通经经理。2019年6月起来任海富通经经理。2019年6月起来任海富通经经理。2019年6月起来任海富通经经理。2019年6月起来任海富通经经理。2019年6月起来任海富通经经理。2019年6月起来任海富通经经理。2019年6月起来任海富通经经理:海富通量化的经验是基金经理:海富量化的经验是基金经理:海富通量化的经验是基金经理:海富通量化的经验是基金经理:海富通量化的经验是是基金经理:海富通量化的经验是是是一种经验是是一种经验是是一种经验是是一种经验是是一种经验是是一种经验是一种经验	富通		总监,现任海富通基金
合基 金经 理: 海 富通 安顺收益混合 (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 著混合基 金经理。2018年 3 月起 兼任海富通富省混合基 金经理。2018年 4 月至 2018年 7 月兼任海富通富祥混合基 金经理。2018年 4 月至 2018年 7 月兼任海富通高报时,为数据混合基金经理。2018年 4 月起 兼任海富通国通知业板增强。2018年 4 月起 中沿。高通富通创业板增强。2018年 4 月起 中沿。高通量化的益量、2018年 4 月起 中沿。高通量化多位,海富通通创业板增聚。海富通稳的收益。高通量化多位,海高通量化多位,海高通量化多位,海高通量化多位,海高通量经理。2019年 6 月起兼任 海富通量化 前锋 股票基金经理:海富通量化	新内		管理有限公司量化投资
金经理:海宫通	需混		部总监。2016年6月起
理;海 富通 於荣 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 海富通富睿混合基 金经理。2018年3月起 兼任海富通富睿混合基 金经理。2018年3月起 兼任海富通富祥混合基 金经理。2018年4月至 2018年7月兼任海富通 高通阿尔法对冲混 合基。金经理:海富通创业板增强、海富通创业板增强、海富通量化的锋股票、海富通和欣章混合、海温量化多因子(各种、海、海、高通、海、海、海、高通量化多。 理:海富通 包土 化 第二 2019年6月起来任 海宫通研究精选混合基金经理:海宫通量化	合基		任海富通新内需混合和
理;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月兼任海富通欣盛之17年5月起秦企经理。2018年3月起秦任海富通富睿混合基金经理。2018年3月起秦任海富通富睿混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海富通富河东财大数据混合基金经理。2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年6月起兼任海富通问尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通创业板增强、海富通通欣查、海富通创业板增强、海富通通农市等股票、海富通通、企经理、海富通量化的联票基金经理。	金经		海富通安颐收益混合
富通 欣荣 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5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2018年4月至2018年4月至2018年7月兼任海富通高岭混合基金经理。2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至2018年4月至土海高通时外流域,海高通量化的峰质质,海高通化的峰质质,海高通化多因子混合的基金经理。2019年6月起兼任海高通研究精选混合基金经理,海高通量化前锋限票基金经理,海高通量化前锋限票基金经理,海高			
除荣 混合基金经理。2017年 4月至2018年1月兼任 海富通於盛定开混合基 金经理。2017年5月起 兼任海富通富睿年3月起 兼任海富通富睿年3月起 兼任海富通富睿年3月起 秦经理。2018年3月起 兼任海富通高睿年3月起 兼任海富通高睿年3月起 秦经理。2018年4月至 2018年7月兼任海富通 京财大数据混合基金经 理。2018年4月至 1018年7月兼任海富通 京财大数据混合基章 理。2018年4月延兼任 海富通创业板增强、海富通是化的锋股票、海富通是化的锋股票、海富通流混合、海宫量化多因子混合、海宫量化多因子混合。有月起兼任 海岛通外交流。2019年6月起兼任 海宫通研究精选混合基 金经理;海富通 量化 前锋股票基金 经理;海富量			
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月起兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2018年3月起兼任海富通富祥混合基金经理。2018年7月兼任海富通富祥混合基金经理。2018年7月兼任海富通高祥混合基金经理。2018年7月兼任海富通阿尔法对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、海富通创业板增强、海富通创业板增强、海富通最大新产品。通时企业、海富通、企业、海富通研究精选混合基金经理。2019年6月起兼任海富通研究精选混合基金经理。			·
基金 经理; 海富 通富 睿混 合基 金经理。2017 年 5 月起 兼任海富通官睿混合基 金经理。2018 年 3 月起 兼任海富通富祥混合基 金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通 案好大数据混合基 金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通 案财大数据混合基 金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通 系财大数据混合基 全理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通 系财大数据混合基 全理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通 系财大数据混合基 全理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月走任海富通 系财大数据混合基 建。2019 年 6 月起兼任海富通研究精选混合基 金经理。 2019 年 6 月起兼任海富通研究精选混合基 金经理。 2019 年 6 月起兼任海富通研究精选混合基 金经理。 2019 年 6 月起秦任海富通研究精选混合基 金经理。 2019 年 6 月起秦任海富通研究精选混合基 金经理。			=
经理: 海富 通富 睿混 合基 金经理。2017 年 5 月起 兼任海富通富睿混合基 金经理。2018 年 3 月起 兼任海富通富祥混合基 金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通 东财大数据混合基金经 理。2018 年 4 月至 理。2018 年 4 月至 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、海富通量化前锋股票、海富通舱之流合、海富通舱之流合、海富通金经 理;海 富通 创业 板增 强基 金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理;海 富通			
海富 通富 睿混 合基 金经理。2018 年 3 月起 兼任海富通富祥混合基 金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通 家财大数据混合基金经 理。2018 年 4 月起 新大数据混合基金经 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、海富通量化前锋股票、海富通最险单混合、海富通量化前锋股票、海富通融上、海富通所之混合、海富通量、企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:海富通量化前锋股票			
通富 睿混 合基 金经理。2018 年 3 月起 兼任海富通富祥混合基 金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通 东财大数据混合基金经 理。2018 年 4 月起兼任 海富通阿尔法对冲混 合、海富通创业板增强、 海富通量化前锋股票、 海富通航成享混合、海富通 创业 板增 强基 金经 理:海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理:海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理:海 富通	' - '		
香混 金经理。2018年3月起 兼任海富通富祥混合基 金经理。2018年4月至 2018年4月至 2018年4月起兼任 海富通 河尔 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 前锋 股票 基金 经理:海富			
合基金经理:海宫通宫样混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海宫通宫样混合基金经阿尔大数据混合基金经理。2018年4月起兼任海宫通阿尔法对冲混合、海宫通创业板增强、海宫通量化前锋股票、海宫通融险时益债券、海宫通融险时益债券、海宫通融险时益债券、海宫通量化多因子混合的基金经理。2019年6月起兼任海宫通研究精选混合基金经理:海宫			
金经理;海富通 宗财大数据混合基金经理。2018年4月至2018年7月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通量化前锋股票、海富通通政企员,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;海富通量化前锋股票基金经理;海富			
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 前锋 股票 基金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金经 理;海 富通研究精选混合基 金经 理。2019 年 6 月起兼任 海富通研究精选混合基 金经理。2019 年 6 月起,在 海富通研究精选混合基 金经理;海 富通			
富通 阿尔 法对 冲混 合基金经理。2018年4月起兼任 海富通阿尔法对冲混 合基 金经 理:海 富通 创业 板增 强			
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 前锋 股票 基金 经理;海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理;海 富 重			
法对	I ' '		
中混合基金经理;海富通 创业	阿尔		
合基 金经理;海 富通 创业 板增 强基 金经理;海富 富通 量化 前锋 股票 基金 经理;海富	法对		海富通阿尔法对冲混
金经理:海富通	冲混		合、海富通创业板增强、
理;海 富通 创业 板增 强基 金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理;海富	合基		海富通量化前锋股票、
富通 创业 板增 强基 金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理;海富	金经		海富通稳固收益债券、
创业 板增 强基 金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理;海富	理;海		海富通欣享混合、海富
板增 强基 金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理;海富	富通		通欣益混合、海富通量
强基 金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理; 海富	包业		化多因子混合的基金经
强基 金经 理;海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理; 海富	板増		理。2019年6月起兼任
金经理:         理: 海         富通         量化         前锋         股票         基金         经理:         海富			
理; 海 富通 量化 前锋 股票 基金 经理; 海富			
富通         量化         前锋         股票         基金         经理;         海富			<u> </u>
量化 前锋 股票 基金 经理; 海富			
前锋 股票 基金 经理; 海富	I ' '		
股票 基金 经理; 海富			
基金       经理;       海富	'''		
经理;     海富			
海富			
	I		
週稿			

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			
量化			
多因			
子混			
合基			
金经			
理;量			
化投			
资部			
总监;			
海富			
通研			
究精			
选混			
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遵规守信情况的说明

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。

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。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;而国内货币政策略显定力,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%。

本基金在三季度灵活调整利率债的久期,积极参与波段机会。同时,本基金三季度根据市场情况调整了可转债资产仓位,以在控制波动的同时获取权益上涨收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通富祥基金净值增长率为1.29%,同期业绩比较基准收益率为0.97%,基金净值跑赢业绩比较基准0.32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

本基金自 2019 年 5 月 27 日至 2019 年 8 月 16 日,已连续五十九个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

#### %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	6,850,115.60	15.10
	其中: 股票	6,850,115.60	15.10
2	固定收益投资	34,367,804.55	75.74
	其中:债券	34,367,804.55	75.74
	资产支持证券	1	ı
3	贵金属投资	1	ı
4	金融衍生品投资	1	ı
5	买入返售金融资产	1	ı
	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	3,729,343.34	8.22
7	其他资产	426,422.05	0.94
8	合计	45,373,685.54	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	8,650.00	0.02
В	采矿业	17,748.00	0.04
С	制造业	2,876,683.60	6.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	6,307.00	0.01
Е	建筑业	180,233.00	0.40
F	批发和零售业	39,738.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	38,021.00	0.08
Н	住宿和餐饮业	1	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	176,684.00	0.39
J	金融业	3,085,831.00	6.84

K	房地产业	290,444.00	0.64
L	租赁和商务服务业	42,663.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	31,218.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	2,853.00	0.01
О	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	53,042.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	6,850,115.60	15.19

#### 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	601939	建设银行	130,000	908,700.00	2.02
2	601166	兴业银行	45,600	799,368.00	1.77
3	601318	中国平安	7,200	626,688.00	1.39
4	600036	招商银行	16,600	576,850.00	1.28
5	600887	伊利股份	14,400	410,688.00	0.91
6	600519	贵州茅台	200	230,000.00	0.51
7	000338	潍柴动力	15,300	171,666.00	0.38
8	000002	万科 A	6,600	170,940.00	0.38
9	000651	格力电器	2,300	131,790.00	0.29
10	000333	美的集团	2,421	123,713.10	0.27

## 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	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,190,289.80	44.77
	其中: 政策性金融债	20,190,289.80	44.77
4	企业债券	8,058,600.00	17.87
5	企业短期融资券	-	ı
6	中期票据	-	1
7	可转债(可交换债)	6,118,914.75	13.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,367,804.55	76.21

#### 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	160210	16 国开 10	100,000	9,703,000.00	21.52
2	018007	国开 1801	50,700	5,130,840.00	11.38
3	108602	国开 1704	30,000	3,021,300.00	6.70
4	018009	国开 1803	21,310	2,335,149.80	5.18
5	127208	15 国网 01	20,000	2,070,400.00	4.59

# 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 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。

#### 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

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### 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

本报告期,本基金未参与国债期货投资。

#### 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,或在报告编制目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	3,933.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	421,926.49
5	应收申购款	562.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	426,422.05
---	----	------------

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

				占基金资产净
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	直坐金贯广伊 值比例(%)
1	113019	玲珑转债	166,276.90	0.37
2	113522	旭升转债	165,643.20	0.37
3	123009	星源转债	163,363.20	0.36
4	110041	蒙电转债	160,724.80	0.36
5	128021	兄弟转债	160,131.18	0.36
6	113013	国君转债	158,557.50	0.35
7	113518	顾家转债	157,878.80	0.35
8	110048	福能转债	157,072.50	0.35
9	128019	久立转 2	156,996.00	0.35
10	113020	桐昆转债	156,142.80	0.35
11	127006	敖东转债	155,844.00	0.35
12	128045	机电转债	155,692.80	0.35
13	113508	新凤转债	155,272.90	0.34
14	113504	艾华转债	154,325.60	0.34
15	113515	高能转债	153,335.70	0.34
16	113011	光大转债	153,252.00	0.34
17	110042	航电转债	152,988.00	0.34
18	128048	张行转债	152,609.60	0.34
19	110050	佳都转债	152,308.10	0.34
20	113519	长久转债	152,139.00	0.34
21	127005	长证转债	151,667.10	0.34
22	110043	无锡转债	151,358.20	0.34
23	110046	圆通转债	151,244.80	0.34
24	110038	济川转债	151,088.00	0.34
25	113017	吉视转债	150,475.10	0.33
26	110045	海澜转债	150,117.50	0.33
27	113516	吴银转债	148,577.10	0.33

	_	T	1	
28	110047	山鹰转债	148,302.50	0.33
29	113523	伟明转债	148,204.80	0.33
30	128046	利尔转债	147,976.29	0.33
31	110049	海尔转债	147,525.00	0.33
32	132009	17 中油 EB	147,378.40	0.33
33	113505	杭电转债	146,462.40	0.32
34	128034	江银转债	145,953.36	0.32
35	113525	台华转债	145,462.50	0.32
36	113517	曙光转债	144,360.90	0.32
37	110044	广电转债	101,959.20	0.23
38	128047	光电转债	97,991.52	0.22
39	113008	电气转债	87,172.00	0.19
40	110034	九州转债	154,396.00	0.34
41	123002	国祯转债	160,687.50	0.36

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## % 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	43,702,079.13
本报告期基金总申购份额	4,652,683.85
减:本报告期基金总赎回份额	7,290,984.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,063,778.98

#### **§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。

#### 88 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

序号     超过20%的时间     份额     份额     额     持有份额       区间     18,68		报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情 况	
1 2019/7/1=2019 1 1 1 1 1 1 8 687 850 1		序号	比例达到或者 超过20%的时间				持有份额	份额占 比
机构 1 /9/30   7,850   -   -   18,661,666   45.8	机构	1	2019/7/1-2019 /9/30	7, 850	I	I	18, 687, 850 . 48	45. 51%

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。

#### 89 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富祥混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富祥混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富祥混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富祥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)报告期内海富通富祥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