

海富通可转债优选债券型证券投资基金
(原海富通双福债券型证券投资基金)

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。

本报告期内，原海富通双福债券型证券投资基金转型为海富通可转债优选债券型证券投资基金。原海富通双福债券型证券投资基金本报告期自 2019 年 7 月 1 日至 2019 年 7 月 3 日止，海富通可转债优选债券型证券投资基金本报告期自 2019 年 7 月 4 日至 2019 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 海富通可转债优选债券型证券投资基金

基金简称	海富通可转债优选债券
基金主代码	519059
交易代码	519059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年7月4日
报告期末基金份额总额	144,501,128.72份
投资目标	本基金以可转换债券为主要投资对象，在严格控制风险的基础上，通过积极主动的管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券资产的投资比例不低

	<p>于基金资产的80%，投资于可转换债券、可分离交易可转换债券的比例合计不低于非现金基金资产的80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。由于可转换债券兼具债性和股性，本基金将着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究。对于可转换债券的投资将主要从三个方面的分析：数量为主的价值分析、债股性分析和公司基本面分析。通过以上分析，力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好，并且发行人成长性良好的品种进行投资。</p>
业绩比较基准	<p>中证可转换债券指数收益率×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%+沪深300指数收益率×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。</p>
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

2.2 海富通双福债券型证券投资基金

基金简称	海富通双福债券
基金主代码	519059
交易代码	519059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月6日
报告期末基金份额总额	6,788,764.67份

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，积极把握信用类债券的投资机会，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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

§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4日-2019年 9月30日)	报告期 (2019年7月1日-2019 年7月3日)
1.本期已实现收益	297.93	-75,383.71
2.本期利润	1,177.93	-154,950.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0002	-0.0141
4.期末基金资产净值	5,537,542.06	113,949,611.62
5.期末基金份额净值	0.8157	0.7886

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) 海富通基金管理有限公司于2019年7月3日刊登公告,《海富通可转债优选债券型证券投资基金基金合同》将自2019年7月4日起生效,原《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》将自同日起失效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 海富通可转债优选债券型证券投资基金

(报告期:2019年7月4日-2019年9月30日)

3.2.1.1 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

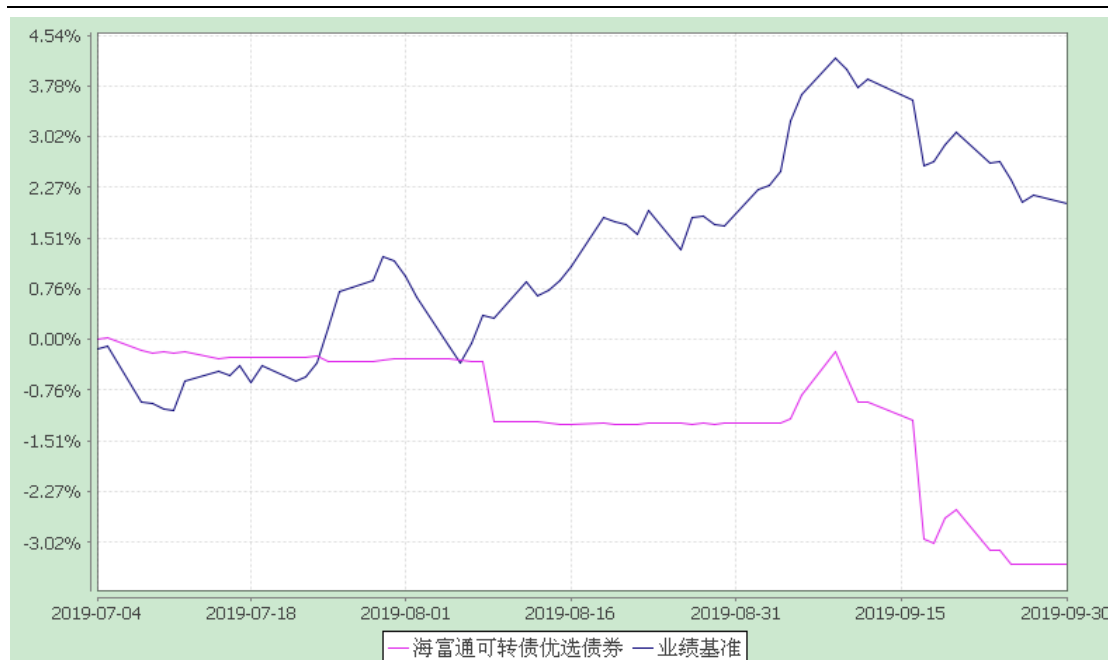
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019.7.4-2019.9.30	-3.36%	0.30%	2.02%	0.35%	-5.38%	-0.05%

3.2.1.2 自基金转型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

海富通可转债优选债券型证券投资基金

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

(2019年7月4日-2019年9月30日)



注：1.本基金第二次转型日期为 2019 年 7 月 4 日，截止报告期末，本基金第二次转型后基金合同生效未满一年。

2.按基金合同的约定，自基金合同转型生效之日起六个月内为建仓期，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2.2 海富通双福债券型证券投资基金

（报告期：2019年7月1日-2019年7月3日）

3.2.2.1 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

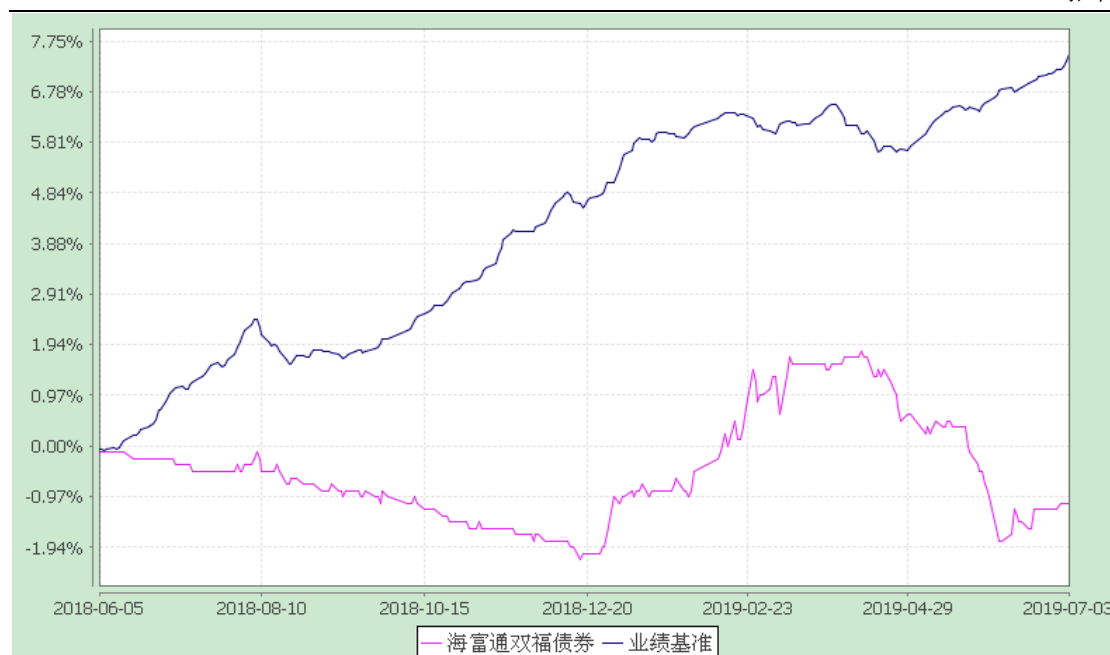
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019.7.1-2019.7.3	0.00%	0.00%	0.28%	0.04%	-0.28%	-0.04%

3.2.2.2 自基金转型（第一次）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

海富通双福债券型证券投资基金

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

(2018年6月5日-2019年7月3日)



注：本基金合同于2014年5月6日生效，于2018年6月5日完成第一次转型。按照本基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同生效起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（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		
何谦	本基金的基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通	2016-05-06	-	8年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任平安银行资金交易员，华安基金管理有限公司债券交易员，2014年6月加入海富通基金管理有限公司，任海富通货币基金经理助理。2016年5月至2017年10月兼任海富通双利债券基金经理。2016年5月起任海

	货币基金 经理； 海富通集利债券基金 经理；海富通添益货币基金 经理；海富通聚丰纯债债券基金 经理；海富通稳健添利债券基金 经理。				富通纯债债券、海富通可转债优选债券（原海富通双福债券）及海富通货币基金经理。2016年9月起兼任海富通集利债券基金经理。2017年8月起兼任海富通添益货币基金经理。2018年11月起兼任海富通聚丰纯债债券基金经理。2019年4月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。
--	---	--	--	--	---

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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%。

三季度，本基金转型成功，后续按照可转债基金的投资范围和投资策略进行主动投资管理。

展望四季度，预计年内经济向下空间或有限，而通胀中枢大概率逐步上行。具体来看，房地产投资或平稳回落，制造业投资难言回暖，而在政策支撑下基建投资增速大概率延续回升；汽车的拖累有望逐步缓释，消费或有所企稳；需求疲软背景下企业生产动能或维持弱势，同时全球经济下行风险加大，出口难有起色，但考虑到去年四季度基数较低，年内工业生产和出口压力或有限。通胀方面，在猪价高位和基数影响下，年底CPI大概率破3%，而PPI或低位企稳，于10月触及年内低点。总体看四季度国内经济下行风险可控，而通胀面临阶段性压力。因此，考虑到政府对经济下行容忍度的提升和通胀中枢的抬升，四季度货币政策放松的节奏或有放缓，但央行大概率将维持流动性的合理充裕。在上述判断下，我们认为四季度利率或延续震荡态势，利率债交易机会或有限，但若出现较大调整则可关注其配置价值。信用债方面，目前票息保护有限，信用利差处于历史低位，市场相对脆弱，久期上推荐中短久期；品种上，在基建托底、政府协调力保城投公募债不出现实质性违约的情况下，城投债超额利差压缩的空间大于产业债。可转债方面，四季度海外股市波动加大可能对国内带来影响，而转债短期问题在于高估值，整体防御性变差。因此策略上可由进攻转向防御，重点关注绝对价格和估值均不高的标的以及转股溢价率较低的核心标的。

四季度，本基金将密切关注国内货币政策的导向、宏观经济走势、通胀水平，关注债券的配置机会，为明年做好准备。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，原海富通双福债券（2019.7.1-2019.7.3）基金份额净值增长率为0.0%，同期业绩比较基准收益率为0.28%；海富通可转债优选债券（2019.7.4-2019.9.30）基金份额净值增长率为-3.36%，同期业绩比较基准收益率为2.02%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

海富通双福债券型证券投资基金自2018年6月5日至2019年7月3日，已

连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形,并在此期间出现了连续超过六十个工作日存在基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人于2019年6月4日至2019年7月1日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议通过了《关于变更注册海富通双福债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据持有人大会通过的议案及方案说明,本基金于2019年7月4日起正式转型为海富通可转债优选债券型证券投资基金。

海富通可转债优选债券型证券投资基金自2019年7月4日至2019年9月25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,并出现了连续五十九个工作日存在基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§5 投资组合报告

5.1 海富通可转债优选债券型证券投资基金

(报告期:2019年7月4日-2019年9月30日)

5.1.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	93,633,328.86	82.13
	其中:债券	93,633,328.86	82.13
	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	-	-
	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	17,964,955.12	15.76
7	其他各项资产	2,403,804.21	2.11

8	合计	114,002,088.19	100.00
---	----	----------------	--------

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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。

5.1.2.2 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。

5.1.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 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	90,027,000.00	79.01
	其中：政策性金融债	90,027,000.00	79.01
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）	3,606,328.86	3.16
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	93,633,328.86	82.17

5.1.5 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	180216	18 国开 16	900,000	90,027,000.00	79.01

2	113009	广汽转债	2,400	273,720.00	0.24
3	127011	中鼎转2	2,470	268,390.20	0.24
4	113022	浙商转债	2,460	263,712.00	0.23
5	113011	光大转债	2,320	263,366.40	0.23

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 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。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不投资股指期货。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

5.1.10.2 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。

5.1.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内本基金未投资国债期货。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 报告期内本基金投资的长证转债（127005）的发行人，因对境外子公司

管理方面存在未按规定履行报告义务、对境外子公司管控不到位,未有效督促境外子公司强化风险管理及审慎开展业务、对境外子公司的绩效考核存在不足等问题,于2019年6月13日被湖北证监局处以责令改正的行政监管措施。

对该证券的投资决策程序的说明:该券商为全国大型综合券商,全国排名前列,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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	801.86
2	应收证券清算款	278,766.21
3	应收股利	-
4	应收利息	2,124,236.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,403,804.21

5.1.11.4 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	113009	广汽转债	273,720.00	0.24
2	127011	中鼎转2	268,390.20	0.24
3	113022	浙商转债	263,712.00	0.23
4	113011	光大转债	263,366.40	0.23
5	113013	国君转债	261,913.50	0.23
6	113008	电气转债	260,369.00	0.23

7	128045	机电转债	258,724.80	0.23
8	127005	长证转债	256,846.20	0.23
9	110042	航电转债	245,708.00	0.22
10	110031	航信转债	218,453.40	0.19
11	128046	利尔转债	126,308.70	0.11
12	128019	久立转2	106,533.00	0.09
13	127007	湖广转债	102,819.20	0.09
14	128055	长青转2	99,751.86	0.09
15	127012	招路转债	95,461.40	0.08

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.2 海富通双福债券型证券投资基金

(报告期: 2019年7月1日-2019年7月3日)

5.2.1 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	-	-
	其中: 股票	-	-
2	固定收益投资	4,466,940.00	80.29
	其中: 债券	4,466,940.00	80.29
	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	-	-
	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	1,052,280.15	18.92
7	其他各项资产	43,945.75	0.79
8	合计	5,563,165.90	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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。

5.2.2.2 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。

5.2.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.4 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	4,466,940.00	80.67
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）	-	-
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,466,940.00	80.67

5.2.5 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	019611	19 国债 01	26,500	2,648,940.00	47.84
2	108602	国开 1704	18,000	1,818,000.00	32.83

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 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。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不投资股指期货。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不投资国债期货。

5.2.10.2 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。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不投资国债期货。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	759.87
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	-
4	应收利息	43,185.88

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,945.75

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

6.1 海富通可转债优选债券型证券投资基金

单位：份

基金转型日（2019-07-04）基金份额总额	6,788,764.67
基金转型日起至报告期期末基金总申购份 额	139,679,691.32
减：基金转型日起至报告期期末基金总赎 回份额	1,967,327.27
基金转型日起至报告期期末基金拆分变动 份额	-
本报告期末基金份额总额	144,501,128.72

注：海富通可转债优选债券型证券投资基金报告期期间:2019年7月4日至2019年9月30日。

6.2 海富通双福债券型证券投资基金

单位：份

报告期期初基金份额总额	6,788,764.67
报告期基金总申购份额	-
减：报告期基金总赎回份额	-

报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	6,788,764.67

注：海富通双福债券型证券投资基金报告期期间:2019年7月1日至2019年7月3日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 海富通可转债优选债券型证券投资基金

7.1.1 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。

7.1.2 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。

7.2 海富通双福债券型证券投资基金

7.2.1 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。

7.2.2 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 海富通可转债优选债券型证券投资基金

8.1.1 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	2019/07/04-2019/09/16	1,823,905.56	0.00	1,823,905.56	0.00	0.00%
	2	2019/07/04-2019/09/25	1,823,905.56	-	-	1,823,905.56	1.26%

			6				
	3	2019/9/26-2019/09/30	-	44,381,181.84	-	44,381,181.84	30.71%
	4	2019/9/26-2019/09/30	-	31,700,481.87	-	31,700,481.87	21.94%

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。

注：期初日期指基金转型日2019年7月4日

8.2 海富通双福债券型证券投资基金

8.2.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间区间					
机构	1	2019/07/01-2019/07/03	1,823,905.56	-	-	1,823,905.56	26.87%
	2	2019/07/01-2019/07/03	1,823,905.56	-	-	1,823,905.56	26.87%

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。

注：期末日期指基金转型前最后一日

8.3 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予海富通双福债券型证券投资基金变更注册的文件
- （二）海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金基金合同

(三) 海富通双福债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金招募说明书

(四) 海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券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) 报告期内海富通双福债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券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