

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金
(原海富通富睿混合型证券投资基金)

2019 年第 4 季度报告

2019 年 12 月 31 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：二〇二〇年一月二十一日

§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 2020 年 1 月 20 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，原海富通富睿混合型证券投资基金转型为海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金。原海富通富睿混合型证券投资基金本报告期自 2019 年 10 月 1 日至 2019 年 10 月 8 日止，海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金本报告期自 2019 年 10 月 9 日至 2019 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

基金简称	海富通沪深 300 增强
基金主代码	004512
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 9 日
报告期末基金份额总额	9,482,235.53 份
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型股票指数基金，以沪深 300 指数

	为标的指数。本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在跟踪目标指数的基础上一定程度地调整投资组合，力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%（税后）	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
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	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
下属两级基金的交易代码	004513	004512
报告期末下属两级基金的份额总额	6,399,058.06 份	3,083,177.47 份

2.2 海富通富睿混合型证券投资基金

基金简称	海富通富睿混合
基金主代码	004512
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 10 日
报告期末基金份额总额	8,444,869.53 份
投资目标	本基金通过稳健的大类资产配置策略和个券及个股精选策略，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。	
投资策略	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。在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×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	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通富睿混合 A	海富通富睿混合 C
下属两级基金的交易代码	004513	004512
报告期末下属两级基金的份额总额	6,889,756.32 份	1,555,113.21 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 10 月 9 日-2019 年 12 月 31 日)	
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
1.本期已实现收益	-81,406.75	-28,087.68
2.本期利润	218,684.93	81,757.95
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0322	0.0491
4.期末基金资产净值	7,034,747.72	3,526,410.32
5.期末基金份额净值	1.0993	1.1438

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）原海富通富睿混合型证券投资基金于 2019 年 10 月 9 日转型为海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金。

3.1.2 海富通富睿混合型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 10 月 1 日-2019 年 10 月 8 日)	
	海富通富睿混合 A	海富通富睿混合 C
1.本期已实现收益	-2,282.23	-640.76
2.本期利润	7,716.01	1,706.65
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0011	0.0011
4.期末基金资产净值	7,344,890.29	1,724,431.80
5.期末基金份额净值	1.0660	1.1090

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 海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期: 2019年10月9日-2019年12月31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

1. 海富通沪深 300 增强 A:

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
2019.10.9-2019.12.31	3.12%	0.57%	6.41%	0.70%	-3.29%	-0.13%

2. 海富通沪深 300 增强 C:

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
2019.10.9-2019.12.31	3.14%	0.58%	6.41%	0.70%	-3.27%	-0.12%

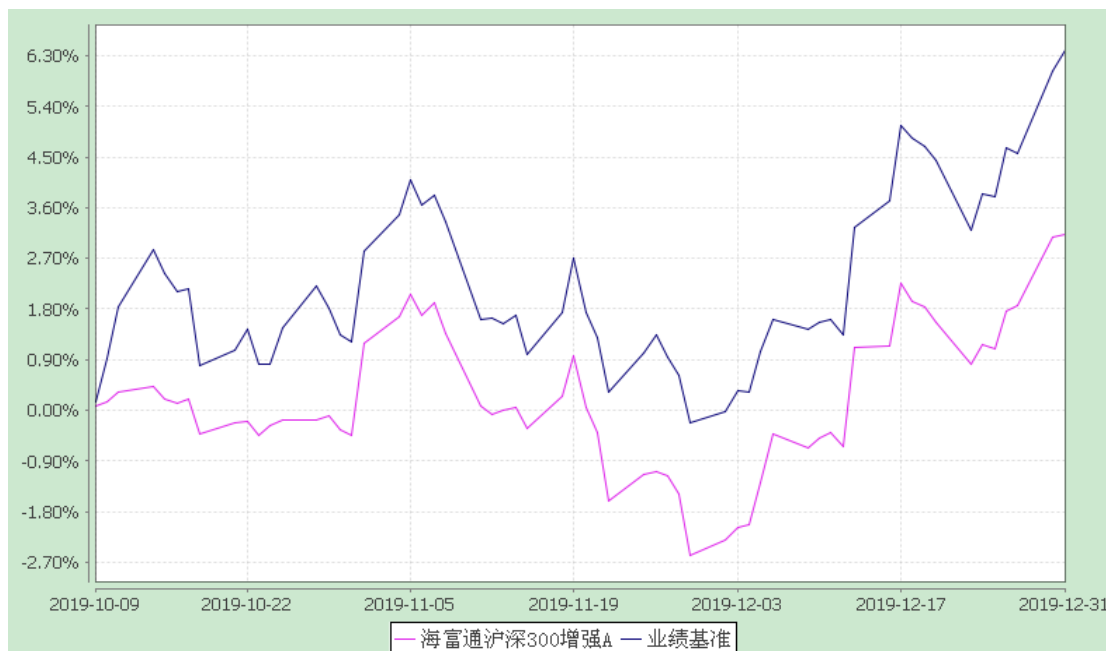
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

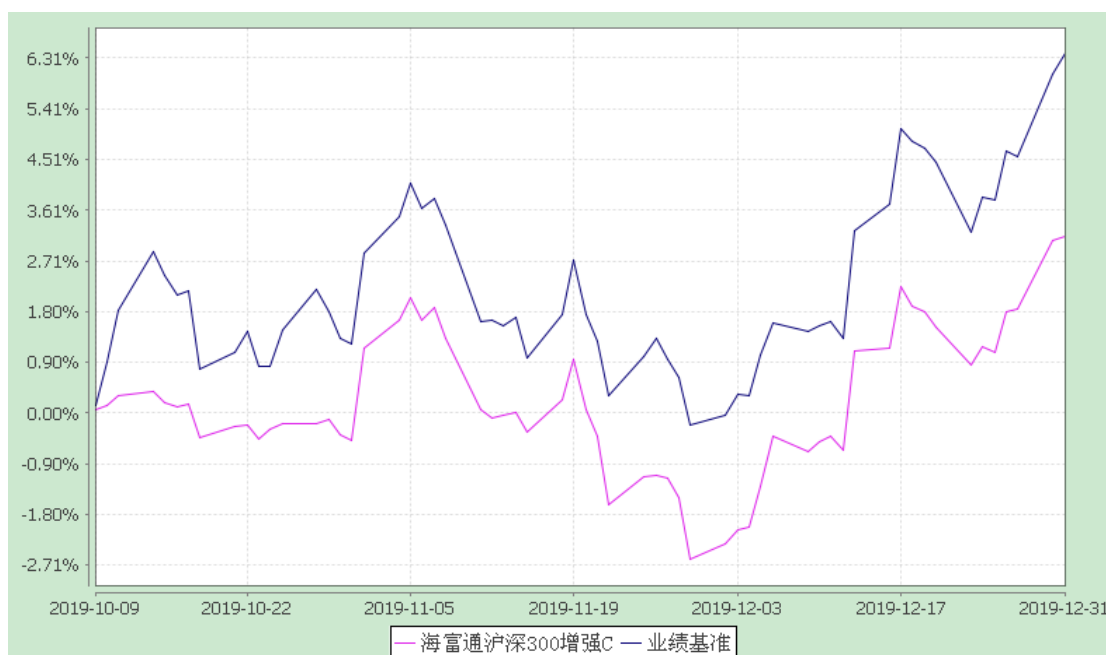
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 10 月 9 日至 2019 年 12 月 31 日)

1、海富通沪深 300 增强 A



2、海富通沪深 300 增强 C



注：1、本基金转型日期为 2019 年 10 月 9 日，截止报告期末，本基金转型未
 满一年。

2、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。截止
 本报告期末，本基金转型后尚处于建仓期。

3.2.2 海富通富睿混合型证券投资基金

(报告期：2019年10月1日-2019年10月8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

1. 海富通富睿混合 A:

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
2019.10.1-2019.10.8	0.09%	0.00%	0.26%	0.00%	-0.17%	0.00%

2. 海富通富睿混合 C:

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
2019.10.1-2019.10.8	0.09%	0.00%	0.26%	0.00%	-0.17%	0.00%

3.2.2.2 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

海富通富睿混合型证券投资基金

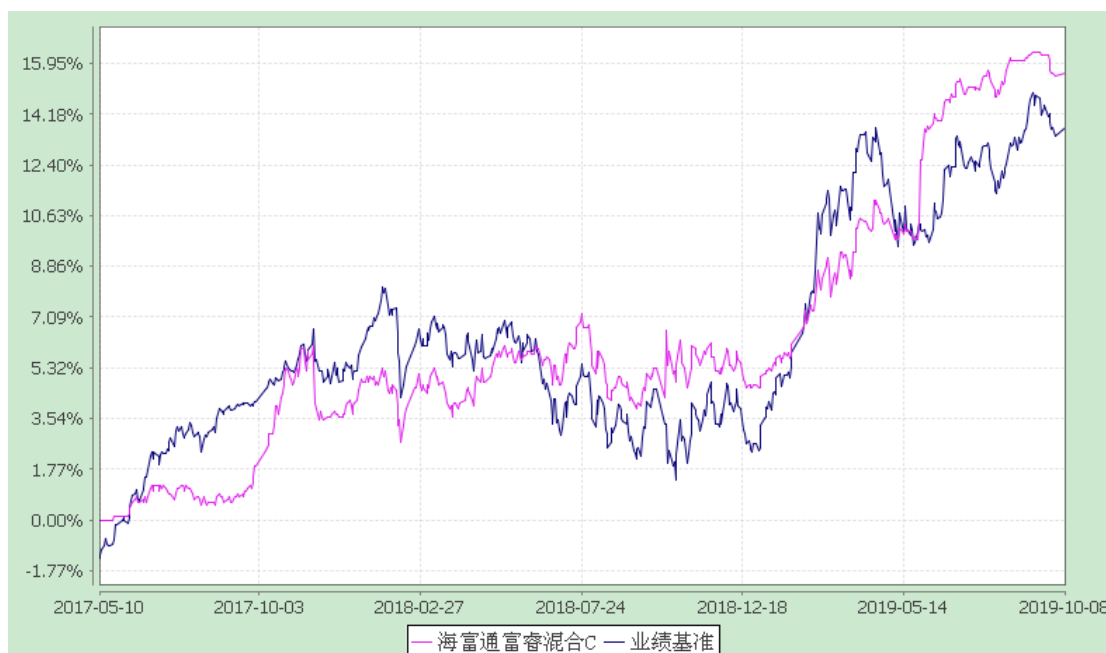
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 5 月 10 日至 2019 年 10 月 8 日)

1、海富通富睿混合 A



2、海富通富睿混合 C



注：本基金合同于2017年5月10日生效，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		
杜晓海	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富	2017-05-22	2019-10-15	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

	通安颐收益混合基金经理;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;海富通稳固收益债券基金经理;海富通欣荣混合基金经理;海富通欣享混合基金经理;海富通新内需混合基金经理;海富通研究				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 月至 2019 年 10 月兼任海富通沪深 300 增强(原海富通富睿混合)基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 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、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、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。
--	---	--	--	--	--

	精选混合基金经理；量化投资部总监。				
朱斌全	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通量化多因子混合基金经理；海富通欣益混合基金经理。	2019-10-15	-	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通富祥混合、海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准为：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、督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

2019 年第四季度 A 股市场震荡走高，其中科技成长类、金融周期类行业表现更为突出。截至 2019 年 12 月 31 日，沪深 300 收于 4096.58 点，单四季度上涨 7.39%；中小板指收于 6632.68 点，上涨 10.59%；创业板指收于 1798.12 点，上涨 10.48%。

具体来看，10 月份沪深 300、中小板指、创业板指均小幅微涨，当月农林牧渔行业因猪价大涨、业绩突出而领涨，以银行、地产为代表的低估值蓝筹和以家电、医药和食品饮料为代表的消费白马因三季度业绩稳健向好而表现领先，强周期的周期品表现落后。11 月份沪深 300、中小板指、创业板指均小幅微跌，风格

也出现了变化，以电子、新能源、传媒为代表的科技成长个股领涨大盘，建材、汽车、有色、钢铁等受益经济企稳预期也有突出表现，而泛消费领域的食品饮料、医药等个股出现滞涨甚至下跌，农林牧渔则在监管层加强猪禽等价格管控后显著回落。12 月份市场出现了较大幅度上涨，沪深 300、中小板指、创业板指单月涨幅分别为 7.00%、8.80%、8.00%，经济企稳迹象不断验证、中美贸易谈判阶段性达成一致、国内货币政策持续推动融资成本稳步下行，这些均推动市场的经济预期和风险偏好不断修复，受益于经济预期改善和资金利率下行的建材、地产、有色、化工、汽车等表现突出，受益于风险偏好提升的传媒、电子、通信、计算机、券商等也表现较好，而弹性相对较低的银行、医药、食品饮料等涨幅较小。

四季度，中信一级行业分类中，绝大部分行业录得上涨。其中，建材(21.69%)、家电(14.61%)、电子元器件(14.52%)、传媒(13.69%)、汽车(13.07%)排名前五，而煤炭(1.61%)、建筑(0.92%)、电力及公用事业(0.88%)、商贸零售(0.08%)、国防军工(-1.27%)排名落后。

本基金于 2019 年 4 季度初进行了转型，在控制风险的基础上，采取量化策略进行指数增强，通过多因子策略力争稳定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金转型前(2019.10.1-2019.10.8 期间)，海富通富睿混合 A 净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%，基金净值跑输业绩比较基准 0.17 个百分点；海富通富睿混合 C 净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%，基金净值跑输业绩比较基准 0.17 个百分点。基金转型后(2019.10.9-2019.12.31 期间)，海富通沪深 300 指数增强 A 净值增长率为 3.12%，同期业绩比较基准收益率为 6.41%，基金净值跑输业绩比较基准 3.29 个百分点；海富通沪深 300 指数增强 C 净值增长率为 3.14%，同期业绩比较基准收益率为 6.41%，基金净值跑输业绩比较基准 3.27 个百分点。本基金在报告期内转型为沪深 300 指数增强基金，处于建仓期，同期沪深 300 指数涨幅明显，基金净值因仓位较低而跑输基准。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，海富通富睿混合型证券投资基金于 2019 年 10 月 9 日转型为海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金。自 2019 年 10 月 9 日至 2019 年 12 月 31

日, 本基金连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5,000 万元的情形。基金管理人已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。

§5 投资组合报告

5.1 海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期: 2019年10月9日-2019年12月31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	9,051,437.45	82.28
	其中: 股票	9,051,437.45	82.28
2	固定收益投资	359,215.40	3.27
	其中: 债券	359,215.40	3.27
	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	1,541,379.95	14.01
7	其他各项资产	49,148.79	0.45
8	合计	11,001,181.59	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

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	196,056.00	1.86
B	采矿业	154,645.00	1.46

C	制造业	4,622,105.65	43.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,028.00	0.96
E	建筑业	107,484.00	1.02
F	批发和零售业	93,799.00	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	145,485.00	1.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	256,451.00	2.43
J	金融业	2,542,904.00	24.08
K	房地产业	612,128.00	5.80
L	租赁和商务服务业	39,962.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	77,380.80	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	1,900.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	56,835.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	43,274.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	9,051,437.45	85.70

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

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	9,100	777,686.00	7.36
2	600519	贵州茅台	584	690,872.00	6.54
3	600036	招商银行	15,100	567,458.00	5.37
4	000651	格力电器	5,400	354,132.00	3.35
5	000002	万科 A	10,000	321,800.00	3.05

6	600585	海螺水泥	5,000	274,000.00	2.59
7	600276	恒瑞医药	3,100	271,312.00	2.57
8	002475	立讯精密	6,650	242,725.00	2.30
9	601166	兴业银行	11,700	231,660.00	2.19
10	600030	中信证券	9,000	227,700.00	2.16

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	359,215.40	3.40
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	359,215.40	3.40

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	019611	19 国债 01	3,590	359,215.40	3.40

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

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

5.1.11.2 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	5,780.63
2	应收证券清算款	13,941.35
3	应收股利	-

4	应收利息	8,291.81
5	应收申购款	21,135.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,148.79

5.1.11.4 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。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2 海富通富睿混合型证券投资基金

(报告期: 2019年10月1日-2019年10月8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	1,454,908.65	15.45
	其中: 股票	1,454,908.65	15.45
2	固定收益投资	2,413,536.50	25.63
	其中: 债券	2,413,536.50	25.63
	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	3,494,333.64	37.10
7	其他各项资产	2,055,672.86	21.83

8	合计	9,418,451.65	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

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	3,797.00	0.04
B	采矿业	29,095.00	0.32
C	制造业	660,533.65	7.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,801.00	0.66
E	建筑业	1,926.00	0.02
F	批发和零售业	33,485.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	17,931.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,500.00	0.37
J	金融业	478,805.00	5.28
K	房地产业	109,890.00	1.21
L	租赁和商务服务业	2,595.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	11,718.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	1,928.00	0.02
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	9,904.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	1,454,908.65	16.04

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

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	2,400	211,200.00	2.33
2	601939	建设银行	17,900	126,732.00	1.40
3	600519	贵州茅台	84	98,036.40	1.08
4	601166	兴业银行	5,400	96,984.00	1.07
5	600900	长江电力	3,000	55,740.00	0.61
6	600585	海螺水泥	900	38,196.00	0.42
7	600048	保利地产	2,400	36,264.00	0.40
8	000568	泸州老窖	400	35,300.00	0.39
9	000333	美的集团	645	33,959.25	0.37
10	000002	万科 A	1,200	31,632.00	0.35

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	1,394,860.50	15.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	523,776.00	5.78
	其中：政策性金融债	523,776.00	5.78
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）	494,900.00	5.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,413,536.50	26.61

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	13,950	1,394,860.50	15.38
2	018006	国开 1702	5,120	523,776.00	5.78
3	132015	18 中油 EB	5,000	494,900.00	5.46

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

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。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	11,271.47
2	应收证券清算款	2,004,432.37
3	应收股利	-
4	应收利息	39,969.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,055,672.86

5.2.11.4 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	132015	18 中油 EB	494,900.00	5.46

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动**6.1 海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金**

单位: 份

项目	海富通沪深300增强 A	海富通沪深300增强 C
基金转型日（2019-10-09）基金份额总额	6,889,756.32	1,555,113.21
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	66,094.62	2,338,562.18
减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额	556,792.88	810,497.92
基金转型日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,399,058.06	3,083,177.47

注：海富通沪深300指数增强型证券投资基金报告期期间：2019年10月9日至2019年12月31日。

6.2 海富通富睿混合型证券投资基金

单位：份

项目	海富通富睿混合A	海富通富睿混合C
报告期期初基金份额总额	6,998,922.45	1,557,913.77
报告期基金总申购份额	-	-
减：报告期基金总赎回份额	109,166.13	2,800.56
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	6,889,756.32	1,555,113.21

注：海富通富睿混合型证券投资基金报告期期间：2019年10月1日至2019年10月8日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

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 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.2 海富通富睿混合型证券投资基金

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 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

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

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。

8.2 海富通富睿混合型证券投资基金

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

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。

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 74 只公募基金。截至 2019 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1114 亿元人民币。

海富通是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，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。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 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。

§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富睿混合型证券投资基金变更注册的文件
- （二）海富通富睿混合型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- （三）海富通富睿混合型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通富睿混合型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强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）报告期内海富通富睿混合型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强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

二〇二〇年一月二十一日