

海富通稳固收益债券型证券投资基金
2020 年第 1 季度报告
2020 年 3 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年四月二十二日

§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 2020 年 4 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 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通稳固收益债券
基金主代码	519030
交易代码	519030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	650,214,995.87 份
投资目标	通过合理运用投资组合优化策略，力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，即资产配置策略，将以优化投资组合保险策略为核心，实现基金投资目标；第二层次，即债券投资策略，将采用自上而下的策略，以久期管理为核心；第三层次，即股票投资策略，包括新股申购策略和积极的精选个股策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金，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

主要财务指标	报告期 (2020 年 1 月 1 日-2020 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	1,880,652.75
2.本期利润	-1,723,910.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0029
4.期末基金资产净值	745,678,616.48
5.期末基金份额净值	1.147

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	0.26%	0.34%	0.68%	0.01%	-0.42%	0.33%

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

海富通稳固收益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
 (2010 年 11 月 23 日至 2020 年 3 月 31 日)



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）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		
陈轶平	本基金的基金经理；海富通恒丰定开债券基金经理；海富通	2015-12-18	-	11 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

	<p>弘丰定开债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通瑞利债券基金经理；海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理；海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理；海富通上</p>			<p>监，现任固定收益投资副总监。2013 年 8 月起任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF（现为海富通上证城投债 ETF）基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017 年 1 月起兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 指数增强）</p>
--	---	--	--	--

	证城投债 ETF 基金经理；海富通上证周期产业债 ETF 基金经理；固定收益投资副总监。				基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任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 月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。
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；海富通安颐收益混合基金经理；海富通创业板增强基金经	2018-04-09	-	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 月至

	理;海富通量化先锋股票基金经理;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;海富通研究精选混合基金经理;海富通安益对冲混合基金经理;海富通中证 500 增强基金经理;					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、海富通量化先锋股票、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。2020 年 1 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。
--	--	--	--	--	--	---

	量化 投资 部 总 监。				
--	--------------------------	--	--	--	--

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

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年 1 季度，受到新冠疫情全球扩散和石油价格战的双重冲击，全球资本市场几乎所有资产类别都发生了剧烈波动。美欧多国的国债收益率创下历史新低，VIX 指数直追 2008 年历史峰值，石油价格再度刷新 2008 年危机之后的低点记录，黄金价格在刷新 1700 美元的高点之后也出现了高达 200 多美元的巨幅波动。

为了应对危机，全球主要国家纷纷推出大幅降息、天量宽松搭配的货币刺激计划与财政救助计划。G20 国家领导人以及财政、金融部门负责人的协调会议向全球宣示了协

调政策、挽救危机的坚定决心。

具体到 A 股市场，主要经历了两波调整：第一波调整是跟随国内新冠疫情由扩散到受控的过程展开的；第二波调整主要是受到外部冲击的拖累。较之于全球主要股市的表现，A 股是其中表现最佳的市场，当期万得全 A 指数仅回调 6.79%。

分市场看，创业板指数不但没有下跌，反而上涨 4.10%，表现最为强劲；中小板指跌 1.94%、中证 1000 跌 2.51%、中证 500 跌 4.29%、中证 800 跌 8.66%、沪深 300 跌 10.02%、上证 50 跌 12.20%。

分行业看，中信一级行业当中绝大部分下跌。其中，石油石化、家电、非银、煤炭和消费者服务回调幅度居前，幅度分别达到 -16.50%、-15.85%、-15.58%、-15.39% 和 -15.20%。农业、医药、计算机和通信是仅有的四个上涨的行业，幅度分别为 16.02%、8.22%、2.86% 和 0.47%。

从成交看，A 股市场累计成交金额达到 49.60 万亿，居历史纪录第四高峰。创业板、中小板、沪市主板和深市主板的成交金额分别达到 10.48 万亿、13.29 万亿、19.52 万亿和 6.59 万亿，其中创业板和中小板的成交金额均创历史新高。

综上所述，一季度 A 股市场虽然受到冲击，但总体表现坚挺且活跃度非常高。代表 5G 方向的消费电子和新基建硬件以及与应用内容相关的 VR\AR 等传媒服务类仍然是最受机构投资者看好与投资的主要方向。其他代表未来成长方向的诸如新能源车产业链、创新药与医疗服务、自主可控的半导体产业链和网络安全、新基建的电网投资，以及白酒所代表的高端消费和内需、与疫情相关材料设备也是机构投资者重要的布局领域。而与宏观面和政策面预期相关度较高的部分权重行业，包括银行保险、地产产业链、石化产业链、传统汽车产业链等受到的冲击相对较大。

本报告期，本基金适当增加了一些股票配置，力争在风险可控的基础上，跑赢市场。

2 季度，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来控制回撤风险。

债券方面，从国内经济基本面来看，在年初国内新冠肺炎疫情的发酵下，1-3 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下跌 8.4%、16.1% 和 19.0%，跌幅较 2019 年同期分别走阔 14.9、22.4 和 27.3 个百分点，一季度实际 GDP 同比下降 6.8%。通胀延续分化态势，基数效应下一季度 CPI 中枢落在 5% 左右，而原油大跌致使 PPI 出现通缩。国内疫情出现拐点后，2 月下旬以来海外疫情转而开始发酵，全球经济衰退风险加大，美联储于 3 月二度紧急降息至零，并推出无限量 QE，其他主要国家央行亦延续宽松潮。国内央行延续稳健偏松的货币政策，一季度二次降准并调降 MLF 利率 10BP 和逆回购利率 30BP，一季度银行间质押式回购利率中枢下行 51BP 至 1.82%。在疫情相继冲击国内外经济、资金面宽松的背景下，一季度利率整体实现大幅下行，其间共遇两次回调，第一次发生于 2 月上中旬，因国内疫情防控工作有序开展，市场对复工的预期有所增强，而海外疫情尚未发酵，利率小幅回调了约 10BP；第二次发生在 3 月中旬，因美元陷入流动性危机，各大类资产普跌，利率亦出现明显调整，回调幅度达

到 20BP 左右。整体看，一季度 10 年期国债收益率累计下行 55BP 至 2.59%，而 1 年期国债收益率累计下行 68BP 至 1.69%，收益率曲线走陡。信用债方面，一季度信用债收益率亦跟随利率债大幅下行。从绝对收益率来看，AA 及以上评级二级市场收益率均低于 4%，短融已经全面位于 3% 以下，绝对收益率基本处于历史 10% 分位数以下。从信用利差来看，高等级品种和中低等级品种延续分化态势。可转债方面，一季度转债市场先扬后抑，尽管权益市场受疫情影响高位下跌，转债市场的估值水平一路上扬达到了近两年以来的高点，一季度中证转债指数基本收平，累计微涨 0.02%。

本基金在一季度根据组合规模情况配置信用债并调整利率债久期，积极参与波段机会。同时，一季度根据市场情况调整了可转债资产，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，海富通稳固收益净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%，基金净值跑输业绩比较基准 0.42 个百分点。报告期内股票市场波动较大，导致基金跑输基准。

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	92,434,954.80	12.36
	其中：股票	92,434,954.80	12.36
2	固定收益投资	634,272,136.50	84.83
	其中：债券	634,272,136.50	84.83
	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	8,744,770.67	1.17
7	其他资产	12,260,860.79	1.64
8	合计	747,712,722.76	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	135,200.00	0.02
B	采矿业	1,076,970.00	0.14
C	制造业	56,170,551.20	7.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	203,740.00	0.03
E	建筑业	698,614.00	0.09
F	批发和零售业	736,537.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	427,768.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,405,188.00	0.59
J	金融业	21,147,709.00	2.84
K	房地产业	6,943,633.00	0.93
L	租赁和商务服务业	99,760.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	158,885.60	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	11,968.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	218,431.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	92,434,954.80	12.40

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	968,700	6,141,558.00	0.82
2	600887	伊利股份	191,300	5,712,218.00	0.77
3	601166	兴业银行	306,800	4,881,188.00	0.65
4	600048	保利地产	324,000	4,817,880.00	0.65
5	600519	贵州茅台	4,100	4,555,100.00	0.61
6	000568	泸州老窖	54,700	4,028,655.00	0.54
7	002007	华兰生物	76,350	3,658,692.00	0.49
8	000063	中兴通讯	77,800	3,329,840.00	0.45
9	600036	招商银行	99,600	3,215,088.00	0.43
10	601688	华泰证券	179,900	3,099,677.00	0.42

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	339,064,734.50	45.47
	其中：政策性金融债	339,064,734.50	45.47
4	企业债券	66,725,700.00	8.95
5	企业短期融资券	70,248,000.00	9.42
6	中期票据	112,229,000.00	15.05
7	可转债（可交换债）	46,004,702.00	6.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	634,272,136.50	85.06

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	018007	国开 1801	1,101,630	110,989,222.50	14.88
2	018009	国开 1803	788,060	90,784,512.00	12.17
3	180304	18 进出 04	500,000	51,280,000.00	6.88
4	110220	11 国开 20	400,000	41,016,000.00	5.50
5	042000012	20 江阴公 CP001	400,000	40,132,000.00	5.38

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

根据本基金合同，本基金暂未参与股指期货交易。

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	62,220.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,145,816.64
5	应收申购款	52,823.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,260,860.79

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	127005	长证转债	5,119,315.20	0.69
2	113011	光大转债	5,075,114.00	0.68
3	128046	利尔转债	518,208.96	0.07
4	128045	机电转债	504,461.40	0.07
5	128048	张行转债	499,535.01	0.07
6	128034	江银转债	480,734.73	0.06
7	128041	盛路转债	323,036.00	0.04
8	113511	千禾转债	276,266.00	0.04

9	128021	兄弟转债	272,183.10	0.04
10	110034	九州转债	271,861.20	0.04
11	113504	艾华转债	267,012.20	0.04
12	113502	嘉澳转债	262,782.00	0.04
13	113505	杭电转债	262,613.20	0.04
14	113515	高能转债	261,867.20	0.04
15	128065	雅化转债	260,922.60	0.03
16	113527	维格转债	260,588.20	0.03
17	110038	济川转债	259,705.60	0.03
18	123002	国祯转债	258,777.20	0.03
19	113518	顾家转债	256,344.50	0.03
20	113531	百姓转债	256,171.30	0.03
21	113525	台华转债	254,896.20	0.03
22	128019	久立转 2	254,754.92	0.03
23	113017	吉视转债	253,992.90	0.03
24	110047	山鹰转债	253,232.00	0.03
25	132009	17 中油 EB	252,857.40	0.03
26	128064	司尔转债	252,781.70	0.03
27	110043	无锡转债	252,719.00	0.03
28	128018	时达转债	252,578.00	0.03
29	127006	敖东转债	252,502.10	0.03
30	113519	长久转债	252,038.10	0.03
31	128044	岭南转债	251,673.60	0.03
32	110045	海澜转债	251,566.00	0.03
33	110051	中天转债	251,385.80	0.03
34	113508	新风转债	251,035.20	0.03
35	123004	铁汉转债	250,823.70	0.03
36	128037	岩土转债	250,376.40	0.03
37	113534	鼎胜转债	249,238.00	0.03
38	128015	久其转债	249,098.00	0.03
39	128051	光华转债	248,283.00	0.03

40	113019	玲珑转债	247,955.40	0.03
41	110057	现代转债	245,364.00	0.03
42	113014	林洋转债	244,858.00	0.03
43	113516	苏农转债	244,486.80	0.03
44	110042	航电转债	243,307.80	0.03
45	127007	湖广转债	242,256.00	0.03
46	128028	赣锋转债	242,150.80	0.03
47	128032	双环转债	242,111.76	0.03
48	123023	迪森转债	241,938.50	0.03
49	123025	精测转债	241,882.20	0.03
50	110048	福能转债	241,535.00	0.03
51	128067	一心转债	241,509.10	0.03
52	110056	亨通转债	240,847.20	0.03
53	113013	国君转债	239,965.20	0.03
54	113016	小康转债	239,244.40	0.03
55	128033	迪龙转债	238,792.50	0.03
56	128025	特一转债	237,800.00	0.03
57	128058	拓邦转债	237,767.60	0.03
58	113008	电气转债	236,974.10	0.03
59	113012	骆驼转债	236,456.00	0.03
60	128010	顺昌转债	235,586.40	0.03
61	132014	18 中化 EB	235,140.30	0.03
62	132011	17 浙报 EB	234,668.00	0.03
63	132008	17 山高 EB	233,910.00	0.03
64	132006	16 皖新 EB	233,167.50	0.03
65	113532	海环转债	233,144.80	0.03
66	110052	贵广转债	232,750.00	0.03
67	132007	16 凤凰 EB	232,560.00	0.03
68	132015	18 中油 EB	232,432.20	0.03
69	113022	浙商转债	232,356.00	0.03
70	132012	17 巨化 EB	232,221.00	0.03

71	113521	科森转债	231,987.20	0.03
72	113509	新泉转债	231,912.20	0.03
73	110031	航信转债	231,516.60	0.03
74	110041	蒙电转债	230,973.40	0.03
75	132004	15 国盛 EB	230,943.00	0.03
76	128059	视源转债	230,799.60	0.03
77	132013	17 宝武 EB	230,497.40	0.03
78	128075	远东转债	230,406.90	0.03
79	110055	伊力转债	229,956.30	0.03
80	113009	广汽转债	229,702.80	0.03
81	128022	众信转债	229,183.50	0.03
82	128029	太阳转债	229,019.30	0.03
83	128071	合兴转债	228,585.00	0.03
84	110033	国贸转债	227,888.40	0.03
85	110053	苏银转债	225,461.70	0.03
86	113543	欧派转债	225,330.00	0.03
87	113021	中信转债	223,510.00	0.03
88	127012	招路转债	220,687.20	0.03
89	113530	大丰转债	217,960.00	0.03
90	113020	桐昆转债	216,863.90	0.03
91	128035	大族转债	216,537.30	0.03
92	132005	15 国资 EB	212,917.60	0.03
93	128074	游族转债	211,035.80	0.03
94	123022	长信转债	198,165.60	0.03
95	128017	金禾转债	184,371.32	0.02

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	539,358,169.94
--------------	----------------

本报告期基金总申购份额	319,059,045.25
减：本报告期基金总赎回份额	208,202,219.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	650,214,995.87

§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	2020/01/01-2020/03/01	120,000,000.00	-	-	120,000,000.00	18.46%

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 77 只公募基金。截至 2020 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1576 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) 中国证监会批准设立海富通稳固收益债券型证券投资基金的文件
- (二) 海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通稳固收益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) 法律法规及中国证监会规定的其它文件

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
二〇二〇年四月二十二日