

海富通中证 500 指数增强型证券投资基金
(原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金)
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。

本报告期内，原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金转型为海富通中证 500 指数增强型证券投资基金。原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金本报告期自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 4 日止，海富通中证 500 指数增强型证券投资基金本报告期自 2020 年 3 月 5 日至 2020 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 海富通中证 500 增强 |
| 基金主代码 | 519034 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 3 月 5 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 17,298,374.43 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 | <p>本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。</p> <p>本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 500 指数。本基金主要策略为复制目标指数，投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用海富通定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。</p> | |
| 业绩比较基准 | 95% × 中证 500 指数收益率 + 5% × 银行活期存款利率（税后） | |
| 风险收益特征 | <p>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、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p> | |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 海富通中证 500 增强 A | 海富通中证 500 增强 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 519034 | 009004 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 17,197,374.36 份 | 101,000.07 份 |

2.2 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

| | |
|------|-------------|
| 基金简称 | 海富通中证内地低碳指数 |
|------|-------------|

| | |
|------------|--|
| 基金主代码 | 519034 |
| 交易代码 | 519034 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012 年 5 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 17,367,521.34 份 |
| 投资目标 | 本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数。在正常市场情况下，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。 |
| 投资策略 | 本基金将采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 |
| 业绩比较基准 | 中证内地低碳经济主题指数×95%+人民币税后活期存款利率×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的投资品种，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动投资的指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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 | 中国建设银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 海富通中证 500 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 (2020 年 3 月 5 日-2020 年 3 月 31 日) | |
|--------------------|---|----------------|
| | 海富通中证 500 增强 A | 海富通中证 500 增强 C |
| 1.本期已实现收益 | -277,857.53 | 601.58 |
| 2.本期利润 | -3,242,309.61 | -5,081.69 |
| 3.加权平均基金份额 本期利润 | -0.1880 | -0.1184 |
| 4.期末基金资产净值 | 22,567,970.33 | 132,524.10 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3123 | 1.3121 |

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)原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金于 2020 年 3 月 5 日转型为海富通中证 500 指数增强型证券投资基金，并且增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。

3.1.2 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

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 4 日) | |
|--------------------|--|-----------|
| | 1.本期已实现收益 | 58,713.78 |
| 2.本期利润 | 2,720,506.53 | |
| 3.加权平均基金份额 本期利润 | 0.1488 | |
| 4.期末基金资产净值 | 26,045,229.31 | |
| 5.期末基金份额净值 | 1.500 | |

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)原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金于 2020 年 3 月 5 日转型为海富通中证 500 指数增强型证券投资基金。

3.2 基金净值表现

3.2.1 海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

（报告期：2020年3月5日-2020年3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. 海富通中证 500 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 |
|-------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 20200305-20200331 | -12.51% | 2.36% | -11.22% | 2.06% | -1.29% | 0.30% |

2. 海富通中证 500 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 |
|-------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 20200305-20200331 | -13.72% | 2.32% | -11.22% | 2.06% | -2.50% | 0.26% |

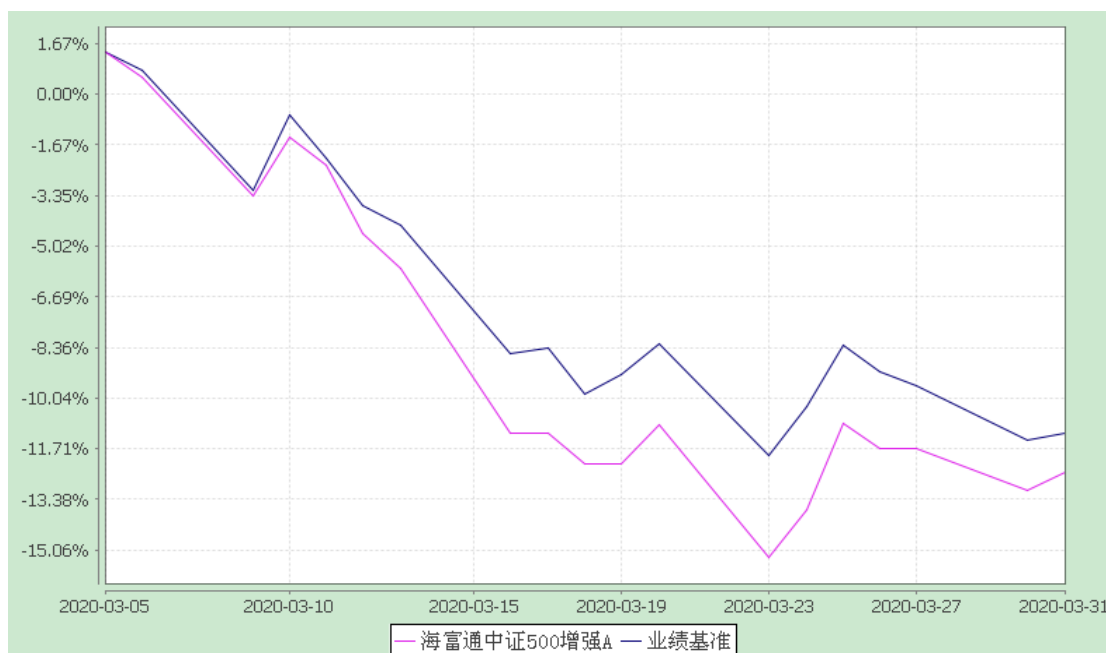
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

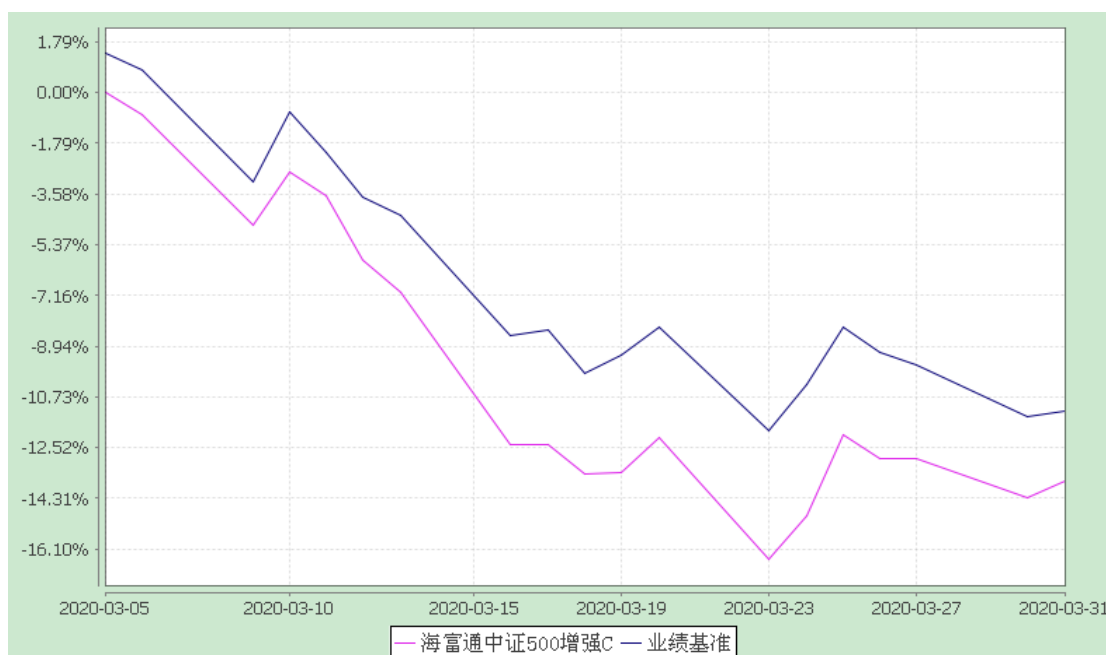
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 3 月 5 日至 2020 年 3 月 31 日)

1、海富通中证 500 增强 A



2、海富通中证 500 增强 C



注：1、本基金转型日期为2020年3月5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 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

(报告期：2020年1月1日-2020年3月4日)

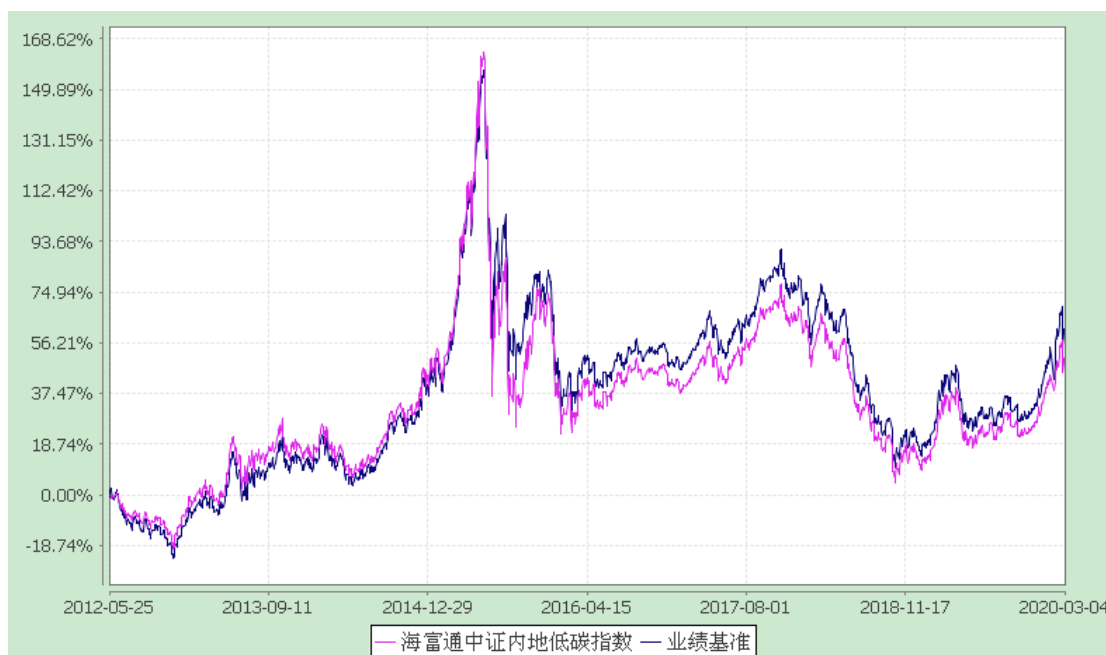
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|-------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 20200101-20200304 | 11.86% | 1.58% | 13.74% | 2.12% | -1.88% | -0.54% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 5 月 25 日至 2020 年 3 月 4 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十二部分（二）投资范围、（六）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 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；量化投资 部总监。 | 2020-03- 05 | - | 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 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。 |
| 江勇 | 本基金的基金经理；海富通上证非周期ETF基金经理；海富通上证非周期ETF联接基金经理；海富通上证周期ETF基金经理；海富通上证周期ETF联接基金经理；海富通中证100指数（LOF）基金经理。 | 2018-07-25 | 2020-03-04 | 8年 | 经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017年6月加入海富通基金管理有限公司。2018年7月起任海富通上证周期ETF、海富通上证周期ETF联接、海富通上证非周期ETF、海富通上证非周期ETF联接、海富通中证100指数（LOF）基金经理。2018年7月至2020年3月任海富通中证内地低碳指数（现海富通中证500增强）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

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。

综上可知，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。

报告期，本基金进行了转型，转型后本基金在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，基金转型前（2020.1.1-2020.3.4 期间），海富通中证内地低碳指数基金净值增长率为 11.86%，同期业绩比较基准收益率为 13.74%，基金净值跑输业绩比较基准 1.88 个百分点。基金转型后（2020.3.5-2020.3.31 期间），海富通中证 500 增强 A 净值增长率为-12.51%，同期业绩比较基准收益率为-11.22%，基金净值跑输业绩比较基准 1.29 个百分点；海富通中证 500 增强 C 净值增长率为-13.72%，同期业绩比较基准收益率为-11.22%，基金净值跑输业绩比较基准 2.50 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 2015 年 9 月 23 日至 2020 年 3 月 4 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。基金管理人于 2020 年 1 月 31 日至 2020

年 2 月 28 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金转型有关事项的议案》。根据持有人大会通过的议案及方案说明，海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金于 2020 年 3 月 5 日转型为海富通中证 500 指数增强型证券投资基金。

§ 5 投资组合报告

5.1 海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

（报告期：2020年3月5日-2020年3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 | 19,451,414.22 | 84.23 |
| | 其中：股票 | 19,451,414.22 | 84.23 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,001,800.00 | 4.34 |
| | 其中：债券 | 1,001,800.00 | 4.34 |
| | 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 | 2,432,136.20 | 10.53 |
| 7 | 其他各项资产 | 206,498.30 | 0.89 |
| 8 | 合计 | 23,091,848.72 | 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 | 189,200.00 | 0.83 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 13,619,301.02 | 60.00 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,185,589.20 | 5.22 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 1,151,100.00 | 5.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,218,010.00 | 9.77 |
| J | 金融业 | 605,000.00 | 2.67 |
| K | 房地产业 | 20,150.00 | 0.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 247,504.00 | 1.09 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 215,560.00 | 0.95 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 19,451,414.22 | 85.69 |

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 | 601012 | 隆基股份 | 40,000 | 993,600.00 | 4.38 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 8,000 | 963,120.00 | 4.24 |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 50,000 | 864,500.00 | 3.81 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 4 | 300014 | 亿纬锂能 | 10,586 | 615,152.46 | 2.71 |
| 5 | 300529 | 健帆生物 | 5,200 | 492,284.00 | 2.17 |
| 6 | 002439 | 启明星辰 | 13,000 | 481,000.00 | 2.12 |
| 7 | 002242 | 九阳股份 | 15,000 | 422,250.00 | 1.86 |
| 8 | 603444 | 吉比特 | 1,000 | 410,390.00 | 1.81 |
| 9 | 000786 | 北新建材 | 17,307 | 408,445.20 | 1.80 |
| 10 | 300628 | 亿联网络 | 5,000 | 407,850.00 | 1.80 |

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 | 1,001,800.00 | 4.41 |
| 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 | 1,001,800.00 | 4.41 |

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 | 019615 | 19 国债 05 | 10,000 | 1,001,800.00 | 4.41 |

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

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与研判，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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 | 1,089.12 |
| 2 | 应收证券清算款 | 105,425.12 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 23,176.31 |
| 5 | 应收申购款 | 76,807.75 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 206,498.30 |

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未存在流通受限情况。

5.2 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

(报告期：2020年1月1日-2020年3月4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 | 22,431,213.69 | 83.71 |
| | 其中：股票 | 22,431,213.69 | 83.71 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,001,800.00 | 3.74 |
| | 其中：债券 | 1,001,800.00 | 3.74 |
| | 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 | 3,235,858.77 | 12.08 |
| 7 | 其他各项资产 | 128,558.19 | 0.48 |
| 8 | 合计 | 26,797,430.65 | 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 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 15,855,500.31 | 60.88 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,436,088.87 | 17.03 |
| E | 建筑业 | 112,434.21 | 0.43 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 961,732.80 | 3.69 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,065,457.50 | 4.09 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 22,431,213.69 | 86.12 |

5.2.3 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。

5.2.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.2.4.1 期末指数投资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 | 300750 | 宁德时代 | 22,300 | 3,204,510.00 | 12.30 |
| 2 | 600900 | 长江电力 | 147,005 | 2,585,817.95 | 9.93 |
| 3 | 601012 | 隆基股份 | 51,637 | 1,572,346.65 | 6.04 |
| 4 | 600703 | 三安光电 | 48,604 | 1,203,435.04 | 4.62 |
| 5 | 002594 | 比亚迪 | 17,661 | 1,175,869.38 | 4.51 |
| 6 | 600406 | 国电南瑞 | 46,060 | 961,732.80 | 3.69 |
| 7 | 002460 | 赣锋锂业 | 14,960 | 823,996.80 | 3.16 |
| 8 | 300014 | 亿纬锂能 | 10,586 | 749,171.22 | 2.88 |
| 9 | 002466 | 天齐锂业 | 17,449 | 599,722.13 | 2.30 |
| 10 | 002129 | 中环股份 | 32,600 | 567,240.00 | 2.18 |

5.2.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.5 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 | 1,001,800.00 | 3.85 |
| 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 | 1,001,800.00 | 3.85 |

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 | 019615 | 19 国债 05 | 10,000 | 1,001,800.00 | 3.85 |

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。

5.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.9 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。

5.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.10.1 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。

5.2.10.2 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。

5.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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投资国债期货。

5.2.11.3 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。

5.2.12 投资组合报告附注

5.2.12.1 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。

5.2.12.2 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。

5.2.12.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,089.12 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 32,125.06 |
| 5 | 应收申购款 | 95,344.01 |
| 6 | 其他应收款 | 0.00 |
| 7 | 待摊费用 | 0.00 |
| 8 | 其他 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 128,558.19 |

5.2.12.4 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。

5.2.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.2.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.2.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

单位：份

| 项目 | 海富通中证500增强 A | 海富通中证500增强 C |
|----------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金转型日（2020年3月5日）基金份额总额 | 17,367,521.34 | 0.00 |
| 基金转型日起至报告期期末基金总申购份额 | 2,401,928.88 | 104,472.71 |
| 减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额 | 2,572,075.86 | 3,472.64 |
| 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 | 17,197,374.36 | 101,000.07 |

注：1、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金报告期期间：2020 年 3 月 5 日至 2020 年 3 月 31 日。

2、原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金于 2020 年 3 月 5 日转型为海富通中证 500 指数增强型证券投资基金，并且增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。

6.2 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

单位：份

| | |
|---------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 14,651,379.30 |
| 本报告期基金总申购份额 | 25,606,926.59 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 22,890,784.55 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 17,367,521.34 |

注：中证内地低碳经济主题指数证券投资基金报告期期间：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 4 日。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

(报告期: 2020年3月5日-2020年3月31日)

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。

7.1.1.1 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 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年3月4日)

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。

7.2.1.1 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 海富通中证 500 指数增强型证券投资基金

(报告期: 2020年3月5日-2020年3月31日)

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 海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

(报告期: 2020年1月1日-2020年3月4日)

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 | 期初 | 申购 | 赎回份 | 持有份额 | 份额占 |

| | | 比例达到或者超过20%的时间区间 | 份额 | 份额 | 额 | | 比 |
|---|---|--------------------|----|---------------|---------------|------|-------|
| 机构 | 1 | 2020/1/22-2020/2/6 | - | 15,459,592.41 | 15,459,592.41 | 0.00 | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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：</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>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。</p> | | | | | | | |

注：期末日期指基金转型前最后一日

8.2.2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中证内地低碳经济主题指数证券投资基金的文件、中国证监会准予海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金变更注册的文件

（二）海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通中证500指数增强型证券投资基金基金合同

（三）海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通中证500指数增强型证券投资基金招募说明书

（四）海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通中证500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) 法律法规及中国证监会规定的其他文件

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