

**海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金**  
**2020 年第 3 季度报告**  
**2020 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：二〇二〇年十月二十八日

## §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 10 月 27 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通新内需混合
基金主代码	519130
交易代码	519130
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 27 日
报告期末基金份额总额	637,532,080.42 份
投资目标	本基金将从受益于国家扩大内需促进经济发展政策的热点行业中，精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极投资，同时利用灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，从而做出权益类资产的具体仓位选择。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	MSCI 中国 A 股指数×50%+上证国债指数×50%	
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	
下属两级基金的基金简称	海富通新内需混合 A	海富通新内需混合 C
下属两级基金的交易代码	519130	002172
报告期末下属两级基金的份额总额	176,760,154.19 份	460,771,926.23 份

### §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7月1日-2020年9月30日)	
	海富通新内需混合 A	海富通新内需混合 C
1.本期已实现收益	10,182,005.57	16,218,996.30
2.本期利润	15,238,457.87	18,013,479.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0667	0.0509
4.期末基金资产净值	232,107,476.81	638,512,672.10
5.期末基金份额净值	1.313	1.386

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）海富通新内需混合型证券投资基金于2015年12月15日刊登公告，自2015年12月17日起增加一种新的收费模式-C类收费模式。

#### 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

##### 1、海富通新内需混合 A：

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	5.12%	0.24%	4.72%	0.84%	0.40%	-0.60%
过去六个月	7.89%	0.22%	12.63%	0.69%	-4.74%	-0.47%
过去一年	12.32%	0.30%	14.05%	0.72%	-1.73%	-0.42%
过去三年	24.27%	0.27%	12.71%	0.68%	11.56%	-0.41%
过去五年	33.83%	0.23%	24.58%	0.66%	9.25%	-0.43%
自基金合同生效起至今	84.42%	0.66%	39.91%	0.79%	44.51%	-0.13%

## 2、海富通新内需混合 C:

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	5.08%	0.24%	4.72%	0.84%	0.36%	-0.60%
过去六个月	7.86%	0.21%	12.63%	0.69%	-4.77%	-0.48%
过去一年	11.95%	0.30%	14.05%	0.72%	-2.10%	-0.42%
过去三年	23.72%	0.27%	12.71%	0.68%	11.01%	-0.41%
自基金合同生效起至今	34.14%	0.25%	16.58%	0.65%	17.56%	-0.40%

### 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

海富通新内需灵活配置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

#### 1. 海富通新内需混合 A

(2014 年 11 月 27 日至 2020 年 9 月 30 日)



## 2. 海富通新内需混合 C

(2015 年 12 月 17 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：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。

## §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	2016-06-22	-	20 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

	<p>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 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；海 富通 添鑫 收益 债券 基金 经理； 海富 通富 盈混</p>			<p>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。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。</p>
--	--	--	--	---

	合基金 经理；海 富通 富泽 混合 基金 经理； 量化 投资 部总 监。				
张靖爽	本基 金的 基金 经理； 海富 通鼎 丰定 开债 券基 金经 理；海 富通 聚合 纯债 基金 经理； 海富 通融 丰定 开债 券基 金经 理；海 富通 瑞福 债券 基金 经理； 海富 通瑞 祥一	2019-05- 09	-	10 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月起兼任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。

	年定开债券基金经理；海富通裕通 30 个月定开债券基金经理；海富通裕昇三年定开债券基金经理；海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理；海富通富泽混合基金经理。				
--	---	--	--	--	--

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，公司对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 年三季度，全球开始逐步从疫情影响中恢复过来。分主要区域看，中国的恢复情况较好，基本只有外部零星的输入病例；欧洲、美国也基本控制住了疫情快速蔓延的趋势，虽然还有一定反复；一些发展中国家的防疫形势仍较为严峻，但对全球经济的整体影响相对较小。全球均开始推动生活、消费、生产的正常化运行，中国由于疫情控制得力而经济修复显著，除了需要人员聚集的一些社交性消费仍有制约外，国内其它日常生活、商品交易、工业生产、交通运输等均基本恢复。中国三季度各项经济数据也逐步接近正常水平，因此监管层也开始考虑和推动货币、财政等各项托底政策转向正常化。

在国内各项经济指标逐步接近正常水平的推动下，三季度国内权益市场的表现也较为优异。A 股主要指数方面，上证指数上涨 7.82%，沪深 300 上涨 10.17%，中证 800 上涨 9.03%，中小板指上涨 8.19%，创业板指上涨 5.60%。分行业看，中信一级行业中绝大部分上涨，其中国防军工、消费者服务、电力设备、汽车、食品饮料涨幅居前，涨幅分别达到 32.02%、26.56%、23.69%、20.42% 和 19.38%，而通信、商贸零售、综合金融、计算机、传媒、农林牧渔是仅有的六个下跌行业，下跌幅度分别为-8.03%、-3.05%、-2.37%、-2.06%、-1.70% 和 -0.13%。从三季度 A 股内部的结构看，受益于经济逐步恢复的顺周期行业取得了不错的表现，包括餐饮旅游、汽车、食品饮料、建材、非银行金融、机械、基础化工、轻工制造等；以国防军工、电力设备为代表的部分高端装备制造行业自身行业景气好、之前估值不贵，因此也有显著表现；上半年涨幅较大、估值也较高的通信、计算机、传媒、医药等高估值板块，在货币政策逐步转向正常化的背景下出现了阶段性的落后。

本报告期，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。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

下季度，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，从经济基本面来看，2020 年三季度国内经济逐步修复，1-9 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升 1.2%、上升 0.8% 和下跌 7.2%，较 1-6 月分别上涨 2.5%，3.9% 和 4.2%。

通胀方面，猪肉等食品价格均有所下跌，CPI 延续回落态势；但原油等主要工业品价格均有所上涨，PPI 仍不改向上趋势。三季度 CPI 和 PPI 的中枢或分别落在 2.3% 和 -2.2% 左右。

货币政策方面，7-9 月央行并未进一步调降公开市场操作利率，银行间质押式隔夜回购加权利率中枢由二季度的 1.45% 回升至三季度的 1.98%。

在国内经济逐步修复、资金面边际收紧以及利率债供给压力仍然较大的情况下，各期限利率债收益率呈现震荡上行的态势。整体看，三季度 1 年期国债收益率累计上行 47bp 至 2.65%，而 10 年期国债收益率累计上行 33bp 至 3.15%。信用债方面，三季度信用债收益率整体震荡上行，但信用利差继续压缩至历史低位。

本基金在三季度将组合的整体杠杆和久期维持在较低水平。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通新内需混合 A 基金净值增长率为 5.12%，同期业绩比较基准收益率为 4.72%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.40 个百分点。海富通新内需混合 C 基金净值增长率为 5.08%，同期业绩比较基准收益率为 4.72%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.36 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	165,251,693.81	16.98
	其中：股票	165,251,693.81	16.98
2	固定收益投资	468,518,549.84	48.13

	其中：债券	468,518,549.84	48.13
	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	318,482,957.73	32.72
	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	7,060,873.44	0.73
7	其他资产	14,092,250.45	1.45
8	合计	973,406,325.27	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	306,844.00	0.04
B	采矿业	946,735.00	0.11
C	制造业	107,364,543.79	12.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,569,450.00	0.64
E	建筑业	45,309.12	0.01
F	批发和零售业	2,983,160.03	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	973,500.76	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,836,462.77	1.24
J	金融业	25,694,770.80	2.95
K	房地产业	7,072,080.80	0.81
L	租赁和商务服务业	638,620.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	1,828,009.40	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	57,307.34	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	794,452.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	140,448.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	165,251,693.81	18.98

### 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	600519	贵州茅台	5,200	8,676,200.00	1.00
2	600036	招商银行	179,600	6,465,600.00	0.74
3	600031	三一重工	232,000	5,774,480.00	0.66
4	000333	美的集团	69,400	5,038,440.00	0.58
5	600900	长江电力	244,800	4,683,024.00	0.54
6	002142	宁波银行	140,800	4,432,384.00	0.51
7	601318	中国平安	56,300	4,293,438.00	0.49
8	002001	新 和 成	141,300	4,209,327.00	0.48
9	601012	隆基股份	47,200	3,540,472.00	0.41
10	600887	伊利股份	88,000	3,388,000.00	0.39

### 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	29,670,300.00	3.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	205,742,155.00	23.63
	其中：政策性金融债	185,740,155.00	21.33
4	企业债券	144,863,500.00	16.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	80,579,000.00	9.26
7	可转债（可交换债）	7,663,594.84	0.88

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	468,518,549.84	53.81

### 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	101801122	18 金川 MTN002	500,000	50,805,000.00	5.84
2	190409	19 农发 09	500,000	49,650,000.00	5.70
3	140222	14 国开 22	400,000	42,152,000.00	4.84
4	170208	17 国开 08	300,000	30,876,000.00	3.55
5	127452	PR 硃口债	500,000	29,685,000.00	3.41

### 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

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2010	IF2010	-12.00	-16,420,320.00	654,949.57	-
IF2103	IF2103	-11.00	-14,739,780.00	65,820.00	-
公允价值变动总额合计(元)					720,769.57
股指期货投资本期收益(元)					-3,134,209.5

	7
股指期货投资本期公允价值变动(元)	879,530.00

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

## 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，符合既定投资政策及投资目标。

## 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

根据基金合同，本组合暂不投资国债期货。

### 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

根据基金合同，本组合暂不投资国债期货。

## 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	4,085,096.75
2	应收证券清算款	1,774,704.58
3	应收股利	-
4	应收利息	6,850,249.95
5	应收申购款	1,382,199.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	14,092,250.45
---	----	---------------

## 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	110059	浦发转债	2,935,273.90	0.34
2	128064	司尔转债	825,661.36	0.09
3	110045	海澜转债	654,559.80	0.08
4	110034	九州转债	541,916.10	0.06
5	128102	海大转债	533,402.10	0.06
6	132011	17 浙报 EB	491,500.00	0.06
7	113025	明泰转债	203,587.50	0.02
8	113026	核能转债	186,111.00	0.02
9	110051	中天转债	163,879.40	0.02
10	110048	福能转债	162,554.00	0.02
11	128028	赣锋转债	142,490.80	0.02
12	110041	蒙电转债	135,846.70	0.02
13	113021	中信转债	134,387.20	0.02
14	113024	核建转债	122,760.40	0.01
15	127011	中鼎转 2	94,140.88	0.01
16	132015	18 中油 EB	70,723.10	0.01
17	110061	川投转债	67,698.40	0.01
18	128035	大族转债	53,595.00	0.01
19	128010	顺昌转债	53,060.00	0.01
20	113508	新风转债	41,240.00	0.00
21	113525	台华转债	34,839.00	0.00
22	113504	艾华转债	14,368.20	0.00

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通新内需混合A	海富通新内需混合C
本报告期期初基金份额总额	214,253,616.62	125,430,609.53
本报告期基金总申购份额	73,164,544.84	415,472,535.38
减：本报告期基金总赎回份额	110,658,007.27	80,131,218.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	176,760,154.19	460,771,926.23

## §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	2020/7/1-2020/7/7	81,906,355.22	-	-	81,906,355.22	12.85%
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>							

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 90 只公募基金。截至 2020 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1283 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。

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。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，

海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

## §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新内需灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通新内需灵活配置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) 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  
二〇二〇年十月二十八日

