

**海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)**  
**2019 年半年度报告摘要**  
**2019 年 6 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：二〇一九年八月二十八日

## 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 基金简称         | 海富通中证 100 指数 (LOF) |
| 场内简称         | 海富 100             |
| 基金主代码        | 162307             |
| 交易代码         | 162307             |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式           |
| 基金合同生效日      | 2009 年 10 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         |
| 报告期末基金份额总额   | 134,391,212.95 份   |
| 基金合同存续期      | 不定期                |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所            |
| 上市日期         | 2010 年 1 月 8 日     |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 采用指数化投资方式, 通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段, 控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度, 实现对业绩比较基准的有效跟踪。 |
| 投资策略   | 本基金采取完全复制策略, 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 100 指数 $\times 95\%$ + 活期存款利率 (税后) $\times 5\%$                       |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金, 属于较高风险、较高收益的投资品种。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人            | 基金托管人                |
|-------------|------|------------------|----------------------|
| 名称          |      | 海富通基金管理有限公司      | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 奚万荣              | 王永民                  |
|             | 联系电话 | 021-38650891     | 010-66594896         |
|             | 电子邮箱 | wrxi@hftfund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      |      | 40088-40099      | 95566                |

|    |              |              |
|----|--------------|--------------|
| 传真 | 021-33830166 | 010-66594942 |
|----|--------------|--------------|

## 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人的住所  |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 8,791,036.49                          |
| 本期利润          | 25,509,328.35                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2881                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 29.62%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1167                                |
| 期末基金资产净值      | 150,074,031.04                        |
| 期末基金份额净值      | 1.117                                 |

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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 | 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|    |          |             |            |               |     |     |

|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一个月      | 7.15%  | 1.13% | 6.25%  | 1.12% | 0.90%  | 0.01%  |
| 过去三个月      | 3.62%  | 1.42% | 1.82%  | 1.44% | 1.80%  | -0.02% |
| 过去六个月      | 29.62% | 1.46% | 27.30% | 1.47% | 2.32%  | -0.01% |
| 过去一年       | 17.72% | 1.43% | 13.36% | 1.45% | 4.36%  | -0.02% |
| 过去三年       | 46.34% | 1.06% | 36.75% | 1.07% | 9.59%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.44% | 1.40% | 28.23% | 1.40% | 10.21% | 0.00%  |

### 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

海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)  
 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  
 (2009 年 10 月 30 日至 2019 年 6 月 30 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。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十五条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准,由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司(现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”)于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2019 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理 61 只公募基金:海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金 (LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金 (FOF)、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务  | 任本基金的基金经<br>理<br>(助理) 期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明   |
|----|---|--------------------------|------|------------|--|
|    |   | 任职日<br>期                 | 离任日期 |            |  |
| 江勇 | 本基金的基金<br>经理；海富通上<br>证周期 ETF 基<br>金经理；海富通<br>上证周期 ETF 联<br>接基金经<br>理；海富通上<br>证非周期<br>ETF 基金经<br>理；海富通<br>上证非周期<br>ETF 联接基<br>金经理；海富<br>通中证内地<br>低碳指数<br>基金经理。 | 2018-07-<br>25           | -    | 8 年        | 经济学硕士，持有基金从业<br>人员资格证书。历任国泰君<br>安期货有限公司研究所高级<br>分析师，资产管理部研究<br>员、交易员、投资经理。2017<br>年 6 月加入海富通基金管理<br>有限公司。2018 年 7 月起任<br>海富通上证周期 ETF、海富<br>通上证周期 ETF 联接、海富<br>通上证非周期 ETF、海富通<br>上证非周期 ETF 联接、海富<br>通中证 100 指数(LOF)、海<br>富通中证内地低碳指数的<br>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：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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年 A 股市场出现了明显涨幅。截至 2019 年 6 月 30 日，上证综指收于 2978.88 点，上半年上涨 19.45%，深证成指收于 9178.31 点，上涨幅度为 26.78%。中小板指收于 5678.75 点，上涨 20.75%，创业板上涨 20.87%，报 1511.51 点。

具体来看，自从 1 月 4 日上证综指盘中触及近三年新低 2440.91 点之后，市场便开始温和反弹，一直延续到月底，1 月份上证综指涨幅 3.64%。板块上，家电、食品饮料、保险、银行等价值权重板块率先企稳反弹，涨幅居前。进入 2 月份，随着困扰 2018 年的几大利空因素均有所缓解：中美贸易摩擦的积极向好谈判、监管层对去杠杆告一段落等，2 月份上证综指涨幅达到 13.79%，创近几年新高。同时随着 2 月末两市单日总成交量放大到万亿、融资余额回到 8000 亿以上，市场风险偏好大幅上升。趋势延续到 3 月，当月上证综指上涨 5.09%，表现依旧不错。进入二季度，一季度大幅上涨之后，4 月份存在一定的调整压力。因此在月初上证综指触及短期新高 3288.45 点之后，便开始区间震荡。同时月底贸易谈判陷入僵局，指数也开始出现回调。4 月份上证综指下跌 0.4%。5 月月初随着中美贸易谈判陷入僵局，以及对国内宏观经济下行压力的预期，市场出现了大幅回调，单 5 月份上证综指下跌 5.84%，深证成指下跌 7.77%。板块上看，仅有以黄金为代表的有色板块涨幅 2.2%，其他板块悉数下跌，其中禽畜产业链、食品饮料等相对跌幅较少，而 TMT 板块、券商等高弹性板块跌幅居前。进入 6 月份之后，虽然 4-5 月份的宏观经济数据依旧没有改善预期，但随着对中美 G20 重启贸易谈判的预期，市场逐步开始筑底回升，风险偏好有所提升，单 6 月上证综指上涨 2.77%。

行业方面，在申万 28 个一级行业分类中，上半年均录得涨幅，单板块间差异巨大。其中食品饮料 (61.01%)、非银金融 (43.83%)、农林牧渔 (41.96%)、家电 (37.82%)、计算机 (32.77%) 涨幅排名前五，且都涨幅超过 30%。而建筑装饰 (4.16%)、钢铁 (5.04%)、传媒 (7.79%)、纺织服装 (9.27%)、汽车 (10.03%) 涨幅靠后。

报告期内，本基金完成了年中的指数成分股调整。作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 29.62%，同期业绩比较基准收益率为 27.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年初，市场对经济的担忧有所缓解。外部中美贸易摩擦暂缓，并貌似朝着达成协议的方向演进。内部政策宽松，降准、地方债发行前置、信贷周期回暖，资产价格预期企稳。2019 年 4 月中旬，国内外不确定性上升。4 月中旬起国内政策边际收紧，5 月初中美局势恶化，5 月 24 日包商银行被接管，中小银行结构性去杠杆。市场风险偏好显著回落。2019 年 6 月中旬，中美领导人通电话，确定 G20 见面，市场预期谈判重启；美联储 6 月议息会议释放鸽派信号；证监会就修改《上市公司重大资产重组管理办法》征求意见，市场风险偏好迅速提升。上半年的行情基本上来源于估值修复。

下半年，国内宏观经济增长压力仍在。一季度在信贷及社融扩张提振下，经济增长体现一定韧性，但随着外部中美贸易摩擦带来的负面效果更大范围地显现，内部房地产市场可能逐步降温、基建增速制约重重、中小银行去杠杆对实体经济的影响尚未完全体现等，中国经济增长在 2019 年下半年仍将面临压力。同时，从政策角度看，下半年宏观政策倾向将维持宽松，尤其是三季度将在边际上较二季度宽松。但在高杠杆环境以及结构性去杠杆政策背景制约下，政策效果有待验证。同时，包商银行事件后，流动性出现分层，中小银行及非银机构融资困难程度及成本上升，为避免出现局部风险，预计货币政策将采取进一步措施缓解结构性流动性压力。

从中期角度，我们依旧对下半年的资本市场保持相对乐观。我们认为估值的变化依然是核心变量，仍存在修复机会。估值端来自无风险利率下行带来的修复机会较为确定，风险偏好短期将出现抬升，但后续存在不确定性，整体上市场环境好于二季度，策略上更加积极，但需留意市场可能会阶段性对业绩下滑做出负面反应。从行业角度看，我们认为科技、消费、金融等板块有望持续跑出超额收益，包括计算机、半导体、5G、食品饮料、医药、券商、银行等。

未来，本基金将继续严格按照基金合同的要求，秉承指数化投资策略，提高组合与指数的拟合度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的

风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年至多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%；

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2019 年 6 月 18 日本基金的可供分配利润为基准，于 2019 年 6 月 27 日完成权益登记，单位分红金额为 0.264 元，合计利润分配金额 34,809,457.32 元。符合基金合同规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体: 海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 资产          | 附注号     | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产:         |         |                        |                          |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 12,862,889.89          | 2,303,574.85             |
| 结算备付金       |         | 287,896.19             | 72,363.30                |
| 存出保证金       |         | 52,881.51              | 2,616.56                 |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 142,007,994.91         | 74,393,742.99            |
| 其中: 股票投资    |         | 138,607,317.31         | 72,384,942.99            |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | 3,400,677.60           | 2,008,800.00             |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 应收证券清算款     |         | 27,119,590.13          | 1,023,744.87             |
| 应收利息        | 6.4.7.5 | 42,169.58              | 56,326.91                |
| 应收股利        |         | -                      | -                        |
| 应收申购款       |         | 54,902.99              | 13,681.32                |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| <b>资产总计</b> |         | <b>182,428,325.20</b>  | <b>77,866,050.80</b>     |
| 负债和所有者权益    | 附注号     | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
| 负债:         |         |                        |                          |
| 短期借款        |         | -                      | -                        |
| 交易性金融负债     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款   |         | -                      | -                        |

|               |          |                |               |
|---------------|----------|----------------|---------------|
| 应付证券清算款       |          | -              | 1,596.16      |
| 应付赎回款         |          | 339,615.83     | 6,616.01      |
| 应付管理人报酬       |          | 96,367.39      | 47,551.46     |
| 应付托管费         |          | 16,520.12      | 8,151.67      |
| 应付销售服务费       |          | -              | -             |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 63,194.29      | 4,290.28      |
| 应交税费          |          | -              | -             |
| 应付利息          |          | -              | -             |
| 应付利润          |          | 31,685,844.04  | -             |
| 递延所得税负债       |          | -              | -             |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 152,752.49     | 300,020.98    |
| 负债合计          |          | 32,354,294.16  | 368,226.56    |
| <b>所有者权益:</b> |          |                |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 134,391,212.95 | 72,594,149.57 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 15,682,818.09  | 4,903,674.67  |
| 所有者权益合计       |          | 150,074,031.04 | 77,497,824.24 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 182,428,325.20 | 77,866,050.80 |

注:1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.117 元,基金份额总额 134,391,212.95 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

## 6.2 利润表

会计主体:海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期:2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位:人民币元

| 项目          | 附注号      | 本期                                 | 上年度可比期间                            |
|-------------|----------|------------------------------------|------------------------------------|
|             |          | 2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
| <b>一、收入</b> |          | <b>26,298,936.41</b>               | <b>-8,319,464.91</b>               |
| 1.利息收入      |          | 63,708.88                          | 26,945.48                          |
| 其中:存款利息收入   | 6.4.7.11 | 27,110.76                          | 26,945.48                          |
| 债券利息收入      |          | 36,428.01                          | -                                  |
| 资产支持证券利息收入  |          | -                                  | -                                  |

|                             |          |                      |                      |
|-----------------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 买入返售金融资产收入                  |          | 170.11               | -                    |
| 其他利息收入                      |          | -                    | -                    |
| 2.投资收益 (损失以“-”填列)           |          | 9,506,893.93         | 2,817,326.69         |
| 其中: 股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 7,599,610.29         | 1,820,947.97         |
| 基金投资收益                      |          | -                    | -                    |
| 债券投资收益                      | 6.4.7.13 | 13,203.88            | -                    |
| 资产支持证券投资收益                  |          | -                    | -                    |
| 贵金属投资收益                     | 6.4.7.14 | -                    | -                    |
| 衍生工具收益                      | 6.4.7.15 | -                    | -                    |
| 股利收益                        | 6.4.7.16 | 1,894,079.76         | 996,378.72           |
| 3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)      | 6.4.7.17 | 16,718,291.86        | -11,169,387.86       |
| 4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)          |          | -                    | -                    |
| 5.其他收入 (损失以“-”号填列)          | 6.4.7.18 | 10,041.74            | 5,650.78             |
| <b>减: 二、费用</b>              |          | <b>789,608.06</b>    | <b>740,339.33</b>    |
| 1. 管理人报酬                    |          | 391,174.83           | 332,298.65           |
| 2. 托管费                      |          | 67,058.55            | 56,965.46            |
| 3. 销售服务费                    |          | -                    | -                    |
| 4. 交易费用                     | 6.4.7.19 | 116,373.38           | 31,861.25            |
| 5. 利息支出                     |          | -                    | -                    |
| 其中: 卖出回购金融资产支出              |          | -                    | -                    |
| 6.税金及附加                     |          | 0.15                 | -                    |
| 7. 其他费用                     | 6.4.7.20 | 215,001.15           | 319,213.97           |
| <b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b> |          | <b>25,509,328.35</b> | <b>-9,059,804.24</b> |
| 减: 所得税费用                    |          | -                    | -                    |
| <b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>   |          | <b>25,509,328.35</b> | <b>-9,059,804.24</b> |

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期                              |
|----|---------------------------------|
|    | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|    |                                 |

|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
|--|--|----------------|----------------|
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)                                | 72,594,149.57                              | 4,903,674.67   | 77,497,824.24  |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本<br>期利润)                   | -  | 25,509,328.35  | 25,509,328.35  |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动<br>数(净值减少以“-”号填<br>列)      | 61,797,063.38                              | 20,079,272.39  | 81,876,335.77  |
| 其中：1.基金申购款   | 74,218,319.03                              | 23,917,112.29  | 98,135,431.32  |
| 2.基金赎回款  | -12,421,255.65                             | -3,837,839.90  | -16,259,095.55 |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的<br>基金净值变动(净值减<br>少以“-”号填列) | -  | -34,809,457.32 | -34,809,457.32 |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 134,391,212.95                             | 15,682,818.09  | 150,074,031.04 |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                |                |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)                                | 76,780,247.26                              | 23,198,575.05  | 99,978,822.31  |
| 二、本期经营活动产生的<br>基金净值变动数(本<br>期利润)                   | -  | -9,059,804.24  | -9,059,804.24  |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变动<br>数(净值减少以“-”号填<br>列)      | -3,857,960.82                              | -1,314,467.81  | -5,172,428.63  |
| 其中：1.基金申购款   | 6,066,404.38                               | 1,969,894.48   | 8,036,298.86   |
| 2.基金赎回款  | -9,924,365.20                              | -3,284,362.29  | -13,208,727.49 |
| 四、本期向基金份额持<br>有人分配利润产生的<br>基金净值变动(净值减<br>少以“-”号填列) | -  | -              | -              |

|                     |               |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|---------------|
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值) | 72,922,286.44 | 12,824,303.00 | 85,746,589.44 |
|---------------------|---------------|---------------|---------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 879 号《关于核准海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,086,432,233.85 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字 (2009)第 226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 10 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,087,148,875.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 716,641.45 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 205 号文审核同意，本基金 107,647,812.00 份基金份额于 2010 年 1 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数成份股及备选成份股、新股(首次公开发行股票或增发)、固定收益产品、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，现金、固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的基金管理人力争控制本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 0.35%，年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数×95%+活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2019 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF) 基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人



以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系         |
|--------------------|-----------------|
| 海富通基金管理有限公司(“海富通”) | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金托管人、基金销售机构    |
| 海通证券股份有限公司(“海通证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目                  | 本期<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年<br>6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费      | 391,174.83                     | 332,298.65                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护<br>费 | 78,726.88                      | 75,656.29                           |

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.7% / 当年天数。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 67,058.55                      | 56,965.46                           |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.12% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

**6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 12,862,889.89              | 23,454.24 | 6,707,234.91                    | 26,738.56 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明****6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明**

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 128,062 股股东公司海通证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,917,194.67 元，估值总额为人民币 1,817,199.78 元，占基金资产净值的比例为 1.2109%（2018 年 12 月 31 日：持有 82,262 股，成本总额为人民币 1,389,838.38 元，估值总额为人民币 723,905.60 元，占基金资产净值的比例为 0.9341%）。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 351,776.00 托管人公司的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,589,106.72 元，估值总额为人民币 1,315,642.24 元，占基金资产净值的比例为 0.8767%（2018 年 12 月 31 日：持有 238,476 股，成本总额为人民币 1,208,278.10 元，估值总额为人民币 860,898.36 元，占基金资产净值的比例为 1.1109%）。

**6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |           |           |           |    |
|---------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300788              | 中信出版 | 2019-06-27 | 2019-07-05 | 新股未上市  | 14.85 | 14.85  | 1,556     | 23,106.60 | 23,106.60 | -  |

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量 (股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 600485 | 信威集团 | 2016-12-26 | 重大资产重组 | 6.28   | 2019-07-12 | 13.86  | 36,178 | 773,505.60 | 227,197.84 | -  |

注：本基金截至 2019 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目    | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资  | 138,607,317.31 | 75.98         |
|    | 其中：股票 | 138,607,317.31 | 75.98         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 3,400,677.60   | 1.86   |
|   | 其中：债券             | 3,400,677.60   | 1.86   |
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 13,150,786.08  | 7.21   |
| 8 | 其他各项资产            | 27,269,544.21  | 14.95  |
| 9 | 合计                | 182,428,325.20 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,044,020.00  | 1.36          |
| B  | 采矿业              | 4,370,304.89  | 2.91          |
| C  | 制造业              | 45,220,276.59 | 30.13         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,186,230.04  | 2.12          |
| E  | 建筑业              | 4,716,640.85  | 3.14          |
| F  | 批发和零售业           | 1,370,838.12  | 0.91          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,741,293.42  | 2.49          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,917,247.75  | 1.28          |
| J  | 金融业              | 62,995,344.21 | 41.98         |
| K  | 房地产业             | 6,447,895.37  | 4.30          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,914,634.69  | 1.28          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | 130,020.00     | 0.09  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -              | -     |
| 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            | 138,054,745.93 | 91.99 |

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -             |
| B  | 采矿业              | 100,642.50 | 0.07          |
| C  | 制造业              | 389,218.52 | 0.26          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -             |
| E  | 建筑业              | -          | -             |
| 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  | 39,603.76  | 0.03          |
| 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    | -          | -             |
| 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        | 23,106.60  | 0.02          |
| S  | 综合               | -          | -             |

|    |            |      |
|----|------------|------|
| 合计 | 552,571.38 | 0.37 |
|----|------------|------|

### 7.2.3 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。

### 7.3 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

#### 7.3.1 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量 (股)  | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 181,856 | 16,114,260.16 | 10.74         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 7,848   | 7,722,432.00  | 5.15          |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 158,413 | 5,699,699.74  | 3.80          |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 80,680  | 4,437,400.00  | 2.96          |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 234,988 | 4,297,930.52  | 2.86          |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 77,307  | 4,009,141.02  | 2.67          |
| 7  | 000858 | 五粮液  | 32,276  | 3,806,954.20  | 2.54          |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 101,471 | 3,390,146.11  | 2.26          |
| 9  | 600030 | 中信证券 | 132,106 | 3,145,443.86  | 2.10          |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 459,195 | 2,810,273.40  | 1.87          |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

#### 7.3.2 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------|------------|---------------|
| 1  | 600485 | 信威集团 | 36,178 | 227,197.84 | 0.15          |
| 2  | 600968 | 海油发展 | 28,350 | 100,642.50 | 0.07          |

|   |        |      |        |           |      |
|---|--------|------|--------|-----------|------|
| 3 | 300782 | 卓胜微  | 743    | 80,927.56 | 0.05 |
| 4 | 601698 | 中国卫通 | 10,103 | 39,603.76 | 0.03 |
| 5 | 300594 | 朗进科技 | 721    | 31,803.31 | 0.02 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 8,356,612.00 | 10.78           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 3,641,890.68 | 4.70            |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 3,260,436.00 | 4.21            |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 2,716,534.00 | 3.51            |
| 5  | 300498 | 温氏股份 | 2,672,269.02 | 3.45            |
| 6  | 000651 | 格力电器 | 2,381,639.36 | 3.07            |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 2,105,468.00 | 2.72            |
| 8  | 000858 | 五粮液  | 1,785,753.00 | 2.30            |
| 9  | 600887 | 伊利股份 | 1,618,533.00 | 2.09            |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 1,504,334.00 | 1.94            |
| 11 | 601328 | 交通银行 | 1,497,170.00 | 1.93            |
| 12 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,485,190.00 | 1.92            |
| 13 | 600016 | 民生银行 | 1,383,981.00 | 1.79            |
| 14 | 600000 | 浦发银行 | 1,283,319.00 | 1.66            |
| 15 | 601288 | 农业银行 | 1,277,554.00 | 1.65            |
| 16 | 000002 | 万科 A | 1,168,957.00 | 1.51            |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 1,106,583.00 | 1.43            |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 18 | 000001 | 平安银行 | 1,061,900.00 | 1.37 |
| 19 | 601888 | 中国国旅 | 1,058,986.00 | 1.37 |
| 20 | 601668 | 中国建筑 | 1,056,321.00 | 1.36 |

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 3,889,810.84 | 5.02            |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 2,052,361.38 | 2.65            |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 1,608,199.91 | 2.08            |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 990,712.00   | 1.28            |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 922,249.00   | 1.19            |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 861,324.33   | 1.11            |
| 7  | 000858 | 五粮液  | 800,321.00   | 1.03            |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 768,835.00   | 0.99            |
| 9  | 600276 | 恒瑞医药 | 733,913.00   | 0.95            |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 711,171.00   | 0.92            |
| 11 | 601328 | 交通银行 | 648,151.00   | 0.84            |
| 12 | 600016 | 民生银行 | 623,723.00   | 0.80            |
| 13 | 601288 | 农业银行 | 561,995.00   | 0.73            |
| 14 | 600900 | 长江电力 | 509,021.00   | 0.66            |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 507,636.00   | 0.66            |
| 16 | 600000 | 浦发银行 | 504,025.00   | 0.65            |
| 17 | 601601 | 中国太保 | 488,445.92   | 0.63            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 18 | 601668 | 中国建筑 | 484,779.00 | 0.63 |
| 19 | 000002 | 万科 A | 472,391.59 | 0.61 |
| 20 | 000001 | 平安银行 | 460,259.06 | 0.59 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 78,752,812.44 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 36,842,413.75 |

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|--------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 3,400,677.60 | 2.27          |
| 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       | -            | -             |
| 8  | 同业存单      | -            | -             |
| 9  | 其他        | -            | -             |
| 10 | 合计        | 3,400,677.60 | 2.27          |

### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|---------------|
| 1  | 019611 | 19 国债 01 | 30,030 | 3,000,597.60 | 2.00          |
| 2  | 019544 | 16 国债 16 | 4,000  | 400,080.00   | 0.27          |

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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持有国债期货。

#### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的交通银行（601328）于 2018 年 12 月 7 日公告称，因并购贷款占并购交易价款比例不合规，并购贷款尽职调查和风险评估不到位，违反了《商业银行并购贷款风险管理指引》和《中华人民共和国银行业监督管理法》相关规定，被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 50 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金系指数型基金，对上述证券的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 52,881.51     |
| 2  | 应收证券清算款 | 27,119,590.13 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 42,169.58     |
| 5  | 应收申购款   | 54,902.99     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 27,269,544.21 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|--------------|----------|
| 1  | 600485 | 信威集团 | 227,197.84  | 0.15         | 重大资产重组   |

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构         |            |               |            |
|----------|---------------|---------------|------------|---------------|------------|
|          |               | 机构投资者         |            | 个人投资者         |            |
|          |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 3,711    | 36,214.29     | 64,366,414.12 | 47.89%     | 70,024,798.83 | 52.11%     |

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称              | 持有份额 (份)   | 占上市总份额比例 |
|----|--------------------|------------|----------|
| 1  | 齐齐哈尔中通公共交通有限责任公司   | 500,030.00 | 21.96%   |
| 2  | 何小娥                | 384,511.00 | 16.89%   |
| 3  | 乐玉屏                | 216,503.00 | 9.51%    |
| 4  | 高德荣                | 191,138.00 | 8.40%    |
| 5  | 黄晟昊                | 120,000.00 | 5.27%    |
| 6  | 李建义                | 102,349.00 | 4.50%    |
| 7  | 单世扬                | 100,003.00 | 4.39%    |
| 8  | 葛光亚                | 92,007.00  | 4.04%    |
| 9  | 北京鸿愿非凡装饰材料<br>有限公司 | 80,000.00  | 3.51%    |
| 10 | 李瑶琼                | 50,001.00  | 2.20%    |

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 2,345.51   | 0.0017%  |

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                     | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基<br>金 | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 0                  |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2009 年 10 月 30 日）基金份额总额 | 2,087,148,875.30 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 72,594,149.57    |
| 本报告期基金总申购份额                     | 74,218,319.03    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 12,421,255.65    |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 134,391,212.95   |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2019 年 3 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，因第五届董事会任期届满，经公司 2019 年第一次临时股东会审议通过，选举杨仓兵先生、吴淑琨先生、芮政先先生、任志强先生、Ligia TORRES (陶乐斯)女士、Alexandre WERNO (韦历山)先生、张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士担任公司第六届董事会董事，其中张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士为独立董事。原第五届董事会成员张文伟先生、杨明先生、杨国平先生、Marc Bayot (巴约特)先生、郑国汉 (Leonard K.CHENG)先生不再担任公司董事职务。

2、2019 年 3 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第一次会议审议通过，张文伟先生不再担任公司董事长职务，并决定由公司总经理任志强先生代为履行董事长职务，代为履行董事长职务的期限不超过 90 日。

3、2019 年 4 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第一次会议审议通过，聘请杨仓兵先生担任公司董事长职务。自杨仓兵先生任董事长职务之日起，公司总经理任志强先生不再代行董事长职务。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 申万宏源 | 2      | 73,180,202.00 | 63.98%       | 31,001.21 | 44.69%     | -  |
| 中信证券 | 2      | 41,202,420.07 | 36.02%       | 38,371.84 | 55.31%     | -  |
| 中信建投 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 渤海证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国盛证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中金公司 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 上海证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 银河证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |

注：1、注：报告期内本基金交易单元无变化。

**2、（1）交易单元的选择标准**

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

## (2) 交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择:

<1> 推荐。投资部业务人员推荐,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见,并报公司总经理办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的总经理办公会核准。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易         |              | 回购交易       |              | 权证交易 |              |
|------|--------------|--------------|------------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额       | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 申万宏源 | 2,281,177.90 | 47.97%       | -          | -            | -    | -            |
| 中信证券 | 2,474,667.90 | 52.03%       | 900,000.00 | 100.00%      | -    | -            |
| 中信建投 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 渤海证券 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 国盛证券 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 中金公司 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 上海证券 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 华创证券 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 银河证券 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 天风证券 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 国金证券 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |
| 长江证券 | -            | -            | -          | -            | -    | -            |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 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  | 2019/4/29-2019/6/30    | 0.00 | 36,656,158.36 | 0.00 | 36,656,158.36 | 27.28% |
| <b>产品特有风险</b>   |    |                        |      |               |      |               |        |
| <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> |    |                        |      |               |      |               |        |

## 11.2 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 69 只公募基金。截至 2019 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 780 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 6 月 30 日，海外业务规模约 23 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 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业约 438 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 6 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约 388 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, 中国证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。

海富通基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十八日