

**海富通富祥混合型证券投资基金
2018 年第 3 季度报告
2018 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：二〇一八年十月二十六日

§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 2018 年 10 月 25 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 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 海富通富祥混合 |
| 基金主代码 | 519134 |
| 交易代码 | 519134 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 7 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 45,389,721.14 份 |
| 投资目标 | 本基金通过稳健的大类资产配置策略和个券及个股精选策略，在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金为混合型基金，对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 70%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场风险收益特征及市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和股票资产等的预期风险收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率 \times 70% + 沪深 300 指数收益率 \times 30%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高 |

| | |
|-------|---------------------------------------|
| | 于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。 |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国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 |
|----------------|----------------------------------|
| | (2018 年 7 月 1 日-2018 年 9 月 30 日) |
| 1.本期已实现收益 | -847,137.79 |
| 2.本期利润 | 32,054.16 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0006 |
| 4.期末基金资产净值 | 45,539,890.21 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.003 |

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 | -0.20% | 0.25% | 0.36% | 0.39% | -0.56% | -0.14% |

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

海富通富祥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历史走势对比图
(2016 年 7 月 27 日至 2018 年 9 月 30 日)



注：本基金合同于2016年7月27日生效，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 | | |
| 陈轶平 | 本基金的基金经理；海富通货币基金经理；海富通季季增利理财债券 | 2016-07-27 | - | 9 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、债券基金部总监，现任固定收益投资副总监。2013 年 8 月起 |

| | | | |
|---|--|--|--|
| 基金经理; 海富通稳 固收 益债 券基 金经 理;海 富通 一年 定开 债券 基金 经理; 海富通 上证可 质押城 投债 ETF 基金 经理; 海富通 瑞丰 一年定 开债券 基金经 理;海 富通 美元 债 (QD II)基 金经 理;海 富通 上证 周期 产业 债 | | | 任海富通货币基金经理。2014 年 8 月起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 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 月兼任海富通稳健增利债券 (LOF) 基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。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 月起兼任海富通美元债 (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 月起兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。 |
|---|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| ETF 基金 经理; 海富 通瑞 利债 券基 金经 理;海 富通 瑞合 纯债 基金 经理; 海富 通富 睿混 合基 金经 理;海 富通 欣悦 混合 基金 经理; 海富 通瑞 福一 年定 开债 券基 金经 理;海 富通 瑞祥 一年 定开 债券 基金 经理; 海富 通恒 丰定 开债 | | | | |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|---------|--|------------|---|------|--|
| | 券基 金经 理。固 定收 益投 资副 总监。 | | | | |
| 杜晓 海 | 本基金 的基金 经理； 海富通安 颐收 益混 合基 金经 理；海 富通新 内需混 合基 金经 理；海 富通欣 荣混 合基 金经 理；海 富通富 睿混 合基 金经 理；海 富通阿 尔法对 冲混 合基 金经 理；海 富通创 业 | 2018-03-16 | - | 18 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 月起兼任海富通富睿混合基金经理。2018 年 3 月起兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合、海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。 |

| | | | | |
|---|--|--|--|----|
| 板增强基金经理;海富通量化前锋股票基金经理;海富通稳固收益债券基金经理;海富通欣享混合基金经理;海富通欣益混合基金经理;海富通量化多因子混合基金经理;量化投资部总监。 | | | | 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018 年三季度，受到宏观经济下行预期和中美贸易摩擦内外双重因素的影响，A 股市场总体表现较弱，且内部结构分化明显。两个市场表现为沪强深弱，其中上证 50 指数当期涨幅超过 5%，领先两市各主要指数；受到油价上涨、鸡价上涨、基建加码预期的影响，与宏观实体经济表现更紧密的石油石化、农业、建筑、银行等表现良好，而与居民支出相关的家电、医药、纺织服装等消费板块以及计算机、电子等成长性行业调整比较显著。

具体来说，全市场主要指数当中，上证 50 收于 2606.67 点，涨幅 5.11%；上证综指收于 2821.35 点，跌幅-0.92%；沪深 300 收于 3438.86 点，跌幅-2.05%；深成指收于 8401.09 点，跌幅-10.43%；创业板指收于 1411.34 点，跌幅-12.16%；中小板指收于 5750.77 点，跌幅-11.22%；中证 800 收于 3662.11 点，跌幅-3.54%；万得全 A 收于 3674.76 点，跌幅-4.81%。

行业方面，三季度在中信证券 29 个一级行业分类中，银行、石油石化和非银分别上涨 12.41%、11.60% 和 5.46%，分列前三位。下跌前三位的行业则包括家电、纺织服装和电子，分别下跌 17.34%、15.34% 和 14.91%。

本报告期，本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。

四季度，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。

债市方面，从基本面看，三季度经济趋于下行，通胀抬升。生产端，工业企业生产有所走弱，工业增加值较二季度出现下滑；投资端，固定资产投资增速延续下跌态势，其中房地产投资在前期土地购置费支撑下维持高增速，制造业投资持续小幅回暖，但基建投资增速继续大幅下滑；消费端，乘用车需求疲软，消费整体表现偏弱；融资端，社融存量增速下滑至历史新低。而通胀在三季度有所抬升，猪肉、蔬菜等食品项出现超季节性上涨，8 月 CPI 同比回升至 2.3%。总体看去杠杆带来的融资收缩和贸易战的不确定性给经济带来了一些下行压力。为了缓解压力，三季度国内政策出现了一定程度的转向，从“紧信用”目标转为“宽信用”，而货币政策继续稳健灵活，保持流动性合理充裕。在这种背景下，三季度利率呈现震荡走高的态势。尽管经济下滑、资金面宽松，但“宽信用”的政策目标使得债券牛市的逻辑被打上问号，而 8 月以来在财政部督促下地方债加速发行，供给压力较大，加上通胀预期的抬升和美联储加息影响，三季度 1 年期国债收益率下行 19BP，10 年期国债收益率上行 13BP，收益率曲线变得极度陡峭。信用债方面，7 月央行指导银行增配低等级信用债，同时国常会提出要保障平台合理融资需求，政策和融资环境相比上半年得到一定程度的改善，信用债收益率也迎来一波快速下行，但随后两月又跟随利率债出现一定幅度的回调。整个三季度 3 年期 AAA 级企业债收益率下行 37BP，AA 级企业债收益率下行 49BP，信用利差收窄。可转债方面，三季度转债市场筑底企稳，与股市震荡下行不同的是，转债指数呈现震荡上行的态势，主因是整体债底的支撑以及规模占比较大的银行转债的上涨，三季度中证转债指数上涨 2.68%。

本基金债券部分在三季度维持了信用债的久期，同时保持了相对较高久期，在风险可控前提下争取获得较高收益。同时，本组合大部分时间低配了可转债仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富祥基金净值增长率为-0.20%，同期业绩比较基准收益率为 0.36%，基金净值跑输业绩比较基准 0.56 个百分点。本季度股票市场波动较大，主流指数大多下跌，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

本报告期内，本基金自 2018 年 8 月 3 日至 2018 年 9 月 30 日，已连续四十个工作日出现基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§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 | 4,880,186.80 | 8.36 |
| | 其中：股票 | 4,880,186.80 | 8.36 |
| 2 | 固定收益投资 | 48,271,745.95 | 82.71 |
| | 其中：债券 | 48,271,745.95 | 82.71 |
| | 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 | 4,374,279.54 | 7.50 |
| 7 | 其他资产 | 835,423.43 | 1.43 |
| 8 | 合计 | 58,361,635.72 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,899,698.40 | 6.37 |
| 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 | 160,796.00 | 0.35 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 24,690.00 | 0.05 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 130,610.00 | 0.29 |

| | | | |
|---|---------------|--------------|-------|
| J | 金融业 | 1,272,120.00 | 2.79 |
| K | 房地产业 | 215,508.00 | 0.47 |
| L | 租赁和商务服务业 | 44,592.40 | 0.10 |
| 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 | 132,172.00 | 0.29 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,880,186.80 | 10.72 |

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 | 130,000 | 941,200.00 | 2.07 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 9,200 | 625,140.00 | 1.37 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 14,400 | 369,792.00 | 0.81 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 7,600 | 305,520.00 | 0.67 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 4,100 | 280,850.00 | 0.62 |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 300 | 219,000.00 | 0.48 |
| 7 | 002008 | 大族激光 | 5,000 | 211,850.00 | 0.47 |
| 8 | 002304 | 洋河股份 | 1,100 | 140,800.00 | 0.31 |
| 9 | 600406 | 国电南瑞 | 7,400 | 130,610.00 | 0.29 |
| 10 | 001979 | 招商蛇口 | 6,200 | 115,878.00 | 0.25 |

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 | 29,393,000.00 | 64.54 |
| | 其中：政策性金融债 | 29,393,000.00 | 64.54 |
| 4 | 企业债券 | 15,795,877.50 | 34.69 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 3,082,868.45 | 6.77 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 48,271,745.95 | 106.00 |

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 | 160210 | 16 国开 10 | 200,000 | 18,514,000.00 | 40.65 |
| 2 | 180210 | 18 国开 10 | 100,000 | 9,873,000.00 | 21.68 |
| 3 | 127208 | 15 国网 01 | 40,000 | 4,074,000.00 | 8.95 |
| 4 | 136845 | 16 环球 03 | 40,430 | 4,012,677.50 | 8.81 |
| 5 | 136174 | 16 工艺 01 | 40,000 | 3,867,200.00 | 8.49 |

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

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。

5.10 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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本报告期，本基金未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的五粮液（000858）的发行人于2018年8月28日公告称，公司监事、监事会主席余铭书涉嫌严重违纪违法，正接受纪律审查和监察调查。

对该证券的投资决策程序的说明：公司二季度收入、净利润表现亮眼；从行业趋势上看，消费升级和集中度提升带动高端酒持续扩容，继续看好公司后续的量价表现。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的国君转债（113013）的发行人作为平凉市城乡建设投资有限责任公司2017年非公开发行公司债券的受托管理人，未按照规定有效监督平凉城投募集资金使用及信息披露，且出具的2017年度受托管理事务报告中平凉城投募集资金使用信息与实际情况不符。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》的相关规定，公司于2018年8月16日收到甘肃证监局出具的警示函。

对该证券的投资决策程序的说明：公司为老牌券商，投行业务始终保持较强的专业能力和品牌知名度，投行业务的传统优势地位较为牢固，同时，公司经纪业务市场份额较大，居行业前列，整体盈利能力较强，并且公司为主板上市公司，融资渠道通畅，因而整体信用风险较低。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实

际投资组合。

其他八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。

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 | 7,630.42 |
| 2 | 应收证券清算款 | 85,138.61 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 742,456.38 |
| 5 | 应收申购款 | 198.02 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 835,423.43 |

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 | 515,869.90 | 1.13 |
| 2 | 113013 | 国君转债 | 577,392.00 | 1.27 |
| 3 | 113018 | 常熟转债 | 504,752.40 | 1.11 |
| 4 | 110043 | 无锡转债 | 442,836.90 | 0.97 |
| 5 | 128024 | 宁行转债 | 348,659.90 | 0.77 |
| 6 | 128034 | 江银转债 | 153,494.95 | 0.34 |

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

| | |
|--------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 67,208,514.64 |
|--------------|---------------|

| | |
|---------------|---------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 51,551.43 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 21,870,344.93 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 45,389,721.14 |

§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

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 61 只公募基金。截至 2018 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 733.55 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 2018 年 9 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 28 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 2018 年 9 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 407 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 2018 年 9 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 411 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。

2016 年 3 月,国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通基金管理有限公司“固定收益投资金牛基金公司”。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。

§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富祥混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通富祥混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通富祥混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通富祥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) 报告期内海富通富祥混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一八年十月二十六日