

海富通安颐收益混合型证券投资基金
(原海富通养老收益混合型证券投资基金)
2018 年第 2 季度报告
2018 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：二〇一八年七月十八日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 月 17 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通安颐收益混合
基金主代码	519050
交易代码	519050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 29 日
报告期末基金份额总额	442,569,196.53 份
投资目标	本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。
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，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。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。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+2%

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	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
下属两级基金的交易代码	519050	002339
报告期末下属两级基金的份额总额	395,082,268.39 份	47,486,928.14 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 (2018 年 4 月 1 日-2018 年 6 月 30 日)	
	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
1.本期已实现收益	1,935,185.23	593,562.79
2.本期利润	1,506,091.37	748,525.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0038	0.0097
4.期末基金资产净值	486,564,161.20	58,942,935.79
5.期末基金份额净值	1.232	1.241

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）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）于2016年1月6日刊登公告，自2016年1月8日起增加收取销售服务费的C类份额。

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、海富通安颐收益混合 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	0.33%	0.21%	1.16%	0.01%	-0.83%	0.20%

2、海富通安颐收益混合 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	0.40%	0.21%	1.16%	0.01%	-0.76%	0.20%

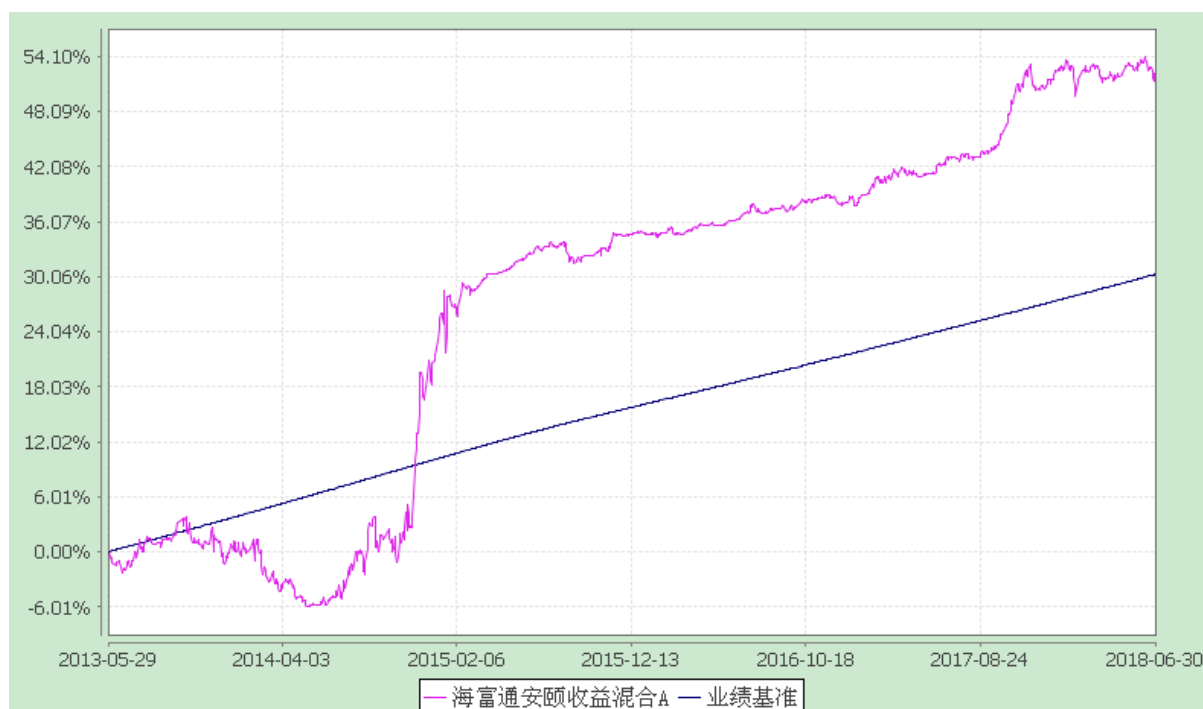
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通安颐收益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

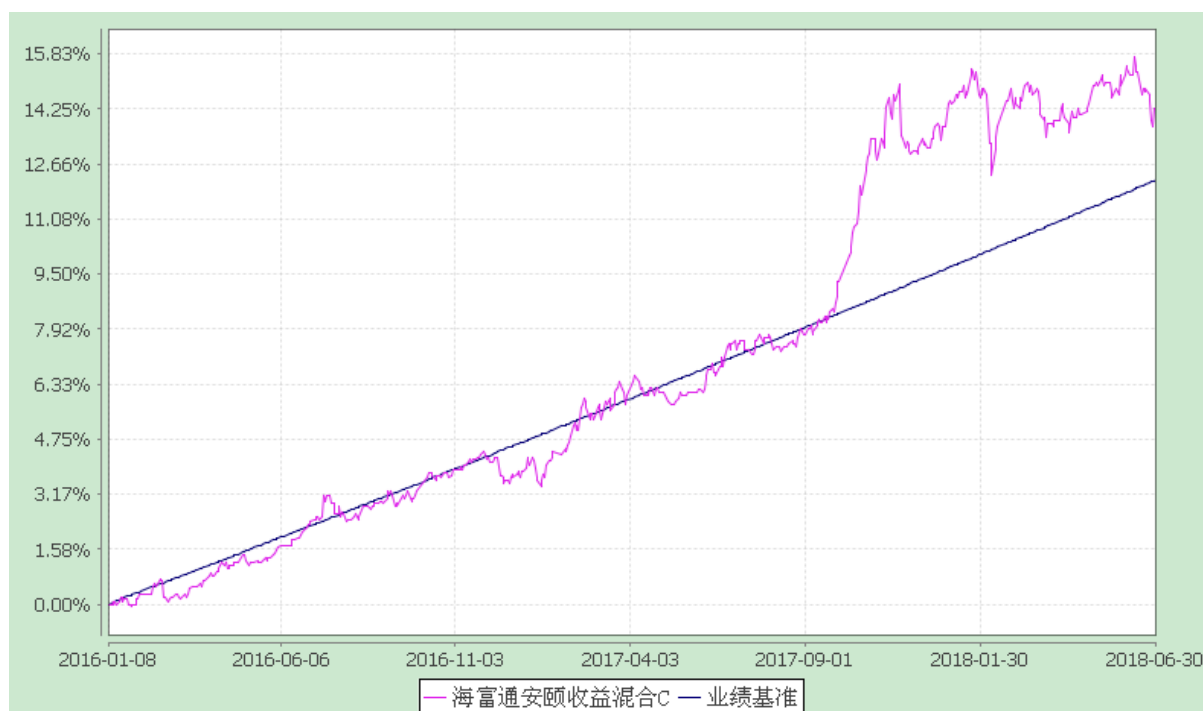
1. 海富通安颐收益混合 A

(2013 年 5 月 29 日至 2018 年 6 月 30 日)



2. 海富通安颐收益混合 C

(2016 年 1 月 8 日至 2018 年 6 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		
谈云飞	本基金的基金经理；海富通季季增利	2016-04-22	-	13 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月

	财债 券基 金经 理；海 富通 稳健 添利 债券 基金 经理； 海富 通新 内需 混合 基金 经理； 海富 通货 币基 金经 理；海 富通 欣益 混合 基金 经理； 海富 通聚 利债 券基 金经 理；海 富通 欣荣 混合 基金 经理； 海富 通强 化回 报混 合基 金经 理；海				任海富通现金管理货币基金 经理。2014 年 9 月起兼任海 富通季季增利理财债券基金 经理。2015 年 1 月起兼任海 富通稳健添利债券基金经理。 2015 年 4 月起兼任海富通新 内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经 理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富 通双福债券（原海富通双福分 级债券）、海富通双利债券基 金经理。2016 年 4 月起兼任 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 益混合、海富通聚利债券及海 富通欣荣混合基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通强化回 报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基 金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开 混合基金经理。2017 年 7 月 起兼任海富通季季通利理财 债券基金经理。
--	--	--	--	--	--

	富通欣享混合基金经理；海富通季季通利理财债券基金经理。				
杜晓海	本基金的基金经理；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；海富通富祥混合基金经理；海富通阿尔法对	2016-06-22	-	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 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通东财大数据混合、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、海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。

	冲混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通东财大数据混合基金经理；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				
--	---	--	--	--	--

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

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

回顾二季度，市场整体呈现震荡下行的走势，6 月市场跌幅明显。上证综指收于 2847.42 点，二季度下跌 10.14%，深证成指报 9379.47 点，下跌 13.70%。中小板指收于 6477.76 点，跌幅为 12.98%，创业板指跌 15.46%，收于 1606.71 点。

具体来看，4 月主要指数呈现震荡下跌的态势，在此期间，美国商务部对中兴通讯启动禁令，引发了市场的恐慌情绪。但市场仍表现出一定的结构性行情，医药、钢铁等

板块表现亮眼。上证综指全月下跌 2.73%，深证成指下跌 5.01%，中小板指和创业板指分别下跌 5.98%和 4.99%。5 月市场冲高回落。月初在资管新规落地、A 股正式启动纳入 MSCI 以及中美贸易磋商取得进展等多重利好下，A 股主要指数震荡上行。随后美国单方面再挑贸易战使得市场悲观情绪加剧，指数开启震荡下行态势。全月白酒、医药等板块存在结构性行情。最终上证综指微涨 0.43%，深证成指下跌 0.28%，中小板指上涨 1.41%，创业板指下挫 3.43%。6 月延续了 5 月的悲观情绪，市场加速下跌，沪指一度跌破 2800 点，创两年以来新低。各行业也全线下跌。上证综指和深证成指单月分别下跌 8.01%和 8.90%，中小板指和创业板指下跌 8.73%和 7.86%。

行业方面，二季度在中信证券 29 个一级行业分类中，仅食品饮料（9.03%）、餐饮旅游（3.15%）录得涨幅，其余行业均下跌，综合（-23.60%）、通信（-22.28%）、电力设备（-21.18%）跌幅居前。

本季度，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。

债市方面，从经济层面看，二季度经济数据呈现供给强于需求的特征。供给端，工业企业生产相对旺盛，4-5 月工业增加值同比增幅和 PMI 生产指数均高于去年同期，工业品库存加速去化，工业品价格普遍上涨，且高炉开工率已恢复到去年 10 月底的水平；需求端，房地产投资依靠前期的土地购置费保持一定的增速，但已出现边际转弱的迹象，基建投资受非标和融资渠道的收紧出现大幅下滑，同时消费端表现较弱。通胀方面，整体表现相对温和，CPI 受食品项低于季节性的影响表现较弱，而因工业品价格普涨和低基数效应，PPI 同比增速相较一季度有所上行。二季度货币政策稳健偏松，资金面整体保持平稳，而债券收益率呈现震荡下行的态势。4 月中旬央行宣布年内第二次定向降准的消息，市场情绪随之高涨，10 年期国债收益率快速下行至 3.5%，但随后出现回调；5 月中旬至 6 月，随着中美贸易摩擦不断反复，5 月经济数据又出现超预期的下滑，央行宽货币的意图进一步明确，不仅未跟随美联储加息，随之又宣布第三次定向降准以支持银行“债转股”项目和解决小微企业融资问题。在上述多重利好因素下，6 月下旬利率再次大幅下行。信用债方面，二季度民营企业债券违约事件频发，城投非标逾期等负面消息不断，市场笼罩在违约阴影下，风险偏好急剧下降，信用利差也随之大幅走扩。整个二季度，10 年期国债收益率下行 27BP，10 年期国开债收益率下行 39BP，3 年期 AAA 级企业债收益率下行 39BP，AA 级企业债收益率上行 10BP。可转债方面，二季度转债市场受股市下跌影响较大，整体巨幅波动，呈现出前期震荡、后期单边下行的走势。此外，信用风险的叠加使得低价券杀跌更为严重，二季度中证转债指数跌 5.82%。

在二季度，本基金债券部分降低了同业存单的配置比例，增加了中等期限信用债的配置，拉长了组合久期，起了一定杠杆，债券部分收益较为稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通安颐收益混合 A 净值增长率为 0.33%，同期业绩比较基准收益率

为 1.16%，基金净值跑输业绩比较基准 0.83 个百分点。海富通安颐收益混合 C 净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为 1.16%，基金净值跑输业绩比较基准 0.76 个百分点。本季度股票市场波动较大，主流指数大多下跌，导致基金微微跑输基准。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年三季度，中国经济将面临内外部两个方向的考验。内部考验主要来自于去杠杆政策延续对于实体部门信用收缩的压力，而外部考验主要来自于中美贸易争端的影响，以及美联储持续加息对于外汇部门和国内金融资产估值的压力。同时，国内政策如何调整和应对，尚需等待 7 月份中央政治局会议对下半年经济工作的具体定调和部署。

回到我们关注的 A 股市场，大概率会在企业盈利增速的正面支撑与宏观各方面负面冲击的估值调整之间来回拉锯。宏观经济各方面的不确定性带来了股市风险偏好的迅速回落，但从乐观的角度看，本轮供给侧改革政策既有加法也有减法，宏观经济并未过热，也没有形成新一轮的产能“过剩”，反映在行业中观层面表现为多数行业的竞争格局有所优化，同时“去杠杆”政策在长期将能够带来中国经济的长期稳健发展和信用风险溢价的逐步回落。

从市场结构方面来看，龙头企业在各自行业内竞争力强化、强者恒强的格局将延续，长期看这些龙头企业将构筑成中国经济的“核心资产”；同时，以创业板为代表的新兴成长行业经历了几年持续调整压力，部分细分行业的景气开始具备相对比较优势，如果中报业绩增速能够得到验证，并且下半年的业绩趋势仍可持续，那么有可能成为市场新的优势板块。

本基金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。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。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。

从债市看，展望三季度，预计经济数据有一些回落的压力，而通胀数据较为温和。6 月中下旬以来，工业品价格出现小幅回调，库存去化速度放缓，预计三季度工业生产会季节性走弱。房地产投资虽有前期土地购置费用的支撑，但受房地产企业融资渠道受限的影响，或边际转弱；而在二季度基建投资大幅下滑的背景下，三季度政府或增加财政支出，基建投资增速或保持相对平稳。随着中美贸易战的不断反复，出口仍存在边际下行压力。总体看经济承压但有一定的韧性，或继续呈现平稳下行的态势。通胀方面，受季节性和高基数效应的影响，PPI 相较二季度走弱，同时考虑到猪肉价格底部震荡，CPI 增长或保持温和态势。政策方面，紧信用环境下实体经济融资难度和成本提高，为对冲经济的下滑，三季度货币政策或延续稳健偏松和灵活操作，定向降准仍有空间。在上述判断下，我们认为三季度利率仍有进一步下行的机会和空间，可积极参与利率债交易，但要把握节奏，密切关注资管新规细则落地的影响和人民币汇率的走势。信用债方面，低资质企业非标转标和直接融资预计仍然比较困难，叠加三季度信用债到期和回售

压力较大，信用负面事件对市场的冲击或仍未结束，信用策略总体仍以防守为主，但亦要观察可能出现的政策托底带来的机会。可转债方面，估值已接近历史底部但股市风险未消，与二季度相同的是，情绪化引起的大幅波动将是交易机会和风险的集中体现，而不同于二季度的个券行情，三季度市场的 beta 机会可能会更多显现。

下一季度，本基金债券部分将维持当前高等级信用债组合，在严格控制信用风险的基础上，提高组合持有债券的收益率，在个券选择上关注流动性和信用风险。在风险可控的前提下，视行情以适度仓位参与利率债交易以增厚收益。

4.7 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	96,764,623.66	16.52
	其中：股票	96,764,623.66	16.52
2	固定收益投资	468,999,103.00	80.05
	其中：债券	468,999,103.00	80.05
	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	7,776,877.45	1.33
7	其他资产	12,308,781.55	2.10
8	合计	585,849,385.66	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	2,069,012.00	0.38
C	制造业	67,134,572.99	12.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,074,924.00	0.20
E	建筑业	45,211.00	0.01
F	批发和零售业	1,878,323.50	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,358,872.19	0.25
H	住宿和餐饮业	2,608.32	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	469,643.90	0.09
J	金融业	15,718,504.21	2.88
K	房地产业	4,253,270.00	0.78
L	租赁和商务服务业	1,459,977.80	0.27
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	1,299,703.75	0.24
S	综合	-	-
	合计	96,764,623.66	17.74

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	000651	格力电器	199,897	9,425,143.55	1.73
2	600519	贵州茅台	12,414	9,080,344.44	1.66
3	600887	伊利股份	300,700	8,389,530.00	1.54
4	601318	中国平安	89,663	5,252,458.54	0.96

5	601939	建设银行	632,800	4,144,840.00	0.76
6	600104	上汽集团	99,700	3,488,503.00	0.64
7	300296	利亚德	213,800	2,753,744.00	0.50
8	600048	保利地产	220,900	2,694,980.00	0.49
9	000858	五 粮 液	35,022	2,661,672.00	0.49
10	600690	青岛海尔	134,600	2,592,396.00	0.48

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	40,576,000.00	7.44
	其中：政策性金融债	40,576,000.00	7.44
4	企业债券	192,451,000.00	35.28
5	企业短期融资券	80,117,000.00	14.69
6	中期票据	50,027,000.00	9.17
7	可转债（可交换债）	524,103.00	0.10
8	同业存单	105,304,000.00	19.30
9	其他	-	-
10	合计	468,999,103.00	85.97

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	011800460	18 康美 SCP002	300,000	29,940,000.00	5.49
2	136503	16 兴杭债	300,000	29,346,000.00	5.38
3	112462	16 徐工 02	300,000	29,340,000.00	5.38
4	101751031	17 苏交通 MTN003	200,000	20,176,000.00	3.70
5	180201	18 国开 01	200,000	20,060,000.00	3.68

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
IF1807	IF1807	-17.00	-17,746,980.0 0	1,306,560.00	-
公允价值变动总额合计(元)					1,306,560.0 0
股指期货投资本期收益(元)					-91,820.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,306,560.0 0

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

根据本基金合同, 本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的利亚德（300296）未获证监会2015年7月2日的许可，在新股配套募集资金到位前，先行以自有资金向交易对方支付部分现金对价，合计9,128.43万元。配套募集资金到位后，公司于2015年12月24日未经董事会审议将9,128.43万元募集资金由募集资金专户汇至公司其它账户，以募集资金置换了先期投入的自有资金，直至2017年4月20日才补充履行了董事会审议程序及相关信息披露义务。公司及相应高管人员上述行为违反了《创业板股票上市规则（2014年修订）》和《创业板上市公司规范运作指引（2015年修订）》等相关规定，均于2018年5月4日受到深圳交易所通报批评的处分。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是小间距LED行业巨擘。从“四轮战略”到“文化科技+金融”，战略升级路径清晰。收入利润稳增长，研发投入与现金流改善助推可持续。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。

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	2,732,640.15
2	应收证券清算款	2,091,424.79
3	应收股利	-
4	应收利息	7,477,022.30
5	应收申购款	7,694.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,308,781.55

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	113012	骆驼转债	5,736.60	0.00
2	113014	林洋转债	79,411.20	0.01
3	128021	兄弟转债	69,705.00	0.01
4	128032	双环转债	50,173.80	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通安颐收益混合 A	海富通安颐收益混合 C
本报告期期初基金份额总额	395,066,287.45	26,532,677.31
本报告期基金总申购份额	438,337.63	120,707,656.12
减：本报告期基金总赎回份额	422,356.69	99,753,405.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	395,082,268.39	47,486,928.14

§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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情
-----	----------------	-----------

类别						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	2018/4/1-2018/6/30	185,568,684.66	-	-	185,568,684.66	41.93%
	2	2018/4/1-2018/6/30	118,778,196.31	-	-	118,778,196.31	26.84%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险； 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。 4、其他可能的风险。 另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 61 只公募基金。截至 2018 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 574.03 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 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 32 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 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 401 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 6 月 30 日，海富通管理的

特定客户资产管理业务规模超过 443 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安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）的文件

（二）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）基金合同

（三）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）招募说明书

（四）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益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）报告期内海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益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
二〇一八年七月十八日