

---

海富通双福债券型证券投资基金  
(原海富通双福分级债券型证券投资基金)  
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。

本报告期内，原海富通双福分级债券型证券投资基金转换为海富通双福债券型证券投资基金。原海富通双福分级债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 4 日止，海富通双福债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 6 月 5 日至 2018 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 海富通双福债券型证券投资基金

|            |                |
|------------|----------------|
| 基金简称       | 海富通双福债券        |
| 基金主代码      | 519059         |
| 交易代码       | 519059         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式         |
| 基金合同生效日    | 2014 年 5 月 6 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,858,067.22 份 |

|        |                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，积极把握信用类债券的投资机会，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。                                                                   |
| 投资策略   | 本基金为债券型基金，对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。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、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。                                                             |
| 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                                                                                                               |

## 2.2 海富通双福分级债券型证券投资基金

|            |                                                                                                                                                            |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 海富通双福分级债券                                                                                                                                                  |
| 基金主代码      | 519059                                                                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型，本基金以“运作周期滚动”的方式运作。双福 A 自每个运作周期起始日起每满 6 个月设一个开放期，双福 B 在任一运作周期内封闭运作，不上市交易。运作周期届满，在满足本基金合同约定的条件下，本基金将转换为“海富通双福债券型证券投资基金”；不满足条件时，本基金将进入过渡期，过渡期结束将进入下一运作周期。 |
| 基金合同生效日    | 2014 年 5 月 6 日                                                                                                                                             |
| 报告期末基金份额总额 | 108,155,078.72 份                                                                                                                                           |
| 投资目标       | 本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，积极把握信用类债券的投资机会，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。                                                                                                     |
| 投资策略       | 本基金为债券型基金，对债券类资产的投资比例不低于基                                                                                                                                  |

|                 |                                                                                                 |                          |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|
|                 | 金资产的 80%。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、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。 |                          |
| 业绩比较基准          | 中证全债指数                                                                                          |                          |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。                                    |                          |
| 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     | 海富通双福分级债券 A                                                                                     | 海富通双福分级债券 B              |
| 下属两级基金的交易代码     | 519057                                                                                          | 519058                   |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 11,092,791.47 份                                                                                 | 97,062,287.25 份          |
| 下属两级基金的风险收益特征   | 双福 A 将表现出低风险、收益相对稳定的特征。                                                                         | 双福 B 则表现出较高风险、收益相对较高的特征。 |

### § 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         | 海富通双福债券型证券投资基金<br>(2018年6月5日-2018年6月30日) | 海富通双福分级债券型证券投资基金<br>(2018年4月1日-2018年6月4日) |
|----------------|------------------------------------------|-------------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | -10,306.78                               | 368,119.67                                |
| 2.本期利润         | -10,306.78                               | 357,799.87                                |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0008                                  | 0.0033                                    |

|            |              |               |
|------------|--------------|---------------|
| 4.期末基金资产净值 | 6,466,089.26 | 89,237,055.11 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.823        | 0.825         |

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)原海富通双福分级债券型证券投资基金之双福 A、双福 B 以 2018 年 6 月 4 日各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为海富通双福债券型证券投资基金，双福 A 转换比例为 1: 1.23496225，双福 B 转换比例为 1: 0.97314726。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 海富通双福债券型证券投资基金

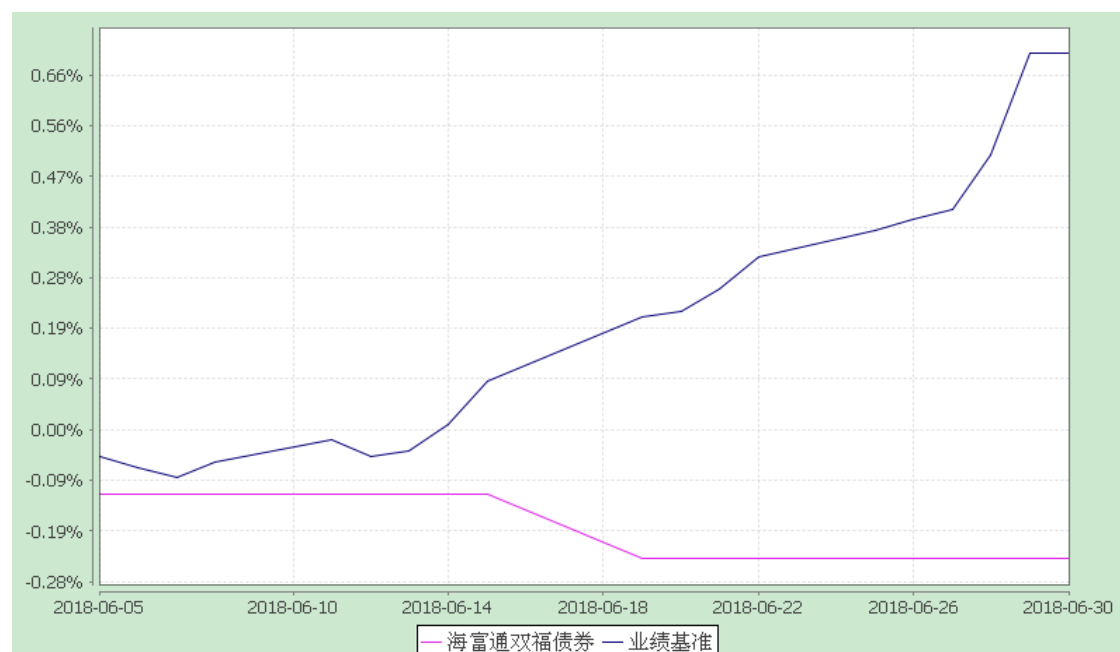
（报告期：2018年6月5日-2018年6月30日）

#### 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

| 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    |
|---------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2018-6-5--2018-6-30 | -0.24% | 0.04%     | 0.70%      | 0.06%         | -0.94% | -0.02% |

#### 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

海富通双福债券型证券投资基金  
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  
(2018 年 6 月 5 日-2018 年 6 月 30 日)



注：1、本基金转型日期为2018年6月4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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

### 3.2.2 海富通双福分级债券型证券投资基金

（报告期：2018年4月1日-2018年6月4日）

#### 3.2.2.1 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

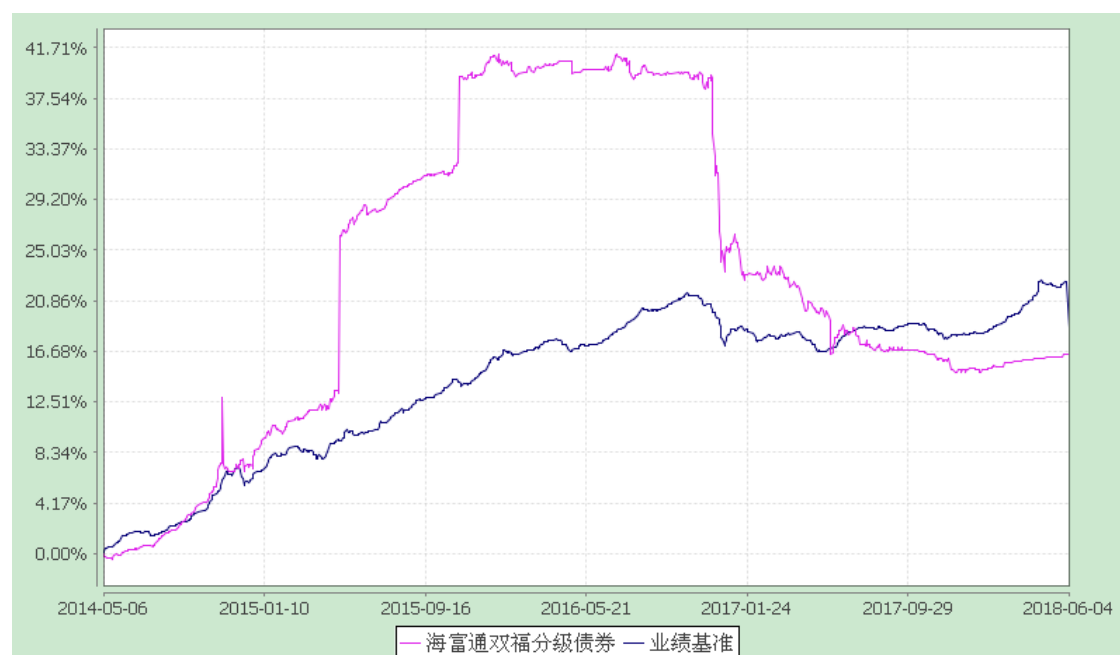
| 阶段                  | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|---------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2018-4-1---2018-6-4 | 0.36%  | 0.03%     | 1.46%      | 0.12%         | -1.10% | -0.09% |

#### 3.2.2.2 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

海富通双福分级债券型证券投资基金

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

(2014年5月6日-2018年6月4日)



注：本基金合同于 2014 年 5 月 6 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十四部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

#### 3.3.1 海富通双福债券型证券投资基金

单位：人民币元

| 其他指标         | 报告期末(2018 年 6 月 30 日) |
|--------------|-----------------------|
| 期末双福份额累计参考净值 | 0.823                 |
| 期末双福份额参考净值   | 0.823                 |

注：海富通双福债券型证券投资基金报告期期间:2018年6月5日至2018年6月30日。

#### 3.3.2 海富通双福分级债券型证券投资基金

单位：人民币元

| 其他指标            | 报告期末(2018 年 6 月 4 日) |
|-----------------|----------------------|
| 期末双福 B 份额累计参考净值 | 1.234                |
| 期末双福 B 份额参考净值   | 0.803                |
| 期末双福 A 份额累计参考净值 | 1.166                |
| 双福 A 与双福 B 基金份额 | 0.11428529 :1        |

|               |       |
|---------------|-------|
| 配比            |       |
| 期末双福 A 份额参考净值 | 1.019 |
| 双福 A 的预计年收益率  | 3.80% |

注：海富通双福分级债券型证券投资基金报告期期间:2018年4月1日至2018年6月4日。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                                                            |
| 何谦 | 本基金的基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通集利债券基金经理；海富通添益货币基金经理。 | 2016-05-06  | -    | 7 年    | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任平安银行资金交易员，华安基金管理有限公司债券交易员，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，任海富通货币基金经理助理。2016 年 5 月至 2017 年 10 月兼任海富通双利债券基金经理。2016 年 5 月起任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）及海富通货币基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通集利债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通添益货币基金经理。 |

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，为应对本基金的开放申赎和转型，我们主动变现了所有资产以应对赎回。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，原海富通双福分级债券型证券投资基金（2018.4.1-2018.6.4）基金份额净值增长率为0.36%，同期业绩比较基准收益率为1.46%；海富通双福债券型证券投资基金（2018.6.5-2018.6.30）基金份额净值增长率为-0.24%，同期业绩比较基准收益率为0.70%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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相较于二季度走弱，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。

三季度, 本基金转型为普通的开放式债基，主要投资范围为：可转债，利率债等固定收益品种。本基金将根据规模变动情况来优化组合结构。

#### 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 海富通双福债券型证券投资基金

（报告期：2018年6月5日-2018年6月30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              | -            | -            |
|    | 其中：股票             | -            | -            |
| 2  | 固定收益投资            | -            | -            |
|    | 其中：债券             | -            | -            |
|    | 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      | 6,700,689.74 | 99.92        |

---

|   |        |              |        |
|---|--------|--------------|--------|
| 7 | 其他各项资产 | 5,243.99     | 0.08   |
| 8 | 合计     | 6,705,933.73 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

#### 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

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

##### 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.1.10.3 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。

#### 5.1.11 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 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 2,538.05 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | 2,705.94 |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |
| 9  | 合计      | 5,243.99 |

##### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.2 海富通双福分级债券型证券投资基金

(报告期：2018年4月1日-2018年6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              | -             | -            |
|    | 其中：股票             | -             | -            |
| 2  | 固定收益投资            | -             | -            |
|    | 其中：债券             | -             | -            |
|    | 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      | 8,237,691.86  | 9.22         |
| 7  | 其他各项资产            | 81,147,950.55 | 90.78        |
| 8  | 合计                | 89,385,642.41 | 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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.2.2.2 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。

### 5.2.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

---

本基金本报告期末未持有债券。

#### **5.2.5 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**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **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。

#### **5.2.7 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。

#### **5.2.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

#### **5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **5.2.9.1 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。

##### **5.2.9.2 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。

#### **5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **5.2.10.1 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。

##### **5.2.10.2 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。

##### **5.2.10.3 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。

#### **5.2.11 投资组合报告附注**

##### **5.2.11.1 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。

5.2.11.2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。

#### 5.2.11.3其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,538.05      |
| 2  | 应收证券清算款 | 81,138,342.78 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 7,069.72      |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 81,147,950.55 |

#### 5.2.11.4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。

#### 5.2.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 开放式基金份额变动

### 6.1 海富通双福债券型证券投资基金

单位:份

|                       |              |
|-----------------------|--------------|
| 本报告期期初基金份额总额          | 7,858,067.22 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | -            |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 | -            |

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 份额                     |              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | -            |
| 本报告期期末基金份额总额           | 7,858,067.22 |

注：海富通双福债券型证券投资基金报告期期间：2018年6月5日至2018年6月30日。

## 6.2 海富通双福分级债券型证券投资基金

单位：份

| 项目                                 | 海富通双福分级债券A    | 海富通双福分级债券B    |
|------------------------------------|---------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额                       | 11,092,791.47 | 97,062,287.25 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | -             | -             |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | -             | -             |
| 基金合同生效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                       | 11,092,791.47 | 97,062,287.25 |

注：(1)海富通双福分级债券型证券投资基金报告期期间：2018年4月1日至2018年6月4日。

(2)海富通双福债券型证券投资基金报告期期间：2018年6月5日至2018年6月30日。

(3)2018年6月5日确认2018年6月4日投资者申请赎回双福A 5,068,267.56份额，双福B 96,632,745.25份额；海富通双福债券型证券投资基金报告期期初基金份额总额=（双福A报告期末份额-2018年6月5日双福A确认赎回份额）\*转换比例+（双福B报告期末份额-2018年6月5日双福B确认赎回份额）\*转换比例。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 海富通双福债券型证券投资基金

#### 7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

#### 7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有投资本基金。

### 7.2 海富通双福分级债券型证券投资基金

#### 7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

## 7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1海富通双福债券型证券投资基金

#### 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海富通双福分级债券型证券投资基金

#### 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  |
|                                                                                                                           | 1              | 2018/4/1-2018/6/4      | 51,575,054.08 | -    | 51,575,054.08 | 0.00       | 0.00% |
| 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。 |                |                        |               |      |               |            |       |

### 8.3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双福分级债券型证券投资基金的文件
- （二）海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同
- （三）海富通双福分级债券型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通双福分级债券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）报告期内海富通双福分级债券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。

二〇一八年七月十八日