

海富通瑞利纯债债券型证券投资基金
2017 年半年度报告摘要
2017 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金简称 | 海富通瑞利债券 |
| 基金主代码 | 519226 |
| 交易代码 | 519226 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 2 月 16 日 |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,208,825,307.80 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，追求基金资产长期稳定增值，力争实现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 | 中证全债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 奚万荣 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 021-38650891 | 95559 |
| | 电子邮箱 | wrxj@hftfund.com | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 40088-40099 | 95559 |
| 传真 | | 021-33830166 | 021-62701216 |

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 | http://www.hftfund.com |
| 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（2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日） |
|---------------|--|
| 本期已实现收益 | 38,956,436.06 |
| 本期利润 | 42,373,099.87 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0147 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.36% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0025 |
| 期末基金资产净值 | 3,220,309,656.29 |
| 期末基金份额净值 | 1.0036 |

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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金合同生效日为 2017 年 2 月 16 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

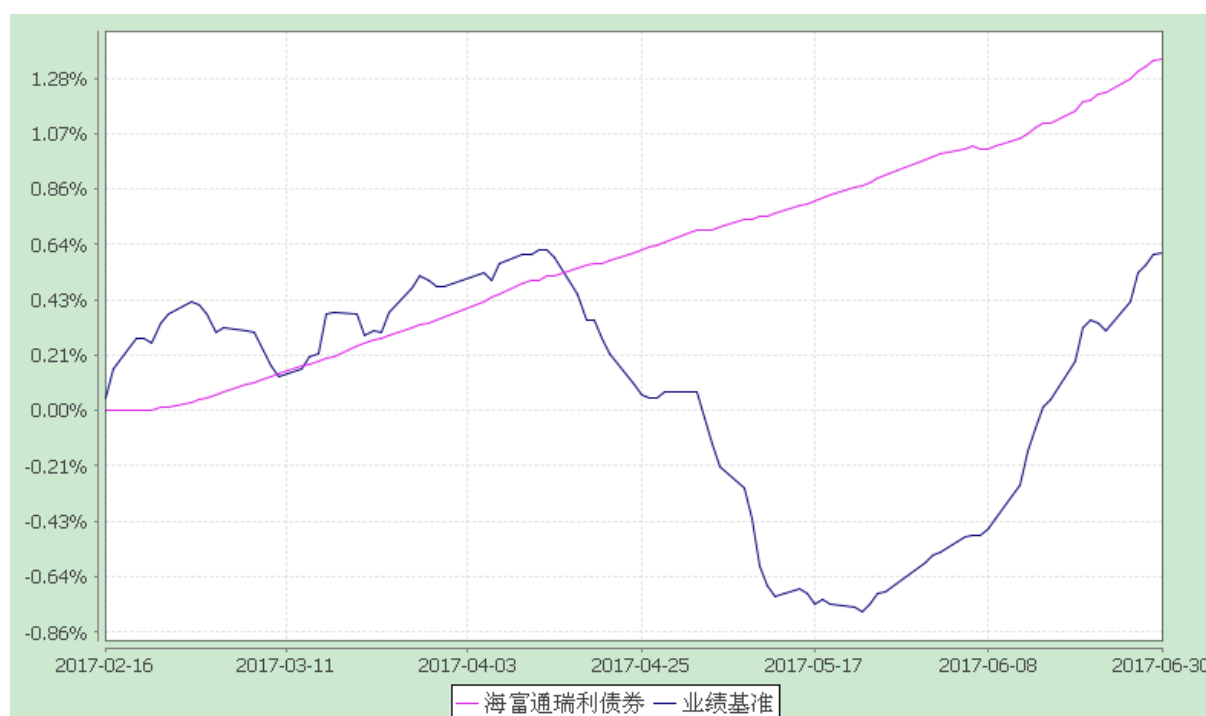
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|--------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|--------------|-----|-----|

| | | | | ④ | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.39% | 0.01% | 1.20% | 0.05% | -0.81% | -0.04% |
| 过去三个月 | 1.00% | 0.02% | 0.13% | 0.07% | 0.87% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.36% | 0.01% | 0.61% | 0.07% | 0.75% | -0.06% |

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

海富通瑞利纯债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
(2017 年 2 月 16 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2017 年 2 月 16 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、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。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 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、海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）、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、海富通养老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、海富通双利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、海富通双福分级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、上证可质押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、海富通东财大数据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、海富通瑞益债券型证券投资基金、海富通瑞丰一年定期开放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、海富通欣盛定期开放混合型证券投资基金、海富通富源债券型证券投资基金、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。

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 | 任本基金的基金经理 （助理）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 | 2017-02-16 | - | 8 年 | 博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|-----|--|
| | 富通瑞丰一年定开债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳进增利债券基金（LOF）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；海富通瑞益债券基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通美元债（QDII）基金经理；海富通上证周期产业债 ETF 基金经理；海富通富源债券基金经理；海富通瑞合纯债基金经理；海富通富睿混合基金经理；固定收益投资部副总监。 | | | | 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，现任固定收益投资部副总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月起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和海富通稳进增利债券（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 月起兼任海富通瑞益债券和海富通瑞丰一年定开债券基金经理。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 月起兼任海富通富源债券和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。 |
| 刘田 | 本基金的基金经理助 | 2017-02-22 | - | 1 年 | 管理学学士，持有基金从业人员资格证书。曾任上海银 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | 理；海富通瑞益债券基金经理助理；海富通瑞丰一年定开债券基金经理助理；海富通聚利债券基金经理助理；海富通集利债券基金经理助理；海富通瑞合纯债基金经理助理。 | | | | 行同业客户经理，2016 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通瑞益债券、海富通瑞丰一年定开债券、海富通聚利债券、海富通集利债券、海富通瑞利债券、海富通瑞合纯债的基金经理助理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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上市股票、债券的一级市场申购、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、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，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，

假设溢价率为 0 的 T 分布检验，检验结果表明，在 T 日、T+3 日和 T+5 日不同循环期内，不管是买入或是卖出，公司各组合间买卖价差并不显著，表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待，不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

上半年债券市场延续跌势，利率呈现“快速上行—修复—再次上行—再修复”的波浪式上升。10 年期国债收益率从年初的 3.0% 抬升至半年末的 3.57%，而“紧货币”和“严监管”分别成为一、二季度利率快速上行的主要推手。具体来看，一季度经济复苏的态势不减，PPI 向上带动企业持续补库存，同时三四线地产销售火爆，地产和基建投资均维持高位。经济的企稳回升给予了政策一定的空间，为了稳汇率、去杠杆一季度货币政策出现明显的收紧。央行于 1 月下旬上调 MLF 利率为近几年来首次提高政策利率，随后又多次上调公开市场逆回购及其他货币工具利率，市场流动性趋紧，资金利率中枢逐月抬升。一季度监管也有趋严之势，但并未全面铺开，传闻中的同业存单、同业理财新规也是迟迟未落地，存单发行量居高不下，市场从担忧转为麻木。基于此，一季度利率先上后下，上行主要源于货币收紧，而下行则是对悲观预期的修复。进入二季度，各项经济数据依然平稳，尤其是公布的一季度 GDP 增速达 6.9% 远高于市场预期。在这种情况下监管出现全面升级，银监会连续出台包括 6 号文、46 号文、53 号文在内的多个文件，以限制同业、理财业务的套利和资金空转行为，证监会也出台政策加强对券商资管资金池产品的监管。由此金融去杠杆转为行政去杠杆阶段，市场悲观情绪再起，抛压严重。四月 10 年期国债收益率一路上行超过 40BP，五月上旬达到高点的 3.69%，随后维持高位震荡直到六月。为了应对半年末流动性和下半年可能出现的经济下滑，六月央行货币政策操作从“偏紧”转为“中性”，监管态度亦有所缓和，利率再度迎来一波修复。纵观整个上半年表现，1 年期国债收益率上行 81BP，10 年期国债收益率上行 56BP，3 年期 AA+ 中短期票据收益率上行约 49BP，期限利差极度压缩，信用利差走扩。可转债方面，一至五月转债持续阴跌，主要是受股债拖累以及再融资新政后转债供给加大影响，转债市场总体的价格和估值都逼近历史低位，债性支撑明显。六月转债在股债反弹的情况下出现逆袭，量价齐升，中证转债指数月涨 5.03%，使得上半年转债指数收涨。

本基金在上半年持仓主要以银行存款和信用债券为主，控制信用风险，优化配置，等待债券机会出现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通瑞利债券基金净值增长率为 1.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从基本面看，经济名义增速高点已过，下半年存在一些回落压力。从去年七月开启的补库存周期至今已持续 12 个月，近几月原材料购进和出厂价格回落较快，五月份 PMI 产成品库存出现明显下滑，或意味着目前已进入被动去库阶段，此轮库存周期可能已接近尾声。但是，我们也看到工业企业利润仍处于同比增长的通道中；得益于低库存使得房地产开发商补库存意愿较强，棚户区改造货币化支撑三四线城市房地产销量，地产投资增速的下滑可能较为缓慢，而基建投资依然能起到托底作用，因此三四季度经济增速的环比下滑或比较平缓。通胀方面，CPI 下半年翘尾因素低，高点大概率已过；PPI 已从高位回落，在下半年高基数效应下同比可能降至 0%，再通胀预期不强。在这种环境下我们认为去年四季度开启的“防风险、挤泡沫、去杠杆”的政策目标仍会继续。货币政策可能从上半年偏紧的状态转为“不松不紧”，防止经济、汇率出现大幅波动，同时引导金融市场去杠杆的预期。而监管仍会稳步推进，虽然经过半年的结构调整金融企业债务增速有所回落，银行同业杠杆率下降，去杠杆取得了一定成效，但还远没有结束。下半年监管依然是金融市场的主要矛盾之一。此外，美联储的缩表进程也是全球关注的焦点，会对国内的政策和市场产生较大影响，存在一定不确定性。总体看，下半年的债市环境可能比上半年有所改善，但杠杆的收缩、负债端的不稳定使得利率依然是易上难下，利率债总体机会有限，可适当参与波段交易；信用债的信用利差有继续走扩压力，但绝对收益仍有配置价值；可转债规模增加可选标的增多，市场吸引力在增强，可精选个券积极布局。

本基金在下半年将继续严控风险。等待调整到位后经济增长预期回落可能出现的债券市场机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有 3 年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。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。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总裁办公会批准后实施。

基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

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,基金收益每年至少分配一次,基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成。

本基金报告期内进行过一次利润分配,以截止 2017 年 6 月 8 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2017 年 6 月 22 日完成权益登记,单位分红金额为 0.01 元,合计利润分配金额 32,088,254.57 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

2017 年上半年度,基金托管人在海富通瑞利纯债债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年上半年度,海富通基金管理有限公司在海富通瑞利纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配,分配金额为 32,088,254.57 元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2017 年上半年度,由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通瑞利纯债债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：海富通瑞利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------|------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 807,576,982.94 |
| 结算备付金 | | - |
| 存出保证金 | | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,383,025,000.00 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 2,275,235,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | 107,790,000.00 |
| 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 | | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 30,939,315.31 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 3,221,541,298.25 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 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 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 797,957.65 |
| 应付托管费 | | 265,985.89 |

| | | |
|---------------|----------|------------------|
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 15,346.87 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 152,351.55 |
| 负债合计 | | 1,231,641.96 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 3,208,825,307.80 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 11,484,348.49 |
| 所有者权益合计 | | 3,220,309,656.29 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,221,541,298.25 |

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0036 元，基金份额总额 3,208,825,307.80 份。

2、基金合同成立于 2017 年 2 月 16 日，上年度可比区间无比较数据。

3、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：海富通瑞利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|
| 一、收入 | | 46,924,750.09 |
| 1.利息收入 | | 43,458,434.42 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 25,873,051.26 |
| 债券利息收入 | | 14,327,632.26 |
| 资产支持证券利息收入 | | 1,271,113.51 |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,986,637.39 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 49,644.81 |

| | | |
|----------------------------|----------|----------------------|
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 116,101.24 |
| 资产支持证券投资收益 | | -66,456.43 |
| 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 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 3,416,663.81 |
| 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 | 7.05 |
| 减：二、费用 | | 4,551,650.22 |
| 1. 管理人报酬 | | 3,232,655.35 |
| 2. 托管费 | | 1,077,551.83 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 12,400.00 |
| 5. 利息支出 | | 72,016.96 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 72,016.96 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 157,026.08 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 42,373,099.87 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 42,373,099.87 |

注：基金合同成立于 2017 年 2 月 16 日，上年度可比区间无比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通瑞利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 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 | 210,047,392.35 | - | 210,047,392.35 |

| | | | |
|--|------------------|----------------|------------------|
| (基金净值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 42,373,099.87 | 42,373,099.87 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 2,998,777,915.45 | 1,199,503.19 | 2,999,977,418.64 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,998,801,441.29 | 1,199,526.14 | 3,000,000,967.43 |
| 2.基金赎回款 | -23,525.84 | -22.95 | -23,548.79 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -32,088,254.57 | -32,088,254.57 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 3,208,825,307.80 | 11,484,348.49 | 3,220,309,656.29 |

注：基金合同成立于 2017 年 2 月 16 日，上年度可比区间无比较数据。

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：张文伟，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

海富通瑞利纯债债券型证券投资基金(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[2016] 1601 号《关于准予海富通瑞利纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册，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《海富通瑞利纯债债券型证券投资基金基金合同》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 210,028,432.34 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(2017) 第 080 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通瑞利纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 210,047,392.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,960.01 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通瑞利纯债债券型证券投资基金

基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。在正常市场情况下，基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率。

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 2017 年 8 月 24 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》、《海富通瑞利纯债债券型证券投资基金基金合同》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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间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 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、

应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允

价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015

年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

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 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 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

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行股票交易，上年度可比区间无比较数据。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行权证交易，上年度可比区间无比较数据。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期间无应支付关联方的佣金，上年度可比区间无比较数据。

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 2017年2月16日（基金合同生效日）至2017年6月 30日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,232,655.35 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1.71 |

注：1、支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.3%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 0.3% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 2 月 16 日，上年度可比区间无比较数据。

6.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年2月16日（基金合同生效日）至2017年6月 30日 | |
|----------------|--|--------------|
| | | |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | | 1,077,551.83 |

注：1、支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 0.1% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 2 月 16 日，上年度可比区间无比较数据。

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

本基金本报告期末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固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | |
|-------|---------------------|------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 交通银行 | 3,208,817,380.21 | 100.00% |

注：基金合同成立于 2017 年 2 月 16 日，上年度可比区间无比较数据。

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 2017年2月16日（基金合同生效日）至2017年6月30日 | |
|-------|--------------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| | | |
| 交通银行 | 207,576,982.94 | 210,768.95 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

3、基金合同成立于 2017 年 2 月 16 日，上年度可比区间无比较数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2017 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

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

(1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；

(2) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。
上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 2,383,025,000.00 | 73.97 |
| | 其中：债券 | 2,275,235,000.00 | 70.63 |
| | 资产支持证券 | 107,790,000.00 | 3.35 |
| 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 | 807,576,982.94 | 25.07 |
| 7 | 其他各项资产 | 30,939,315.31 | 0.96 |
| 8 | 合计 | 3,221,541,298.25 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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**

本基金本报告期内未进行股票投资。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 209,842,000.00 | 6.52 |
| | 其中：政策性金融债 | 209,842,000.00 | 6.52 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,571,867,000.00 | 48.81 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 493,526,000.00 | 15.33 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,275,235,000.00 | 70.65 |

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 | 011698824 | 16 联通 SCP005 | 3,200,000 | 320,672,000.00 | 9.96 |
| 2 | 011760076 | 17 国药控股 SCP001 | 2,000,000 | 200,280,000.00 | 6.22 |
| 3 | 011751035 | 17 中电投 SCP008 | 2,000,000 | 200,160,000.00 | 6.22 |
| 4 | 111716055 | 17 上海银行 CD055 | 2,000,000 | 193,540,000.00 | 6.01 |
| 5 | 111714093 | 17 江苏银 | 2,000,000 | 193,500,000.00 | 6.01 |

| | | | | | |
|--|--|---------|--|--|--|
| | | 行 CD093 | | | |
|--|--|---------|--|--|--|

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 1789133 | 17 开元 1A | 3,000,000 | 107,790,000.00 | 3.35 |

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合约。

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合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 30,939,315.31 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 30,939,315.31 |

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债券。

7.12.5 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。

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 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 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 221 | 14,519,571.53 | 3,208,817,380.21 | 100.00% | 7,927.59 | 0.00% |

8.2 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 | 158.47 | 0.0000% |
|------------------|--------|---------|

8.3 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 研究部门负责人持有本开放式基 金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基 金 | 0 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2017 年 2 月 16 日）基金份 额总额 | 210,047,392.35 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额 | 2,998,801,441.29 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额 | 23,525.84 |
| 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 | 3,208,825,307.80 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额(如有)，总赎回份额含转换出份额(如有)。

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

2017 年 2 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第五届董事会第十次临时会议审议通过，同意刘颂先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长张文伟先生代为履行总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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 | |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

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,并报公司总裁办公会议核准。

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 |
| 海通证券 | - | - | 815,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 2017/3/1-2017/6/30 | 210,017,900.00 | 2,998,799,480.00 | - | 3,208,817,380.00 | 100.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <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> | | | | | | | |

注：本基金合同生效日为2017年2月16日，期初份额指基金合同生效日持有份额。

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 50 只公募基金。截至 2017 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 468 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 2017 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 224 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 2017 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 376 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 2017 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 294 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”。

海富通基金管理有限公司
二〇一七年八月二十五日