

**海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金**  
**2017 年年度报告摘要**  
**2017 年 12 月 31 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：二〇一八年三月二十七日

## §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 2018 年 3 月 23 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	海富通沪港深混合
基金主代码	519139
交易代码	519139
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 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	156,760,379.57 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金以投资目标为中心，将定性和定量的分析方法运用于资产配置，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，包括大类资产的历史回报、历史波动率等制定本基金在股票、债券、现金、衍生品等资产之间的初步配置；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，再根据基本面、资金面、估值等具体因素，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40% +恒生指数收益率×40% +中债综合财富指数收益率×20%
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。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 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	wrxh@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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2017 年	2016 年 11 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	36,300,945.92	101,725.18
本期利润	41,339,239.30	-129,965.70
加权平均基金份额本期利润	0.2413	-0.0006
本期基金份额净值增长率	25.11%	-0.06%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2503	-0.0006
期末基金资产净值	195,991,662.92	229,892,961.37
期末基金份额净值	1.2503	0.9994

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 2016 年 11 月 11 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 ④	①—③	②—④
过去三个月	7.21%	1.04%	5.36%	0.59%	1.85%	0.45%
过去六个月	15.65%	1.04%	10.41%	0.52%	5.24%	0.52%
过去一年	25.11%	0.80%	22.60%	0.47%	2.51%	0.33%
自基金合 同生效起 至今	25.03%	0.75%	19.83%	0.47%	5.20%	0.28%

#### 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

海富通沪港深灵活配置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  
(2016 年 11 月 11 日至 2017 年 12 月 31 日)



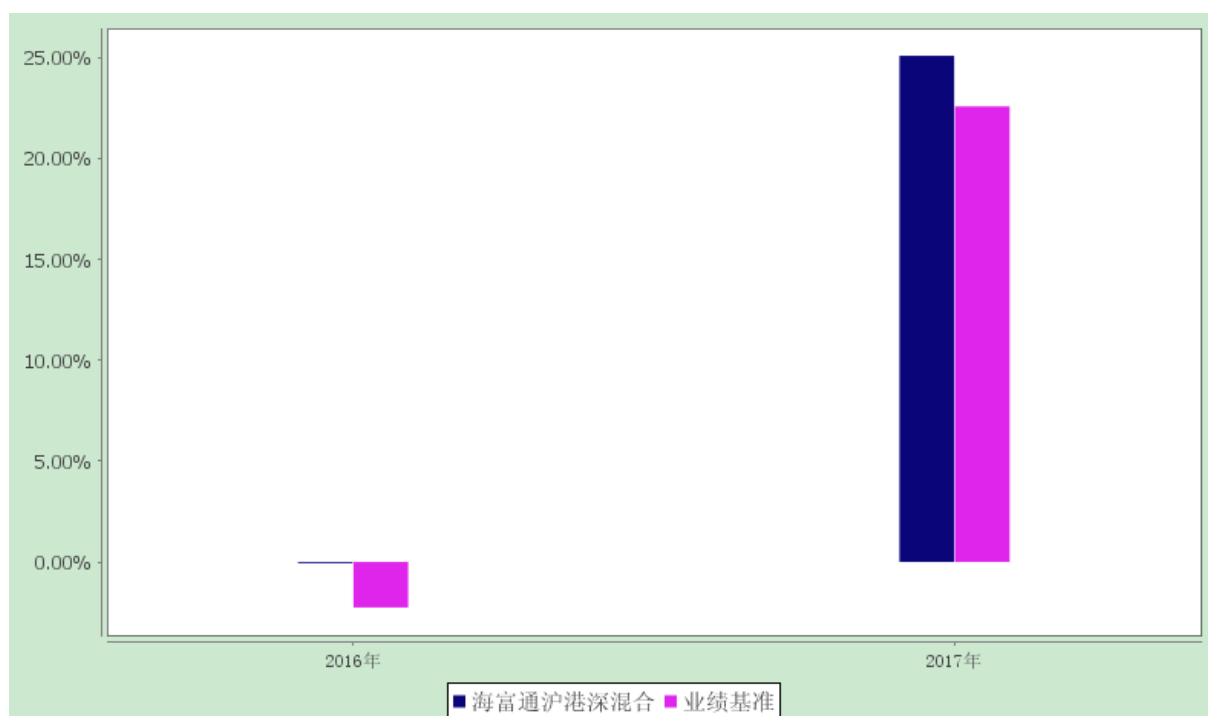
注：本基金合同于 2016 年 11 月 11 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：图中列示的 2016 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 11 月 11 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于 2016 年 11 月 11 日生效，未实施利润分配。

## §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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 52 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、海富通欣悦灵活配置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、海富通瑞福一年定期开放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）。

#### 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	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

		理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
张炳炜	本基金的基金经理；海富通中国海外混合（QDII）基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通大中华混合（QDII）基金经理；海富通欣悦混合基金经理。	2016-11-11	-	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任交银施罗德基金管理有限公司数量分析师，2011 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，任股票分析师。2015 年 6 月起任海富通强化回报混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通大中华混合（QDII）和海富通中国海外混合（QDII）基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通沪港深混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通欣悦混合基金经理。
王智慧	本基金的基金经理；海富通精选贰号混合基金经理；海富通精选混合基金经理；总经理助理。	2016-11-30	-	15 年	管理学博士。持有基金从业人员资格证书。曾在华宝兴业基金管理有限公司、中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团股份有限公司、国元证券有限责任公司从事投资研究及管理工作。2012 年 1 月至 2015 年 11 月任华宝大盘精选混合基金经理，2012 年 2 月



					至 2015 年 11 月任华宝医药生物混合型基金经理，2013 年 2 月至 2015 年 11 月任华宝兴业多策略股票基金经理。2015 年 11 月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2016 年 4 月起兼任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通沪港深混合基金经理。
高 崢	本基金的基金经理	2017-08-28	-	10 年	经济学硕士。持有基金从业人员资格证书。历任德勤华永会计师事务所审计部职员，光大证券股份有限公司行业研究员，中金公司研究部执行总经理、化工行业研究团队负责人。2017 年 3 月加入海富通基金管理有限公司，2017 年 4 月至 2017 年 8 月任海富通沪港深混合的基金经理助理。2017 年 8 月起任海富通沪港深混合的基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

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。同时，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。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、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）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

### 4.3.3 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，未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

## 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

回顾 2017 年，A 股市场整体“稳中有进”，但分化较为显著，各大指数的表现也很好的反映了这一点。2017 年以上证 50 为代表的大盘蓝筹股高歌猛进，全年累计上涨 25.08%，而创业板指则一路震荡，最终仍下跌 10.67%。同期上证综指上涨 6.56%，深证成指和中小板指分别上涨 8.48% 和 16.73%。

金融监管是 2017 年 A 股市场最重要的政策变量，在防风险、去杠杆、“脱虚向实”等的导向之下，再融资新规、减持新规等相继发布，高杠杆收购、操纵股价等违规行为也受到了严厉的处罚，IPO 提速的同时也加强了审核的力度。2017 年的 A 股市场也在不断探索前进，6 月 A 股被正式纳入 MSCI，进一步与国际市场接轨。

回顾全年的走势，年初以来，沪深股指维持小幅震荡上行的行情。一季度除了创业板指表现为下跌外，其余三大指数均以阳线报收，但行业板块方面分化较为严重。二季度初始雄安新区概念引发了市场的高度关注，带动指数持续上涨，整体呈现先抑后扬的走势。白马龙头股继续上攻，创业板和次新股出现大幅调整，市场呈现明显的“一九行情”。三季度市场整体恢复震荡上行趋势，热点层出不穷，市场情绪较二季度有所回暖，大盘蓝筹依然备受青睐，周期股也强势爆发。但后续上涨乏力，利率中枢不断抬升导致估值预期出现调整，资金追高动能不足，叠加临近年底机构获利了结等因素，大消费板块集体回调，带动指数快速下跌。最终上证综指收于 3307.17 点，深证成指收于 11040.45 点，中小板指和创业板指报 7554.86 点和 1752.65 点。

2017 年，恒生指数大幅跑赢全球，成长胜价值，板块分化显著，盈利为主要动力。恒生指数全年上涨 36%，成为全球表现最佳的市场之一，不仅跑赢多数新兴市场，更是显著好于发达国家股市。市场风格方面，成长股好于价值股；同时板块之间分化十分显著，其中恒生国企指数年涨幅高达 25%，由于金融权重占比较高，涨幅仍较恒生指数偏弱。分板块来看，表现最好的信息技术板块年全年涨幅高达 92%，而电信板块却下跌了 1%。2017 年海外中资股市场出现的估值和盈利双轮驱动，还是 2009 年以来的首次。不过，尽管市盈率出现扩张，但企业盈利仍然是驱动市场上涨的主要因素。流动性方面，南下资金流入毋庸置疑是 2017 年 H 股市场流动性的主导因素。全年南向资金累计净流入规模达到 3,400 亿港元，明显高于 2016 年全年的 2,460 亿港元。海外资金流入规模相对较小，且多数为被动性流入。

回顾 2017 年，本基金在 2 季度完成建仓后仓位一直维持在较高水平。结构上，年初基于看好经济复苏持续，建仓配置部分周期板块，后续以 A 股银行保险与 H 股权重股；半年报后开始增配 A 股周期板块并获取了部分超额收益，在 3 季度末逐步将结构均衡化，后续配置行业结构较为均衡，个股以行业景气度向上的行业龙头为主。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为 25.11%，同期业绩比较基准收益率为 22.60%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.51 个百分点。

#### 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 2018 年全年，预计中国经济仍将保持较好韧性，虽然地产和基建的小幅回落、2+26 城环保限产对短期经济会带来小幅下行压力，但居民消费稳中升级、全球经济复苏带来外需稳中向好、制造业投资提升均是经济增长的重要支撑。通胀水平总体平稳、温和，物价结构可能出现新的分化，PPI 对 CPI 的传导、大宗商品如石油、农产品等可能成为新的涨价因素，要警惕通胀走高的风险。而房地产相关的价格上涨、供给侧改革触发的价格波动可能有所弱化。

宏观政策方面，积极的财政政策取向不变，但会调整优化财政支出结构；稳健的货币政策要保持中性，管住货币供给总闸门；守住不发生系统性金融风险的底线；结构性政策要发挥更大作用，更好地服务实体经济。因此，金融监管仍然是全年的主线，而更好地服务和促进实体经济是目前宏观监管政策的主要目标。

2017 年，泛消费、大金融、周期品行业及白马蓝筹表现较好，这与经济平稳复苏、企业业绩改善、金融监管抑制高估值成长股泡沫是密切相关的。2018 年全年，从盈利、估值、流动性三要素来看，我们仍看好 A 股股票市场的表现，而 2018 年香港市场估值依然处于全球低位，海外资金的回流与南下资金的共振将带来继续上涨的动力。2018 年我们将坚持同纬度选行业，跨市场选标的原则，做好跨市场的选股工作。我们预计价值投资仍是市场的主线，市场将继续围绕业绩增长、价值发现的方向进行演绎。投资策略来看：第一，由于新增资金（海外资金和理财资金）的属性偏好低估值高分红的品种，因此，低估值品种的价值提升和重估可能是全年的主线逻辑；第二，目前各传统、新兴行业均显著出现龙头企业竞争力突出、市场占有率不断提升的状况，而且大部分龙头的估值依然具备优势（相对于行业内的非龙头公司），因此优选龙头依然是较好的策略之一；第三，随着经济复苏进入第三年，我们可以去挖掘较晚进入复苏周期或行业复苏可持续的细分行业和个股，也可关注全球经济回暖引发通胀中枢的回升的涨价机会；第四，我们可以在调整时间较长、未来符合经济转型或政策鼓励方向的“偏成长”的细分行业加大挖掘、配置力度，十九大报告、中央经济工作会议文件已经给出了很好的方向指引。

2018 年，秉承“行业相对分散，个股适度集中；同维度选行业，跨市场选股票”的跨 A/H 市场的投资框架。本基金将加强风险控制，在全球进入加息周期之后将不断审视组合的资产质量与估值的匹配度。同时加强不同行业间的核心资产之间的比较与甄选，进一步深挖估值洼地的优质龙头资产。

#### 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 10%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 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 年度，基金托管人在海富通沪港深灵活配置混合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 年度，海富通基金管理有限公司在海富通沪港深灵活配置混合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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2017 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沪港

深灵活配置混合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 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	13,977,045.10	18,810,684.82
结算备付金	3,713,037.53	-
存出保证金	2,999,946.79	-
交易性金融资产	178,726,970.83	8,954,664.00
其中：股票投资	178,726,970.83	8,954,664.00
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	100,000,000.00
应收证券清算款	970,346.41	102,438,557.46
应收利息	8,633.46	74,854.77
应收股利	35,200.00	-

应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	200,431,180.12	230,278,761.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,411,468.59	-
应付赎回款	3,358.28	9.83
应付管理人报酬	217,007.30	292,004.13
应付托管费	36,167.89	48,667.36
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	555,510.87	17,027.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	216,004.27	28,091.16
负债合计	4,439,517.20	385,799.68
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	156,760,379.57	230,022,926.96
未分配利润	39,231,283.35	-129,965.59
所有者权益合计	195,991,662.92	229,892,961.37
负债和所有者权益总计	200,431,180.12	230,278,761.05

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2503 元，基金份额总额 156,760,379.57 份。于 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9994 元，基金份额总额 230,022,926.96 份。

2、基金合同成立于 2016 年 11 月 11 日。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 11 月 11 日 (基金合同生效 日) 至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>48,220,323.06</b>	<b>471,645.65</b>
1.利息收入	742,956.76	537,766.81
其中：存款利息收入	549,432.30	192,340.88
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	193,524.46	345,425.93
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	42,102,684.15	165,569.24
其中：股票投资收益	39,520,964.82	165,569.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	3,157.64	-
股利收益	2,578,561.69	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5,038,293.38	-231,690.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	336,388.77	0.48
<b>减：二、费用</b>	<b>6,881,083.76</b>	<b>601,611.35</b>
1. 管理人报酬	2,830,965.85	471,079.56
2. 托管费	471,827.66	78,513.25
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,363,532.59	23,457.39



5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	214,757.66	28,561.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	<b>41,339,239.30</b>	<b>-129,965.70</b>
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	<b>41,339,239.30</b>	<b>-129,965.70</b>

注：本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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（基金净值）	230,022,926.96	-129,965.59	229,892,961.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,339,239.30	41,339,239.30
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）	-73,262,547.39	-1,977,990.36	-75,240,537.75
其中：1.基金申购款	142,462,043.30	28,973,058.08	171,435,101.38
2.基金赎回款	-215,724,590.69	-30,951,048.44	-246,675,639.13
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）	-	-	-
五、期末所有者权	156,760,379.57	39,231,283.35	195,991,662.92

益（基金净值）			
项目	上年度可比期间		
	2016 年 11 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 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（基金净值）	230,023,025.79	-	230,023,025.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-129,965.70	-129,965.70
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）	-98.83	0.11	-98.72
其中：1.基金申购款	19.73	-0.03	19.70
2.基金赎回款	-118.56	0.14	-118.42
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	230,022,926.96	-129,965.59	229,892,961.37

注：本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金（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]第 1647 号《关于准予海富通沪港深灵活配置混合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《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合

同》组织基金发售。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 230,010,422.60 元，已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第 1389 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 230,023,025.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 12,603.19 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《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、证券公司发行的短期公司债及其他经中国证监会允许投资的债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、国债期货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（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%（其中，投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票比例为基金资产的 0-95%）；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40% + 恒生指数收益率×40% + 中债综合财富指数收益率×20%。

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 2018 年 3 月 23 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度和 2016 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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 年度和 2016 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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衍生工具(主要为权证投资) 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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 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、买入返售金融资产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其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 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。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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为权证投资)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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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确认。

#### 7.4.4.8 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确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 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。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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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[2017]13号《中国证监会关于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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自 2017 年 9 月 22 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中央国债登记结算有限责任公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内无重大会计差错。

### 7.4.6 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》、[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东

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。



**7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.8.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年11月11日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	1,928,872,458.74	99.21%	18,583,854.12	100.00%

**7.4.8.1.2 权证交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年11月11日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	3,157.64	100.00%	-	-

**7.4.8.1.3 债券交易**

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债券交易。

**7.4.8.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年11月11日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
海通证券	713,000,000.00	100.00%	1,100,000,000.00	100.00%

**7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	1,654,095.13	99.34%	544,597.15	98.04%
关联方名称	上年度可比期间 2016年11月11日（基金合同生效日）至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	17,027.20	100.00%	17,027.20	100.00%

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年11月11日（基金 合同生效日）至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,830,965.85	471,079.56
其中：支付销售机构的客户维护费	2,153.97	15.88

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 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年11月11日（基金 合同生效日）至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	471,827.66	78,513.25

注：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 0.25% 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 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年11月11日（基金合同生效 日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	13,977,045.10	408,925.51	18,810,684.82	192,340.88

注：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。

#### 7.4.8.6 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在承销期内参与关联方承销证券，上年度可比区间无比较数据。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

**7.4.9.2 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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601600	中国铝业	2017-09-12	重大资产重组	6.67	2018-02-26	7.28	896,100	4,601,108.00	5,976,987.00	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 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。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 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。

**7.4.9.3.2 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。

**7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****(1) 公允价值****(a) 金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

**(b) 持续的以公允价值计量的金融工具**

## (i)各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 172,700,282.12 元, 属于第二层次的余额为 6,026,688.71 元, 无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 8,954,664.00 元, 无属于第二层次以及第三层次的余额)。

## (ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日: 同)。

## (d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

## (2)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, 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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外, 财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

## (3)除公允价值和增值税外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	178,726,970.83	89.17
	其中：股票	178,726,970.83	89.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	17,690,082.63	8.83
8	其他各项资产	4,014,126.66	2.00
9	合计	200,431,180.12	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 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	6,250,240.00	3.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,964,242.65	14.78
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	4,070,956.00	2.08
J	金融业	7,484,570.94	3.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,049,177.60	5.13
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	56,819,187.19	28.99

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	4,942,836.14	2.52
工业	8,160,475.24	4.16
金融	52,237,803.09	26.65
信息技术	16,661,391.56	8.50
医疗保健	7,703,345.32	3.93
房地产	32,201,932.29	16.43
合计	121,907,783.64	62.19

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 8.3 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

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	002027	分众传媒	713,720	10,049,177.60	5.13
2	00998	中信银行	2,344,000	9,600,927.90	4.90
3	00960	龙湖地产	579,000	9,476,561.21	4.84
4	03968	招商银行	317,500	8,253,984.32	4.21
5	00966	中国太平	320,000	7,837,492.16	4.00
6	01093	石药集团	584,000	7,703,345.32	3.93

7	00813	世茂房地产	532,000	7,559,970.04	3.86
8	601318	中国平安	106,953	7,484,570.94	3.82
9	01766	中国中车	1,016,000	7,100,018.92	3.62
10	00732	信利国际	2,412,000	6,814,806.43	3.48

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 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	00939	建设银行	24,036,407.95	10.46
2	00966	中国太平	19,247,617.85	8.37
3	601318	中国平安	18,974,820.65	8.25
4	01093	石药集团	18,269,277.80	7.95
5	01398	工商银行	17,501,444.01	7.61
6	00998	中信银行	17,269,939.24	7.51
7	600104	上汽集团	17,013,340.37	7.40
8	06818	中国光大银行	16,488,031.88	7.17
9	601169	北京银行	16,024,773.85	6.97
10	01288	农业银行	16,020,393.14	6.97
11	601939	建设银行	15,816,308.00	6.88
12	000725	京东方 A	15,383,890.11	6.69
13	00960	龙湖地产	14,980,378.72	6.52
14	00700	腾讯控股	14,739,450.26	6.41
15	01336	新华保险	14,517,047.14	6.31
16	002027	分众传媒	14,459,466.68	6.29
17	002041	登海种业	14,116,608.49	6.14
18	600887	伊利股份	13,966,512.00	6.08
19	00753	中国国航	12,853,841.32	5.59
20	01293	广汇宝信	12,628,637.85	5.49
21	00763	中兴通讯	12,241,710.19	5.32
22	600406	国电南瑞	11,499,178.79	5.00
23	00732	信利国际	11,380,674.90	4.95
24	02899	紫金矿业	11,221,296.70	4.88
25	601636	旗滨集团	11,122,393.62	4.84
26	01055	中国南方航空股份	11,042,034.92	4.80
27	06886	HTSC	10,865,815.61	4.73



28	00323	马鞍山钢铁股份	10,506,454.44	4.57
29	01208	五矿资源	10,399,732.28	4.52
30	01766	中国中车	10,268,303.03	4.47
31	601398	工商银行	10,079,025.00	4.38
32	00291	华润啤酒	9,883,713.21	4.30
33	601336	新华保险	9,840,950.62	4.28
34	00288	万洲国际	9,508,387.15	4.14
35	00981	中芯国际	9,175,448.31	3.99
36	601988	中国银行	8,966,380.00	3.90
37	03968	招商银行	8,925,581.62	3.88
38	02386	中石化炼化工程	8,911,203.71	3.88
39	000333	美的集团	8,810,007.00	3.83
40	03908	中金公司	8,625,589.41	3.75
41	600028	中国石化	8,618,304.00	3.75
42	601899	紫金矿业	8,328,981.00	3.62
43	002024	苏宁易购	8,147,615.00	3.54
44	02601	中国太保	8,109,172.68	3.53
45	300316	晶盛机电	7,996,951.19	3.48
46	600036	招商银行	7,907,778.97	3.44
47	00813	世茂房地产	7,783,396.83	3.39
48	06030	中信证券	7,778,437.21	3.38
49	00347	鞍钢股份	7,623,919.72	3.32
50	002092	中泰化学	7,521,917.30	3.27
51	02600	中国铝业	7,435,306.74	3.23
52	600741	华域汽车	7,375,629.64	3.21
53	01088	中国神华	7,354,384.71	3.20
54	002304	洋河股份	7,316,796.00	3.18
55	002415	海康威视	7,126,242.00	3.10
56	00368	中外运航运	7,039,287.39	3.06
57	02319	蒙牛乳业	7,027,733.05	3.06
58	02238	广汽集团	6,994,839.24	3.04
59	600563	法拉电子	6,913,952.33	3.01
60	00688	中国海外发展	6,736,543.37	2.93
61	01958	北京汽车	6,698,772.83	2.91
62	01171	兖州煤业股份	6,583,830.09	2.86
63	601058	赛轮金宇	6,448,603.80	2.81
64	600141	兴发集团	6,419,800.00	2.79
65	600109	国金证券	6,111,866.84	2.66
66	00884	旭辉控股集团	5,865,615.89	2.55
67	601009	南京银行	5,626,690.00	2.45
68	002831	裕同科技	5,534,729.00	2.41
69	002601	龙蟠佰利	5,508,113.61	2.40
70	02382	舜宇光学科技	5,496,628.87	2.39
71	02007	碧桂园	5,317,599.79	2.31

72	600196	复星医药	5,227,246.05	2.27
73	600282	南钢股份	5,222,982.80	2.27
74	01308	海丰国际	5,163,815.56	2.25
75	000538	云南白药	5,034,123.94	2.19
76	02607	上海医药	4,902,165.69	2.13
77	601600	中国铝业	4,601,108.00	2.00

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。

#### 8.4.2 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	600104	上汽集团	19,273,408.96	8.38
2	01398	工商银行	17,818,491.22	7.75
3	601318	中国平安	17,397,409.56	7.57
4	00939	建设银行	16,924,223.10	7.36
5	601939	建设银行	16,402,408.66	7.13
6	601169	北京银行	16,268,896.37	7.08
7	01288	农业银行	16,095,075.14	7.00
8	01336	新华保险	14,923,845.75	6.49
9	00753	中国国航	13,822,807.50	6.01
10	00700	腾讯控股	13,084,211.96	5.69
11	01293	广汇宝信	12,714,932.94	5.53
12	01093	石药集团	12,012,226.46	5.23
13	01055	中国南方航空股份	11,993,890.35	5.22
14	00966	中国太平	11,989,106.87	5.22
15	000725	京东方 A	11,817,844.87	5.14
16	600887	伊利股份	11,590,324.65	5.04
17	601636	旗滨集团	11,384,604.00	4.95
18	02899	紫金矿业	11,326,197.10	4.93
19	601336	新华保险	11,037,723.45	4.80
20	00323	马鞍山钢铁股份	10,945,505.14	4.76
21	601398	工商银行	10,866,093.87	4.73
22	06818	中国光大银行	10,564,924.61	4.60
23	00288	万洲国际	10,122,920.14	4.40
24	00291	华润啤酒	9,783,788.79	4.26
25	02386	中石化炼化工程	9,686,895.55	4.21
26	00981	中芯国际	9,552,706.12	4.16
27	600036	招商银行	9,452,636.02	4.11
28	601988	中国银行	9,234,018.00	4.02

29	00763	中兴通讯	9,083,203.46	3.95
30	02600	中国铝业	8,996,791.04	3.91
31	601899	紫金矿业	8,894,920.00	3.87
32	600741	华域汽车	8,742,230.00	3.80
33	002092	中泰化学	8,713,742.00	3.79
34	600028	中国石化	8,692,883.02	3.78
35	600141	兴发集团	8,529,417.00	3.71
36	002415	海康威视	8,398,446.51	3.65
37	300316	晶盛机电	8,204,557.00	3.57
38	02601	中国太保	7,904,209.31	3.44
39	02238	广汽集团	7,785,458.72	3.39
40	002304	洋河股份	7,733,623.00	3.36
41	600406	国电南瑞	7,455,657.57	3.24
42	002041	登海种业	7,398,353.99	3.22
43	00998	中信银行	7,359,978.49	3.20
44	002024	苏宁易购	7,346,189.40	3.20
45	01088	中国神华	7,164,930.95	3.12
46	01171	兖州煤业股份	7,051,697.86	3.07
47	02319	蒙牛乳业	6,907,461.61	3.00
48	002027	分众传媒	6,865,996.40	2.99
49	00347	鞍钢股份	6,846,718.02	2.98
50	600563	法拉电子	6,410,790.00	2.79
51	01958	北京汽车	6,209,462.26	2.70
52	01208	五矿资源	6,170,226.29	2.68
53	601058	赛轮金宇	6,149,951.00	2.68
54	02382	舜宇光学科技	6,122,647.13	2.66
55	06886	HTSC	6,090,126.36	2.65
56	01308	海丰国际	6,086,117.74	2.65
57	00368	中外运航运	5,855,621.54	2.55
58	03993	洛阳钼业	5,668,904.11	2.47
59	600196	复星医药	5,602,485.09	2.44
60	601009	南京银行	5,505,960.72	2.40
61	300136	信维通信	5,443,237.00	2.37
62	02607	上海医药	5,439,657.09	2.37
63	600109	国金证券	5,347,588.08	2.33
64	02007	碧桂园	5,336,671.89	2.32
65	00960	龙湖地产	5,260,408.01	2.29
66	002601	龙蟠佰利	5,206,468.00	2.26
67	002831	裕同科技	5,192,744.00	2.26
68	000333	美的集团	4,961,957.65	2.16
69	000538	云南白药	4,954,519.06	2.16
70	02333	长城汽车	4,782,649.68	2.08
71	000778	新兴铸管	4,761,279.97	2.07
72	00175	吉利汽车	4,759,586.93	2.07

73	03323	中国建材	4,706,034.02	2.05
74	600519	贵州茅台	4,664,971.69	2.03
75	600511	国药股份	4,610,248.65	2.01
76	000951	中国重汽	4,601,596.92	2.00

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。

### 8.4.3 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	1,035,064,406.03
卖出股票的收入（成交）总额	909,851,358.43

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。

### 8.5 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。

### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时,可以通过买入股指期货作为股票替代,增加股票仓位,同时提高资金的利用效率;在预期市场下跌时,可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险,对投资组合的价值进行保护。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资以风险管理为原则,以套期保值为目的。管理人按照相关法

律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 报告期内本基金投资的中信银行（601998）于 2017 年 11 月 24 日发布的《关于中信银行股份有限公司公开发行申请文件反馈意见的回复》称，因涉嫌违反法律法规，中信银行及其部分控股子公司、分支机构受到中国银监会（包括中国银监会派出机构）及其他行政机构的处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是国内综合实力最雄厚的商业银行之一，17 年业绩符合预期，优化负债结构，压降低效资产，预计 18 年资产有望重回小幅扩表阶段，息差有望企稳回升，基本面有望出现边际改善。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。

**8.12.2** 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。

### 8.12.3 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	2,999,946.79
2	应收证券清算款	970,346.41
3	应收股利	35,200.00
4	应收利息	8,633.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,014,126.66

### 8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 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
197	795,737.97	156,624,005.64	99.91%	136,373.93	0.09%

**9.2 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	49.01	0.0000%

**9.3 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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2016 年 11 月 11 日)基金份额总额	230,023,025.79
本报告期期初基金份额总额	230,022,926.96
本报告期基金总申购份额	142,462,043.30
减：本报告期基金总赎回份额	215,724,590.69
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额	156,760,379.57
--------------	----------------

注：总申购份额含转换入份额(如有)，总赎回份额含转换出份额(如有)。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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、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。

2、2017 年 9 月 13 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五次会议审议通过，聘任任志强先生担任公司总经理职务，同时公司董事长张文伟先生不再代行总经理职务。

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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。2016 年 11 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间应支付的审计费用是 66,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 2 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	1,928,872,458.74	99.21%	1,654,095.13	99.34%	-
太平洋证券	2	15,343,065.15	0.79%	10,913.72	0.66%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

注：报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

(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。



## 11.7.2 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	-	-	713,000,000.00	100.00%	3,157.64	100.00%
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 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	2017/1/1-2017/12/13 2017/12/15-2017/12/31	50,001,250.00	40,130,829.12	50,001,250.00	40,130,829.12	25.60%
	2	2017/1/1-2017/12/31	50,001,250.00	48,531,250.00	50,000,000.00	48,532,350.00	30.96%

		2/12 2017/12/19-2017 /12/31	, 250.0 0	, 100.8 7	00.00	87	
	3	2017/1/1-2017/1 2/31	50,003 , 500.0 0	-	15,000,0 00.00	35,003,500. 00	22.33%
	4	2017/12/18-2017 /12/18	40,000 , 800.0 0	24,216 , 176.9 5	40,000,8 00.00	24,216,176. 95	15.45%
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>							

## 12.2 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 56 只公募基金。截至 2017 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 507.14 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 12 月 31 日，投资咨询及海外业务规模超过 41 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 12 月 31 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 12 月 31 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 417 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  
二〇一八年三月二十七日