

海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金
2017 年半年度报告
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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43

§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	海富通东财大数据混合
基金主代码	519132
交易代码	519132
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 29 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	43,202,778.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过灵活有效的资产配置策略和个股精选策略，实现基金资产的稳健、持续增值。
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，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；其次结合东方财富大数据指标及其他证券市场趋势指标，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。在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times 60\%$ + 上证国债指数收益率 $\times 40\%$
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	郭明
	联系电话	021-38650891	010-66105799

电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	40088-40099	95588
传真	021-33830166	010-66105798
注册地址	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	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	张文伟	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-6,249,314.72
本期利润	-4,158,353.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0852
本期加权平均净值利润率	-8.65%

本期基金份额净值增长率	-6.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,565,554.83
期末可供分配基金份额利润	-0.0362
期末基金资产净值	41,637,223.33
期末基金份额净值	0.964
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.60%

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）。

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
过去一个月	3.66%	0.52%	3.05%	0.40%	0.61%	0.12%
过去三个月	-3.21%	0.74%	3.71%	0.37%	-6.92%	0.37%
过去六个月	-6.95%	0.75%	6.54%	0.34%	-13.49%	0.41%
过去一年	-6.59%	0.80%	10.40%	0.41%	-16.99%	0.39%
自基金合同生效起至今	-3.60%	0.87%	18.15%	0.57%	-21.75%	0.30%

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

海富通东财大数据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历史走势对比图
 (2016 年 1 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金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

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		
陈甄璞	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；量化投资部总监	2016-01-29	-	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任复旦金仕达计算机有限公司高级程序员、部门经理，东方证券股份有限公司高级开发经理，IBM 中国有限公司高级咨询顾问，海富通基金管理有限公司量化分析师、投资经理、量化投资部副总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2014 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2015 年 4 月至 2016 年 6 月兼任海富通养老收益混合和海富通新内需混合基金经理。2016 年 1 月起兼任海富通东财大数据混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。

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 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

回顾 2017 上半年，市场整体呈现震荡走势，风格分化较为明显，以上证 50 为代表的优质大盘股屡创新高，上半年涨幅达 11.50%。“一带一路”、雄安新区、自贸区到粤港澳大湾区的“地图”行情也轮番上演。上半年上证综指、深证成指和中小板指数分别收涨 2.86%、3.46% 和 7.33%，创业板独跌 7.34%。

年初，沪指一路震荡上行，主要源于两会召开前的政策期待以及对经济复苏的预期，其中以家电和食品饮料为代表的大消费行业以及与基建相关的周期性行业表现较好，加之国际峰会的推动，“一带一路”也掀起过两波浪潮。直至一季度末受流动性收紧的影响，沪指出现回调。4月初始，雄安新区横空出世引发市场高度关注，大盘在相关概念股的带领下持续上攻，上证综指最高上冲至 3295 点。但好景不长，随后金融监管频频出招，引发委外资金大规模赎回，资金面一度趋紧。加之海外局势震荡，市场恐慌情绪蔓延，对投资者风险偏好形成较大冲击，仅数个交易日，上证综指一度刺破 3100 点关口。直至 5 月末，在减持新规的刺激下，市场才重拾信心进一步上扬，金融板块强势崛起。随着美联储如期加息、监管政策趋缓，市场风险偏好有所提升。此外，A 股成功纳入 MSCI，国际化进程进一步提速，或将为市场带来增量资金，沪指再度呈现震荡上行态势。

行业方面，在中信 29 个一级行业分类中，家电（29.66%）、食品饮料（19.07%）、电子元器件（9.08%）、银行（8.91%）和煤炭（7.90%）涨幅居前，农林牧渔（-15.41%）、纺织服装（-13.55%）、计算机（-13.23%）、传媒（-11.98%）和国防军工（-10.86%）跌幅逾 10%。

上半年的 A 股市场先跌后涨，指数在一、二季度出现两个高点，说明市场的震荡波动对投资操作带来的难度。本基金在一季度过于偏向小盘股，尽管在二季度都是按照量化模型均衡配置行业权重，但是由于因子暴露上依然偏向小盘因子，导致优质大盘股的配置没有提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-6.95%，同期业绩比较基准收益率为 6.54%，基金净值跑输业绩比较基准 13.49 个百分点。主要原因是量化股票模型过于偏向小股票，在上半年股票市场的风格变换中，本基金未能跟上市场表现较好的股票，导致净值受到较大的影响。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济在 2017 年上半年呈现冲高、小幅回落的走势。PPI、固定资产投资、工业增加值等经济指标分别在 2-3 月份达到高点，随后温和回落；市场对经济的预期也经历了一个从乐观到悲观的过程。展望下半年，我们认为中国经济的韧性较强，并没有市场之前预期的那么悲观。进出口贸易数据始终维持在较高水平；6 月份 PMI 指数在淡季回升至 51.7%，超过市场预期；挖掘机、重卡销量增长的持续性也高于市场预期。目前看，三季度宏观经济仍将维持在较好水平，四季度可能随着地产、基建投资的逐步下行而出现温和回落，但消费稳中升级、进出口贸易维持复苏、制造业投资温和回暖等均支持宏观经济保持较好的内生动能。

相较于上半年的偏紧、波动，货币金融市场在下半年预计更为稳健。目前金融监管措施已有一定成效，维持当前的监管强度和资金利率水平有望实现温和去杠杆的效果；同时，当前中美资金利差维持在较高水平，人民币短期无显著贬值压力，这使得我们面

临的外围环境有所改善。因此，我们预计下半年货币金融市场有望实现“不紧不松”的状态。当然，四季度面临的不确定性相对大一些，宏观经济走势、海外市场的波动仍需进一步观察。

股票市场在 2017 年上半年呈现出明显的价值偏好，预计下半年关注企业竞争力、业绩增长、合理估值的价值投资风格仍将延续。国内经济总量稳中波动、结构小幅分化的态势不会有大的变化；大部分行业的发展和竞争格局日益稳定，互联网、电子信息等近五年崛起的新兴行业也开始进入寡头竞争时代；国内强监管、金融去杠杆政策延续，资本市场日益开放，机构投资者话语权不断提升；这些都决定了以价值评估为主、结合基本面趋势变化的投资风格仍有望得到市场的认可。考虑到宏观经济韧性较强、资金利率更为平稳，预计业绩稳健、估值不高的龙头蓝筹仍有较好的投资价值，而且对龙头蓝筹的选择不必拘泥于金融、投资品、消费、成长等行业属性限制。此外，经过持续的股价、估值调整，越来越多的成长股开始进入估值合理区间；行业前景良好、公司竞争力突出、业绩增长较好且估值已近合理的潜力成长股也是下半年可以考虑积极挖掘、择机布局的方向。

展望下半年，本基金将大幅度完善龙头白马股和沪深 300 增强量化模型，更多结合多因子等的量化选股体系，努力抓住盈利因子、动量因子等主题性上涨波段股票的因子特征，改善市值加权模式，积极判断公司稳定增长趋势，追求低估值并有确定性盈利增长的股票，争取为持有人提供稳定收益。

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

一、本基金本报告期内无应分配的收益。

- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

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

本报告期内，本基金自 2017 年 5 月 23 日至 2017 年 6 月 30 日，已连续二十八个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内，本基金托管人在对海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金
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	上年度末
----	-----	-----	------

		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
资产:		-	-
银行存款	6.4.7.1	8,371,464.33	8,505,112.22
结算备付金		406,416.19	893,395.20
存出保证金		49,515.40	146,868.97
交易性金融资产	6.4.7.2	31,738,584.66	58,058,364.97
其中: 股票投资		31,738,584.66	58,058,364.97
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,000,000.00	-
应收证券清算款		2,866,111.34	64,330.11
应收利息	6.4.7.5	2,338.58	2,308.97
应收股利		-	-
应收申购款		599.10	2,960.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		49,435,029.60	67,673,341.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 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		7,398,092.71	-
应付赎回款		19,059.12	274,806.42
应付管理人报酬		54,438.19	94,319.65
应付托管费		8,505.94	14,737.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	139,138.73	464,812.71
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	178,571.58	350,970.88
负债合计		7,797,806.27	1,199,647.10
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	43,202,778.16	64,150,534.67
未分配利润	6.4.7.10	-1,565,554.83	2,323,159.23
所有者权益合计		41,637,223.33	66,473,693.90
负债和所有者权益总计		49,435,029.60	67,673,341.00

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.964 元，基金份额总额 43,202,778.16 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通东财大数据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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 29 日 (基金合同生效 日) 至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-2,919,222.94	8,660,483.19
1.利息收入		53,881.69	727,661.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	39,345.63	609,528.39
债券利息收入		30.84	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,505.22	118,132.82
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,256,489.42	-875,435.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,501,411.85	-881,670.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	483.66	-
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-349,120.00
股利收益	6.4.7.16	244,438.77	355,354.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,090,961.13	8,344,804.35
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	192,423.66	463,453.62
减：二、费用		1,239,130.65	4,141,287.66
1. 管理人报酬		382,256.07	1,634,137.60
2. 托管费		59,727.43	255,334.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	609,263.66	2,082,610.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	187,883.49	169,205.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,158,353.59	4,519,195.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,158,353.59	4,519,195.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通东财大数据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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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（基金净值）	64,150,534.67	2,323,159.23	66,473,693.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,158,353.59	-4,158,353.59
三、本期基金份额交易	-20,947,756.51	269,639.53	-20,678,116.98

产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	10,998,233.16	-660,801.92	10,337,431.24
2.基金赎回款	-31,945,989.67	930,441.45	-31,015,548.22
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)	43,202,778.16	-1,565,554.83	41,637,223.33
项目	上年度可比期间		
	2016年1月29日(基金合同生效日)至2016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(基金净值)	326,320,977.35	-	326,320,977.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,519,195.53	4,519,195.53
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)	-127,953,641.65	1,861,365.20	-126,092,276.45
其中：1.基金申购款	3,297,081.44	-10,814.35	3,286,267.09
2.基金赎回款	-131,250,723.09	1,872,179.55	-129,378,543.54
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)	198,367,335.70	6,380,560.73	204,747,896.43

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

海富通东财大数据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] 3083 号文注册,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《海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 326,201,647.16 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(2016)第 112 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 326,320,977.35 份基金份额,其中认购资金利息折合 119,330.19 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,基金托管人为工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通东财大数据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)、债券(包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转换债券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、货币市场工具、权证、股指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的相关规定)。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票投资 0%-95%,权证投资 0%-3%,在每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,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%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 60%+上证国债指数收益率 \times 40%。

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》、《海富通东财大数据灵活配置混合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 1 月 1 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 1 月 1 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金报告期内无重大会计差错。

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) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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重要财务报表项目的说明**6.4.7.1 银行存款**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
活期存款	8,371,464.33	-
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	8,371,464.33	-

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,768,138.05	31,738,584.66	970,446.61
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	30,768,138.05	31,738,584.66	970,446.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	6,000,000.00	-
----	--------------	---

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,740.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	174.57
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	403.56
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	20.07
合计	2,338.58

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	139,138.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	139,138.73

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	53.09
预提费用	178,518.49
合计	178,571.58

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,150,534.67	64,150,534.67
本期申购	10,998,233.16	10,998,233.16
本期赎回（以“-”号填列）	-31,945,989.67	-31,945,989.67
本期末	43,202,778.16	43,202,778.16

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,504,403.59	-4,181,244.36	2,323,159.23
本期利润	-6,249,314.72	2,090,961.13	-4,158,353.59
本期基金份额交易产生的变动数	-779,075.55	1,048,715.08	269,639.53
其中：基金申购款	117,058.18	-777,860.10	-660,801.92
基金赎回款	-896,133.73	1,826,575.18	930,441.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-523,986.68	-1,041,568.15	-1,565,554.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	33,849.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,235.59

其他	1,260.18
合计	39,345.63

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	219,013,781.84
减：卖出股票成本总额	224,515,193.69
买卖股票差价收入	-5,501,411.85

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	105,514.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	105,000.00
减：应收利息总额	30.84
买卖债券差价收入	483.66

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	244,438.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	244,438.77

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	2,090,961.13
——股票投资	2,090,961.13
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	2,090,961.13

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	192,388.25
基金转换费收入	35.41
合计	192,423.66

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2.本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	609,263.66
银行间市场交易费用	-
合计	609,263.66

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	365.00
合计	187,883.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比区间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比区间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比区间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月29日（基 金合同生效日）至 2016 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	382,256.07	1,634,137.60
其中：支付销售机构的客户维护 费	217,560.88	1,083,122.23

注：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 1.6% 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 1.6% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月29日（基金合 同生效日）至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	59,727.43	255,334.06

注：支付基金托管人工商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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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6月30 日		上年度可比期间 2016年1月29日（基金合同生效 日）至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国工商银行	8,371,464.33	33,849.86	6,272,847.97	362,022.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比区间无通过关联方购买其承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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证券。

6.4.12.2 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 盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000100	TCL 集 团	2017-06-02	重大事 项	3.43	2017-07- 26	3.72	24,500	88,467.48	84,035.00	-
000682	东方电 子	2016-10-03	重大资 产重组	5.20	2017-08- 07	5.60	44,400	240,168.00	230,880.00	-
000889	茂业通 信	2017-04-14	重大资 产重组	16.71	-	-	3,700	62,702.00	61,827.00	-

002129	中环股份	2016-07-06	重大事项	8.27	-	-	47,800	379,042.00	395,306.00	-
002621	三垒股份	2017-06-14	重大资产重组	15.19	-	-	6,900	100,050.00	104,811.00	-
300065	海兰信	2017-06-22	重大资产重组	25.63	2017-07-06	23.07	5,400	133,749.00	138,402.00	-
300486	东杰智能	2017-01-25	重大资产重组	22.63	2017-08-09	20.38	19,800	600,557.10	448,074.00	-
300518	盛讯达	2017-05-22	重大资产重组	113.30	2017-07-10	101.97	600	83,315.00	67,980.00	-
600136	当代明诚	2017-02-13	重大事项	16.79	-	-	6,000	92,676.48	100,740.00	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组	3.60	-	-	40,500	133,566.51	145,800.00	-
601717	郑煤机	2017-04-24	重大资产重组	7.79	-	-	20,000	173,381.90	155,800.00	-
603238	诺邦股份	2017-06-07	重大资产重组	29.38	2017-08-23	31.99	2,400	72,019.00	70,512.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收

益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立风险委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风险管理委员会,实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责,并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的四层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日,本基金无债券投资(2016 年 12 月 31 日,同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的

处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量（2016 年 12 月 31 日，同）。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,371,464.33	-	-	-	8,371,464.33
结算备付金	406,416.19	-	-	-	406,416.19
存出保证金	49,515.40	-	-	-	49,515.40

交易性金融资产	-	-	-	31,738,584.66	31,738,584.66
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,866,111.34	2,866,111.34
应收申购款	-	-	-	599.10	599.10
应收利息	-	-	-	2,338.58	2,338.58
资产总计	14,827,395.92	-	-	34,607,633.68	49,435,029.60
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	54,438.19	54,438.19
应付托管费	-	-	-	8,505.94	8,505.94
应付交易费用	-	-	-	139,138.73	139,138.73
应付赎回款	-	-	-	19,059.12	19,059.12
应付证券清算款	-	-	-	7,398,092.71	7,398,092.71
其他负债	-	-	-	178,571.58	178,571.58
负债总计	-	-	-	7,797,806.27	7,797,806.27
利率敏感度缺口	14,827,395.92	-	-	26,809,827.41	41,637,223.33
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,505,112.22	-	-	-	8,505,112.22
结算备付金	893,395.20	-	-	-	893,395.20
存出保证金	146,868.97	-	-	-	146,868.97
交易性金融资产	-	-	-	58,058,364.97	58,058,364.97
应收证券清算款	-	-	-	64,330.11	64,330.11
应收申购款	-	-	-	2,960.56	2,960.56
应收利息	-	-	-	2,308.97	2,308.97
资产总计	9,545,376.39	-	-	58,127,964.61	67,673,341.00
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	94,319.65	94,319.65
应付托管费	-	-	-	14,737.44	14,737.44
应付交易费用	-	-	-	464,812.71	464,812.71
应付赎回款	-	-	-	274,806.42	274,806.42

其他负债	-	-	-	350,970.88	350,970.88
负债总计	-	-	-	1,199,647.10	1,199,647.10
利率敏感度缺口	9,545,376.39	-	-	56,928,317.51	66,473,693.90

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日，同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%，权证投资 0%-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	31,738,584.66	76.23	58,058,364.97	87.34
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,738,584.66	76.23	58,058,364.97	87.34

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 188	增加约 217
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 188	减少约 217

注：金额为约数,精确到万元。

6.4.14 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	31,738,584.66	64.20
	其中：股票	31,738,584.66	64.20
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	6,000,000.00	12.14
	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	8,777,880.52	17.76
7	其他各项资产	2,918,564.42	5.90
8	合计	49,435,029.60	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

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	210,616.00	0.51
C	制造业	19,440,250.30	46.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,705,402.00	4.10
E	建筑业	701,218.00	1.68
F	批发和零售业	362,400.00	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	968,028.00	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,832,904.00	4.40
J	金融业	4,417,563.00	10.61
K	房地产业	391,460.00	0.94
L	租赁和商务服务业	675,840.00	1.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	932,163.36	2.24
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	100,740.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	31,738,584.66	76.23

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所有股票投资明细

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	002466	天齐锂业	30,000	1,630,500.00	3.92
2	601166	兴业银行	90,000	1,517,400.00	3.64
3	300450	先导智能	25,000	1,294,250.00	3.11

4	600703	三安光电	60,000	1,182,000.00	2.84
5	002241	歌尔股份	55,000	1,060,400.00	2.55
6	002572	索菲亚	25,000	1,025,000.00	2.46
7	002340	格林美	160,270	969,633.50	2.33
8	000725	京东方 A	220,100	915,616.00	2.20
9	601901	方正证券	90,400	897,672.00	2.16
10	601006	大秦铁路	100,000	839,000.00	2.02
11	600104	上汽集团	26,800	832,140.00	2.00
12	601288	农业银行	219,400	772,288.00	1.85
13	600900	长江电力	44,900	690,562.00	1.66
14	000826	启迪桑德	19,578	687,579.36	1.65
15	002624	完美世界	20,000	686,000.00	1.65
16	601668	中国建筑	60,200	582,736.00	1.40
17	002415	海康威视	18,000	581,400.00	1.40
18	000858	五 粮 液	10,000	556,600.00	1.34
19	002027	分众传媒	40,000	550,400.00	1.32
20	600008	首创股份	80,000	526,400.00	1.26
21	600660	福耀玻璃	20,000	520,800.00	1.25
22	600690	青岛海尔	32,000	481,600.00	1.16
23	000063	中兴通讯	20,000	474,800.00	1.14
24	600019	宝钢股份	70,100	470,371.00	1.13
25	601555	东吴证券	40,000	449,200.00	1.08
26	300486	东杰智能	19,800	448,074.00	1.08
27	000651	格力电器	10,000	411,700.00	0.99
28	002129	中环股份	47,800	395,306.00	0.95
29	600511	国药股份	10,000	362,400.00	0.87

30	601318	中国平安	7,300	362,153.00	0.87
31	601688	华泰证券	20,000	358,000.00	0.86
32	600406	国电南瑞	19,900	351,235.00	0.84
33	600388	龙净环保	20,000	310,600.00	0.75
34	600309	万华化学	10,000	286,400.00	0.69
35	600276	恒瑞医药	5,000	252,950.00	0.61
36	000682	东方电子	44,400	230,880.00	0.55
37	300418	昆仑万维	10,000	228,700.00	0.55
38	600856	中天能源	20,000	225,200.00	0.54
39	300037	新宙邦	9,300	213,714.00	0.51
40	600885	宏发股份	5,000	199,450.00	0.48
41	600383	金地集团	16,900	193,843.00	0.47
42	600519	贵州茅台	400	188,740.00	0.45
43	002601	龙麟佰利	10,000	163,800.00	0.39
44	300073	当升科技	6,400	159,616.00	0.38
45	601717	郑煤机	20,000	155,800.00	0.37
46	300401	花园生物	4,000	148,200.00	0.36
47	300395	菲利华	10,000	146,500.00	0.35
48	600795	国电电力	40,500	145,800.00	0.35
49	300065	海兰信	5,400	138,402.00	0.33
50	300342	天银机电	9,000	137,340.00	0.33
51	600188	兖州煤业	11,200	137,088.00	0.33
52	600208	新湖中宝	30,400	136,800.00	0.33
53	300365	恒华科技	3,800	135,660.00	0.33
54	300258	精锻科技	8,200	135,382.00	0.33
55	300007	汉威电子	7,000	134,820.00	0.32

56	300400	劲拓股份	9,000	134,280.00	0.32
57	300121	阳谷华泰	9,600	132,480.00	0.32
58	300127	银河磁体	8,000	130,640.00	0.31
59	300302	同有科技	7,200	129,672.00	0.31
60	300306	远方光电	7,400	128,242.00	0.31
61	300286	安科瑞	6,200	127,906.00	0.31
62	300204	舒泰神	8,200	127,838.00	0.31
63	300326	凯利泰	13,600	127,704.00	0.31
64	300233	金城医药	6,000	125,940.00	0.30
65	300067	安诺其	20,000	125,800.00	0.30
66	300178	腾邦国际	9,800	125,440.00	0.30
67	300193	佳士科技	15,000	124,650.00	0.30
68	300054	鼎龙股份	12,200	124,074.00	0.30
69	300114	中航电测	9,200	124,016.00	0.30
70	300353	东土科技	9,600	123,648.00	0.30
71	300187	永清环保	10,800	123,552.00	0.30
72	300138	晨光生物	9,240	121,228.80	0.29
73	300190	维尔利	8,200	121,032.00	0.29
74	300165	天瑞仪器	14,600	119,720.00	0.29
75	300262	巴安水务	7,800	118,482.00	0.28
76	300363	博腾股份	7,800	118,248.00	0.28
77	600011	华能国际	16,000	117,440.00	0.28
78	300246	宝莱特	4,200	114,870.00	0.28
79	002082	栋梁新材	6,600	107,514.00	0.26
80	002621	三垒股份	6,900	104,811.00	0.25
81	600136	当代明诚	6,000	100,740.00	0.24

82	601636	旗滨集团	20,000	90,200.00	0.22
83	000100	TCL 集团	24,500	84,035.00	0.20
84	601225	陕西煤业	10,400	73,528.00	0.18
85	600118	中国卫星	2,600	72,384.00	0.17
86	603238	诺邦股份	2,400	70,512.00	0.17
87	600221	海航控股	21,500	69,230.00	0.17
88	300518	盛讯达	600	67,980.00	0.16
89	300208	恒顺众昇	3,900	62,283.00	0.15
90	000889	茂业通信	3,700	61,827.00	0.15
91	600048	保利地产	6,100	60,817.00	0.15
92	300350	华鹏飞	5,800	59,798.00	0.14
93	300011	鼎汉技术	3,700	59,200.00	0.14
94	300061	康耐特	3,200	58,944.00	0.14
95	300179	四方达	9,000	58,860.00	0.14
96	300316	晶盛机电	4,700	58,703.00	0.14
97	300167	迪威视讯	5,000	58,700.00	0.14
98	300160	秀强股份	6,500	58,305.00	0.14
99	300339	润和软件	4,600	57,960.00	0.14
100	300285	国瓷材料	2,900	57,130.00	0.14
101	300327	中颖电子	1,800	57,060.00	0.14
102	300203	聚光科技	2,000	56,240.00	0.14
103	300031	宝通科技	3,000	55,170.00	0.13
104	601601	中国太保	1,000	33,870.00	0.08
105	601628	中国人寿	1,000	26,980.00	0.06

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

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	601688	华泰证券	3,586,000.00	5.39
2	000928	中钢国际	1,890,514.00	2.84
3	002466	天齐锂业	1,877,950.00	2.83
4	300083	劲胜智能	1,821,337.60	2.74
5	002736	国信证券	1,784,678.00	2.68
6	601166	兴业银行	1,686,393.00	2.54
7	600030	中信证券	1,623,736.00	2.44
8	000776	广发证券	1,614,566.00	2.43
9	600104	上汽集团	1,580,661.00	2.38
10	601618	中国中冶	1,539,604.00	2.32
11	601888	中国国旅	1,531,624.94	2.30
12	601901	方正证券	1,471,400.00	2.21
13	601006	大秦铁路	1,469,628.00	2.21
14	600338	西藏珠峰	1,465,783.00	2.21
15	601992	金隅股份	1,430,695.00	2.15
16	300450	先导智能	1,369,341.00	2.06
17	600068	葛洲坝	1,334,340.00	2.01
18	601186	XD 中国铁	1,307,552.00	1.97
19	000063	中兴通讯	1,283,846.00	1.93
20	601800	中国交建	1,277,031.00	1.92

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。

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

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	601688	华泰证券	3,199,151.00	4.81
2	002736	国信证券	1,793,345.00	2.70
3	300083	劲胜智能	1,725,200.08	2.60
4	000776	广发证券	1,686,711.00	2.54
5	000928	中钢国际	1,658,861.95	2.50
6	600030	中信证券	1,633,200.00	2.46
7	601618	中国中冶	1,531,510.00	2.30
8	600338	西藏珠峰	1,527,151.00	2.30
9	601888	中国国旅	1,526,435.00	2.30
10	601992	金隅股份	1,432,886.00	2.16
11	601390	中国中铁	1,194,221.00	1.80
12	601186	XD 中国铁	1,166,817.00	1.76
13	601111	中国国航	1,165,744.00	1.75
14	000615	京汉股份	1,147,071.00	1.73
15	601669	中国电建	1,136,200.69	1.71
16	600068	葛洲坝	1,132,800.00	1.70
17	601800	中国交建	1,078,218.00	1.62
18	000063	中兴通讯	1,068,500.00	1.61
19	600104	上汽集团	995,862.00	1.50
20	000709	河钢股份	989,621.00	1.49

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。

7.4.3 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	196,104,452.25
---------------	----------------

卖出股票的收入（成交）总额	219,013,781.84
---------------	----------------

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。

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。

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

根据基金合同，本组合暂不投资国债期货。

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歌尔股份（002241）于 2016 年 7 月 16 日公告称，公司因违反《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》，于 2016 年 7 月 14 日收到中国证券监督管理委员会山东监管局《关于对歌尔股份有限公司采取责令改正措施的决定》。

对该证券的投资决策程序的说明：公司主营业务为微型电声元器件和消费类电声产品的研发、制造和销售。在微型驻极体麦克风领域，公司市场占有率居国内同行业之首，国际同行业第三名；在手机用微型扬声器/受话器领域，公司居国内同行业第二名。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的方正证券（601901）的发行人于 2016 年 10 月 18 日公告称，由于违反了《发布证券研究报告暂行规定》第六条、第十条、第十七条的相关规定，被湖南证监局采取出具警示函的监督管理措施。公司于 2016 年 11 月 29 日公告称，公司因违反《证券登记结算管理办法》、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》等的规定对客户的信息身份进行审查和了解，同时违反了《证券公司监督管理条例》的相关规定，被中国证监会责令改正，给予警告，没收违法所得 7,862,735.62 元，并处以 15,725,471.24 元罚款。公司于 2016 年 12 月 15 日收到全国股转公司给予出具警示函的自律监管措施。公司作为上海天信网络科技股份有限公司的主办券商，在核查过程中已关注到公司存在资金占用事项，但未及时督促公司履行信息披露义务，未能履行勤勉尽责义务及保证申请挂牌文件信息披露的真实、准确、完整。上述行为违反了《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》。公司于 2016 年 12 月 28 日被湖南证监局对公司采取责令限期改正以及给予谴责的措施，原因是公司部分营业部存在违反《证券公司内部控制指引》、《证券公司监督管理条例》和《证券投资顾问业务暂行规定》的有关规定的行为。公司于 2017 年 5 月 5 日公告称，方正集团、利德科技、西藏昭融、西藏容大、方正证券存在关联方关系，却数年来未如实履行披露义务，违反了《上市公司信息披露管理办法》、《证券法》等法规。时任方正集团董事、执行总裁李友，作为对方正集团上述违法行为直接负责的主管人员，被中国证券监督管理委员会采取终身证券市场禁入措施，终身不得从事证券业务或者担任上市公司董事、监事、高级管理人员职务。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是中国首批综合类证券公司，上海证券交易所、深圳证券交易所首批会员，目前已设立投行、期货、直投、合资基金、另类投资、香港金控等六家子公司，并持有盛京银行股份有限公司 5.17% 的股权。公司综合实力突出。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。

其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

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	49,515.40
2	应收证券清算款	2,866,111.34
3	应收股利	-
4	应收利息	2,338.58
5	应收申购款	599.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,918,564.42

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换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§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
1,290	33,490.53	-	-	43,202,778.16	100.00%

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	101,807.63	0.2357%

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	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 1 月 29 日）基金份额总额	326,320,977.35
本报告期期初基金份额总额	64,150,534.67
本报告期基金总申购份额	10,998,233.16
减：本报告期基金总赎回份额	31,945,989.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	43,202,778.16

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）。

§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	
中信建投	1	120,015,225.73	28.92%	109,369.99	30.95%	-
中泰证券(原齐鲁)	2	106,250,252.36	25.60%	91,697.50	25.95%	-
华泰证券	1	57,819,970.17	13.93%	53,847.53	15.24%	-
中金公司	2	48,773,290.63	11.75%	45,118.72	12.77%	-
东吴证券	2	31,887,644.44	7.68%	23,318.75	6.60%	-
申万宏源	2	28,214,505.31	6.80%	11,878.50	3.36%	-
东兴证券	3	10,825,212.52	2.61%	7,700.04	2.18%	-
兴业证券	2	9,058,918.28	2.18%	8,436.74	2.39%	-
东方证券	1	2,213,065.49	0.53%	2,061.02	0.58%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	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。

<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
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	19,000,000.00	45.24%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	105,514.50	100.00%	10,000,000.00	23.81%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	13,000,000.00	30.95%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

民族证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司旗下基金 2016 年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-12
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-12
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-18
5	海富通基金管理有限公司关于参加凤凰金信（银川）投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-18
6	海富通基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-04
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-10
8	海富通基金管理有限公司关于参加深圳市金斧子投资咨询有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-10
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华龙证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-03
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增首创证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-03
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加首创证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-03
12	海富通基金管理有限公司关于参加上海华夏财富投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-21
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-21

	司为销售机构的公告		
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中泰证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-29
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续在中国工商银行股份有限公司开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-31
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-07
17	海富通基金管理有限公司关于参加南京苏宁基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-07
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增光大证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-17
19	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-20
20	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-11
21	海富通基金管理有限公司关于参加北京蛋卷基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-11
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-19
23	海富通基金管理有限公司关于参加上海基煜基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-19
24	海富通基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-19
25	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增安信证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-24

§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

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。

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”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通东财大数据灵活配置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) 报告期内海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 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。

12.3 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
二〇一七年八月二十五日