

**海富通中国海外精选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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	36
7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	错误！未定义书签。
7.6 积极投资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益投资明细.....	错误！未定义书签。
7.7 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.8 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	42

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	42
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	42
7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	42
7.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	42
7.13 投资组合报告附注 .....	42
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
8.3 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	错误！未定义书签。
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>55</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中国海外精选混合型证券投资基金
基金简称	海富通中国海外混合(QDII)
基金主代码	519601
交易代码	519601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 27 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	110,654,460.91 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以在香港、美国等海外证券交易所上市的具有“中国概念”的上市公司为主要投资对象。本基金管理人将深入研究全球及内地经济状况以及政策导向，采取主动精选证券和适度资产配置的投资策略，实施全程风险管理，在保证资产良好流动性的前提下，在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	根据对境内外证券市场投资经验的认识和对证券市场的实证分析，本基金管理人将基金的整体投资策略分为二个层次：第一层次为适度主动的资产配置，以控制或规避市场系统性风险；第二层次为积极主动的精选证券，以分散或规避个券风险。主动精选证券是本基金投资策略的重点，本基金不积极谋求寻找市场的拐点，主要从控制系统性风险出发适度调整资产配置。
业绩比较基准	MSCI 中国指数（以美元计价）
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，属于中高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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	田青
	联系电话	021-38650891	010-67595096
	电子邮箱	wrxixi@hftfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		40088-40099	010-67595096
传真		021-33830166	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25 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	北京市西城区闹市口大街1 号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		张文伟	王洪章

**2.4 境外投资顾问和境外资产托管人**

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	BNP Paribas Asset Management UK Limited	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	法国巴黎资产管理英国有限公司	纽约梅隆银行
注册地址		5, Aldermanbury Square London EC2V 7BP, United Kingdom	One Wall Street New York , NY10286
办公地址		5, Aldermanbury Square London EC2V 7BP, United Kingdom	One Wall Street New York , NY10286
邮政编码		-	NY10286

**2.5 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	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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

## 2.6 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	8,591,890.48
本期利润	24,323,276.40
加权平均基金份额本期利润	0.2120
本期加权平均净值利润率	14.21%
本期基金份额净值增长率	15.50%
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	11,720,285.08
期末可供分配基金份额利润	0.1059
期末基金资产净值	173,910,124.61
期末基金份额净值	1.572
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	93.19%

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	份额净	业绩比较	业绩比	①—③	②—④
----	------	-----	------	-----	-----	-----

	增长率①	值增长率 率标准 差②	基准收益 率③	较基准 收益率 标准差 ④		
过去一个月	2.14%	0.84%	0.91%	0.77%	1.23%	0.07%
过去三个月	5.93%	0.79%	7.74%	0.73%	-1.81%	0.06%
过去六个月	15.50%	0.76%	17.38%	0.76%	-1.88%	0.00%
过去一年	24.47%	0.78%	32.97%	0.89%	-8.50%	-0.11%
过去三年	8.19%	1.99%	28.68%	1.30%	-20.49%	0.69%
自基金合同生 效起至今	93.19%	1.69%	14.48%	1.73%	78.71%	-0.04%

### 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

海富通中国海外精选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  
 (2008年6月27日至2017年6月30日)



注：1、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条（二）投资范围、（八）投资限制



中规定的各项比例；

2、本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国指数（美元计价），在与同期业绩进行比较时，该基准已经转换为与本基金相同的计价货币（人民币）。

## §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		
张炳炜	本基金的基金经理；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；海富通沪港深混合基金经理	2016-02-04	-	8 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。

卜正伦	本基金的基金经理；海富通大中华混合（QDII）基金经理	2016-08-16	-	12 年	中国籍，硕士，持有基金从业人员资格证书。历任永丰金证券、富邦证券、海富通资产管理（香港）有限公司分析师。2016 年 8 月起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。
-----	-----------------------------	------------	---	------	---

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Colin Walsh GRAHAM	法国巴黎资产管理(原法国巴黎投资管理)英国有限公司多重资产主动资产配置总监、首席投资官	21 年	英国国籍，伦敦布鲁内尔大学管理学和数学理学学士。历任 Mercer（美世咨询）精算顾问、BlackRock（贝莱德集团）全球多资产策略团队联席主管。2014 年 3 月起担任法国巴黎资产管理(原法国巴黎投资管理)多重资产主动资产配置总监、首席投资官。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年受惠于互通南下资金流入及公司普遍业绩预期向好，港股整体表现稳定且呈现强势向上趋势。除了南下资金在一季度增持的保险、内银之外，基本面佳的科网、汽车、医药等多个板块随著业绩提升、后续利好不断浮现，也有资金进行布局推动股价。而 2016 年四季度开始进入调整的中概股，也因季报公布后多数优于预期，随著港股及美股科网板块出现强劲涨势。由于科网股无论软、硬件，在一、二季度均陆续有推出新产品或接下新订单，整体气氛佳，也成为上半年最为强势的板块。

上半年由于全球宏观预期向好，资金偏向风险投资，新兴市场表现要优于发达国家市场，而中国海外股票由于上述因素，表现更优于整体新兴市场平均水平。报告期内本基金持续增加电子、保险等板块股票，调降原物料、工业、基建板块仓位。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 15.50%，同期业绩比较基准收益率 17.38%，基金净值跑输业绩比较基准 1.88 个百分点。跑输指数主要在于相对指数而言，基金低配了港股、中概股中涨幅最大的电子权值股票。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年港股及中概股走势的焦点在资金趋势，年初以来持续涌入的国内资金在险资陆续启动南下后将更为充沛。展望下半年，我们认为中国经济的韧性仍强，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；而 6 月份 PMI 指数在淡季更回升至 51.7%，超过市场预期。预计宏观经济以稳中分化为主，消费稳中升级，而进出口贸易、制造业投资等呈现温和复苏的态势；同时，物价方面总体平稳，PPI 缓慢下行，CPI 维持低位。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。

港股及中概股市场在 2017 年上半年与区内其他市场类似，呈现明显的价值偏好；下半年关注企业竞争力、业绩增长、估值合理的价值投资风格仍将延续。考虑到经济韧性仍强、资金利率维持平稳，业绩稳健、估值不高的蓝筹仍有不少投资价值，预计电子、汽车、保险等行业龙头均有机会在业绩上跑赢预期，为下半年可以继续积极挖掘的方向。

#### 4.7 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，并经本公司业务管理委员会批准后实施。

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。

本基金采用彭博（bloomberg）咨询系统提供的价格估值。

#### 4.8 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，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 60%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.9 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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

本托管人复核审查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。

### §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：海富通中国海外精选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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	33,129,443.73	46,910,838.13
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	141,115,104.39	120,542,177.87
其中：股票投资		141,115,104.39	120,542,177.87

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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,240.59	2,319.14
应收股利		921,006.93	-
应收申购款		136,425.07	27,600.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>175,303,220.71</b>	<b>167,482,935.84</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
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		-	1,586,974.58
应付赎回款		944,376.44	479,962.56
应付管理人报酬		213,730.48	220,671.61
应付托管费		49,870.46	51,490.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	185,118.72	372,930.56
<b>负债合计</b>		<b>1,393,096.10</b>	<b>2,712,029.38</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	110,654,460.91	121,037,728.10

未分配利润	6.4.7.10	63,255,663.70	43,733,178.36
<b>所有者权益合计</b>		<b>173,910,124.61</b>	<b>164,770,906.46</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>175,303,220.71</b>	<b>167,482,935.84</b>

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.572 元，基金份额总额 110,654,460.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通中国海外精选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 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>26,504,683.20</b>	<b>-12,016,452.32</b>
1.利息收入		17,152.53	9,881.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,152.53	9,881.01
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,572,544.71	-25,144,372.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,194,137.76	-27,179,314.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,378,406.95	2,034,941.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	15,731,385.92	12,877,766.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-826,871.63	230,495.30
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,471.67	9,777.23
<b>减：二、费用</b>		<b>2,181,406.80</b>	<b>1,416,457.65</b>
1. 管理人报酬		1,270,691.88	930,336.37



2. 托管费		296,494.74	217,078.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	428,470.41	74,330.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	185,749.77	194,712.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>24,323,276.40</b>	<b>-13,432,909.97</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>24,323,276.40</b>	<b>-13,432,909.97</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通中国海外精选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）	121,037,728.10	43,733,178.36	164,770,906.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,323,276.40	24,323,276.40
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）	-10,383,267.19	-4,800,791.06	-15,184,058.25
其中：1.基金申购款	3,795,795.30	1,905,551.25	5,701,346.55
2.基金赎回款	-14,179,062.49	-6,706,342.31	-20,885,404.80
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）	110,654,460.91	63,255,663.70	173,910,124.61

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 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）	102,384,429.05	40,735,034.07	143,119,463.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,432,909.97	-13,432,909.97
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）	16,675,244.21	4,015,611.62	20,690,855.83
其中：1.基金申购款	25,938,534.52	6,256,661.31	32,195,195.83
2.基金赎回款	-9,263,290.31	-2,241,049.69	-11,504,340.00
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）	119,059,673.26	31,317,735.72	150,377,408.98

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

海富通中国海外精选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”)证监基金字[2007]第 340 号《关于同意海富通中国海外精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，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《海富通中国海外精选混合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 508,724,605.42 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(2008)第 104 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通中国海外精选混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 6 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 508,856,821.43 份基金份额，其中认购资金利息折合 132,216.01 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，基金托管人为中国建设银行

股份有限公司，境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)，境外投资顾问为法国巴黎投资管理英国有限公司(BNP Paribas Investment Partners UK Limited)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通中国海外精选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，包括股票以及银行存款、现金等，以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其中股票投资以在香港、美国等海外证券交易所上市的具有“中国概念”的上市公司为主要投资对象。在正常市场情况下，本基金各类资产配置的比例范围是：股票占基金资产的 60%-100%，银行存款及现金等高流动性资产占基金资产的 0%-40%。本基金的业绩比较基准为：MSCI China 指数(以美元计价)。

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》、《海富通中国海外精选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 年半年度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 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税，对金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 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
活期存款	33,129,443.73
定期存款	-
其他存款	-
合计	33,129,443.73

注：于 2017 年 06 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为港币活期存款 22,734,598.52 元(折合人民币 19,729,099.13 元);美元 136.07 元(折合人民币 921.79 元)。

### 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	121,127,764.41	141,115,104.39	19,987,339.98
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	121,127,764.41	141,115,104.39	19,987,339.98

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 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	1,240.57
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,240.59

#### 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

本基金本报告期末应付交易费用无余额。

#### 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	648.95
预提费用	184,469.77
合计	185,118.72

**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	121,037,728.10	121,037,728.10
本期申购	3,795,795.30	3,795,795.30
本期赎回（以“-”号填列）	-14,179,062.49	-14,179,062.49
本期末	110,654,460.91	110,654,460.91

**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	3,778,473.49	39,954,704.87	43,733,178.36
本期利润	8,591,890.48	15,731,385.92	24,323,276.40
本期基金份额交易产生的变动数	-650,078.89	-4,150,712.17	-4,800,791.06
其中：基金申购款	268,971.94	1,636,579.31	1,905,551.25
基金赎回款	-919,050.83	-5,787,291.48	-6,706,342.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,720,285.08	51,535,378.62	63,255,663.70

**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	17,150.77
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	-
其他	1.76
合计	17,152.53

#### 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	109,069,368.36
减：卖出股票成本总额	98,875,230.60
买卖股票差价收入	10,194,137.76

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期末无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期末无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 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	1,378,406.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,378,406.95

#### 6.4.7.16 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	15,731,385.92
——股票投资	15,731,385.92
——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	15,731,385.92

#### 6.4.7.17 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	10,471.67
合计	10,471.67

注：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。

#### 6.4.7.18 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	428,470.41
银行间市场交易费用	-
合计	428,470.41

#### 6.4.7.19 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	35,704.06
信息披露费	148,765.71
其他	200.00
银行汇划费	1,080.00
合计	185,749.77



## 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司(“纽约梅隆银行”)	基金境外资产托管人
海通国际证券集团有限公司(“海通国际证券”)	海通证券间接控股子公司

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

本基金本报告期及上年度可比期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

本基金本报告期及上年度可比期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

本基金本报告期及上年度可比期间未有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1日至2016年6 月30日

当期发生的基金应支付的管理费	1,270,691.88	930,336.37
其中：支付销售机构的客户维护费	240,300.28	248,588.64

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 1.5% 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。

#### 6.4.10.2 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1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	296,494.74	217,078.53

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.35% 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 0.35% / 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通过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

份额单位：份

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1日至2016年6月 30日
报告期初持有的基金份额	10,007,100.00	10,007,100.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,007,100.00	10,007,100.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	9.04%	8.41%

##### 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

本基金本报告期末及上年度末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 1 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
中国建设银行	13,417,019.61	17,150.77	26,765,025.89	8,874.27
纽约梅隆银行	19,712,424.12	-	24,103,744.05	-
合计	33,129,443.73	17,150.77	50,868,769.94	8,874.27

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管,其中由中国建设银行保管的银行存款按适用利率计息,由纽约梅隆银行保管的银行存款不计息。

#### 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期间未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

本基金本报告期内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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票以及银行存款、现金等，以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。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建设银行以及境外次托管行纽约梅隆银行，与该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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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 06 月 30 日，本基金未持有债券(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所持金融工具变现的难易程度。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。本基金投资于同一机构发行的证券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同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约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。

### 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	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	13,417,019.61	-	-	19,712,424.12	33,129,443.73
交易性金融资产	-	-	-	141,115,104.39	141,115,104.39
应收利息	-	-	-	1,240.59	1,240.59
应收股利	-	-	-	921,006.93	921,006.93
应收申购款	10.00	-	-	136,415.07	136,425.07
<b>资产总计</b>	<b>13,417,029.61</b>			<b>161,886,191.10</b>	<b>175,303,220.71</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	944,376.44	944,376.44
应付管理人报酬	-	-	-	213,730.48	213,730.48
应付托管费	-	-	-	49,870.46	49,870.46
其他负债	-	-	-	185,118.72	185,118.72
<b>负债总计</b>				<b>1,393,096.10</b>	<b>1,393,096.10</b>
利率敏感度缺口	13,417,029.61	-	-	160,493,095.00	173,910,124.61
<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	9,029,445.89	-	-	37,881,392.24	46,910,838.13
交易性金融资产	-	-	-	120,542,177.87	120,542,177.87
应收利息	-	-	-	2,319.14	2,319.14
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	27,600.70	27,600.70
<b>资产总计</b>	<b>9,029,445.89</b>			<b>158,453,489.95</b>	<b>167,482,935.84</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	1,586,974.58	1,586,974.58
应付赎回款	-	-	-	479,962.56	479,962.56

应付管理人报酬	-	-	-	220,671.61	220,671.61
应付托管费	-	-	-	51,490.07	51,490.07
其他负债	-	-	-	372,930.56	372,930.56
负债总计	-	-	-	2,712,029.38	2,712,029.38
利率敏感度缺口	9,029,445.89	-	-	155,741,460.57	164,770,906.46

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 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券，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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

下表统计了本基金于 2017 年 6 月 30 日资产负债表项目面临的外汇风险敞口，各原币资产和负债的账面价值已折合为人民币金额。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	921.79	19,729,099.13	19,730,020.92
交易性金融资产	26,597,615.39	114,517,489.00	141,115,104.39
应收股利	-	921,006.93	921,006.93
应收利息	-	2.93	2.93
<b>资产合计</b>	<b>26,598,537.18</b>	<b>135,167,597.99</b>	<b>161,766,135.17</b>
以外币计价			

的负债				
应付证券清算款	-	-	-	
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	<b>26,598,537.18</b>	<b>135,167,597.99</b>	-	<b>161,766,135.17</b>
项目	上年度末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币		合计
以外币计价的资产				
银行存款	23.38	37,881,613.09		37,881,636.47
交易性金融资产	5,248,950.41	115,293,227.46		120,542,177.87
应收股利	-	-		-
应收利息	-	-		-
资产合计	<b>5,248,973.79</b>	<b>153,174,840.55</b>		<b>158,423,814.34</b>
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	1,586,974.58		1,586,974.58
负债合计	-	<b>1,586,974.58</b>		<b>1,586,974.58</b>
资产负债表 外汇风险敞口净额	<b>5,248,973.79</b>	<b>151,587,865.97</b>		<b>156,836,839.76</b>

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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. 所有外币相对人民币贬值5%	减少约 809	减少约 784
	2. 所有外币相对人民币升值5%	增加约 809	增加约 784



注：影响金额为约数,精确到万元。

#### 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的股票，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其他价格风险。

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占基金资产的 60%-100%，银行存款及现金等高流动性资产占基金资产的 0%-40%。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	141,115,104.39	81.14	120,542,177.87	73.16
交易性金融资产—基金 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券 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	141,115,104.39	81.14	120,542,177.87	73.16
----	----------------	-------	----------------	-------

#### 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 554	增加约 557
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 554	减少约 557

影响金额为约数,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	141,115,104.39	80.50
	其中：普通股	114,517,489.00	65.33
	存托凭证	26,597,615.39	15.17
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	33,129,443.73	18.90
8	其他各项资产	1,058,672.59	0.60
9	合计	175,303,220.71	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	114,517,489.00	65.85
美国	26,597,615.39	15.29
合计	141,115,104.39	81.14

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
信息技术	62,189,045.40	35.76
金融	23,254,019.83	13.37
非日常生活消费品	20,672,337.66	11.89
工业	11,010,654.51	6.33
医疗保健	10,374,556.65	5.97
房地产	6,351,432.88	3.65
能源	4,527,749.84	2.60
日常消费品	2,735,307.62	1.57
合计	141,115,104.39	81.14

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国 家(地区)	数量 (股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证 券交易 所	中国香港	72,000	17,444,875.57	10.03
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	美国证 券交易 所	美国	15,000	14,317,694.39	8.23
3	SUNNY OPTICAL	舜宇光学科技(集团)有限	2382 HK	香港证 券交易 所	中国香港	150,000	9,111,906.71	5.24

	TECH	公司						
4	CHINA MERCH ANTS BANK- H	招商银行 股份有限 公司	3968 HK	香港证 券交易 所	中国香港	350,000	7,152,846.77	4.11
5	AAC TECHN OLOGIES HOLDI NGS IN	瑞声科技 控股有限 公司	2018 HK	香港证 券交易 所	中国香港	70,000	5,928,813.97	3.41
6	GEELY AUTO MOBIL E HOLDI NGS LT	吉利汽车 控股有限 公司	175 HK	香港证 券交易 所	中国香港	400,000	5,845,505.11	3.36
7	CHINA SOFT INTER NATIO NAL LTD	中软国际 有限公司	354 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,500,000	5,389,041.97	3.10
8	MINTH GROUP LTD	敏实集团 有限公司	425 HK	香港证 券交易 所	中国香港	180,000	5,170,356.21	2.97
9	NETEA SE.CO M INC-AD R	网易公司	NTES US	美国证 券交易 所	美国	2,500	5,091,469.68	2.93
10	SHENZ HEN INTL HOLDI NGS	深圳国际	152 HK	香港证 券交易 所	中国香港	400,000	4,970,762.06	2.86
11	CSPC PHARM ACEUT ICAL GROUP LT	石药集团	1093 HK	香港证 券交易 所	中国香港	450,000	4,451,817.28	2.56
12	LONGF OR	龙湖地产	960 HK	香港证 券交易	中国香港	300,000	4,368,508.42	2.51

	PROPERTIES			所				
13	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	4,139,409.05	2.38
14	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	3,905,102.88	2.25
15	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国工商银行股份有限公司、	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	850,000	3,887,312.96	2.24
16	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	80,000	3,571,867.43	2.05
17	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国际集团有限公司	3311 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000	3,478,144.96	2.00
18	JD.COM INC-ADR	京东	JD US	美国证券交易所	美国	13,000	3,453,995.58	1.99
19	WH GROUP LTD	万洲国际	288 HK	香港证券交易所	中国香港	400,000	2,735,307.62	1.57
20	KINGS OFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	2,648,961.45	1.52
21	CHINA PETROLEUM & CHEMI	中国石化	386 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	2,642,452.95	1.52

	CAL-H							
22	CHINA COSCO HOLDI NGS-H	中远海控	1919 HK	香港证 券交易 所	中国香港	800,000	2,561,747.49	1.47
23	BRILLI ANCE CHINA AUTO MOTIV E	华晨中国 汽车控股 有限公司	1114 HK	香港证 券交易 所	中国香港	200,000	2,468,025.02	1.42
24	AGRIC ULTUR AL BANK OF CHINA- H	农业银行	1288 HK	香港证 券交易 所	中国香港	750,000	2,401,638.27	1.38
25	KINGD EE INTER NATIO NAL SFTWR	金蝶国际 软件集团 有限公司	268 HK	香港证 券交易 所	中国香港	800,000	2,256,281.66	1.30
26	CITIC SECURI TIES CO LTD-H	中信证券 股份有限 公司	6030 HK	香港证 券交易 所	中国香港	150,000	2,100,945.35	1.21
27	SHANG HAI PHARM ACEUT ICALS- H	上海医药	2607 HK	香港证 券交易 所	中国香港	100,000	2,017,636.49	1.16
28	CHINA OVERS EAS LAND & INVEST	中国海外 发展	688 HK	香港证 券交易 所	中国香港	100,000	1,982,924.46	1.14
29	NEW ORIENT AL EDUCA	新东方教 育科技集 团	EDU US	美国证 券交易 所	美国	4,000	1,910,109.82	1.10

	TIO-SP ADR							
30	CHINA SHENH UA ENERG Y CO-H	中国神华	1088 HK	香港证 券交易 所	中国香港	125,000	1,885,296.89	1.08
31	CTrip. COM INTER NATIO	CTrip.co m 国际有 限公司	CTRP US	美国证 券交易 所	美国	5,000	1,824,345.92	1.05

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	11,265,946.66	6.84
2	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 HK	6,244,116.22	3.79
3	CHINA COSCO HOLDINGS-H	1919 HK	5,138,851.94	3.12
4	NETEASE INC-ADR	NTES US	4,860,300.27	2.95
5	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	4,830,245.41	2.93
6	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	4,748,964.89	2.88
7	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	4,143,645.41	2.51
8	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	3,959,764.47	2.40
9	IND & COMM BK OF CHINA-H	1398 HK	3,801,628.45	2.31
10	LONGFOR PROPERTIES	960 HK	3,673,666.60	2.23
11	NEW CHINA LIFE	1336 HK	3,534,738.62	2.15



	INSURANCE C-H			
12	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	3,274,803.97	1.99
13	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	2,871,480.99	1.74
14	JD.COM INC-ADR	JD US	2,842,790.95	1.73
15	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	2039 HK	2,749,474.18	1.67
16	WH GROUP LTD	288 HK	2,709,051.95	1.64
17	SINOTRUK HONG KONG LTD	3808 HK	2,706,573.95	1.64
18	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	548 HK	2,688,337.84	1.63
19	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	257 HK	2,648,822.04	1.61
20	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	2,569,569.75	1.56

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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	525 HK	7,896,162.50	4.79
2	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	7,696,076.84	4.67
3	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	6,260,440.07	3.80
4	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	1513 HK	5,709,131.54	3.46
5	BBMG CORP-H	2009 HK	5,415,022.94	3.29
6	CHINA MOBILE LTD	941 HK	5,279,497.69	3.20
7	SUN ART RETAIL GROUP LTD	6808 HK	4,804,420.50	2.92
8	COGOBUY GROUP	400 HK	4,548,690.95	2.76
9	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	4,041,192.82	2.45
10	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	3,981,620.19	2.42
11	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	3,763,590.51	2.28
12	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	3,499,171.84	2.12
13	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	1385 HK	3,483,838.58	2.11
14	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1800 HK	3,249,056.92	1.97
15	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	3,230,824.83	1.96

16	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	3,189,666.29	1.94
17	SINOTRUK HONG KONG LTD	3808 HK	2,589,540.18	1.57
18	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	2,539,957.92	1.54
19	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	2039 HK	2,423,715.16	1.47
20	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	548 HK	2,394,696.29	1.45

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	103,761,966.61
卖出收入（成交）总额	109,069,368.36

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券资产。

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金资产。

### 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1** 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

**7.11.2** 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.11.3 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	921,006.93
4	应收利息	1,240.59
5	应收申购款	136,425.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,058,672.59

**7.11.4 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可转换债券。

**7.11.5 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不存在流通受限情况。

**§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
5,826	18,993.21	42,054,475.54	38.01%	68,599,985.37	61.99%

**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	33,095.65	0.0299%

**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（2008 年 6 月 27 日）基金 份额总额	508,856,821.43
本报告期期初基金份额总额	121,037,728.10
本报告期基金总申购份额	3,795,795.30
减：本报告期基金总赎回份额	14,179,062.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	110,654,460.91

**§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	
China Merchants Sec(HK) Limited	-	81,653,238.07	38.37%	81,653.23	35.98%	-
UBS Securities Asia Limited	-	45,411,227.47	21.34%	45,411.24	20.01%	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	38,784,540.33	18.22%	36,781.97	16.21%	-
CITIC Securities International Company Limited	-	16,799,888.31	7.89%	20,159.86	8.88%	-
ICBC International Holdings Limited	-	9,931,000.32	4.67%	9,931.01	4.38%	-
Credit Suisse	-	7,643,680.36	3.59%	15,287.34	6.74%	-

(Hong Kong) Ltd						
BOCOM International Securities Limited	-	5,775,400.30	2.71%	8,663.11	3.82%	-
CCB International Securities Limited	-	4,454,860.05	2.09%	6,682.29	2.94%	-
UOB KAY HIAN (Hong Kong) Limited	-	2,377,499.75	1.12%	2,377.50	1.05%	-
CHINA INDUSTRIA L SECURITIE S INTERNATI ONAL BROKERAG E LIMITED	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank A.G. London	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities(H K) Limited	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-
ShenYin WanGuo (H.K.)Limite d	-	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIE S CO., LTD.	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-
CICC HK	-	-	-	-	-	-

SEC. Limited							
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities(Ho ng Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Group	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY CO. INTERNATI ONAL PLC	-	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-

注：1. 报告期内本基金新租用券商兴证国际 CHINA INDUSTRIAL SECURITIES INTERNATIONAL BROKERAGE LIMITED 的交易单元。

## 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
China Merchants Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC	-	-	-	-	-	-	-	-



Securities International Company Limited								
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UO	-	-	-	-	-	-	-	-

B KAY HIA N (Hon g Kon g) Limi ted								
CHI NA IND UST RIA L SEC URI TIE S INT ERN ATI ON AL BRO KER AGE LIM ITE D	-	-	-	-	-	-	-	-
Deut sche Ban k A.G. Lon don	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Ever brig ht Secu rities	-	-	-	-	-	-	-	-

(HK ) Limi ted									
First Shan ghai Secu rities Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Shen Yin Wan Guo (H.K )Li mite d	-	-	-	-	-	-	-	-	-
YU ANT A SEC URI TIE S CO., LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Nom ura Secu rities (HK ) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CIC C HK SEC. Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Hait ong Inter natio nal	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Secu rities Grou p Limi ted								
BOC I Secu rity Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Pari bas Secu rities (Asi a) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Guo du Secu rities (Hon g Kon g) Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
CLS A Grou p	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Mor gan Secu rities (Asi a Pacif ic) Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI	-	-	-	-	-	-	-	-

Asia Limited								
MORGAN STANLEY CO. INTERNATIONAL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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 QDII 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》	2017-01-04
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	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-18

	率优惠活动的公告		
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继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-23
10	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
11	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》	2017-03-21
12	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
13	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
14	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
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发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》	2017-04-07
16	海富通中国海外精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-11
17	海富通旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-22
18	海富通中国海外精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-28
19	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

20	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
21	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
22	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
23	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
24	海富通旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-30

## §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中国海外精选混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通中国海外精选混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通中国海外精选混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通中国海外精选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）报告期内海富通中国海外精选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