

海富通双福分级债券型证券投资基金
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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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的真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
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	19
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
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	41
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	41
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	42

§8 基金份额持有人信息.....	43
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开放式基金份额总量区间的情况.....	错误！未定义书签。
§9 开放式基金份额变动.....	44
§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.....	45
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.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通双福分级债券型证券投资基金	
基金简称	海富通双福分级债券	
基金主代码	519059	
交易代码	519059	
基金运作方式	契约型，本基金以“运作周期滚动”的方式运作。双福 A 自每个运作周期起始日起每满 6 个月设一个开放期，双福 B 在任一运作周期内封闭运作，不上市交易。运作周期届满，在满足本基金合同约定的条件下，本基金将转换为“海富通双福债券型证券投资基金”；不满足条件时，本基金将进入过渡期，过渡期结束将进入下一运作周期。	
基金合同生效日	2014 年 5 月 6 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	111,555,151.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	海富通双福分级债券 A	海富通双福分级债券 B
下属两级基金的交易代码	519057	519058
报告期末下属分级基金的份额总额	14,492,864.22 份	97,062,287.25 份

2.2 基金产品说明

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

	型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	双福 A 将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	双福 B 则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张文伟	田国立

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	-9,529,546.93
本期利润	-4,320,080.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0353
本期加权平均净值利润率	-4.08%
本期基金份额净值增长率	-5.89%
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	12,846,992.64
期末可供分配基金份额利润	0.1152
期末基金资产净值	93,431,130.75
期末基金份额净值	0.838
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	18.10%

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

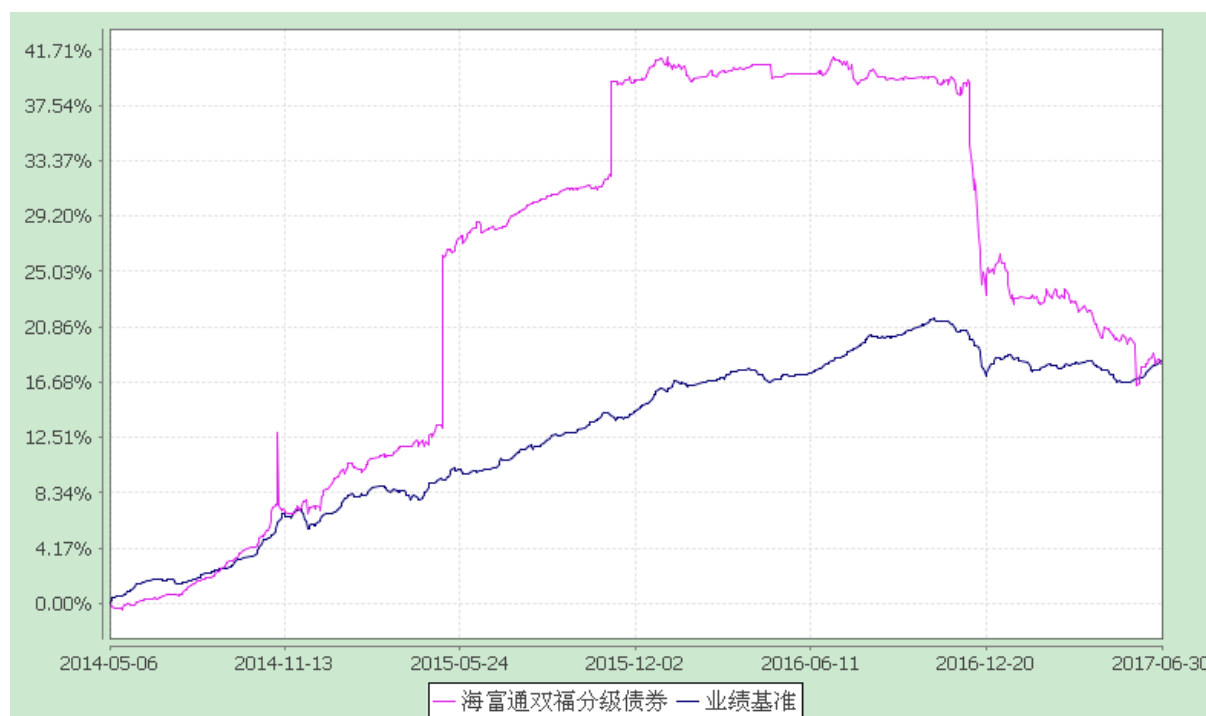
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.24%	0.55%	1.20%	0.05%	-2.44%	0.50%
过去三个月	-3.18%	0.37%	0.13%	0.07%	-3.31%	0.30%

过去六个月	-5.89%	0.31%	-0.20%	0.07%	-5.69%	0.24%
过去一年	-15.78%	0.42%	0.17%	0.09%	-15.95%	0.33%
过去三年	17.52%	0.60%	16.07%	0.09%	1.45%	0.51%
自基金合同生效起至今	18.10%	0.59%	18.27%	0.09%	-0.17%	0.50%

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

海富通双福分级债券型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2014 年 5 月 6 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2014 年 5 月 6 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

3.3 其他指标

其他指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
双福 A 与双福 B 基金份额配比	1:0.14931509066
期末双福 A 份额参考净值	1.003

期末双福 A 份额累计参考净值	1.13
期末双福 B 份额参考净值	0.813
期末双福 B 份额累计参考净值	1.244
双幅 A 的预计年收益率	3.80%

§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		
谈云飞	本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通货币基金经理；海富通养老收益混合基金经理；海富通双利债券基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通欣盛定开混合基	2016-04-22	2017-06-30	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月任海富通纯债债券、海富通双福分级债券、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通养老收益混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合和海富通欣盛定开混合基金经理。

	金经理。				
何谦	本基金的基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通双利债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通集利债券基金经理	2016-05-06	-	6 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任平安银行资金交易员，华安基金管理有限公司债券交易员，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，任海富通货币基金经理助理。2016 年 5 月起任海富通纯债债券、海富通双福分级债券、海富通双利债券及海富通货币基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通集利债券基金经理。
夏妍妍	本基金的基金经理助理；海富通纯债债券基金经理助理；海富通双利债券基金经理助理；海富通养老收益混合基金经理助理；海富通一年定开债券基金经理助理；海富通欣益混合基金经理助理。	2016-01-04	-	2 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，任固定收益分析师。2016 年 1 月起任海富通双利债券、海富通双福分级债券、海富通养老收益混合、海富通一年定开债券、海富通纯债债券的基金经理助理。2017 年 4 月起任海富通欣益混合的基金经理助理。

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

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，检验结果表明，在 T 日、T+3 日和 T+5 日不同循环期内，不管是买入或是卖出，公司各组合间买卖价差并不显著，表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待，不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债券市场延续跌势，利率呈现“快速上行—修复—再次上行—再修复”的波浪式上升。10 年期国债收益率从年初的 3.0% 抬升至半年末的 3.57%，而“紧货币”和“严监管”分别成为一、二季度利率快速上升的主要推手。具体来看，一季度经济复苏的态势不减，PPI 向上带动企业持续补库存，同时三四线地产销售火爆，地产和基建投资均维持高位。经济的企稳回升给予了政策一定的空间，为了稳汇率、去杠杆一季度货币政策出现明显的收紧。央行于 1 月下旬上调 MLF 利率为近几年来首次提高政策利率，随后又多次上调公开市场逆回购及其他货币工具利率，市场流动性趋紧，资金利率中枢逐月抬升。一季度监管也有趋严之势，但并未全面铺开，传闻中的同业存单、同业理财新规也是迟迟未落地，存单发行量居高不下，市场从担忧转为麻木。基于此，一季度利率先上后下，上行主要源于货币收紧，而下行则是对悲观预期的修复。进入二季度，各项经济数据依然平稳，尤其是公布的一季度 GDP 增速达 6.9% 远高于市场预期。在这种情况下监管出现全面升级，银监会连续出台包括 6 号文、46 号文、53 号文在内的多个文件，以限制同业、理财业务的套利和资金空转行为，证监会也出台政策加强对券商资管资金池产品的监管。由此金融去杠杆转为行政去杠杆阶段，市场悲观情绪再起，抛压严重。四月 10 年期国债收益率一路上行超过 40BP，五月上旬达到高点的 3.69%，随后维持高位震荡直到六月。为了应对半年末流动性和下半年可能出现的经济下滑，六月央行货币

政策操作从“偏紧”转为“中性”，监管态度亦有所缓和，利率再度迎来一波修复。纵观整个上半年表现，1 年期国债收益率上行 81BP，10 年期国债收益率上行 56BP，3 年期 AA+ 中短期票据收益率上行约 49BP，期限利差极度压缩，信用利差走扩。

报告期，本基金采用了短久期，类现金化操作的方式，主要资产品种包含：回购、利率债、大额存单等，同时由于创业板指数的下跌，导致权益部分表现不佳，对组合有一定影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值收益率为-5.89%，同期业绩比较基准收益率为-0.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

未来，本基金将继续严格按照基金合同的要求，择机拉长久期，提高高等级信用债占比，适度配置高等级存单，结合资金面变化投放存款或者回购。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有 3 年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以

便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总裁办公会批准后实施。

基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，每一运作周年内，本基金（包括双福 A 和双福 B）不进行收益分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通双福分级债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：海富通双福分级债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,084.30	114,262.21
结算备付金		727,952.33	5,618,341.05
存出保证金		25,176.73	82,418.67
交易性金融资产	6.4.7.2	84,348,882.22	177,134,006.00
其中：股票投资		8,986,891.32	21,937,187.00
基金投资		-	-
债券投资		75,361,990.90	155,196,819.00
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	8,000,000.00	-
应收证券清算款		6,274,849.00	-
应收利息	6.4.7.5	1,480,377.21	1,809,781.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		100,862,321.79	184,758,809.68
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		900,000.00	72,800,000.00

应付证券清算款		6,279,545.66	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		54,168.17	71,288.08
应付托管费		15,476.60	20,368.01
应付销售服务费		4,434.80	10,102.46
应付交易费用	6.4.7.7	8,964.31	182,105.96
应交税费		-	-
应付利息		-	14,088.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	168,601.50	340,000.00
负债合计		7,431,191.04	73,437,952.63
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	80,584,138.11	92,551,227.02
未分配利润	6.4.7.10	12,846,992.64	18,769,630.03
所有者权益合计		93,431,130.75	111,320,857.05
负债和所有者权益总计		100,862,321.79	184,758,809.68

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.003 元，B 类基金份额净值 0.813 元，基金份额总额 111,555,151.47 份，其中 A 类基金份额 14,492,864.22 份，B 类基金份额 97,062,287.25 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通双福分级债券型证券投资基金

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
一、收入		-3,104,553.89	-527,851.33
1.利息收入		1,071,514.09	4,072,473.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,548.57	86,460.43
债券利息收入		1,006,498.89	3,715,632.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		19,466.63	270,380.48

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,385,534.22	-3,253,477.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,203,420.66	-2,812,717.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-6,190,223.72	-440,760.30
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	8,110.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,209,466.24	-1,346,846.65
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	-	-
减：二、费用		1,215,526.80	1,305,590.84
1. 管理人报酬		368,374.08	715,940.13
2. 托管费		105,249.66	204,554.36
3. 销售服务费		44,742.93	66,936.46
4. 交易费用	6.4.7.19	205,300.79	103,534.31
5. 利息支出		300,136.75	18,655.88
其中：卖出回购金融资产支出		300,136.75	18,655.88
6. 其他费用	6.4.7.20	191,722.59	195,969.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,320,080.69	-1,833,442.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,320,080.69	-1,833,442.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通双福分级债券型证券投资基金

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)	92,551,227.02	18,769,630.03	111,320,857.05
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-4,320,080.69	-4,320,080.69
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)	-11,967,088.91	-1,602,556.70	-13,569,645.61
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-11,967,088.91	-1,602,556.70	-13,569,645.61
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)	80,584,138.11	12,846,992.64	93,431,130.75
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)	177,717,529.20	70,382,301.59	248,099,830.79
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-1,833,442.17	-1,833,442.17
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)	8,520,418.70	-27,879,220.85	-19,358,802.15
其中：1.基金申购款	119,229,430.29	15,656,349.60	134,885,779.89
2.基金赎回款	-110,709,011.59	-43,535,570.45	-154,244,582.04
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	186,237,947.90	40,669,638.57	226,907,586.47

(基金净值)			
--------	--	--	--

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

海富通双福分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 193 号《关于核准海富通双福分级债券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《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 507,306,330.75 元，业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(2014)第 234 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 507,427,323.76 份，其中认购资金利息折合 120,993.01 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》和《海富通双福分级债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金通过基金资产及收益的不同分配安排，将基金份额分成预期收益与预期风险不同的两个类别，即双福 A 和双福 B。双福 A 根据基金合同的规定获取约定收益，双福 A 自基金合同生效日起每满 6 个月开放一次，在双福 A 的单独开放日，基金管理人将对双福 A 进行基金份额折算，双福 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的双福 A 份额数按折算比例相应增减；本基金在扣除双福 A 的本金及应计收益后的全部剩余资产归双福 B 享有，亏损以双福 B 的资产净值为限由双福 B 首先承担，双福 B 在任一运作周年内封闭运作，不上市交易，仅在每个运作周年到期日开放一次。本基金双福 A 与双福 B 的份额初始配比原则上为 7：3。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类资产及债券等固定收益类金融工具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)。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%，在每个双福 A 的赎回开放日前 20 个工作日

和后 20 个工作日期间不受前述投资组合比例的限制。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。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。

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》、《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半年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
活期存款	5,084.30
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,084.30

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	9,616,722.56	8,986,891.32	-629,831.24	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	75,715,788.38	75,361,990.90	-353,797.48
	银行间市场	-	-	-

	合计	75,715,788.38	75,361,990.90	-353,797.48
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	85,332,510.94	84,348,882.22	-983,628.72

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	8,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	8,000,000.00	-

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	18.22
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	294.84
应收债券利息	1,483,170.69
应收买入返售证券利息	-3,116.71
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.17
合计	1,480,377.21

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	8,964.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,964.31

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	-
预提费用	168,601.50
合计	168,601.50

6.4.7.9 实收基金

海富通双福分级债券 A

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	账面金额
上年度末	27,539,990.39	24,745,225.66
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-基金拆分/份额折算前	27,539,990.39	24,745,225.66
基金拆分/份额折算调整	269,503.46	—
本期赎回（以“-”号填列）	-13,316,629.63	-11,967,088.91

本期末	14,492,864.22	12,778,136.75
-----	---------------	---------------

海富通双福分级债券 B

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	账面金额
上年度末	97,062,287.25	67,806,001.36
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	97,062,287.25	67,806,001.36

注：1.申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2.根据《海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以 2 年为一个运作周期，第一个运作周期的起始日为基金合同生效日，到期日为基金合同生效日次 2 个公历年的对日。如该日为非工作日或该公历年不存在对日，则到期日为该日之前的最后一个工作日。本基金第一个运作周期后的各运作周期自本基金公告的运作周期起始之日起至 2 个公历年的对日止，如该对日为非工作日或该公历年不存在对日，则到期日为该日前的最后一个工作日。因此，本基金的第一个运作周期自 2014 年 5 月 6 日开始至 2016 年 5 月 6 日止。

根据基金合同的规定，在任一运作周期内，若该运作周期到期日前第 30 日，基金资产净值低于 2 亿元，本基金在该运作周期届满后将转换为“海富通双福债券型证券投资基金”，无须召开持有人大会。不满足上述条件时，本基金将进入下一运作周期之前的过渡期。由于本基金在 2016 年 4 月 6 日（即第一个运作周期到期日前第 30 日）基金资产净值不低于 2 亿元，因此本基金在第一个运作周期结束后将进入下一运作周期之前的过渡期。运作周期到期后的次一工作日起至下一运作周期起始日前一工作日的时间为过渡期，最长不超过 20 个工作日。本次过渡期的时间为 2016 年 5 月 9 日（含）至 2016 年 6 月 3 日（含）。2016 年 6 月 4 日为第二个运作周期的起始日。基金管理人在过渡期内办理本基金的份额折算确认、双福 B 份额的申购、赎回以及和双福 A 份额的申购等事宜。

3. 本基金本年内进行了一次份额折算。根据《海富通双福分级债券型证券投资基金份额折算结果公告》及《海富通双福分级债券型证券投资基金申购与赎回结果及双福 A 折算结果公告》，本基金于 2017 年 06 月 02 日进行了基金份额折算。2017 年 6 月 2 日，折

算后双福 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，双福 A 的折算比例为 1.01894795。折算前，双福 A 的基金份额净值为 1.019 元，双福 A 的基金总份额为 14,223,360.76 份，折算后，双福 A 的基金总份额为 14,492,864.22 份。海富通基金已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并进行了变更登记。

4. 截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金 A 类份额 14,492,864.22 份全部为场外份额；本基金 B 类部分份额为 97,062,287.25 份全部为场外份额。

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	25,633,483.68	-6,863,853.65	18,769,630.03
本期利润	-9,529,546.93	5,209,466.24	-4,320,080.69
本期基金份额交易产生的变动数	-2,393,253.43	790,696.73	-1,602,556.70
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2,393,253.43	790,696.73	-1,602,556.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,710,683.32	-863,690.68	12,846,992.64

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	22,343.66
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	22,804.63
其他	400.28
合计	45,548.57

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	85,823,657.54
减：卖出股票成本总额	89,027,078.20
买卖股票差价收入	-3,203,420.66

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	224,163,015.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	227,033,500.87
减：应收利息总额	3,319,737.86
买卖债券差价收入	-6,190,223.72

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	8,110.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,110.16

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	5,209,466.24
——股票投资	560,185.71
——债券投资	4,649,280.53

——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	5,209,466.24

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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	205,300.79
银行间市场交易费用	-
合计	205,300.79

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	138,848.72
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	800.00
银行划款手续费	4,321.09
合计	191,722.59

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内及上年度可比期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1日至2016 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	368,374.08	715,940.13
其中：支付销售机构的客户维护 费	41,435.64	20,243.02

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 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年 6月30日	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	105,249.66	204,554.36

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通双福分级 债券 A	海富通双福分级债券 B	合计
中国银行	40,270.18	-	40,270.18
海通证券	1.53	-	1.53
海富通	12.73	-	12.73
合计	40,284.44	-	40,284.44
获得销售服务费的 各关联方名称	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销售服务费		
	海富通双福分级 债券A	海富通双福分级债券 B	合计
中国银行	40,727.87	-	40,727.87
海通证券	0.27	-	0.27
海富通	16,314.96	-	16,314.96
合计	57,043.10	-	57,043.10

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类份额对应的基金资产净值的年费率 0.35% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付给海富通基金管理有限公司，再由海富通基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 A 类份额对应的基金资产净值 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

单位：人民币元

上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	10,052,247.92	-	-	-	-

注：本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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
中国银行	5,084.30	22,343.66	7,904,659.33	77,215.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 900,000.00 元，于 2017 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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相对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“相对收益高、风险适中”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。

6.4.12.2 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招商银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	66,455,322.50	70,000,000.00
合计	66,455,322.50	70,000,000.00

注：未评级部分为超短期融资券。

6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
--------	-------------------	--------------------

AAA	8,906,668.40	30,828,575.00
AAA 以下	-	54,368,244.00
未评级	-	-
合计	8,906,668.40	85,196,819.00

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

6.4.12.3 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。

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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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、结算备付金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 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	5,084.30	-	-	-	5,084.30
结算备付金	727,952.33	-	-	-	727,952.33
存出保证金	25,176.73	-	-	-	25,176.73
交易性金融资产	66,714,972.50	8,647,018.40	-	8,986,891.32	84,348,882.22
买入返售金融资产	-	-	-	8,000,000.00	8,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,480,377.21	1,480,377.21
应收证券清算款	-	-	-	6,274,849.00	6,274,849.00
资产总计	67,473,185.86	8,647,018.40	-	24,742,117.53	100,862,321.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,279,545.66	6,279,545.66
应付管理人报酬	-	-	-	54,168.17	54,168.17
应付托管费	-	-	-	15,476.60	15,476.60
应付交易费用	-	-	-	8,964.31	8,964.31
应付销售服务费	-	-	-	4,434.80	4,434.80
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	168,601.50	168,601.50
卖出回购金融资产款	900,000.00	-	-	-	900,000.00
负债总计	900,000.00	-	-	6,531,191.04	7,431,191.04
利率敏感度缺口	66,573,185.86	8,647,018.40	-	18,210,926.49	93,431,130.75
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	114,262.21	-	-	-	114,262.21
结算备付金	5,618,341.05	-	-	-	5,618,341.05
存出保证金	82,418.67	-	-	-	82,418.67
交易性金融资产	75,660,500.00	60,782,719.00	18,753,600.00	21,937,187.00	177,134,006.00
应收利息	-	-	-	1,809,781.75	1,809,781.75
资产总计	81,475,521.93	60,782,719.00	18,753,600.00	23,746,968.75	184,758,809.68
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	71,288.08	71,288.08
应付托管费	-	-	-	20,368.01	20,368.01
应付交易费用	-	-	-	182,105.96	182,105.96
应付销售服务费	-	-	-	10,102.46	10,102.46
应付利息	-	-	-	14,088.12	14,088.12
其他负债	-	-	-	340,000.00	340,000.00
卖出回购金融资产款	72,800,000.00	-	-	-	72,800,000.00
负债总计	72,800,000.00	-	-	637,952.63	73,437,952.63
利率敏感度缺口	8,675,521.93	60,782,719.00	18,753,600.00	23,109,016.12	111,320,857.05

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。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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
	市场利率上升 25 个基点	减少约 10	减少约 87

	点		
	市场利率下降 25 个基点	增加约 10	增加约 89

注：影响金额为约数,精确到万元。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%。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。

6.4.12.4.3.1 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	8,986,891.32	9.62	21,937,187.00	19.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	75,361,990.90	80.66	-	-
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	84,348,882.22	90.28	21,937,187.00	19.71

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(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 75	增加约 10
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 75	减少约 10

注：影响金额为约数，精确到万元。

6.4.13 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	8,986,891.32	8.91
	其中：股票	8,986,891.32	8.91
2	固定收益投资	75,361,990.90	74.72
	其中：债券	75,361,990.90	74.72
	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	8,000,000.00	7.93
	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	733,036.63	0.73
7	其他各项资产	7,780,402.94	7.71
8	合计	100,862,321.79	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	4,648,497.00	4.98
C	制造业	4,338,394.32	4.64
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

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	8,986,891.32	9.62

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	002371	北方华创	181,371	4,338,394.32	4.64
2	600489	中金黄金	233,000	2,336,990.00	2.50
3	600547	山东黄金	79,900	2,311,507.00	2.47

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	600489	中金黄金	13,910,834.00	12.50
2	600547	山东黄金	11,895,809.00	10.69
3	600999	招商证券	8,671,436.79	7.79
4	000063	中兴通讯	7,349,430.00	6.60
5	601788	XD 光大证	6,576,876.00	5.91

6	300038	梅泰诺	6,566,995.61	5.90
7	002371	北方华创	6,155,696.71	5.53
8	300058	蓝色光标	4,584,526.00	4.12
9	002604	龙力生物	2,224,169.59	2.00
10	600498	烽火通信	2,212,172.00	1.99
11	600963	岳阳林纸	2,211,041.11	1.99
12	300315	掌趣科技	1,119,540.00	1.01
13	601069	西部黄金	1,100,331.00	0.99
14	002396	星网锐捷	937,739.00	0.84

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	000063	中兴通讯	15,721,038.15	14.12
2	600489	中金黄金	11,813,386.67	10.61
3	600547	山东黄金	9,334,396.99	8.39
4	600999	招商证券	8,520,485.55	7.65
5	300168	万达信息	8,340,566.15	7.49
6	601788	XD 光大证	6,552,876.00	5.89
7	300038	梅泰诺	6,457,039.50	5.80
8	300058	蓝色光标	5,908,805.00	5.31
9	600963	岳阳林纸	4,285,372.16	3.85
10	002604	龙力生物	2,193,566.82	1.97
11	600498	烽火通信	2,149,635.00	1.93

12	002371	北方华创	1,408,276.55	1.27
13	300315	掌趣科技	1,086,192.00	0.98
14	601069	西部黄金	1,071,345.00	0.96
15	002396	星网锐捷	980,676.00	0.88

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	75,516,596.81
卖出股票的收入（成交）总额	85,823,657.54

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	66,455,322.50	71.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,647,018.40	9.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	259,650.00	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	75,361,990.90	80.66

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	019546	16 国债 18	635,060	63,436,143.40	67.90
2	136633	16 融创 06	90,280	8,647,018.40	9.25
3	019557	17 国债 03	30,310	3,019,179.10	3.23
4	113008	电气转债	2,500	259,650.00	0.28

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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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	25,176.73
2	应收证券清算款	6,274,849.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,480,377.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,780,402.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	259,650.00	0.28

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末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

份额级别	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
海富通双福分级债券 A	325	44,593.43	-	0.00%	14,492,864.22	100.00%

海富通双福 分级债券 B	6	16,177,047 .88	97,012,5 85.46	99.95%	49,701.7 9	0.05%
合计	331	337,024.63	97,012,5 85.46	86.96%	14,542,5 66.01	13.04%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、B 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	份额级别	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 部门负责人持有本开放式基金	海富通双福分级债券 A	0
	海富通双福分级债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通双福分级债券 A	0
	海富通双福分级债券 B	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通双福分级债券 A	海富通双福分级债券 B
基金合同生效日（2014 年 5 月 6 日）基金份额总额	355,203,383.97	-
本报告期期初基金份额总额	27,539,990.39	97,062,287.25
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	13,316,629.63	-
本报告期基金拆分变动份额	269,503.46	-

本报告期末基金份额总额	14,492,864.22	97,062,287.25
-------------	---------------	---------------

§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	2	52,650,881.93	32.63%	33,238.65	32.24%	-

天风证券	2	46,301,847.95	28.70%	33,687.26	32.67%	-
渤海证券	1	29,309,368.64	18.17%	20,847.89	20.22%	-
华创证券	1	23,549,006.13	14.60%	9,685.73	9.39%	-
长江证券	1	7,672,369.70	4.76%	4,690.28	4.55%	-
银河证券	1	1,848,500.00	1.15%	945.14	0.92%	-
国金证券	1	8,280.00	0.01%	4.40	0.00%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期交易单元无变化。

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	215,244,786.10	68.22%	948,000,000.00	62.49%	-	-
天风证券	32,291,937.19	10.23%	368,800,000.00	24.31%	-	-
渤海证券	21,301,009.53	6.75%	-	-	-	-
华创证券	12,187,092.06	3.86%	-	-	-	-

长江证券	5,537,411.15	1.76%	-	-	-	-
银河证券	24,092.50	0.01%	-	-	-	-
国金证券	9,733,891.62	3.09%	200,200,000.00	13.20%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	19,190,962.62	6.08%	-	-	-	-

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
13	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
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增方正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》	2017-04-20
15	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额份额折算的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-18
16	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额开放赎回业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-18
17	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
18	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额份额折算方案的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-31
19	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额开放赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-31
20	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额第二个运作周期内第二个折算基准日次日日起年约定收益率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-01
21	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》	2017-06-02
22	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额赎回结果的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-05
23	海富通双福分级债券型证券投资基金之 A 份额份额折算结果的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-06

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/1/1-2017/6/30	51,575,054.08	-	-	51,575,054.08	46.23%

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>
--

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双福分级债券型证券投资基金的文件
- (二) 海富通双福分级债券型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通双福分级债券型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通双福分级债券型证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 报告期内海富通双福分级债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

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