

**海富通欣享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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

## §1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	55
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	55
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	58
<b>§12 备查文件目录</b> .....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣享混合	
基金主代码	519228	
交易代码	519228	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 10 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	600,104,189.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
下属分级基金的交易代码	519229	519228
报告期末下属分级基金的份额总额	600,097,862.88 份	6,326.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。
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。债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，在市场创新和变化中寻找投资机会，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式，确定和构造合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	陆志俊
	联系电话	021-38650891	95559
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
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	上海市浦东新区银城中路 188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	上海市浦东新区银城中路 188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		张文伟	牛锡明

### 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	<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

### 2.5 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 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日）	
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
本期已实现收益	-3,561,704.96	-40.31
本期利润	1,139,006.92	7.46
加权平均基金份额本期利润	0.0019	0.0012
本期加权平均净值利润率	0.19%	0.12%
本期基金份额净值增长率	0.19%	0.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
期末可供分配利润	-3,561,701.37	-35.58
期末可供分配基金份额利润	-0.0059	-0.0056
期末基金资产净值	601,236,870.49	6,340.56
期末基金份额净值	1.0019	1.0022
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
基金份额累计净值增长率	0.19%	0.22%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金合同生效日为 2017 年 3 月 10 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通欣享混合 A

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	0.74%	0.09%	3.09%	0.34%	-2.35%	-0.25%
过去三个月	0.30%	0.14%	3.10%	0.32%	-2.80%	-0.18%
自基金合同 生效起至今	0.19%	0.13%	3.18%	0.32%	-2.99%	-0.19%

## 海富通欣享混合 C

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	0.79%	0.09%	3.09%	0.34%	-2.30%	-0.25%
过去三个月	0.34%	0.14%	3.10%	0.32%	-2.76%	-0.18%
自基金合同 生效起至今	0.22%	0.13%	3.18%	0.32%	-2.96%	-0.19%

### 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

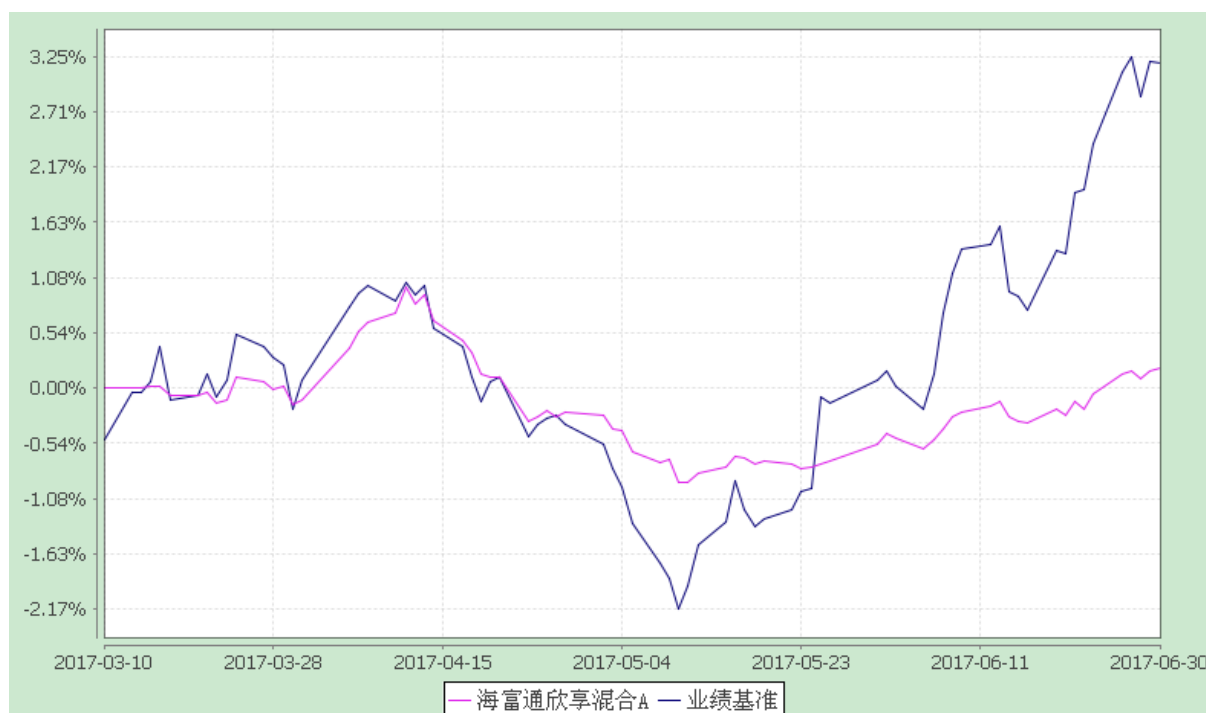
海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金

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

#### 1. 海富通欣享混合 A

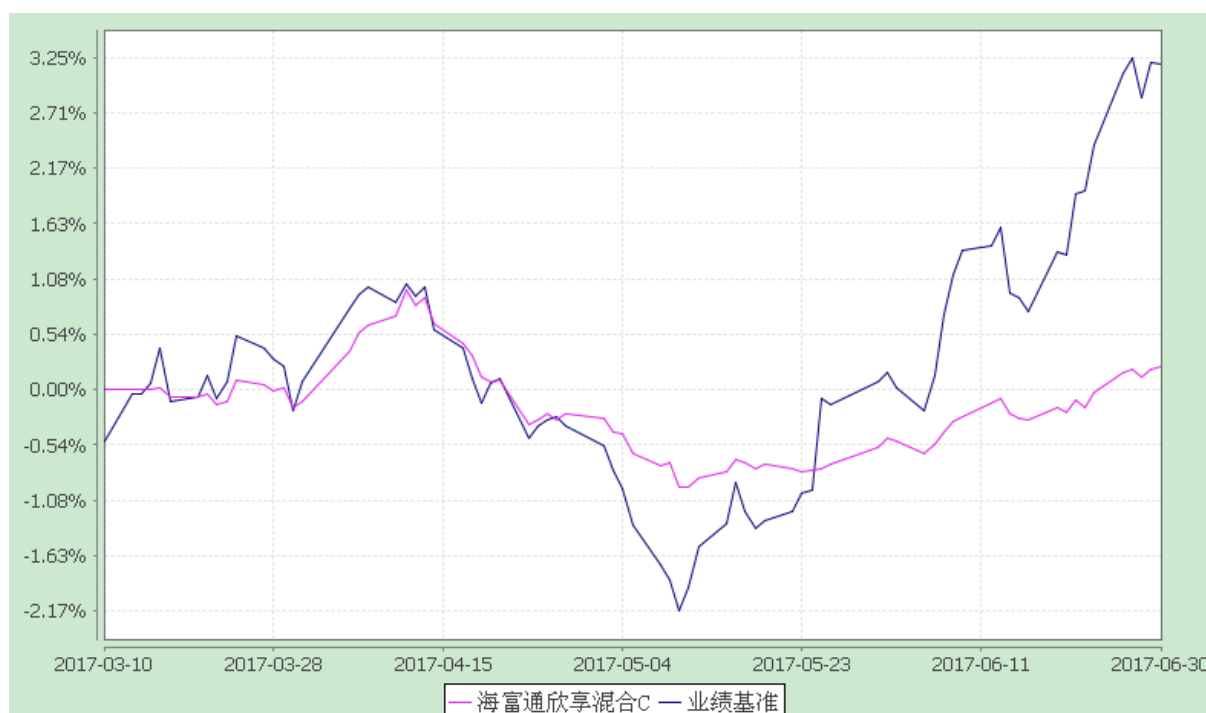
(2017 年 3 月 10 日至 2017 年 6 月 30 日)





## 2. 海富通欣享混合 C

(2017 年 3 月 10 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 10 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 49 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双利债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞益债券型证券投资基金、海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣盛定期开放混合型证券投资基金、海富通富源债券型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		

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；海富通货币基金基金经理；海富通双福分级债券基金经理；海富通双利债券基金经理；海富通养老收益混合基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通新内需混合基金经理；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；海富通欣盛定开混合基金经理。	2017-03-10	-	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。
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；海富通东财大数据混合基金经理；海	2017-03-22	-	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、

	富通欣益混合基金经理；量化投资部总监			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：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%。

报告期本基金依据量化选股模型，更多配置沪深 300 增强大盘股模型，以金融、消费、建筑等行业为主要配置行业。

债券方面，上半年债券市场延续跌势，利率呈现“快速上行—修复—再次上行—再修复”的波浪式上升。10 年期国债收益率从年初的 3.0% 抬升至半年末的 3.57%，而“紧货币”和“严监管”分别成为一、二季度利率快速上行的主要推手。具体来看，一季度经济复苏的态势不减，PPI 向上带动企业持续补库存，同时三四线地产销售火爆，地产和基建投资均维持高位。经济的企稳回升给予了政策一定的空间，为了稳汇率、去杠杆一季度货币政策出现明显的收紧。央行于 1 月下旬上调 MLF 利率为近几年来首次提高政策利率，随后又多次上调公开市场逆回购及其他货币工具利率，市场流动性趋紧，资金利率中枢逐月抬升。一季度监管也有趋严之势，但并未全面铺开，传闻中的同业存单、同业理财新规也是迟迟未落地，存单发行量居高不下，市场从担忧转为麻木。基于此，一季度利率先上后下，上行主要源于货币收紧，而下行则是对悲观预期的修复。进入二

季度,各项经济数据依然平稳,尤其是公布的一季度 GDP 增速达 6.9% 远高于市场预期。在这种情况下监管出现全面升级,银监会连续出台包括 6 号文、46 号文、53 号文在内的多个文件,以限制同业、理财业务的套利和资金空转行为,证监会也出台政策加强对券商资管资金池产品的监管。由此金融去杠杆转为行政去杠杆阶段,市场悲观情绪再起,抛压严重。四月 10 年期国债收益率一路上行超过 40BP,五月上旬达到高点的 3.69%,随后维持高位震荡直到六月。为了应对半年末流动性和下半年可能出现的经济下滑,六月央行货币政策操作从“偏紧”转为“中性”,监管态度亦有所缓和,利率再度迎来一波修复。纵观整个上半年表现,1 年期国债收益率上行 81BP,10 年期国债收益率上行 56BP,3 年期 AA+ 中短期票据收益率上行约 49BP,期限利差极度压缩,信用利差走扩。

本基金在一季度末建仓,绝大多数仓位配置了同业存款,到期后配置了同业存单和短期信用债。整体上,债券部分收益较为稳定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金 A 类份额净值增长率为 0.19%,同期业绩比较基准收益率为 3.18%,基金净值跑输业绩比较基准 2.99 个百分点。本基金 C 类份额净值增长率为 0.22%,同期业绩比较基准收益率为 3.18%,基金净值跑输业绩比较基准 2.96 个百分点。主要原因是配置的股票仓位较低,同时受到了建筑股大幅调整的影响。

#### 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。

预计下半年上证指数很有可能出现震荡突破上行的格局，本基金将积极利用沪深 300 增强量化模型，结合情绪择时指标体系，努力抓住加入 MSCI 新兴市场指数等主题性上涨波段，严格控制回撤风险，同时参与新股申购，继续努力为持有人提供增强收益。

债券方面，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。

下半年，本基金债券部分主要致力于获得低风险的稳定收益，配置以同业存单和短期信用债为主，择机加大杠杆，在控制风险的基础上获得更高的配置收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，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，公司在严格遵循独立投资决策流程和执行投资交易行为监控制度的基础上，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。

#### **4.7 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**

本基金本报告期无需要说明的情形。

### **§5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

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

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

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

#### **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**

2017 年上半年度，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。



## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：海富通欣享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 2017 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	153,392,085.40
结算备付金		6,055,709.44
存出保证金		3,151,471.51
交易性金融资产	6.4.7.2	436,281,187.99
其中：股票投资		89,027,187.99
基金投资		-
债券投资		347,254,000.00
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	3,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	3,296,147.82
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		605,176,602.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,154,633.71
应付赎回款		59.41
应付管理人报酬		295,233.39
应付托管费		73,808.38
应付销售服务费		0.58
应付交易费用	6.4.7.7	272,685.96
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	136,969.68
负债合计		3,933,391.11
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>
实收基金	6.4.7.9	600,104,189.49
未分配利润	6.4.7.10	1,139,021.56
所有者权益合计		601,243,211.05
负债和所有者权益总计		605,176,602.16

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 600,104,189.49 份，其中 A 类基金份额总额 600,097,862.88 份，基金份额净值 1.0019 元；C 类基金份额总额 6,326.61 份，基金份额净值 1.0022 元。

2、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日，上年度可比区间无比较数据。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>3,321,434.19</b>
1.利息收入		6,340,102.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,569,358.62
债券利息收入		610,384.36

资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		160,359.43
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,719,429.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,435,459.01
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	95,100.92
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	-1,166,880.00
股利收益	6.4.7.16	787,808.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,700,759.65
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	1.39
<b>减：二、费用</b>		<b>2,182,419.81</b>
1. 管理人报酬		1,102,826.77
2. 托管费		275,706.70
3. 销售服务费		2.22
4. 交易费用	6.4.7.19	626,167.34
5. 利息支出		37,652.22
其中：卖出回购金融资产支出		37,652.22
6. 其他费用	6.4.7.20	140,064.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,139,014.38</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,139,014.38</b>

注：基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日，上年度可比区间无比较数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	600,104,660.77	-	600,104,660.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,139,014.38	1,139,014.38
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）	-471.28	7.18	-464.10
其中：1.基金申购款	5,006.51	-6.51	5,000.00
2.基金赎回款	-5,477.79	13.69	-5,464.10
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）	600,104,189.49	1,139,021.56	601,243,211.05

注：基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日，上年度可比区间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张文伟，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通欣享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]2661 号《关于准予海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批复，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《海富通欣享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 600,023,657.86 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(2017)第 235 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基

金份额总额为 600,104,660.77 份基金份额,其中认购资金利息折合 81,002.91 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是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(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。在正常市场情况下,本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+中证全债指数收益率 $\times$ 50%。

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》、《海富通欣享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 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **6.4.4.7 实收基金**

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

#### **6.4.4.8 损益平准金**

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

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确

认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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



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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人

所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 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	3,392,085.40
定期存款	150,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	150,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内（含 1 个月）	-
其他存款	-
合计	153,392,085.40

### 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	84,170,115.31	89,027,187.99	4,857,072.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,790,000.00	-124,124.12
	银行间市场	297,464,000.00	412,231.09
	合计	347,254,000.00	288,106.97
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	431,136,008.34	436,281,187.99	5,145,179.65

### 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	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

##### 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	7,101.72
应收定期存款利息	195,833.40
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,305.14
应收债券利息	3,089,871.29
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	36.27
合计	3,296,147.82

#### 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	270,370.93
银行间市场应付交易费用	2,315.03
合计	272,685.96

#### 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	0.12
预提费用	136,969.56
合计	136,969.68

#### 6.4.7.9 实收基金

海富通欣享混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	600,098,340.00	600,098,340.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-477.12	-477.12
本期末	600,097,862.88	600,097,862.88

海富通欣享混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	6,320.77	6,320.77
本期申购	5,006.51	5,006.51
本期赎回（以“-”号填列）	-5,000.67	-5,000.67
本期末	6,326.61	6,326.61

注：1. 本基金自 2017 年 3 月 1 日至 2017 年 5 月 26 日止期间公开发售，于 2017 年 3 月 6 日提前结束募集，共募集有效净认购资金 600,023,657.86 元。根据《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 81,002.91 元在本基金成立后，折算为 81,002.91 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告》的相关规定，本基金于 2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 8 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回业务自 2017 年 6 月 9 日起开始办理。

3. 申购含转换入份额(如有)，赎回含转换出份额(如有)。

#### 6.4.7.10 未分配利润

海富通欣享混合 A

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
本期利润	-3,561,704.96	4,700,711.88	1,139,006.92
本期基金份额交易产生的变动数	3.59	-2.90	0.69
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	3.59	-2.90	0.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,561,701.37	4,700,708.98	1,139,007.61

海富通欣享混合 C

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
本期利润	-40.31	47.77	7.46
本期基金份额交易产生的变动数	4.73	1.76	6.49
其中：基金申购款	-39.16	32.65	-6.51
基金赎回款	43.89	-30.89	13.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-35.58	49.53	13.95

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	106,407.02
定期存款利息收入	5,438,111.18
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	24,593.73
其他	246.69
合计	5,569,358.62

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	175,555,080.54
减：卖出股票成本总额	182,990,539.55
买卖股票差价收入	-7,435,459.01

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月10日（基金合同生效日）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	33,731,368.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	32,946,000.00
减：应收利息总额	690,267.08
买卖债券差价收入	95,100.92

**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**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30

	日
买卖股指期货投资收益	-1,166,880.00

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月 30日
股票投资产生的股利收益	787,808.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	787,808.83

#### 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3月10日（基金合同生效日）至2017年6月 30日
1.交易性金融资产	5,145,179.65
——股票投资	4,857,072.68
——债券投资	288,106.97
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-444,420.00
——权证投资	-
3.其他	-
合计	4,700,759.65

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30 日
基金赎回费收入	1.39

合计	1.39
----	------

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3月10日（基金合同生效日）至2017年6月 30日
交易所市场交易费用	622,769.40
银行间市场交易费用	1,625.00
股指期货交易费用	1,772.94
合计	626,167.34

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月 30日
审计费用	22,828.26
信息披露费	114,141.30
银行划款手续费	3,095.00
合计	140,064.56

### 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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	303,852,547.71	68.76%

注：基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日，上年度可比区间无比较数据。

**6.4.10.1.2 权证交易**

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

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余 额	占期末应付 佣金总额的 比例
海通证券	279,634.80	68.55%	142,075.98	52.55%

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

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

3、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日，上年度可比区间无比较数据。

**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3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,102,826.77
其中：支付销售机构的客户维护费	23.34

注：1、支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 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 0.6% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日, 上年度可比区间无比较数据。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	275,706.70

注：1、支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 0.15% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日, 上年度可比区间无比较数据。

**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3月10日（基金合同生效日）至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C	合计
海富通	-	2.22	2.22
合计	-	2.22	2.22

注：1、本基金 A 类份额不收取销售服务费, C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.1%, 基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.1% 年费率计提, 逐日累计至每月

月底,按月支付。销售服务费的计算方法如下:日销售服务费=前一日 C 类份额的基金资产净值×0.1%/当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日,上年度可比区间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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3月10日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,392,085.40	106,407.02

注:1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

2、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日,上年度可比区间无比较数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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

本基金本报告期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票
----------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下中签	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000100	TCL 集团	2017-06-02	重大资产重组	3.43	2017-7-26	3.72	621,400	2,223,303.24	2,131,402.00	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大资产重组	24.93	-	-	19,100	786,801.42	476,163.00	-
000656	金科股份	2017-05-29	重大资产重组	6.54	2017-07-05	5.92	121,900	733,873.00	797,226.00	-
002252	上海莱士	2017-06-21	重大事项	20.24	-	-	29,300	570,685.13	593,032.00	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大资产重组	12.59	2017-07-03	12.70	8,200	102,982.00	103,238.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	30.68	-	-	3,800	125,234.18	116,584.00	-
300313	天山生物	2017-05-15	重大资产重组	13.10	-	-	3,200	43,358.00	41,920.00	-
600050	中国联通	2017-04-03	重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	26,600	206,416.00	198,702.00	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大资产重组	14.12	-	-	17,600	249,850.10	248,512.00	-
600666	奥瑞德	2017-05-29	重大资产重组	17.40	-	-	15,680	274,498.00	272,832.00	-

600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组	3.60	-	-	495,500	1,655,735.93	1,783,800.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	83,500	1,608,256.18	1,861,215.00	-
601872	招商轮船	2017-05-01	重大事项	5.16	-	-	86,500	456,227.84	446,340.00	-
601989	中国重工	2017-05-29	重大资产重组	6.21	-	-	102,800	645,780.00	638,388.00	-

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。

### 6.4.13.2 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交通银行，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。

#### 6.4.13.2.1 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
A-1	19,976,000.00
A-1 以下	-
未评级	277,488,000.00
合计	297,464,000.00

注：1、未评级部分为政策性金融债、短期融资券和同业存单。

2、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日，上年度可比区间无比较数据。

#### 6.4.13.2.2 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
AAA	49,790,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	49,790,000.00

注：基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日，上年度可比区间无比较数据。

### 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。本基金投资于一家公司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。

### 6.4.13.4 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及结算备付金等。

## 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	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	153,392,085.40	-	-	-	153,392,085.40
结算备付金	6,055,709.44	-	-	-	6,055,709.44
存出保证金	3,151,471.51	-	-	-	3,151,471.51
交易性金融资产	317,468,000.00	29,786,000.00	-	89,027,187.99	436,281,187.99
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,296,147.82	3,296,147.82
<b>资产总计</b>	<b>483,067,266.35</b>	<b>29,786,000.00</b>	<b>-</b>	<b>92,323,335.81</b>	<b>605,176,602.16</b>
<b>负债</b>					
应付销售服务费	-	-	-	0.58	0.58
应付证券清算款	-	-	-	3,154,633.71	3,154,633.71
应付管理人报酬	-	-	-	295,233.39	295,233.39
应付托管费	-	-	-	73,808.38	73,808.38
应付交易费用	-	-	-	272,685.96	272,685.96
应付赎回款	-	-	-	59.41	59.41
其他负债	-	-	-	136,969.68	136,969.68
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,933,391.11</b>	<b>3,933,391.11</b>
利率敏感度缺口	483,067,266.35	29,786,000.00	-	88,389,944.70	601,243,211.05

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。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

项目	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 -
	市场利率上升 25 个基点	减少约 43	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 44	-



	点		
--	---	--	--

注：1、影响金额为约数，精确到万元。

2、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日，上年度可比区间无比较数据。

#### 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交易的股票，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，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动且有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，追求较高的收益，同时规避市场的系统性风险。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。在每个交易日日终持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	89,027,187.99	14.81
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	347,254,000.00	57.76
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	436,281,187.99	72.56

**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
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 138
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 138

注: 1、影响金额为约数,精确到万元。

2、基金合同成立于 2017 年 3 月 10 日,上年度可比区间无比较数据。

**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	89,027,187.99	14.71
	其中:股票	89,027,187.99	14.71

2	固定收益投资	347,254,000.00	57.38
	其中：债券	347,254,000.00	57.38
	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	3,000,000.00	0.50
	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	159,447,794.84	26.35
7	其他各项资产	6,447,619.33	1.07
8	合计	605,176,602.16	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	324,656.00	0.05
B	采矿业	4,692,637.00	0.78
C	制造业	38,615,323.14	6.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,956,398.00	1.32
E	建筑业	3,064,587.50	0.51
F	批发和零售业	3,354,618.30	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	6,768,094.00	1.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,388,313.00	0.40
J	金融业	12,481,469.49	2.08
K	房地产业	6,340,125.00	1.05
L	租赁和商务服务业	504,998.56	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,104,588.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	240,576.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,190,804.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	89,027,187.99	14.81

### 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	000002	万科A	105,600	2,636,832.00	0.44
2	000100	TCL 集团	621,400	2,131,402.00	0.35
3	601318	中国平安	42,800	2,123,308.00	0.35
4	600741	华域汽车	85,400	2,070,096.00	0.34
5	601088	中国神华	83,500	1,861,215.00	0.31
6	600690	青岛海尔	121,400	1,827,070.00	0.30
7	600795	国电电力	495,500	1,783,800.00	0.30
8	601939	建设银行	285,500	1,755,825.00	0.29
9	601607	上海医药	56,900	1,643,272.00	0.27
10	000876	新希望	195,900	1,610,298.00	0.27
11	600104	上汽集团	50,700	1,574,235.00	0.26
12	600518	康美药业	69,900	1,519,626.00	0.25
13	000001	平安银行	159,600	1,498,644.00	0.25
14	002241	歌尔股份	76,800	1,480,704.00	0.25
15	601336	新华保险	26,300	1,351,820.00	0.22
16	601997	贵阳银行	80,000	1,264,800.00	0.21
17	600886	国投电力	150,200	1,186,580.00	0.20
18	000069	华侨城A	109,800	1,104,588.00	0.18
19	601111	中国国航	111,800	1,090,050.00	0.18
20	600061	国投安信	66,000	1,026,300.00	0.17
21	601288	农业银行	269,200	947,584.00	0.16
22	600019	宝钢股份	139,500	936,045.00	0.16
23	600023	浙能电力	160,200	874,692.00	0.15
24	601618	中国中冶	174,000	871,740.00	0.14
25	601669	中国电建	109,200	864,864.00	0.14
26	600660	福耀玻璃	33,000	859,320.00	0.14
27	600276	恒瑞医药	16,400	829,676.00	0.14

28	600383	金地集团	72,200	828,134.00	0.14
29	000656	金科股份	121,900	797,226.00	0.13
30	600029	南方航空	91,000	791,700.00	0.13
31	600011	华能国际	101,700	746,478.00	0.12
32	600118	中国卫星	26,800	746,112.00	0.12
33	600196	复星医药	23,100	715,869.00	0.12
34	002236	大华股份	31,200	711,672.00	0.12
35	002466	天齐锂业	12,800	695,680.00	0.12
36	601989	中国重工	102,800	638,388.00	0.11
37	601098	中南传媒	32,100	598,344.00	0.10
38	002252	上海莱士	29,300	593,032.00	0.10
39	601668	中国建筑	60,400	584,672.00	0.10
40	601818	光大银行	142,800	578,340.00	0.10
41	600033	福建高速	146,300	557,403.00	0.09
42	000587	金洲慈航	35,400	527,460.00	0.09
43	601398	工商银行	95,800	502,950.00	0.08
44	600900	长江电力	32,200	495,236.00	0.08
45	600017	日照港	109,700	493,650.00	0.08
46	600377	宁沪高速	50,100	490,980.00	0.08
47	600271	航天信息	23,600	487,104.00	0.08
48	600688	上海石化	73,000	482,530.00	0.08
49	600585	海螺水泥	21,000	477,330.00	0.08
50	601988	中国银行	129,000	477,300.00	0.08
51	000503	海虹控股	19,100	476,163.00	0.08
52	601377	兴业证券	63,800	474,034.00	0.08
53	600009	上海机场	12,200	455,182.00	0.08
54	601872	招商轮船	86,500	446,340.00	0.07
55	600863	内蒙华电	147,400	443,674.00	0.07
56	600026	中远海能	66,600	441,558.00	0.07
57	601991	大唐发电	96,500	436,180.00	0.07
58	600348	阳泉煤业	63,200	428,496.00	0.07
59	600887	伊利股份	18,500	399,415.00	0.07
60	600028	中国石化	66,000	391,380.00	0.07
61	600066	宇通客车	17,100	375,687.00	0.06
62	600808	马钢股份	104,900	371,346.00	0.06
63	000709	河钢股份	84,700	354,893.00	0.06
64	600085	同仁堂	10,000	349,600.00	0.06
65	600373	中文传媒	14,800	347,948.00	0.06
66	000568	泸州老窖	6,800	343,944.00	0.06
67	600021	上海电力	26,700	322,803.00	0.05
68	600004	白云机场	17,400	321,204.00	0.05
69	600048	保利地产	31,700	316,049.00	0.05
70	603288	海天味业	7,600	309,928.00	0.05
71	000333	美的集团	7,200	309,888.00	0.05

72	000726	鲁泰 A	26,000	308,360.00	0.05
73	600867	通化东宝	16,560	302,054.40	0.05
74	601139	深圳燃气	34,800	301,020.00	0.05
75	002093	国脉科技	34,000	299,200.00	0.05
76	600776	东方通信	43,600	295,608.00	0.05
77	600195	中牧股份	15,200	294,728.00	0.05
78	600126	杭钢股份	42,400	290,864.00	0.05
79	600309	万华化学	10,000	286,400.00	0.05
80	000685	中山公用	26,100	285,795.00	0.05
81	600108	亚盛集团	65,600	282,736.00	0.05
82	000926	福星股份	23,000	280,600.00	0.05
83	300002	神州泰岳	33,600	280,224.00	0.05
84	002063	远光软件	26,800	279,256.00	0.05
85	600801	华新水泥	29,200	278,276.00	0.05
86	600978	宜华生活	27,200	273,360.00	0.05
87	600666	奥瑞德	15,680	272,832.00	0.05
88	300297	蓝盾股份	24,800	271,560.00	0.05
89	300202	聚龙股份	16,400	270,928.00	0.05
90	002155	湖南黄金	28,000	267,960.00	0.04
91	000975	银泰资源	21,200	267,756.00	0.04
92	000612	焦作万方	33,200	267,260.00	0.04
93	002266	浙富控股	54,400	265,472.00	0.04
94	600010	包钢股份	120,860	264,683.40	0.04
95	002437	誉衡药业	36,000	262,080.00	0.04
96	600284	浦东建设	24,400	261,568.00	0.04
97	002028	思源电气	16,400	261,416.00	0.04
98	600039	四川路桥	62,400	259,584.00	0.04
99	601888	中国国旅	8,600	259,204.00	0.04
100	600748	上实发展	36,000	259,200.00	0.04
101	600517	置信电气	34,000	257,380.00	0.04
102	603806	福斯特	8,000	256,080.00	0.04
103	000697	炼石有色	12,400	253,828.00	0.04
104	600064	南京高科	16,800	253,680.00	0.04
105	600743	华远地产	59,600	251,512.00	0.04
106	002106	莱宝高科	24,800	251,224.00	0.04
107	600664	哈药股份	43,200	250,992.00	0.04
108	002727	一心堂	13,600	250,240.00	0.04
109	600750	江中药业	7,200	250,200.00	0.04
110	002022	科华生物	14,400	250,128.00	0.04
111	000012	南玻 A	26,800	250,044.00	0.04
112	600422	昆药集团	22,000	249,480.00	0.04
113	000049	德赛电池	4,800	248,688.00	0.04
114	600100	同方股份	17,600	248,512.00	0.04
115	000541	佛山照明	27,200	247,792.00	0.04

116	000667	美好置业	74,800	247,588.00	0.04
117	002384	东山精密	10,000	247,000.00	0.04
118	300039	上海凯宝	33,600	244,272.00	0.04
119	600546	山煤国际	50,400	241,416.00	0.04
120	600535	天士力	5,800	240,932.00	0.04
121	603377	东方时尚	6,400	240,576.00	0.04
122	002390	信邦制药	27,600	240,396.00	0.04
123	603005	晶方科技	8,400	235,116.00	0.04
124	603766	隆鑫通用	32,000	232,960.00	0.04
125	601898	中煤能源	39,400	231,672.00	0.04
126	601666	平煤股份	43,400	228,718.00	0.04
127	000543	皖能电力	39,200	228,536.00	0.04
128	001696	宗申动力	30,000	227,100.00	0.04
129	600839	四川长虹	62,600	226,612.00	0.04
130	600548	深高速	24,800	224,192.00	0.04
131	600515	海航基础	21,800	223,886.00	0.04
132	000703	恒逸石化	15,600	222,144.00	0.04
133	600642	申能股份	35,200	221,760.00	0.04
134	600022	山东钢铁	106,080	218,524.80	0.04
135	600269	赣粤高速	41,800	217,778.00	0.04
136	600236	桂冠电力	38,200	217,740.00	0.04
137	600875	东方电气	22,600	216,508.00	0.04
138	600499	科达洁能	27,200	215,968.00	0.04
139	002221	东华能源	19,600	213,836.00	0.04
140	600035	楚天高速	38,800	213,788.00	0.04
141	600350	山东高速	34,400	213,280.00	0.04
142	601339	百隆东方	35,800	213,010.00	0.04
143	600141	兴发集团	17,200	212,764.00	0.04
144	600062	华润双鹤	7,700	211,211.00	0.04
145	600578	京能电力	49,000	210,210.00	0.03
146	603188	亚邦股份	12,000	209,280.00	0.03
147	600894	广日股份	17,600	208,384.00	0.03
148	002440	闰土股份	13,600	207,536.00	0.03
149	002277	友阿股份	32,000	206,400.00	0.03
150	002468	申通快递	8,000	203,280.00	0.03
151	600694	大商股份	5,200	202,644.00	0.03
152	600027	华电国际	41,800	201,894.00	0.03
153	000552	靖远煤电	56,000	199,920.00	0.03
154	600050	中国联通	26,600	198,702.00	0.03
155	600614	鹏起科技	18,000	198,000.00	0.03
156	000417	合肥百货	24,000	198,000.00	0.03
157	601225	陕西煤业	28,000	197,960.00	0.03
158	300159	新研股份	14,800	195,952.00	0.03
159	002344	海宁皮城	23,158	192,674.56	0.03

160	600188	兖州煤业	15,600	190,944.00	0.03
161	600519	贵州茅台	400	188,740.00	0.03
162	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.03
163	002056	横店东磁	24,900	186,750.00	0.03
164	600170	上海建工	48,000	183,360.00	0.03
165	002646	青青稞酒	10,400	181,584.00	0.03
166	600572	康恩贝	26,100	180,612.00	0.03
167	601600	中国铝业	39,800	179,896.00	0.03
168	000848	承德露露	18,000	179,640.00	0.03
169	601333	广深铁路	39,400	178,088.00	0.03
170	000036	华联控股	19,000	172,900.00	0.03
171	600157	永泰能源	48,400	172,788.00	0.03
172	603866	桃李面包	4,800	170,784.00	0.03
173	600115	东方航空	25,000	170,000.00	0.03
174	002594	比亚迪	3,400	169,830.00	0.03
175	600221	海航控股	52,400	168,728.00	0.03
176	000778	新兴铸管	24,600	164,820.00	0.03
177	601155	新城控股	8,400	155,736.00	0.03
178	000725	京东方 A	34,200	142,272.00	0.02
179	601238	广汽集团	5,400	140,724.00	0.02
180	600177	雅戈尔	13,900	140,668.00	0.02
181	601169	北京银行	14,000	128,380.00	0.02
182	002223	鱼跃医疗	5,400	127,872.00	0.02
183	600757	长江传媒	16,800	125,496.00	0.02
184	600831	广电网络	12,400	123,380.00	0.02
185	601929	吉视传媒	35,600	123,176.00	0.02
186	000089	深圳机场	12,800	119,680.00	0.02
187	000681	视觉中国	7,600	119,016.00	0.02
188	600018	上港集团	18,700	118,558.00	0.02
189	300043	星辉娱乐	14,400	118,224.00	0.02
190	300104	乐视网	3,800	116,584.00	0.02
191	600297	广汇汽车	15,310	115,284.30	0.02
192	000999	华润三九	3,600	114,300.00	0.02
193	000050	深天马 A	5,500	113,135.00	0.02
194	600522	中天科技	9,300	112,065.00	0.02
195	601788	光大证券	7,500	111,975.00	0.02
196	002681	奋达科技	8,200	103,238.00	0.02
197	300168	万达信息	7,000	101,850.00	0.02
198	000063	中兴通讯	4,000	94,960.00	0.02
199	002450	康得新	2,800	63,056.00	0.01
200	300392	腾信股份	3,900	59,982.00	0.01
201	000963	华东医药	1,200	59,640.00	0.01
202	300312	邦讯技术	4,600	58,236.00	0.01
203	000423	东阿阿胶	800	57,512.00	0.01



204	601018	宁波港	9,900	55,935.00	0.01
205	300410	正业科技	1,500	54,150.00	0.01
206	300023	宝德股份	4,000	53,120.00	0.01
207	300179	四方达	8,100	52,974.00	0.01
208	601166	兴业银行	3,100	52,266.00	0.01
209	300427	红相电力	2,600	51,870.00	0.01
210	300345	红宇新材	5,600	49,728.00	0.01
211	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
212	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
213	300313	天山生物	3,200	41,920.00	0.01
214	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.01
215	603316	诚邦股份	1,825	38,799.50	0.01
216	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
217	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
218	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
219	601766	中国中车	2,100	21,252.00	0.00
220	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
221	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
222	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
223	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
224	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 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末基金资产净值 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	601288	农业银行	8,331,902.00	1.39
2	601398	工商银行	4,376,423.00	0.73
3	601601	中国太保	4,234,266.50	0.70
4	601390	中国中铁	3,803,909.28	0.63
5	601818	光大银行	3,719,652.00	0.62
6	601939	建设银行	3,608,166.00	0.60
7	601988	中国银行	3,569,131.00	0.59
8	601668	中国建筑	3,173,348.00	0.53
9	600028	中国石化	3,039,044.00	0.51
10	000157	中联重科	2,802,028.31	0.47
11	601318	中国平安	2,686,039.00	0.45
12	000100	TCL 集团	2,541,916.81	0.42
13	600741	华域汽车	2,444,909.34	0.41
14	601336	新华保险	2,382,266.00	0.40

15	000002	万科 A	2,251,712.39	0.37
16	601006	大秦铁路	2,234,270.00	0.37
17	600795	国电电力	2,208,629.00	0.37
18	601607	上海医药	2,196,447.00	0.37
19	600518	康美药业	2,196,033.00	0.37
20	000415	渤海金控	2,185,248.00	0.36

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末基金资产净值 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	601288	农业银行	7,398,134.00	1.23
2	601601	中国太保	4,492,760.02	0.75
3	601398	工商银行	3,972,852.00	0.66
4	601390	中国中铁	3,827,919.00	0.64
5	601818	光大银行	3,123,423.00	0.52
6	601988	中国银行	3,078,347.00	0.51
7	601668	中国建筑	2,783,092.00	0.46
8	600028	中国石化	2,777,832.00	0.46
9	000157	中联重科	2,519,491.00	0.42
10	601006	大秦铁路	2,391,876.65	0.40
11	000415	渤海金控	1,988,421.29	0.33
12	601939	建设银行	1,928,039.00	0.32
13	000425	徐工机械	1,919,907.00	0.32
14	600031	三一重工	1,848,232.43	0.31
15	600048	保利地产	1,840,071.00	0.31
16	000786	北新建材	1,807,023.45	0.30
17	002392	北京利尔	1,564,897.47	0.26
18	600688	上海石化	1,500,226.88	0.25
19	002202	金风科技	1,497,753.90	0.25
20	000625	长安汽车	1,468,803.66	0.24

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	267,160,654.86
卖出股票的收入（成交）总额	175,555,080.54

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,979,000.00	4.99
	其中：政策性金融债	29,979,000.00	4.99
4	企业债券	49,790,000.00	8.28
5	企业短期融资券	130,000,000.00	21.62
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	137,485,000.00	22.87
9	其他	-	-
10	合计	347,254,000.00	57.76

## 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	011755015	17 申能股 SCP001	500,000	49,930,000.00	8.30
2	111780185	17 上海农商银行 CD142	500,000	49,450,000.00	8.22
3	111714181	17 江苏银行 CD181	400,000	39,132,000.00	6.51
4	160419	16 农发 19	300,000	29,979,000.00	4.99
5	011754101	17 康美 SCP002	200,000	20,028,000.00	3.33

**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**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1707	IF1707	-11.00	-12,036,420.00	-422,640.00	-
IF1708	IF1708	-3.00	-3,273,480.00	-21,780.00	-
公允价值变动总额合计					-444,420.00
股指期货投资本期收益					-1,166,880.00
股指期货投资本期公允价值变动					-444,420.00

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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

**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**

本基金的国债期货投资将以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

**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**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

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

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

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,151,471.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,296,147.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,447,619.33

**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**

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600795	国电电力	1,783,800.00	0.30	重大资产重组
2	601088	中国神华	1,861,215.00	0.31	重大事项
3	000100	TCL 集团	2,131,402.00	0.35	重大资产重组

## §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
海富通欣 享混合 A	381	1,575,060.0 1	600,078,000. 00	100.00 %	19,862.88	0.00%
海富通欣 享混合 C	15	421.77	0.00	0.00%	6,326.61	100.00 %
合计	396	1,515,414.6 2	600,078,000. 00	100.00 %	26,189.49	0.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	海富通欣享混合 A	-	-
	海富通欣享混合 C	20.00	0.3161%
	合计	20.00	0.0000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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、 基金投资和研发部门 负责人持有本开放式 基金	海富通欣享混合 A	0
	海富通欣享混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	海富通欣享混合 A	0
	海富通欣享混合 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣享混合 A	海富通欣享混合 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 10 日）基金份额总额	600,098,340.00	6,320.77
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	-	5,006.51
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	477.12	5,000.67
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	600,097,862.88	6,326.61

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	303,852,547.71	68.76%	0.69	-	-
长江证券	1	78,926,034.55	17.86%	0.18	-	-
华泰证券	1	35,299,785.77	7.99%	0.08	-	-
中金公司	1	10,963,229.79	2.48%	0.03	-	-
国泰君安	2	9,789,754.95	2.22%	0.02	-	-
华创证券	1	2,710,784.23	0.61%	0.01	-	-
招商证券	1	345,400.00	0.08%	0.00	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-

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, 并报公司总裁办核准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	82,952,492.12	100.00%	488,500,000.00	95.13%	-	-
长江证券	-	-	22,000,000.00	4.28%	-	-
华泰证券	-	-	3,000,000.00	0.58%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 (原申万)	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大	-	-	-	-	-	-

证券						
江海 证券	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-
国元 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	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-21
2	海富通基金管理有限公司关于海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-06
3	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-11
4	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-24
5	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
6	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
7	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-06
8	海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-06
9	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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		区间					
机构	1	2017/3/10-2017/6/30	300,039,500.00	-	-	300,039,500.00	50.00%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

注：本基金合同生效日为2017年3月10日，期初份额指基金合同生效日持有份额。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 50 只公募基金。截至 2017 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 468 亿元人民币。

2004 年末开始，海富通及子公司为 QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至 2017 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 224 亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，截至 2017 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 376 亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，截至 2017 年 6 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 294 亿元。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 2 月，海富通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。2012 年 9 月，中国保

监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2016 年 3 月，国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通基金管理有限公司“固定收益投资金牛基金公司”。

## §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欣享灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通欣享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) 报告期内海富通欣享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