

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金
2017 年年度报告摘要
2017 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通上证可质押城投债 ETF
场内简称	城投 ETF
基金主代码	511220
交易代码	511220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 13 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	35,558,135.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 12 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。
投资策略	本基金为指数基金，将采用分层抽样复制法对业绩比较基准进行跟踪。当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。
业绩比较基准	上证可质押城投债指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证可质押城投债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	167,322,821.05	338,863,579.33	344,081,874.20
本期利润	133,933,310.48	134,889,442.49	661,524,026.47
加权平均基金份额 本期利润	2.3333	2.1991	10.4627
本期基金份额净值 增长率	2.44%	2.16%	11.04%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金 份额利润	-5.4480	-1.7715	0.1270
期末基金资产净值	3,362,092,146.59	6,024,171,632.03	6,260,329,839.29
期末基金份额净值	94.552	98.229	102.029

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、本基金已于 2014 年 12 月 3 日进行了基金份额折算,折算比例为 100:1。

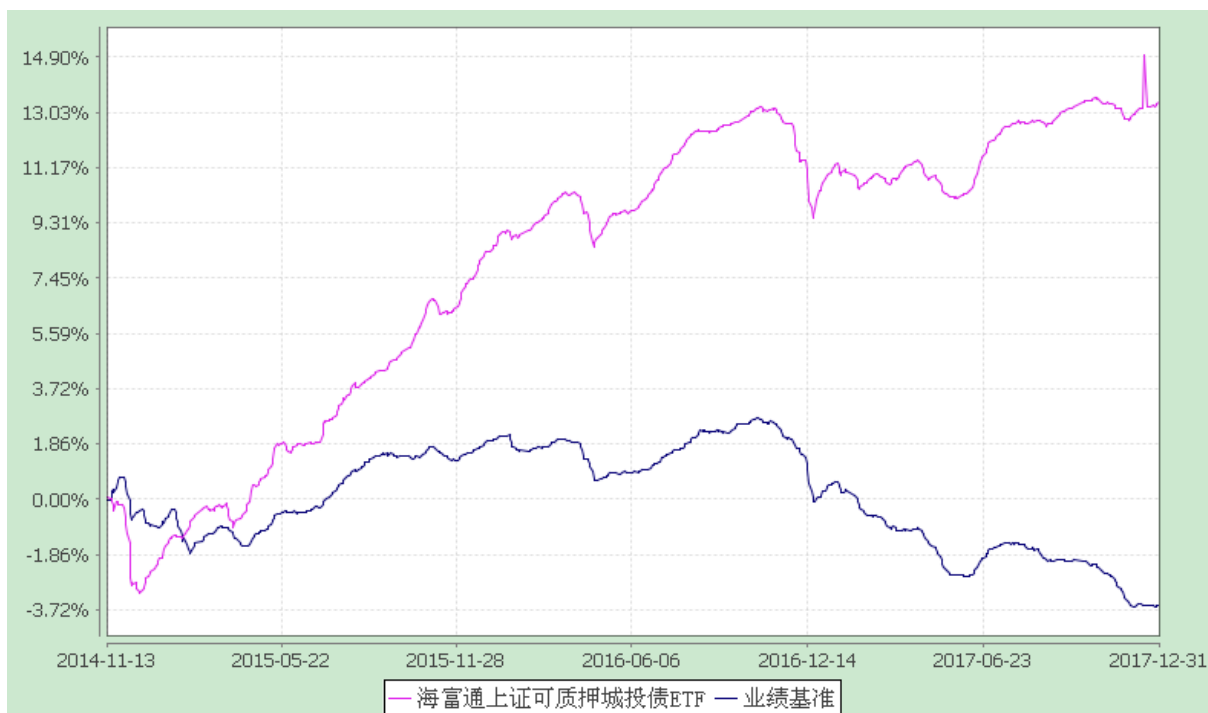
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.12%	0.29%	-1.55%	0.04%	1.67%	0.25%
过去六个月	1.19%	0.20%	-1.92%	0.04%	3.11%	0.16%
过去一年	2.44%	0.15%	-3.83%	0.05%	6.27%	0.10%
过去三年	16.21%	0.11%	-2.74%	0.06%	18.95%	0.05%
自基金合同生效起至今	13.35%	0.12%	-3.57%	0.06%	16.92%	0.06%

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

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2014 年 11 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日)

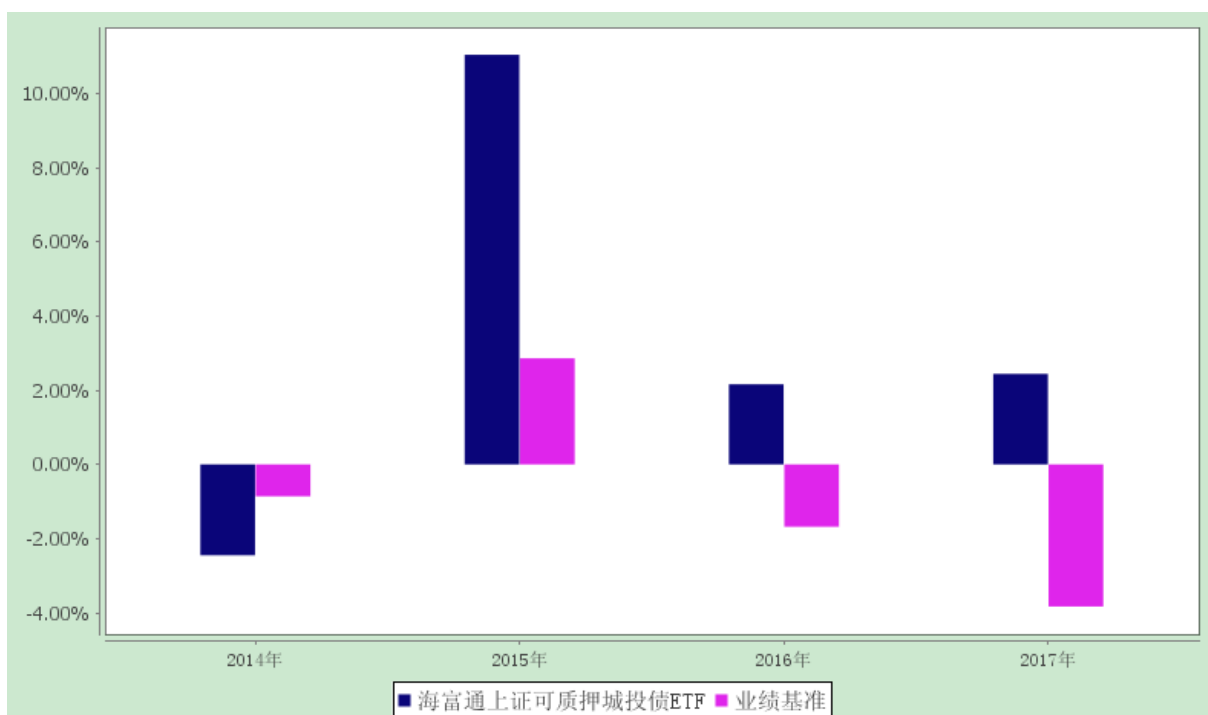


注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 3 个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

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

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：图中列示的 2014 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 11 月 13 日（基
第 6 页 共 34 页

金合同生效日) 起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017 年	60.000	321,528,810.00	-	321,528,810.00	-
2016 年	60.000	368,013,810.00	-	368,013,810.00	-
2015 年	60.000	377,193,810.00	-	377,193,810.00	-
合计	180.000	1,066,736,430.00	-	1,066,736,430.00	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 52 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债

债券型证券投资基金、海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣盛定期开放混合型证券投资基金、海富通富源债券型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通欣悦灵活配置混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福一年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈轶平	本基金的基金经理；海富通货币基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通一年定开债券基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通瑞丰一年定开债券基金经理；海富通美元债（QDII）	2014-11-13	-	8 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理，基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投

	<p>基金经理： 海富通上证 周期产业债 ETF 基金经 理；海富通 瑞利债券基 金经理；海 富通富源债 券基金经理； 海富通瑞合 纯债基金经 理；海富通 富睿混合基 金经理；海 富通欣悦混 合基金经理； 海富通瑞福 一年定开债 券基金经理； 海富通瑞祥 一年定开债 券基金经理； 固定收益投 资部副总监。</p>			<p>资部副总监兼债 券基金部总监。 2013 年 8 月起 任海富通货币基 金经理。 2014 年 8 月起 兼任海富通季季 增利理财债券基 金经理。 2014 年 11 月起 兼任海富通上证 可质押城投债 ETF 基金经理。 2015 年 12 月起 兼任海富通稳固 收益债券基金经 理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通 稳进增利债券 （LOF）基金经 理。2016 年 4 月起兼任海富 通一年定开债券 基金经理。 2016 年 7 月起 兼任海富通富祥 混合基金经理。 2016 年 8 月起 兼任海富通瑞丰 一年定开债券基 金经理。 2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼 任海富通瑞益债 券基金经理。 2016 年 11 月起 兼任海富通美元 债（QDII）基 金经理。 2017 年 1 月起 兼任海富通上证 周期产业债 ETF 基金经理。 2017 年 2 月起</p>
--	---	--	--	--

					<p>兼任海富通瑞利债券基金经理。 2017 年 3 月起兼任海富通富源债券和海富通瑞合纯债基金经理。 2017 年 5 月起兼任海富通富睿混合基金经理。 2017 年 7 月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。</p>
陆丛凡	<p>本基金的基金经理助理；海富通聚利债券基金经理助理；海富通美元债（QDII）基金经理助理；海富通上证周期产业债 ETF 基金经理助理；海富通富睿混合基金经理助理。</p>	2015-06-17	-	5 年	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益定量分析师，2015 年 4 月加入海富通基金管理有限公司。 2015 年 6 月起任海富通上证可质押城投债 ETF 的基金经理助理。2016 年 9 月起任海富通聚利债券的基金经理助理。 2017 年 2 月起任海富通美元债（QDII）和海富通上证周期产业债 ETF 的基金经理助理。 2017 年 5 月起任海富通富睿混合的基金经理助理。</p>

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易，未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年的债券市场延续跌势。宏观层面看，全年经济增长平稳显韧性，供给侧改革、棚改货币化推动固定资产投资维持较高增速，出口得益于全球经济复苏成为拉动国内经济的主要动力；通胀全年维持低位，人民币汇率总体稳定，货币政策主要目标在于去杠杆和去泡沫，因此延续了中性偏紧的基调。同时金融监管全面收紧，抑制同业链条，引导资金脱虚向实。在这种情况下，十年期国债收益率全年呈现波浪式上升的态势，利率于一季度、二季度和四季度经历三次快速上行，并在四季度达到 4% 的水平，创下近几年新高。具体来看，1 月下旬央行公告上调 MLF 利率为近几年来首次提高政策利率，随后央行又多次上调公开市场各期限逆回购及其他货币工具利率，资金利率中枢抬升，长端利率先上后下整体上行。4 月金融监管全面趋严，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、保监会也相继出台政策加强对券商资管资金池产品以及险资通道业务的监管。监管政策的密集出台使得市场悲观情绪再起，抛压严重，利率再次大幅走高。6 月为应对半年末的流动性和稳定经济需要，央行积极呵护资金面，高层也多发声注重监管协调，利率迎来一波修复，并在整个三季度保持平稳。然而进入 10 月，公布的月度经济数据大幅好于预期，叠加周小川行长关于“中国经济 GDP 增速下半年有望实现 7%”的发言，引发市场对经济增长韧性与通胀预期回升的担忧。十九大后维稳期效应消失，资管新规和商业银行流动性风险管理征求意见稿相继公布，加上存单利率的持续上升，美国税改和加息的稳步推进亦对国内债市构成压力。在多重利空因素的作用下，十年期国债收益率出现年内第三次大幅上行，并触及 4% 的新高。随后各种利空预期有所消化，年底利率略有回落。纵观全年表现，利率债全线收跌，一年期国债收益率上行 114BP，十年期国债收益率上行 87BP，曲线变平。信用债走势和利率债类似，但阶段性表现分化，总体看全年信用利差小幅走扩但依然处于低位，评级间利差小幅压缩，中低评级信用债表现相对抗跌。

作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通上证可质押城投债 ETF 基金净值增长率为 2.44%，同期业绩比较基准收益率为-3.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济基本面看，2018 年经济或继续保持平稳增长，全年 GDP 增速预计在 6.6%-6.8%。一季度由于受采暖季限产扰动和地产短周期下行影响，经济阶段性承压，但二季度以后经济内生动能可能有所修复，GDP 或小幅回升。分项来看，18 年制造业投资

可能出现结构性修复，出口继续保持较高增速，基建投资仍能有效托底，此三项或是 2018 年经济的支持项，而地产投资和汽车消费或形成拖累，但下滑幅度预计较为温和。总体看 18 年经济依然保持较强韧性。通胀方面，PPI 受需求放缓和高基数影响大概率将出现回落，而 CPI 可能会取代 PPI 成为 18 年的通胀主线，预计 CPI 中枢较 17 年将出现显著抬升，但整体通胀压力仍较为可控，原油价格是最大的不确定因素。政策方面，18 年金融防风险和实体去杠杆仍将持续推进，货币政策短期继续保持中性偏紧的基调，且不排除会进一步上调政策利率，但如果下半年出现实体融资利率过高，通胀增速回落的情况，货币政策也有边际转松的可能；金融强监管仍将延续，资管新规等制度细则将陆续落地，银行理财、券商资管等规模趋于回落，对债券市场的影响深远，有待进一步观察。此外，18 年诸多海外因素也不容忽视，美国税改的效果、美股可能出现的泡沫、地缘政治局势等都会对汇率及全球资本市场产生较大影响，值得关注。总体看，我们认为 18 年的债市环境仍未转暖，中外货币收紧、通胀预期抬升、资金供需缺口等因素使得利率仍会维持高位且不排除有进一步上行可能，但幅度已相对有限，同时结构性机会增多，利率债波段交易的空间和胜算都会比 17 年要大；信用债受资管收缩影响信用利差和期限利差都面临走扩压力，但票息价值依然较高。

未来，本基金将继续严格按照基金合同的要求，秉承指数化投资策略，提高组合与指数的拟合度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金报告期内进行过四次利润分配，分别以截止 2017 年 3 月 3 日，2017 年 6 月 2 日，2017 年 9 月 1 日和 2017 年 12 月 1 日本基金的可供分配利润为基准。四次分红分别于 2017 年 3 月 17 日，2017 年 6 月 16 日，2017 年 9 月 15 日和 2017 年 12 月 15 日完成权益登记，单位分红金额都为 1.5 元，合计利润分配金额 321,528,810.00 元。符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金（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。

本报告期内本基金进行了 4 次收益分配，合计利润分配金额 321,528,810.00 元，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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 审计报告

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

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	8,419,674.32	15,095,860.44
结算备付金	3,004,545.45	849,484.78
存出保证金	57,931.67	15,982.78
交易性金融资产	3,158,357,742.70	5,745,978,033.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,158,357,742.70	5,745,978,033.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	64,044,606.32	20,000,000.00
应收证券清算款	3,109,144.32	19,569,857.85
应收利息	127,016,881.52	225,464,256.33
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,364,010,526.30	6,026,973,475.18

负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	952,434.25	1,547,822.97
应付托管费	317,478.07	515,940.97
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,039.16	6,773.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	643,428.23	731,306.01
负债合计	1,918,379.71	2,801,843.15
所有者权益：		
实收基金	3,555,813,528.16	6,132,813,527.12
未分配利润	-193,721,381.57	-108,641,895.09
所有者权益合计	3,362,092,146.59	6,024,171,632.03
负债和所有者权益总计	3,364,010,526.30	6,026,973,475.18

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 94.552 元，基金份额总额 35,558,135.00 份。

7.2 利润表

会计主体：上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	158,879,171.12	162,820,598.51
1.利息收入	356,235,911.45	385,000,125.15
其中：存款利息收入	2,067,918.82	400,063.72
债券利息收入	347,745,687.56	381,755,760.52
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,422,305.07	2,844,300.91
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-163,967,340.97	-18,207,213.09
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-163,967,340.97	-18,207,213.09
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-33,389,510.57	-203,974,136.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	111.21	1,823.29
减：二、费用	24,945,860.64	27,931,156.02
1. 管理人报酬	16,734,994.44	18,753,619.45
2. 托管费	5,578,331.51	6,251,206.46
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,944.48	22,862.24
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	2,618,590.21	2,903,467.87
三、利润总额（亏损总额以“-”	133,933,310.48	134,889,442.49

”号填列)		
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	133,933,310.48	134,889,442.49

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	6,132,813,527.12	-108,641,895.09	6,024,171,632.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	133,933,310.48	133,933,310.48
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)	-2,576,999,998.96	102,516,013.04	-2,474,483,985.92
其中: 1.基金申购款	9,000,000.02	-279,205.19	8,720,794.83
2.基金赎回款	-2,585,999,998.98	102,795,218.23	-2,483,204,780.75
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)	-	-321,528,810.00	-321,528,810.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,555,813,528.16	-193,721,381.57	3,362,092,146.59
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权	6,135,813,527.13	124,516,312.16	6,260,329,839.29

益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	134,889,442.49	134,889,442.49
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）	-3,000,000.01	-33,839.74	-3,033,839.75
其中：1.基金申购款	3,000,000.02	70,876.51	3,070,876.53
2.基金赎回款	-6,000,000.03	-104,716.25	-6,104,716.28
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）	-	-368,013,810.00	-368,013,810.00
五、期末所有者权益（基金净值）	6,132,813,527.12	-108,641,895.09	6,024,171,632.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金(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]932 号《关于准予上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,687,472,613.00 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 671 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,687,813,530.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 340,917.00 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《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，基金合同生效后，海富通基金管理有限公司可以对本基金进行基金份额折算与变更登记。根据 2014 年 11 月 28 日海富通基金管理有限公司《海富通基金管理有限公司关于上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》，本基金管理人于 2014 年 12 月 3 日对各基金份额持有人认购的基金份额进行折算。本基金折算前基金份额总额为 6,687,813,530.00 份，折算前基金份额净值为 0.994 元；根据本基金的基金份额折算方法，折算后基金份额总额为 66,878,135.00 份，折算后基金份额净值为 99.422 元。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2014]第 671 号文审核同意，本基金于 2014 年 12 月 16 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证可质押城投债指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券，该部分资产的投资比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场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的相关规定)。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。本基金的业绩比较基准：上证可质押城投债指数。

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 2018 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信

息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司 (BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
海通证券	893,946,329.64	100.00%	1,729,941,802.75	100.00%

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
海通证券	6,322,900,000.00	100.00%	1,162,200,000.00	100.00%

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,734,994.44	18,753,619.45
其中：支付销售机构的客户维护费	292,535.25	307,138.28

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%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×0.30%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,578,331.51	6,251,206.46

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 0.10%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×0.10%÷当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）

交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
海通证券	4,106,252.00	11.55%	5,018,361.00	8.18%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	8,419,674.32	255,195.22	15,095,860.44	385,422.14

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 3,158,357,742.70 元，无属于第一层次以及第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次 5,745,978,033.00 元，无属于第一层次以及第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于

明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,158,357,742.70	93.89
	其中：债券	3,158,357,742.70	93.89
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	64,044,606.32	1.90
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,424,219.77	0.34
8	其他各项资产	130,183,957.51	3.87

9	合计	3,364,010,526.30	100.00
---	----	------------------	--------

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.5 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	9,947,000.00	0.30
	其中：政策性金融债	9,947,000.00	0.30
4	企业债券	3,148,410,742.70	93.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	3,158,357,742.70	93.94

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	122854	11 中汇债	568,850	56,902,065.50	1.69
2	122819	11 常城建	567,610	56,806,408.80	1.69
3	124575	PR 汕投资	455,390	43,225,618.80	1.29
4	122719	12 龙交投	373,580	41,575,718.20	1.24
5	124357	13 津房开	401,350	40,476,147.50	1.20

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的 13 津房开（124357）的发行人因其未于规定时间之前披露 2016 年年度报告，于 2017 年 6 月 9 日收到上海证券交易所出具的书面警示函。

对该证券的投资决策程序的说明：该投资为跟踪指数被动投资。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	57,931.67
2	应收证券清算款	3,109,144.32
3	应收股利	-
4	应收利息	127,016,881.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	130,183,957.51

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,103	32,237.66	34,272,485.00	96.38%	1,285,650.00	3.62%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	海通证券股份有限公司	4,106,252.00	11.55%
2	东方证券股份有限公司	2,000,120.00	5.62%
3	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,700,000.00	4.78%
4	博时基金公司—农行—中国农业银行股份有限公司企业年金理事会	1,300,000.00	3.66%
5	中国建设银行股份有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,174,515.00	3.30%
6	平安资管—中国银行—如意 6 号资产管理产品	1,000,060.00	2.81%
7	华夏基金—民生银行—中国民生银行股份有限公司	1,000,060.00	2.81%
8	平安资管—工商银行—如意 7 号保险资产管理产品	1,000,060.00	2.81%
9	东吴证券股份有限公司	999,990.00	2.81%

10	光大证券股份有限公司	897,701.00	2.52%
----	------------	------------	-------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年11月13日)基金份额总额	6,687,813,530
本报告期期初基金份额总额	61,328,135.00
本报告期基金总申购份额	90,000
减：本报告期基金总赎回份额	25,860,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	35,558,135.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2017年2月4日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第五届董事会第十次临时会议审议通过，同意刘颂先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长张

文伟先生代为履行总经理职务。

2、2017 年 9 月 13 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第五届董事会第五次会议审议通过，聘任任志强先生担任公司总经理职务，同时公司董事长张文伟先生不再代行总经理职务。

基金托管人：

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 110,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

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，并报公司总经理办公会议核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会议核准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	893,946,329.64	100.00%	6,322,900,000.00	100.00%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 56 只公募基金。截至 2017 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 507.14 亿元人民币。

2004 年末开始，海富通及子公司为 QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至 2017 年 12 月 31 日，投资咨询及海外业务规模超

过 41 亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，截至 2017 年 12 月 31 日，海富通为近 80 家企业超过 376 亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，截至 2017 年 12 月 31 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 417 亿元。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 2 月，海富通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

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

海富通基金管理有限公司
二〇一八年三月二十七日