

海富通中国海外精选混合型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	海富通中国海外混合(QDII)
基金主代码	519601
交易代码	519601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 27 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,622,500.98 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以在香港、美国等海外证券交易所上市的具有“中国概念”的上市公司为主要投资对象。本基金管理人将深入研究全球及内地经济状况以及政策导向，采取主动精选证券和适度资产配置的投资策略，实施全程风险管理，在保证资产良好流动性的前提下，在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	根据对境内外证券市场投资经验的认识和对证券市场的实证分析，本基金管理人将基金的整体投资策略分为二个层次：第一层次为适度主动的资产配置，以控制或规避市场系统性风险；第二层次为积极主动的精选证券，以分散或规避个券风险。主动精选证券是本基金投资策略的重点，本基金不积极谋求寻找市场的拐点，主要从控制系统性风险出发适度调整资产配置。
业绩比较基准	MSCI 中国指数（以美元计价）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	海富通基金管理有限公司		中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	田青
	联系电话	021-38650891	010-67595096
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话	40088-40099		010-67595096
传真	021-33830166		010-66275853

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

注：本公司于 2018 年 1 月 31 日发布公告，自 2018 年 2 月 1 日起，法国巴黎资产管理英国有限公司不再担任本基金的境外投资顾问。

2.5 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	10,949,767.21	-35,741,671.07	-26,697,688.33
本期利润	53,923,683.21	-2,213,057.68	-72,480,575.64
加权平均基金份额本期利润	0.4955	-0.0194	-0.5933
本期基金份额净值增长率	37.40%	-2.65%	-12.13%
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	0.1300	0.0312	0.3457
期末基金资产净值	199,402,207.86	164,770,906.46	143,119,463.12
期末基金份额净值	1.870	1.361	1.398

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
过去三个月	5.23%	1.27%	5.46%	1.06%	-0.23%	0.21%
过去六个月	18.96%	1.15%	17.36%	0.97%	1.60%	0.18%
过去一年	37.40%	0.97%	37.76%	0.87%	-0.36%	0.10%
过去三年	17.54%	1.99%	40.64%	1.29%	-23.10%	0.70%
过去五年	43.30%	1.69%	47.15%	1.21%	-3.85%	0.48%
自基金合同生效起至	129.81%	1.67%	34.35%	1.70%	95.46%	-0.03%

今						
---	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

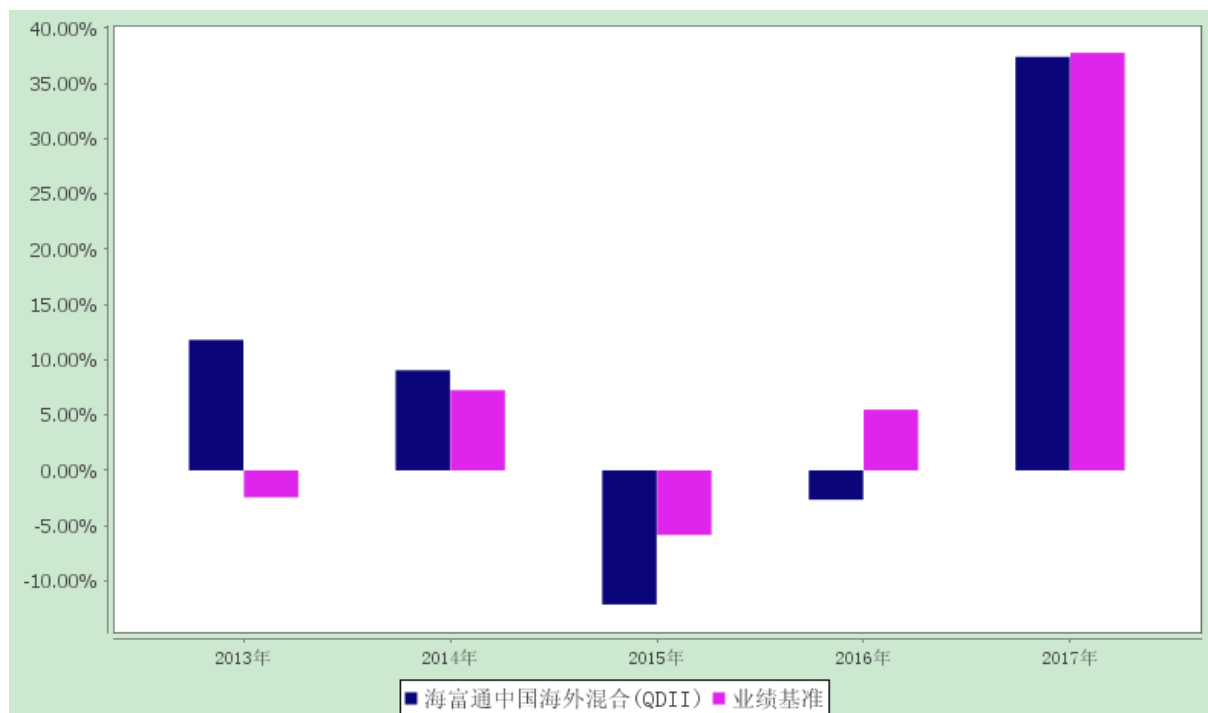
海富通中国海外精选混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2008 年 6 月 27 日至 2017 年 12 月 31 日)



- 注：1、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条（二）投资范围、（八）投资限制中规定的各项比例；
- 2、本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国指数（美元计价），在与同期业绩进行比较时，该基准已经转换为与本基金相同的计价货币（人民币）。

3.2.3 过去五年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

海富通中国海外精选混合型证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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	-	-	-	-	-
2016	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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		
张炳炜	本基金的基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通大中华混合（QDII）基金经理；	2016-02-04	-	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任交银施罗德基金管理有限公司数量分析师，2011 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，任股票分析

	海富通沪港深混合基金经理；海富通欣悦混合基金经理。				师。2015 年 6 月起任海富通强化回报混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通大中华混合（QDII）和海富通中国海外混合（QDII）基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通沪港深混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通欣悦混合基金经理。
卜正伦	本基金的基金经理；海富通大中华混合（QDII）基金经理	2016-08-16	-	12 年	中国籍，硕士，持有基金从业人员资格证书。历任永丰金证券、富邦证券、海富通资产管理（香港）有限公司分析师。2016 年 8 月起任海富通大中华混合（QDII）和海富通中国海外混合（QDII）基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Colin Walsh GRAHAM	法国巴黎资产管理(原法国巴黎投资管理)英国有限公司多重资产主动资产配置总监、首席投资官	22 年	英国国籍，伦敦布鲁内尔大学管理学和数学理科学士。历任 Mercer（美世咨询）精算顾问、BlackRock（贝莱德集团）全球多资产策略团队联席主管。2014 年 3 月起担任法国巴黎资产管理(原法国巴黎投资管理)多重资产主动资产配置总监、首席投资官。

注：本公司于 2018 年 1 月 31 日发布公告，自 2018 年 2 月 1 日起，法国巴黎资产管理英国有限公司不再担任本基金的境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2017 年，中国海外股票市场表现亮眼。其中恒生指数高歌猛进，2017 全年累计上涨 35.99%，恒生国企指数则为 24.64%；相比同期上证综指上涨 6.56%，深证成指和中小板指分别上涨 8.48%和 16.73%，港股明显有受到互连互通机制推动的正面影响。

回顾全年的走势，港股自二月起开始明显感受到南下资金涌入的效应，一路走高。由于两地市场仍有相当价差，港股估值较吸引，不少国内资金正式将香港市场列入配置，增加较大的投研资源配置。在此情况下，港股市场具有特殊成长题材的个股也得到更多关注，得到合理的评价。2017 全年包括权值板块的保险、地产，以及具有成长题材的电子、汽车等等都有不小的涨幅。最终恒生指数收于 29919.15 点，恒生国企指数收于 11709.30 点。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 37.40%，同期业绩比较基准收益率 37.76%，基金净值跑输业绩比较基准 0.36 个百分点。跑输基准主要在于相对低配指数中权重超过 10%的科网股。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年全年，预计中国经济仍将保持较好韧性，虽然地产和基建的小幅回落、2+26 城环保限产对短期经济会带来小幅下行压力，但居民消费稳中升级、全球经济复苏带来外需稳中向好、制造业投资提升均是经济增长的重要支撑。通胀水平总体平稳、温和，物价结构可能出现新的分化，PPI 对 CPI 的传导、大宗商品如石油、农产品等可能成为新的涨价因素，要警惕通胀走高的风险。而房地产相关的价格上涨、供给侧改革触发的价格波动可能有所弱化。

宏观政策方面，积极的财政政策取向不变，但会调整优化财政支出结构；稳健的货币政策要保持中性，管住货币供给总闸门；守住不发生系统性金融风险的底线；结构性政策要发挥更大作用，更好地服务实体经济。因此，金融监管仍然是全年的主线，而更好地服务和促进实体经济是目前宏观监管政策的主要目标。

2017 年在中国海外市场，消费、大金融及电子表现较好，这与经济平稳复苏、企业业绩改善、金融监管抑制高估值成长股泡沫是密切相关的。2018 年全年，我们仍看好股票市场的表现，主要的逻辑是从盈利、估值、流动性三要素来看，由于国内企业盈利稳定增长，港股估值在全球来看并不贵，流动性虽然受金融监管影响，整体货币环境不宽松，但理财新规带来的资产配置转向可能给股票市场带来新的增量。我们预计价值投资仍是市场的主线，市场将继续围绕业绩增长、价值发现的方向进行演绎。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 60%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，

对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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：海富通中国海外精选混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 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	27,381,389.81	46,910,838.13
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	173,777,662.20	120,542,177.87
其中：股票投资	173,777,662.20	120,542,177.87
基金投资	-	-
债券投资	-	-

资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	908.64	2,319.14
应收股利	40,000.00	-
应收申购款	294,491.78	27,600.70
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	201,494,452.43	167,482,935.84
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	-	1,586,974.58
应付赎回款	1,402,533.28	479,962.56
应付管理人报酬	254,351.53	220,671.61
应付托管费	59,348.68	51,490.07
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	376,011.08	372,930.56
负债合计	2,092,244.57	2,712,029.38
所有者权益:		
实收基金	106,622,500.98	121,037,728.10
未分配利润	92,779,706.88	43,733,178.36

所有者权益合计	199,402,207.86	164,770,906.46
负债和所有者权益总计	201,494,452.43	167,482,935.84

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.870 元，基金份额总额 106,622,500.98 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通中国海外精选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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	58,270,160.77	1,365,725.37
1.利息收入	53,777.63	77,757.77
其中：存款利息收入	53,777.63	77,757.77
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	16,689,858.54	-33,860,736.64
其中：股票投资收益	14,474,666.73	-36,765,545.17
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	7,752.68
股利收益	2,215,191.81	2,897,055.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	42,973,916.00	33,528,613.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-1,491,227.15	1,579,856.19
5.其他收入（损失以“-”号填列）	43,835.75	40,234.66

减：二、费用	4,346,477.56	3,578,783.05
1. 管理人报酬	2,665,120.63	2,243,105.52
2. 托管费	621,861.43	523,391.40
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	663,514.78	429,504.95
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	395,980.72	382,781.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	53,923,683.21	-2,213,057.68
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	53,923,683.21	-2,213,057.68

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通中国海外精选混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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）	121,037,728.10	43,733,178.36	164,770,906.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,923,683.21	53,923,683.21
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）	-14,415,227.12	-4,877,154.69	-19,292,381.81
其中：1.基金申购款	36,792,541.03	29,362,144.10	66,154,685.13
2.基金赎回款	-51,207,768.15	-34,239,298.79	-85,447,066.94
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）	106,622,500.98	92,779,706.88	199,402,207.86
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、期初所有者权益（基金净值）	102,384,429.05	40,735,034.07	143,119,463.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,213,057.68	-2,213,057.68
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）	18,653,299.05	5,211,201.97	23,864,501.02
其中：1.基金申购款	51,299,345.82	16,104,885.99	67,404,231.81
2.基金赎回款	-32,646,046.77	-10,893,684.02	-43,539,730.79
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）	121,037,728.10	43,733,178.36	164,770,906.46

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

海富通中国海外精选混合型证券投资基金(原名为海富通中国海外精选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 340 号《关于同意海富通中国海外精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中国海外精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 508,724,605.42 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 104 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通中国海外精选股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 6 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 508,856,821.43 份基金份额,其中认购资金利息折合 132,216.01 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,海富通中国海外精选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为海富通中国海外精选混合型证券投资基金。

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

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 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》、《海富通中国海外精选混合型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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止)且暂不征收企业所得税。

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

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

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	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通国际证券	-	-	10,247,876.04	5.40%

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 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1月1日至2017年12月31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
海通国际证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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
海通国际证券	10,247.88	4.41%	-	-

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	2,665,120.63	2,243,105.52
其中：支付销售机构的客户维护费	520,379.16	509,780.35

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 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

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	621,861.43	523,391.40

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	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
报告期初持有的基金份额	10,007,100.00	10,007,100.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总 份额	10,007,100.00	-
报告期末持有的基金份额	-	10,007,100.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	8.27%

注：1、基金管理人于 2008 年 06 月 18 日运用自有资金认购本基金 3000.71 万元，认购费为 1000 元。

2、基金管理人于报告期赎回共计 10,007,100.00 份，赎回总金额人民币 15,701,104.40 元，由于持有期超过 2 年，该基金相关适用的赎回费率为零，无赎回费，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

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

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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
中国建设银行	3,796,626.25	53,771.10	9,029,445.89	75,541.01
纽约梅隆银行	23,584,763.56	0.62	37,881,392.24	-
合计	27,381,389.81	53,771.72	46,910,838.13	75,541.01

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

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

本基金本报告期内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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

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一层次的余额为 173,777,662.20 元，无属于第二层次和第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次 120,542,177.87 元，无属于第二层次和第三层次的余额）。

(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股票和债券，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)、或属于非公开发行等情况，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股票和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，确定相关股票和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：未持有)。

(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	173,777,662.20	86.24
	其中：普通股	149,296,007.71	74.09
	存托凭证	24,481,654.49	12.15
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,381,389.81	13.59
8	其他各项资产	335,400.42	0.17
9	合计	201,494,452.43	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	149,296,007.71	74.87
美国	24,481,654.49	12.28
合计	173,777,662.20	87.15

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

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	76,771,755.75	38.50
金融	34,856,192.68	17.48
非日常生活消费品	25,263,020.66	12.67
日常消费品	10,489,978.55	5.26
工业	7,870,409.41	3.95
能源	6,258,881.23	3.14
-	5,375,382.63	2.70
医疗保健	4,616,426.42	2.32
公共事业	2,275,614.87	1.14
合计	173,777,662.20	87.15

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	56,000	19,003,996.21	9.53
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	美国证券交易所	美国	14,000	15,773,689.50	7.91
3	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港证券交易所	中国香港	140,000	11,690,266.14	5.86
4	PING AN INSURANCE GROUP	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	145,000	9,859,535.02	4.94

	CO-H							
5	CHINA MERCH ANTS BANK- H	招商银行 股份有限 公司	3968 HK	香港证 券交易 所	中国香港	350,000	9,098,280.20	4.56
6	GEELY AUTO MOBIL E HOLDI NGS LT	吉利汽车 控股有限 公司	175 HK	香港证 券交易 所	中国香港	400,000	9,060,666.73	4.54
7	AAC TECHN OLOGIE S HOLDI NGS IN	瑞声科技 控股有限 公司	2018 HK	香港证 券交易 所	中国香港	70,000	8,156,271.77	4.09
8	CHINA SOFT INTER NATIO NAL LTD	中软国际 有限公司	354 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,500,000	6,507,130.12	3.26
9	MINTH GROUP LTD	敏实集团 有限公司	425 HK	香港证 券交易 所	中国香港	160,000	6,305,689.10	3.16
10	HENGA N INTL GROUP CO LTD	恒安国际	1044 HK	香港证 券交易 所	中国香港	80,000	5,800,832.76	2.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细，应阅读登载于
www.hftfund.com 网站的年度报告正文。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	ALIBABA GROUP	BABA US	11,265,946.66	6.84

	HOLDING-SP ADR			
2	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	7,819,011.54	4.75
3	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 HK	6,244,116.22	3.79
4	NETEASE INC-ADR	NTES US	5,735,638.68	3.48
5	SINOTRUK HONG KONG LTD	3808 HK	5,680,066.96	3.45
6	CHINA COSCO HOLDINGS-H	1919 HK	5,138,851.94	3.12
7	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	5,114,312.04	3.10
8	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	4,830,245.41	2.93
9	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	4,748,964.89	2.88
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	4,391,197.02	2.67
11	IND & COMM BK OF CHINA-H	1398 HK	4,291,299.28	2.60
12	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	4,239,725.97	2.57
13	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1347 HK	4,144,596.98	2.52
14	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	4,143,645.41	2.51
15	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	3,959,764.47	2.40
16	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	1728 HK	3,921,730.82	2.38
17	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	291 HK	3,835,327.67	2.33
18	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	3,762,051.47	2.28
19	LONGFOR PROPERTIES	960 HK	3,673,666.60	2.23

20	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	3,601,748.72	2.19
21	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	3908 HK	3,446,074.75	2.09

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。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代 码	本期累计卖 出金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	525 HK	7,896,162.50	4.79
2	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	7,696,076.84	4.67
3	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	6,390,929.90	3.88
4	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	6,260,440.07	3.80
5	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	1513 HK	5,709,131.54	3.46
6	BBMG CORP-H	2009 HK	5,415,022.94	3.29
7	CHINA MOBILE LTD	941 HK	5,279,497.69	3.20
8	CHINA COSCO HOLDINGS-H	1919 HK	5,250,046.61	3.19
9	SINOTRUK HONG KONG LTD	3808 HK	4,988,481.33	3.03
10	SUN ART RETAIL GROUP LTD	6808 HK	4,804,420.50	2.92
11	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	4,735,281.49	2.87
12	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2628 HK	4,644,580.19	2.82
13	COGOBUY GROUP	400 HK	4,548,690.95	2.76
14	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	4,357,007.54	2.64
15	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	4,041,192.82	2.45
16	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	3,981,620.19	2.42
17	CHINA ZHENG TONG AUTO SERVICE	1728 HK	3,765,730.56	2.29
18	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	3,763,590.51	2.28
19	JD.COM INC-ADR	JD US	3,612,246.06	2.19
20	CITIC SECURITIES CO LTD-H	6030 HK	3,535,800.11	2.15
21	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	3,499,171.84	2.12
22	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	1385 HK	3,483,838.58	2.11
23	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	3,413,684.63	2.07

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	159,761,008.81
卖出收入（成交）总额	163,898,398.61

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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

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

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	40,000.00
4	应收利息	908.64
5	应收申购款	294,491.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	335,400.42

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
8,598	12,400.85	32,073,378.20	30.08%	74,549,122.78	69.92%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	32,016.81	0.0300%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年6月27日)基金份额总额	508,856,821.43
本报告期期初基金份额总额	121,037,728.10
本报告期基金总申购份额	36,792,541.03
减：本报告期基金总赎回份额	51,207,768.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	106,622,500.98

§ 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。

托管行：

2017年9月1日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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。报告期内应付审计费金额为 72,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限是 10 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	
China Merchants Sec(HK) Limited	-	93,419,585.49	28.86%	93,419.62	26.46%	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	64,427,297.54	19.91%	68,060.71	19.28%	-
UBS Securities Asia Limited	-	50,908,187.03	15.73%	50,908.21	14.42%	-
UOB Kay Hian (HongKong) Limited	-	45,309,115.76	14.00%	45,309.13	12.83%	-
BOCOM International Securities Limited	-	24,363,833.49	7.53%	36,545.77	10.35%	-
CITIC Securities International Company	-	16,799,888.31	5.19%	20,159.87	5.71%	-

Limited						
ICBC International Holdings Limited	-	9,931,000.32	3.07%	9,931.00	2.81%	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	7,643,680.36	2.36%	15,287.34	4.33%	-
CCB International Securities Limited	-	4,454,860.05	1.38%	6,682.29	1.89%	-
CHINA INDUSTRIAL SECURITIES INTERNATIONAL BROKERAGE LIMITED	-	3,220,060.75	0.99%	3,376.20	0.96%	-
BOCI Security Ltd	-	2,198,778.25	0.68%	2,198.78	0.62%	-
SINOLINK SECURITIES(SHK)	-	983,120.03	0.30%	1,179.74	0.33%	-
Deutsche Bank A.G. London	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities(HK) Limited	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-
ShenYin WanGuo (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIES CO., LTD.	-	-	-	-	-	-
Nomura	-	-	-	-	-	-

Securities (HK) Ltd						
CICC HK SEC. Limited	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
CLSA Group	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY CO. INTERNATIONAL PLC	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-

注：1. 报告期内本基金新租用券商国金证券（香港）SINOLINK SECURITIES(HK)、UOB Kay Hian (HongKong) Limited 的交易单元。

2. (1) 交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

(2) 交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的

200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总经理办公会议核准。

<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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
China Merchants Sec(HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UOB Kay Hian (HongKong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International	-	-	-	-	-	-	-	-

Holdings Limited									
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CHINA INDUSTRIAL SECURITIES INTERNATIONAL BROKERAGE LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SINOLINK SECURITIES(HK)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank A.G. London	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities(HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ShenYin WanGuo (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIES CO., LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC HK	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

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

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	2017/7/5-2017/12/31	21,555,247.60	-	-	21,555,247.60	20.20%
产品特有风险							
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：

- 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；
- 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。
- 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。
- 4、其他可能的风险。

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。

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