

**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  
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：中国工商银行股份有限公司**

**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。

基金托管人中国工商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	海富通上证非周期 ETF 联接
基金主代码	519032
交易代码	519032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 27 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,048,205.02 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510120
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 22 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 6 月 8 日
基金管理人名称	海富通基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

注：本表所列的基金主代码 510120 为目标基金的二级市场交易代码，目标基金的一级市场申购赎回代码为 510121。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于上证非周期行业 100ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金通过主要投资于上证非周期行业 100ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数的表现。建仓完成后，正常情况下投资于上证非周期行业 100ETF 的比例不低于基金资产净值的

	90%。
业绩比较基准	上证非周期行业 100 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，具有与上证非周期行业 100 指数相似的风险收益特征。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证非周期行业 100 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	郭明
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798

## 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	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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	-1,237,632.56	-1,378,418.31	31,096,996.34
本期利润	3,178,061.55	-3,688,088.50	13,118,944.80
加权平均基金份额本期利润	0.1557	-0.1505	0.2893
本期基金份额净值增长率	14.27%	-11.62%	11.68%
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	0.1513	0.0653	0.2054
期末基金资产净值	20,747,796.22	24,059,062.82	31,027,119.30
期末基金份额净值	1.217	1.065	1.205

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)。

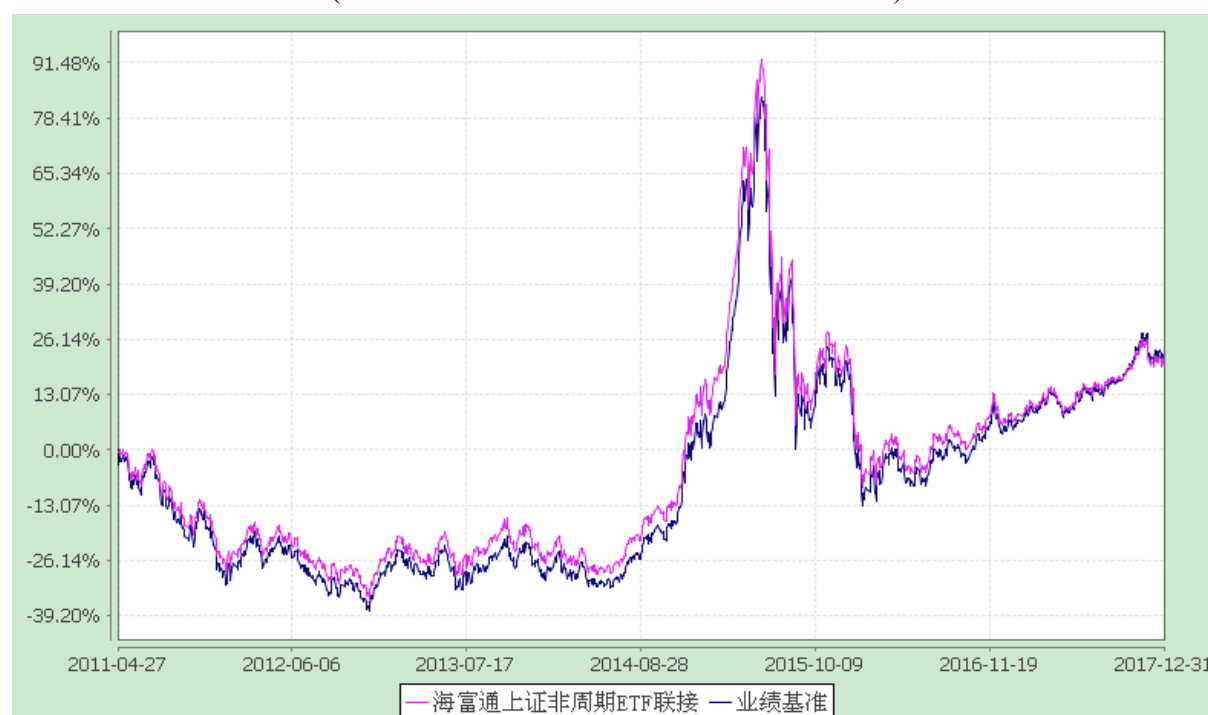
### 3.2 基金净值表现

#### 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	3.57%	0.70%	3.87%	0.77%	-0.30%	-0.07%
过去六个月	5.55%	0.60%	6.67%	0.64%	-1.12%	-0.04%
过去一年	14.27%	0.58%	16.74%	0.61%	-2.47%	-0.03%
过去三年	12.79%	1.68%	20.10%	1.78%	-7.31%	-0.10%
过去五年	64.24%	1.49%	72.68%	1.56%	-8.44%	-0.07%
自基金合同生效起至今	21.70%	1.41%	22.36%	1.49%	-0.66%	-0.08%

#### 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  
(2011 年 4 月 27 日至 2017 年 12 月 31 日)

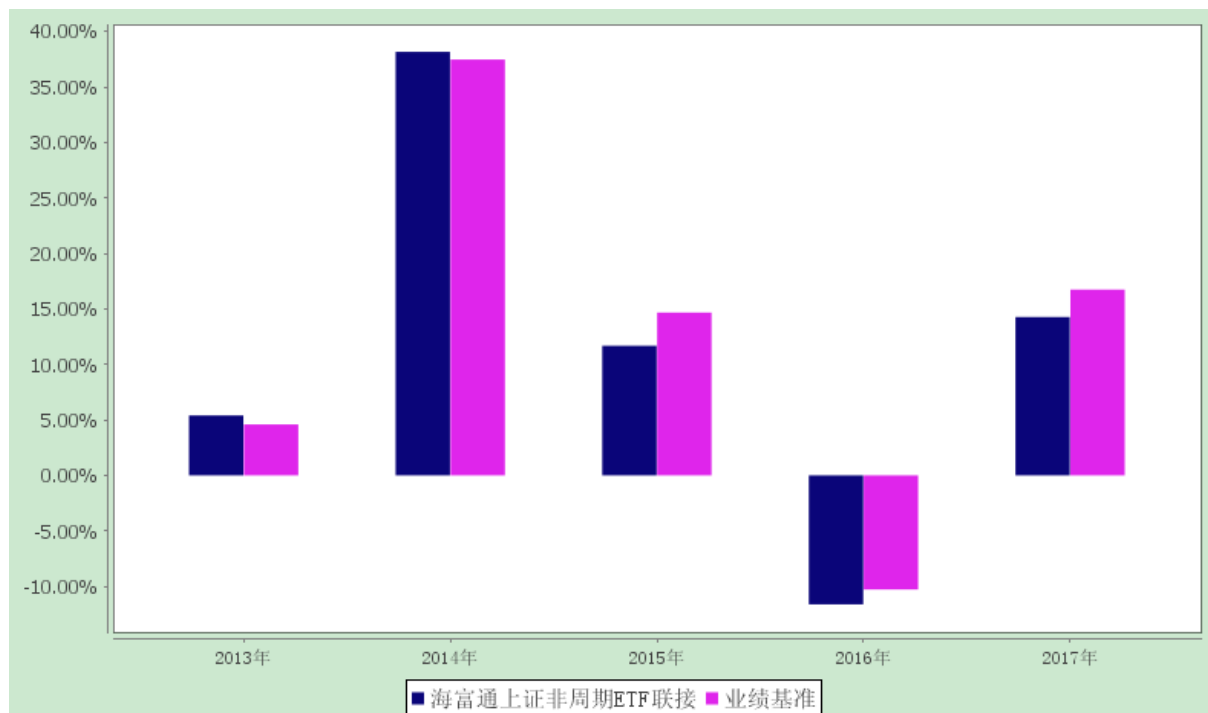


注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起三个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（六）投资限制中规定的各项比例。

### 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

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

注：本基金过去三年未发生利润分配的情况。

## § 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		



刘璎	本基金的基金经理；海富通上证非周期 ETF 基金经理；海富通上证周期 ETF 基金经理；海富通上证周期 ETF 联接基金经理；海富通中证 100 指数 (LOF) 基金经理；海富通中证内地低碳指数基金经理。	2011-04-27	-	16 年	<p>管理学硕士，持有基金从业人员资格证书。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司，曾任华安上证 180ETF 基金经理助理；2007 年 3 月至 2010 年 6 月担任华安上证 180ETF 基金经理，2008 年 4 月至 2010 年 6 月担任华安中国 A 股增强指数基金经理。2010 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2010 年 11 月起任海富通上证周期 ETF 及海富通上证周期 ETF 联接基金经理。2011 年 4 月起任海富通上证非周期 ETF 及海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2012 年 1 月起兼任海富通中证 100 指数 (LOF) 基金经理。2012 年 5 月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。</p>
金晓鸣	本基金的基金经理助理；海富通上证非周期 ETF 基金经	2014-11-13	-	9 年	<p>经济学学士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 7 月加入海富通基金管</p>

	理助理；海富通上证周期 ETF 基金经理助理；海富通上证周期 ETF 联接基金经理助理				理有限公司，先后在运营部和权益投资部任职，2014 年 11 月起任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通上证非周期 ETF 联接的基金经理助理。
--	---	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日；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

回顾 2017 年，A 股市场整体“稳中有进”，但分化较为显著，各大指数的表现也很好的反映了这一点。2017 年以上证 50 为代表的大盘蓝筹股高歌猛进，全年累计上涨 25.08%，而创业板指则一路震荡，最终仍下跌 10.67%。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%。

金融监管是 2017 年 A 股市场最重要的政策变量，在防风险、去杠杆、“脱虚向实”等的导向之下，再融资新规、减持新规等相继发布，高杠杆收购、操纵股价等违规行为也受到了严厉的处罚，IPO 提速的同时也加强了审核的力度。2017 年的 A 股市场也在不断探索前进，6 月 A 股被正式纳入 MSCI，进一步与国际市场接轨。

回顾全年的走势，年初以来，沪深股指维持小幅震荡上行的行情。一季度除了创业板指表现为下跌外，其余三大指数均以阳线报收，但行业板块方面分化较为严重。二季度初始雄安新区概念引发了市场的高度关注，带动指数持续上涨，整体呈现先抑后扬的走势。白马龙头股继续上攻，创业板和次新股出现大幅调整，市场呈现明显的“一九行情”。三季度市场整体恢复震荡上行趋势，热点层出不穷，市场情绪较二季度有所回暖，大盘蓝筹依然备受青睐，周期股也强势爆发。但后续上涨乏力，利率中枢不断抬升导致估值预期出现调整，资金追高动能不足，叠加临近年底机构获利了结等因素，大消费板块集体回调，带动指数快速下跌。最终上证综指收于 3307.17 点，深证成指收于 11040.45 点，中小板指和创业板指报 7554.86 点和 1752.65 点。

板块方面，在中信证券 29 个一级行业分类中，半数飘红，其中食品饮料（55.72%）、家电（36.64%）、煤炭（29.34%）、银行（27.81%）和非银行金融（18.53%）涨幅居前，纺织服装（-22.77%）、传媒（-20.35%）、国防军工（-18.61%）、计算机（-17.49%）和轻工制造（-13.13%）跌幅居前。

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，本基金净值增长率为 14.27%，同期业绩比较基准收益率为 16.74%。

#### 4.5 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发展实体经济是目前宏观监管政策的主要目标。

2017 年，泛消费、大金融、周期品行业及白马蓝筹表现较好，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，A 股企业盈利稳定增长，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。投资策略来看：第一，由于新增资金（海外资金和理财资金）的属性偏好低估值高分红的品种，因此，低估值品种的价值提升和重估可能是全年的主线逻辑；第二，目前各传统、新兴行业均显著出现龙头企业竞争力突出、市场占有率不断提升的状况，而且大部分龙头的估值依然具备优势（相对于行业内的非龙头公司），因此优选龙头依然是较好的策略之一；第三，随着经济复苏进入第三年，我们可以去挖掘较晚进入复苏周期或行业复苏可持续的细分行业和个股，也可关注全球经济回暖引发通胀中枢的回升的涨价机会；第四，我们可以在调整时间较长、未来符合经济转型或政策鼓励方向的“偏成长”的细分行业加大挖掘、配置力度，十九大报告、中央经济工作会议文件已经给出了很好的方向指引。

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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.8 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

本基金自 2015 年 7 月 24 日至 2017 年 12 月 31 日，已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人拟通过终止基金合同的方式解决，并将根据基金合同召开持有人大会进行表决。解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。

## § 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，本基金托管人在对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的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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的管理人——海富通基金管理有限公司在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的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，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未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的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 2017 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：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  
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	1,546,508.28	2,215,055.57

结算备付金	-	-
存出保证金	1,075.05	766.50
交易性金融资产	19,359,717.40	22,178,710.73
其中：股票投资	75,765.00	16,840.00
基金投资	19,283,952.40	22,161,870.73
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	2,052.76	-
应收利息	321.68	447.29
应收股利	-	-
应收申购款	199.76	1,192.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	20,909,874.93	24,396,172.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
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	18,681.21	4,516.95
应付管理人报酬	637.38	869.97
应付托管费	127.51	173.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,619.95	1,540.44
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	140,012.66	330,008.67
负债合计	162,078.71	337,110.02
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	17,048,205.02	22,584,873.92
未分配利润	3,699,591.20	1,474,188.90
所有者权益合计	20,747,796.22	24,059,062.82
负债和所有者权益总计	20,909,874.93	24,396,172.84

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.217 元，基金份额总额 17,048,205.02 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

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
<b>一、收入</b>	<b>3,341,095.58</b>	<b>-3,360,312.15</b>
1.利息收入	13,801.96	14,812.32
其中：存款利息收入	13,801.96	14,812.32
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）	-1,090,164.14	-1,068,725.63
其中：股票投资收益	-3,652.89	-30,319.23
基金投资收益	-1,086,520.35	-1,038,394.40
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	-	-



股利收益	9.10	-12.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,415,694.11	-2,309,670.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,763.65	3,271.35
<b>减：二、费用</b>	<b>163,034.03</b>	<b>327,776.35</b>
1. 管理人报酬	8,202.10	8,848.75
2. 托管费	1,640.44	1,769.74
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	12,953.49	6,919.86
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	140,238.00	310,238.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>3,178,061.55</b>	<b>-3,688,088.50</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>3,178,061.55</b>	<b>-3,688,088.50</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	22,584,873.92	1,474,188.90	24,059,062.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,178,061.55	3,178,061.55
三、本期基金份额交易产生的基金净	-5,536,668.90	-952,659.25	-6,489,328.15

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	887,588.16	106,406.72	993,994.88
2.基金赎回款	-6,424,257.06	-1,059,065.97	-7,483,323.03
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）	17,048,205.02	3,699,591.20	20,747,796.22
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）	25,740,365.29	5,286,754.01	31,027,119.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,688,088.50	-3,688,088.50
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）	-3,155,491.37	-124,476.61	-3,279,967.98
其中：1.基金申购款	2,042,789.83	26,888.86	2,069,678.69
2.基金赎回款	-5,198,281.20	-151,365.47	-5,349,646.67
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）	22,584,873.92	1,474,188.90	24,059,062.82

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(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[2011]第 268 号《关于核准上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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 380,734,029.43 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(2011)第 145 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2011 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 380,846,897.86 份基金份额，其中认购资金利息折合 112,868.43 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

本基金为上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对上证非周期行业 100 指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为目标 ETF、上证非周期行业 100 指数成份股和备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金持有的目标 ETF 资产占基金资产净值的比例不低于 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金业绩比较基准：上证非周期行业 100 指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2017 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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与最近一期年度报告相一致,本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

#### 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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自 2017 年 9 月 22 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中央国债登记结算有限责任公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

### 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金 ("目标 ETF")	本基金的基金管理人管理的其他基金
---------------------------------------	------------------

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

本基金本报告期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	8,202.10	8,848.75
其中：支付销售机构的客户维护费	52,465.47	56,192.23

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取零)的 0.5% 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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) X 0.5% / 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	1,640.44	1,769.74
----------------	----------	----------

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取零)的 0.1% 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-基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) X 0.1% / 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

本基金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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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
中国工商银行	1,546,508.28	13,788.93	2,215,055.57	14,777.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

于本报告期末，本基金持有 6,297,829.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 65.65% (2016 年 12 月 31 日：68.32%)。

## 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

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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	-	-	3,500	51,075.00	51,065.00	-
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	400	12,856.00	12,856.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 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。

### 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 19,295,796.40 元，属于第二层次的余额为 63,921.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 22,161,870.73 元，第二层次



16,840.00 元，无属于第三层次的余额)。

(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：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	75,765.00	0.36
	其中：股票	75,765.00	0.36
2	基金投资	19,283,952.40	92.22
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	1,546,508.28	7.40
8	其他各项资产	3,649.25	0.02
9	合计	20,909,874.93	100.00

## 8.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	海富通基金管理有限公司	19,283,952.40	92.94

### 8.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	75,765.00	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	75,765.00	0.37

#### 8.3.2 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。

### 8.4 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	600485	信威集团	3,500	51,065.00	0.25
2	600332	白云山	400	12,856.00	0.06
3	600074	ST 保千里	1,200	11,844.00	0.06

## 8.5 报告期内股票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 名的股票明细

本基金本报告期未买入股票。

### 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	600519	贵州茅台	723,578.00	3.01
2	600887	伊利股份	314,787.00	1.31
3	601668	中国建筑	308,746.00	1.28
4	600104	上汽集团	227,677.00	0.95
5	601766	中国中车	217,374.00	0.90
6	600900	长江电力	211,422.00	0.88
7	600276	恒瑞医药	199,078.00	0.83
8	600050	中国联通	145,731.00	0.61
9	601390	中国中铁	141,897.00	0.59
10	601989	中国重工	137,345.00	0.57
11	600518	康美药业	128,346.00	0.53
12	601186	中国铁建	123,277.00	0.51
13	600703	三安光电	102,931.00	0.43
14	600309	万华化学	97,608.00	0.41
15	600690	青岛海尔	93,168.00	0.39
16	600089	特变电工	78,594.28	0.33
17	601669	中国电建	75,736.00	0.31
18	601985	中国核电	74,450.00	0.31
19	601727	上海电气	73,418.00	0.31
20	600741	华域汽车	73,295.00	0.30

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 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	-
卖出股票的收入（成交）总额	6,295,211.11

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 期末按债券品种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序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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.12.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 报告期内本基金投资的白云山（600332）于 2017 年 12 月 26 日公告称，山东当

地药监部门于 5 月 17 日在荷泽海慈医药连锁有限公司抽检何济公药厂生产的曲咪新乳膏 A1089 批次，经荷泽市食品药品检验检测研究院检验，有 2 支装量少于标示装量的 93%，不符合规定，其他内在项目包括含量、微生物限度等关键性指标均合格。广州市食品药品监督管理局药品分局调查后发现，以上事项是由于灌装设备故障时产生的装量异常所造成的。公司与何济公药厂对上述事件非常重视，并陆续采取了相关措施予以改进，以避免同类事件的发生。

报告期内本基金投资的 ST 保千里（600074）于 2017 年 8 月 12 日公告称，公司及控股股东、实际控制人庄敏及其一致行动人陈海昌、庄明、蒋俊杰在收购中达股份（保千里的前身）过程中，向评估机构提供虚假协议致使保千里电子评估值虚增，损害被收购公司中达股份及其股东的合法权益，严重违反《证券法》等相关规定；中达股份信息披露包含存在虚假记载的协议，构成信息披露违法行为。公司及当事人因此收到中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》。2017 年 11 月 25 日公告称，因时任实际控制人庄敏所持公司股份质押、冻结情况的信息披露存在违法违规和关联方资金占用和关联交易未披露等事宜，违反了《证券法》、《上市公司信息披露管理办法》等的规定，公司收到中国证监会江苏监管局《关于对江苏保千里视像科技集团股份有限公司采取责令改正措施的决定》。公司于 2017 年 12 月 14 日和 12 月 19 日分别公告称，因涉嫌信息披露违法违规，中国证监会决定对公司及股东庄敏进行立案调查。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金系指数型基金，对该证券的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

其余八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。

**8.13.2** 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。

### 8.13.3 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	1,075.05
2	应收证券清算款	2,052.76
3	应收股利	-
4	应收利息	321.68
5	应收申购款	199.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,649.25

**8.13.4 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。

**8.13.5 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	600485	信威集团	51,065.00	0.25	重大资产重组
2	600332	白云山	12,856.00	0.06	重大资产重组

**§ 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
2,055	8,295.96	99,038.78	0.58%	16,949,166.24	99.42%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

**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(2011 年 4 月 27 日)基金份额总额	380,846,897.86
本报告期期初基金份额总额	22,584,873.92
本报告期基金总申购份额	887,588.16
减：本报告期基金总赎回份额	6,424,257.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,048,205.02

## § 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。

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。

### 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 50,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 7 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	
国信证券	1	6,295,211.11	100.00%	5,863.03	100.00%	-

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》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 2011 年半年度报告的规定，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，并报总经理办公会核准。

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

### 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	占当	成交金	占当	成交金额	占当期	成交金	占当

	额	期债 券成 交总 额 的 比 例	额	期回 购成 交总 额 的 比 例		权证成 交总 额 的 比 例	额	期基 金成 交总 额 的 比 例
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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