

**海富通改革驱动灵活配置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	海富通改革驱动混合
基金主代码	519133
交易代码	519133
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 28 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	1,163,805,045.17 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将积极把握改革带来的投资机会，使投资者充分分享中国改革发展成果，并利用灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金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。本基金股票投资组合构建包括三个层次：首先是挖掘受益改革的行业；然后是在受益行业分析基础之上进行行业分析与配置；最后自下而上在行业内部精选个股。在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×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	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	wrxixi@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 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	107,719,747.14	14,551,142.16
本期利润	121,134,925.95	10,200,508.95
加权平均基金份额本期利润	0.1557	0.0610
本期基金份额净值增长率	17.45%	10.20%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0987	0.1016
期末基金资产净值	1,278,714,500.26	313,895,062.55
期末基金份额净值	1.099	1.102

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 2016 年 4 月 28 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

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	1.48%	0.96%	2.58%	0.41%	-1.10%	0.55%
过去六个月	14.33%	0.93%	5.03%	0.35%	9.30%	0.58%
过去一年	17.45%	0.91%	10.80%	0.32%	6.65%	0.59%
自基金合同生效起至今	29.43%	0.84%	13.65%	0.37%	15.78%	0.47%

#### 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

海富通改革驱动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的历史走势对比图  
 (2016 年 4 月 28 日至 2017 年 12 月 31 日)

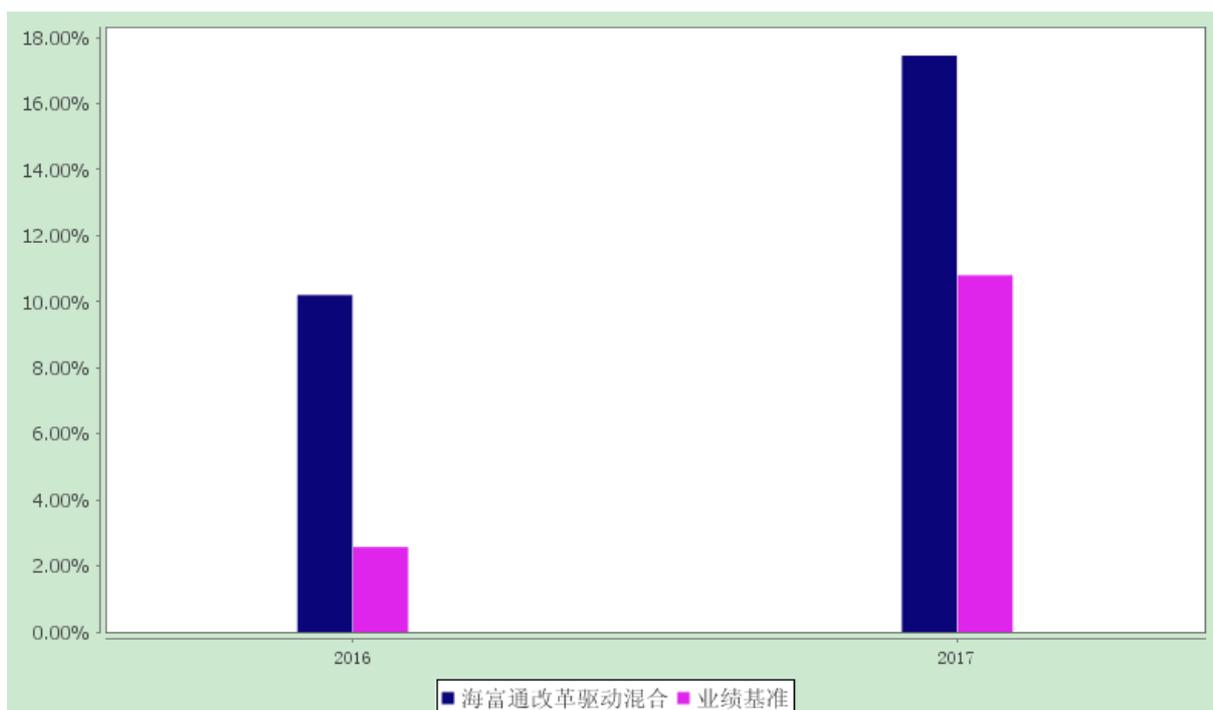


注：本基金合同于 2016 年 4 月 28 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

### 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

#### 海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金

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 2016 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 4 月 28 日（基

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	1.910	270,695,250.8 4	35,025,793.71	305,721,044.5 5	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	1.910	270,695,250.8 4	35,025,793.71	305,721,044.5 5	-

## § 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		
周雪军	本基金的基金经理；海富通收益增长混合基金经理	2016-04-28	-	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任北京金融街控股股份有限公司职员、天治基金管理有限公司研究员，2012 年 6 月至 2015 年 2 月任天治财富增长混合基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 2 月兼任天治趋势精选混合基金经理。2015 年 2 月加入海富通基金管理有限公司，2015 年 6 月起任海富通收益增长混合基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通改革驱动混合基金经

					理。
李志	本基金的基金经理助理；海富通精选混合基金经理助理；海富通收益增长混合基金经理助理；海富通股票混合基金经理助理；海富通强化回报混合基金经理助理；海富通风格优势混合基金经理助理；海富通精选贰号混合基金经理助理；海富通领先成长混合基金经理助理；海富通中小盘混合基金经理助理；海富通国策导向混合基金经理助理；海富通内需热点混合基金经理助理。	2016-07-14	2017-05-15	7 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任上海申银万国证券研究所有限公司助理分析师，汇丰晋信基金管理有限公司研究员，2015 年 12 月加入海富通基金管理有限公司，任股票相对收益组合部分分析师。2016 年 7 月至 2017 年 5 月任海富通精选混合、海富通收益增长混合、海富通股票混合、海富通强化回报混合、海富通风格优势混合、海富通精选贰号混合、海富通领先成长混合、海富通中小盘混合、海富通国策导向混合、海富通内需热点混合和海富通改革驱动混合的基金经理助理。2017 年 5 月起任海富通领先成长混合基金经理。
陶敏	本基金的基金经理助理；海富通精选混合基金经理助理；海富通收益增长混合基金经理助理；海富通股票	2017-06-01	-	12 年	工商管理硕士。持有基金从业人员资格证书。2004 年 7 月至 2008 年 8 月任华泰柏瑞基金管理有限公司基金清算与注册登记经理，2010 年

	混合基金助理；海富通强化回报混合基金助理；海富通风格优势混合基金助理；海富通精选贰号混合基金助理；海富通领先成长混合基金助理；海富通中小盘混合基金助理；海富通国策导向混合基金助理；海富通内需热点混合基金助理。			7 月至 2015 年 7 月任光大保德信基金管理有限公司行业研究员和策略研究员。2015 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任权益投资部行业研究员、周期组组长。2017 年 6 月起任海富通精选混合、海富通收益增长混合、海富通股票混合、海富通强化回报混合、海富通风格优势混合、海富通精选贰号混合、海富通领先成长混合、海富通中小盘混合、海富通国策导向混合、海富通内需热点混合和海富通改革驱动混合的基金助理。
--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限的计算标准：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

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。

在全年的操作中，本基金陆续重点配置了周期品、大金融以及部分消费品行业，总体把握住了市场的整体方向，取得了一定的超额收益。虽然市场的起伏使得基金净值有一定波动，但从全年看本基金表现较为稳健。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为 17.45%，同期基金业绩比较基准收益率为 10.80%，基金净值跑赢业绩比较基准 6.65 个百分点。

#### 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。

在新的一年里，本基金将以各行业龙头和代表性公司为主要关注标的，以经营基本面和企业价值为研究重点，在此基础上把握住各细分行业经营景气波动、公司价值变化带来的投资机会。操作策略方面，本基金将在总体均衡的基础上适时、适度偏离，注重结构转换和及时兑现收益，以“积小胜为大胜”的方式努力实现基金净值的稳健增长。

#### 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，基金管理人可对本基金进行基金分红，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。本基金本报告期内进行一次利润分配。利润分配以截至 2017 年 9 月 8 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2017 年 9 月 26 日完成权益登记，单位分红金额为 0.191 元，合计利润分配金

额 305,721,044.55 元。

本基金本报告期内进行利润分配符合基金合同规定。

#### 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，本基金托管人在对海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 305,721,044.55 元。

#### 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改革驱动灵活配置混合型证券投资基金 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：海富通改革驱动灵活配置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
<b>资产：</b>		
银行存款	70,474,727.12	25,716,086.55
结算备付金	5,638,832.45	1,288,317.65
存出保证金	693,236.60	136,012.85
交易性金融资产	1,207,107,819.50	282,022,464.27
其中：股票投资	1,204,466,615.70	282,022,464.27
基金投资	-	-
债券投资	2,641,203.80	-
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	642,777.21	6,057,838.83
应收利息	16,258.32	7,150.03
应收股利	-	-
应收申购款	234,235.54	48,767.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,284,807,886.74	315,276,637.45
<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</b>

		31 日
<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	634,841.93	-
应付赎回款	514,221.65	119,731.24
应付管理人报酬	1,782,982.47	377,486.15
应付托管费	297,163.72	62,914.34
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,482,829.14	611,015.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	381,347.57	210,427.37
负债合计	6,093,386.48	1,381,574.90
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,163,805,045.17	284,951,967.98
未分配利润	114,909,455.09	28,943,094.57
所有者权益合计	1,278,714,500.26	313,895,062.55
负债和所有者权益总计	1,284,807,886.74	315,276,637.45

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.099 元，基金份额总额 1,163,805,045.17 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通改革驱动灵活配置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	上年度可比期间 2016 年 4 月 28 日
----	-----------------------	----------------------------

	2017 年 12 月 31 日	(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>146,465,800.32</b>	<b>14,035,033.60</b>
1.利息收入	3,281,591.93	357,535.35
其中：存款利息收入	876,509.82	357,535.35
债券利息收入	735.85	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,404,346.26	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	125,833,174.99	17,063,688.34
其中：股票投资收益	120,230,103.82	16,597,503.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	31,430.88	-
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	5,571,640.29	466,185.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	13,415,178.81	-4,350,633.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,935,854.59	964,443.12
<b>减：二、费用</b>	<b>25,330,874.37</b>	<b>3,834,524.65</b>
1. 管理人报酬	13,046,804.39	1,826,109.70
2. 托管费	2,174,467.37	304,351.60
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	9,728,533.45	1,493,311.35
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	381,069.16	210,752.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>121,134,925.95</b>	<b>10,200,508.95</b>

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>121,134,925.95</b>	<b>10,200,508.95</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通改革驱动灵活配置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）	284,951,967.98	28,943,094.57	313,895,062.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	121,134,925.95	121,134,925.95
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）	878,853,077.19	270,552,479.12	1,149,405,556.31
其中：1.基金申购款	1,936,253,916.87	411,213,790.40	2,347,467,707.27
2.基金赎回款	-1,057,400,839.68	-140,661,311.28	-1,198,062,150.96
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）	-	-305,721,044.55	-305,721,044.55
五、期末所有者权益（基金净值）	1,163,805,045.17	114,909,455.09	1,278,714,500.26
项目	上年度可比期间 2016 年 4 月 28 日（基金合同生效日）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）	264,112,228.69	-	264,112,228.69

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,200,508.95	10,200,508.95
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）	20,839,739.29	18,742,585.62	39,582,324.91
其中：1.基金申购款	281,782,417.26	28,207,732.18	309,990,149.44
2.基金赎回款	-260,942,677.97	-9,465,146.56	-270,407,824.53
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）	284,951,967.98	28,943,094.57	313,895,062.55

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

海富通改革驱动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[2015]2741 号文《关于准予海富通改革驱动灵活配置混合型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《海富通改革驱动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 264,051,625.44 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(2016)第 461 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 264,112,228.69 份基金份额,其中认购资金利息折合 60,603.25 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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)。本基金的投资组合比例为:基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%~95%,权证投资占基金资产净值的 0%~3%,现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%~100%,其中,在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金将 80%以上的非现金资产投资于改革驱动主题相关的公司发行的股票和债券。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×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 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》、《海富通改革驱动灵活配置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

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 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4月28日(基金 合同生效日)至2016年

		12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,046,804.39	1,826,109.70
其中：支付销售机构的客户维护费	1,697,927.63	503,828.72

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4月28日（基金 合同生效日）至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,174,467.37	304,351.60

注：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 0.25% 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 0.25% / 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

本报告期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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年4月28日（基金合同生效 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	70,474,727.12	760,189.55	25,716,086.55	349,352.62

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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他需要说明的关联交易事项。

### 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

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
002507	涪陵榨菜	2017-12-04	重大事项	16.77	-	-	83	1,050.14	1,391.91	-
600273	嘉化能源	2017-10-26	重大资产重组	9.53	2018-03-07	10.00	7,600	72,351.92	72,428.00	-
600309	万华化学	2017-12-05	重大资产重组	37.94	-	-	981,572	31,074,876.48	37,240,841.68	-
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	1,763,121	48,960,656.30	56,666,708.94	-
601003	柳钢股份	2017-10-17	重大资产重组	7.98	2018-01-18	7.50	6,067,217	44,447,606.03	48,416,391.66	-

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 1,064,710,057.31 元，属于第二层次的余额为 142,397,762.19 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 279,156,944.27 元，第二层次 2,865,520.00 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	1,204,466,615.70	93.75
	其中：股票	1,204,466,615.70	93.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,641,203.80	0.21
	其中：债券	2,641,203.80	0.21
	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	76,113,559.57	5.92
8	其他各项资产	1,586,507.67	0.12
9	合计	1,284,807,886.74	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

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	877,766,134.25	68.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	64,996,831.20	5.08
F	批发和零售业	51,308,309.80	4.01
G	交通运输、仓储和邮政业	67,674,285.60	5.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,982,184.00	1.80
J	金融业	57,340,600.98	4.48
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	7,811,775.40	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	23,466,452.00	1.84
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	31,120,042.47	2.43
S	综合	-	-
	合计	1,204,466,615.70	94.19

### 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

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	601222	林洋能源	8,226,107	83,412,724.98	6.52
2	600332	白云山	1,763,121	56,666,708.94	4.43
3	600282	南钢股份	10,202,026	49,377,805.84	3.86
4	601003	柳钢股份	6,067,217	48,416,391.66	3.79
5	002531	天顺风能	5,494,951	44,509,103.10	3.48
6	002460	赣锋锂业	612,800	43,968,400.00	3.44
7	002202	金风科技	2,261,842	42,635,721.70	3.33
8	600390	五矿资本	3,508,310	41,398,058.00	3.24
9	002217	合力泰	4,039,726	40,397,260.00	3.16
10	600309	万华化学	981,572	37,240,841.68	2.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 网站的年度报告正文。

## 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

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	601336	新华保险	84,585,541.06	26.95
2	601222	林洋能源	79,643,946.79	25.37
3	601668	中国建筑	75,373,934.40	24.01
4	002555	三七互娱	69,908,853.17	22.27
5	600068	葛洲坝	69,022,834.00	21.99
6	000651	格力电器	68,007,541.30	21.67
7	601003	柳钢股份	66,861,539.07	21.30
8	600309	万华化学	66,756,241.75	21.27
9	002217	合力泰	66,577,795.82	21.21
10	600282	南钢股份	63,574,225.24	20.25
11	600183	生益科技	54,385,742.17	17.33
12	600019	宝钢股份	53,894,215.24	17.17
13	600030	中信证券	53,023,075.00	16.89
14	600029	南方航空	52,785,742.71	16.82
15	600887	伊利股份	51,913,490.32	16.54
16	600390	五矿资本	51,601,741.26	16.44
17	600782	新钢股份	50,358,574.00	16.04
18	002460	赣锋锂业	50,010,413.66	15.93
19	000761	本钢板材	49,485,008.12	15.76
20	002051	中工国际	49,094,041.23	15.64

21	600332	白云山	48,960,656.30	15.60
22	601009	南京银行	46,222,217.12	14.73
23	601377	兴业证券	46,172,699.20	14.71
24	601939	建设银行	45,753,512.32	14.58
25	300323	华灿光电	44,911,281.40	14.31
26	600231	凌钢股份	42,118,625.38	13.42
27	002717	岭南园林	42,014,714.01	13.38
28	600703	三安光电	41,598,038.08	13.25
29	600808	马钢股份	40,344,630.23	12.85
30	002531	天顺风能	39,729,228.79	12.66
31	600741	华域汽车	39,669,532.59	12.64
32	002456	欧菲科技	38,674,425.37	12.32
33	601288	农业银行	38,236,823.00	12.18
34	000059	华锦股份	38,077,063.08	12.13
35	601111	中国国航	37,165,702.74	11.84
36	600036	招商银行	35,853,744.98	11.42
37	002202	金风科技	35,555,994.83	11.33
38	603799	华友钴业	34,975,732.00	11.14
39	000717	韶钢松山	34,730,637.90	11.06
40	000703	恒逸石化	34,529,565.01	11.00
41	601818	光大银行	34,296,649.00	10.93
42	600585	海螺水泥	33,846,307.83	10.78
43	300145	中金环境	33,768,982.05	10.76
44	600104	上汽集团	33,003,603.71	10.51
45	000338	潍柴动力	32,842,163.57	10.46
46	000858	五粮液	31,375,694.96	10.00
47	600056	中国医药	31,357,757.76	9.99
48	002589	瑞康医药	30,818,412.00	9.82
49	002027	分众传媒	30,108,368.36	9.59
50	300083	劲胜智能	29,660,667.24	9.45
51	300316	晶盛机电	29,412,662.43	9.37
52	000018	神州长城	28,082,897.52	8.95
53	601877	正泰电器	28,011,982.33	8.92
54	601233	桐昆股份	27,490,205.12	8.76
55	002174	游族网络	27,311,247.16	8.70
56	601636	旗滨集团	26,703,597.00	8.51
57	000776	广发证券	26,574,062.00	8.47
58	300116	坚瑞沃能	26,226,065.78	8.36
59	600519	贵州茅台	26,030,172.86	8.29
60	000568	泸州老窖	25,741,439.50	8.20
61	600153	建发股份	25,445,937.55	8.11
62	603877	太平鸟	24,928,986.88	7.94
63	002463	沪电股份	24,598,573.49	7.84
64	600529	山东药玻	24,454,574.45	7.79

65	000821	京山轻机	24,349,380.45	7.76
66	601166	兴业银行	24,188,631.50	7.71
67	600136	当代明诚	23,496,595.59	7.49
68	000933	神火股份	23,273,279.04	7.41
69	002573	清新环境	23,225,676.49	7.40
70	600845	宝信软件	22,800,675.07	7.26
71	300413	快乐购	22,681,686.57	7.23
72	002142	宁波银行	22,591,516.48	7.20
73	601601	中国太保	22,110,274.35	7.04
74	600856	中天能源	21,428,358.50	6.83
75	002241	歌尔股份	21,267,920.16	6.78
76	300415	伊之密	20,421,622.54	6.51
77	002466	天齐锂业	20,318,575.57	6.47
78	000596	古井贡酒	20,041,071.49	6.38
79	600388	龙净环保	19,419,547.76	6.19
80	600566	济川药业	18,817,453.51	5.99
81	002020	京新药业	18,638,178.09	5.94
82	603018	中设集团	18,532,111.83	5.90
83	002709	天赐材料	18,331,350.52	5.84
84	000001	平安银行	17,797,676.00	5.67
85	002304	洋河股份	17,542,461.80	5.59
86	002236	大华股份	17,475,238.12	5.57
87	000848	承德露露	17,347,259.70	5.53
88	600581	八一钢铁	16,903,358.98	5.39
89	300418	昆仑万维	16,481,272.69	5.25
90	000963	华东医药	16,343,833.49	5.21
91	600028	中国石化	16,080,923.56	5.12
92	000756	新华制药	16,062,524.05	5.12
93	000669	金鸿控股	15,808,710.18	5.04
94	002026	山东威达	15,203,429.80	4.84
95	002185	华天科技	15,178,103.96	4.84
96	601169	北京银行	15,111,238.60	4.81
97	600219	南山铝业	14,990,904.00	4.78
98	600491	龙元建设	14,771,498.40	4.71
99	000830	鲁西化工	14,741,706.36	4.70
100	002475	立讯精密	14,738,998.00	4.70
101	600688	上海石化	14,653,629.65	4.67
102	601666	平煤股份	14,344,785.73	4.57
103	300115	长盈精密	14,222,993.82	4.53
104	002146	荣盛发展	14,008,683.40	4.46
105	002396	星网锐捷	13,840,442.62	4.41
106	600362	江西铜业	13,697,806.00	4.36
107	601699	潞安环能	13,556,096.90	4.32
108	600075	新疆天业	13,537,108.80	4.31

109	600176	中国巨石	13,429,856.68	4.28
110	601117	中国化学	13,423,482.90	4.28
111	002092	中泰化学	13,219,436.28	4.21
112	002601	龙蟒佰利	13,109,322.51	4.18
113	300197	铁汉生态	13,059,395.92	4.16
114	002635	安洁科技	12,962,588.28	4.13
115	300284	苏交科	12,436,730.65	3.96
116	002271	东方雨虹	12,392,539.45	3.95
117	002508	老板电器	12,079,464.17	3.85
118	300136	信维通信	11,973,782.00	3.81
119	000581	威孚高科	11,972,266.00	3.81
120	600076	康欣新材	11,935,353.00	3.80
121	002507	涪陵榨菜	11,875,137.03	3.78
122	000661	长春高新	11,824,775.71	3.77
123	600508	上海能源	11,748,401.72	3.74
124	000418	小天鹅 A	11,444,970.58	3.65
125	600079	人福医药	11,389,918.65	3.63
126	600273	嘉化能源	11,207,883.98	3.57
127	300357	我武生物	10,681,889.00	3.40
128	600497	驰宏锌锗	10,388,989.15	3.31
129	002410	广联达	10,340,355.24	3.29
130	600761	安徽合力	9,702,657.93	3.09
131	603626	科森科技	9,437,262.93	3.01
132	000525	红太阳	9,304,319.88	2.96
133	002108	沧州明珠	9,258,079.23	2.95
134	601933	永辉超市	9,227,890.00	2.94
135	000786	北新建材	8,898,918.00	2.83
136	002233	塔牌集团	8,838,533.85	2.82
137	000725	京东方 A	8,791,661.00	2.80
138	000049	德赛电池	8,739,365.03	2.78
139	002705	新宝股份	8,698,411.20	2.77
140	603609	禾丰牧业	8,644,715.00	2.75
141	300426	唐德影视	8,105,466.06	2.58
142	600338	西藏珠峰	7,841,033.18	2.50
143	300082	奥克股份	7,701,486.73	2.45
144	000739	普洛药业	7,405,235.15	2.36
145	002245	澳洋顺昌	7,241,435.00	2.31
146	600346	恒力股份	7,239,302.00	2.31
147	600525	长园集团	7,103,927.60	2.26
148	300502	新易盛	6,801,507.00	2.17
149	000915	山大华特	6,635,900.43	2.11
150	600889	南京化纤	6,389,406.61	2.04

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。

#### 8.4.2 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

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	601336	新华保险	93,948,905.29	29.93
2	601668	中国建筑	70,062,733.68	22.32
3	002555	三七互娱	68,283,686.32	21.75
4	600782	新钢股份	66,375,690.99	21.15
5	600068	葛洲坝	61,350,892.43	19.55
6	600019	宝钢股份	57,527,997.92	18.33
7	002051	中工国际	56,250,497.75	17.92
8	600887	伊利股份	55,173,242.21	17.58
9	601939	建设银行	54,640,088.94	17.41
10	600030	中信证券	52,447,037.62	16.71
11	000761	本钢板材	49,406,525.67	15.74
12	600741	华域汽车	47,698,207.08	15.20
13	601009	南京银行	46,427,511.24	14.79
14	600309	万华化学	46,064,300.75	14.68
15	002456	欧菲科技	45,138,660.54	14.38
16	600703	三安光电	45,133,541.71	14.38
17	000717	韶钢松山	43,186,922.51	13.76
18	601377	兴业证券	42,130,490.17	13.42
19	000059	华锦股份	41,126,200.04	13.10
20	601233	桐昆股份	39,680,351.90	12.64
21	600808	马钢股份	39,446,014.93	12.57
22	601818	光大银行	39,313,547.34	12.52
23	000651	格力电器	38,775,270.34	12.35
24	600036	招商银行	38,352,498.84	12.22
25	002027	分众传媒	37,876,770.59	12.07
26	601288	农业银行	36,656,692.00	11.68
27	300083	劲胜智能	36,065,388.26	11.49
28	000858	五粮液	35,502,668.33	11.31
29	600585	海螺水泥	34,564,547.56	11.01
30	600104	上汽集团	33,947,704.92	10.81
31	600029	南方航空	33,723,854.45	10.74
32	000338	潍柴动力	33,579,619.63	10.70
33	300116	坚瑞沃能	29,955,533.72	9.54
34	000933	神火股份	29,329,148.27	9.34
35	601636	旗滨集团	27,835,762.80	8.87

36	000568	泸州老窖	27,405,845.65	8.73
37	601877	正泰电器	27,363,951.91	8.72
38	601003	柳钢股份	26,871,150.78	8.56
39	601166	兴业银行	25,209,261.00	8.03
40	002174	游族网络	25,130,566.40	8.01
41	000776	广发证券	24,929,337.34	7.94
42	002142	宁波银行	24,684,654.64	7.86
43	002217	合力泰	24,164,685.30	7.70
44	600183	生益科技	23,511,030.15	7.49
45	600856	中天能源	23,476,562.04	7.48
46	600153	建发股份	23,475,344.39	7.48
47	002241	歌尔股份	22,257,615.45	7.09
48	000596	古井贡酒	22,028,553.53	7.02
49	300323	华灿光电	21,526,831.42	6.86
50	603799	华友钴业	21,337,194.11	6.80
51	002475	立讯精密	21,073,300.80	6.71
52	002304	洋河股份	20,989,267.83	6.69
53	000703	恒逸石化	20,365,699.53	6.49
54	600231	凌钢股份	20,023,116.99	6.38
55	000001	平安银行	19,926,171.95	6.35
56	002466	天齐锂业	19,678,932.44	6.27
57	300115	长盈精密	19,225,661.99	6.12
58	600388	龙净环保	18,865,928.69	6.01
59	002020	京新药业	18,603,741.28	5.93
60	600581	八一钢铁	17,645,010.60	5.62
61	002635	安洁科技	17,255,646.70	5.50
62	002507	涪陵榨菜	17,244,076.67	5.49
63	600273	嘉化能源	17,243,783.01	5.49
64	002185	华天科技	16,746,225.38	5.33
65	002236	大华股份	16,643,626.02	5.30
66	000669	金鸿控股	16,568,265.66	5.28
67	000848	承德露露	16,552,623.38	5.27
68	300418	昆仑万维	16,258,979.04	5.18
69	000830	鲁西化工	15,986,968.63	5.09
70	601601	中国太保	15,929,513.38	5.07
71	600028	中国石化	15,463,385.23	4.93
72	600075	新疆天业	15,420,949.14	4.91
73	000756	新华制药	15,405,543.67	4.91
74	002601	龙麟佰利	15,069,588.47	4.80
75	601169	北京银行	14,831,340.30	4.72
76	002508	老板电器	14,535,947.49	4.63
77	600338	西藏珠峰	14,355,402.48	4.57
78	600688	上海石化	14,335,155.75	4.57
79	002396	星网锐捷	14,227,543.91	4.53

80	601699	潞安环能	14,167,460.53	4.51
81	600176	中国巨石	13,933,737.91	4.44
82	002245	澳洋顺昌	13,881,808.20	4.42
83	600219	南山铝业	13,849,801.60	4.41
84	600491	龙元建设	13,735,424.83	4.38
85	000661	长春高新	13,602,877.75	4.33
86	601666	平煤股份	13,592,716.62	4.33
87	601600	中国铝业	13,394,143.88	4.27
88	002092	中泰化学	13,229,464.80	4.21
89	300136	信维通信	13,188,598.45	4.20
90	000418	小天鹅 A	12,994,900.49	4.14
91	600362	江西铜业	12,643,595.65	4.03
92	300197	铁汉生态	12,636,835.05	4.03
93	600497	驰宏锌锗	12,472,472.50	3.97
94	000581	威孚高科	12,194,786.00	3.88
95	002271	东方雨虹	12,167,049.10	3.88
96	002053	云南能投	12,092,837.37	3.85
97	002146	荣盛发展	11,999,947.82	3.82
98	000049	德赛电池	11,988,115.52	3.82
99	300284	苏交科	11,961,221.67	3.81
100	600282	南钢股份	11,844,735.48	3.77
101	002311	海大集团	11,825,686.60	3.77
102	002108	沧州明珠	11,822,724.03	3.77
103	600508	上海能源	11,780,687.98	3.75
104	600761	安徽合力	11,605,990.03	3.70
105	600507	方大特钢	11,384,778.93	3.63
106	603609	禾丰牧业	11,304,494.65	3.60
107	601899	紫金矿业	11,009,301.29	3.51
108	000039	中集集团	10,984,331.80	3.50
109	600519	贵州茅台	10,976,952.00	3.50
110	601117	中国化学	10,838,043.83	3.45
111	002410	广联达	10,757,624.12	3.43
112	000786	北新建材	10,606,328.00	3.38
113	600076	康欣新材	10,259,026.30	3.27
114	600569	安阳钢铁	10,166,242.53	3.24
115	600079	人福医药	10,147,403.79	3.23
116	600566	济川药业	10,128,232.44	3.23
117	601933	永辉超市	10,058,360.51	3.20
118	603626	科森科技	9,891,966.62	3.15
119	000963	华东医药	9,856,725.00	3.14
120	603018	中设集团	9,823,309.74	3.13
121	600346	恒力股份	9,299,971.97	2.96
122	002200	云投生态	8,904,493.79	2.84
123	000725	京东方 A	8,819,151.70	2.81

124	002705	新宝股份	8,815,624.55	2.81
125	002589	瑞康医药	8,723,288.53	2.78
126	002233	塔牌集团	8,653,549.00	2.76
127	002717	岭南园林	8,394,873.00	2.67
128	002648	卫星石化	8,234,307.79	2.62
129	601111	中国国航	7,922,529.00	2.52
130	600525	长园集团	7,861,303.12	2.50
131	600742	一汽富维	7,847,407.19	2.50
132	002097	山河智能	7,733,409.04	2.46
133	600595	中孚实业	7,487,098.89	2.39
134	002391	长青股份	7,480,171.08	2.38
135	300082	奥克股份	7,374,600.03	2.35
136	002323	雅百特	7,328,994.86	2.33
137	000915	山大华特	7,253,787.50	2.31
138	000550	江铃汽车	6,915,296.32	2.20
139	000739	普洛药业	6,389,989.67	2.04
140	002597	金禾实业	6,349,761.76	2.02

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。

#### 8.4.3 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	4,085,565,662.70
卖出股票的收入（成交）总额	3,296,566,590.10

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。

#### 8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,641,203.80	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,641,203.80	0.21

## 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	110040	生益转债	23,500	2,544,580.00	0.20
2	110038	济川转债	910	96,623.80	0.01

## 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合约。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。

## 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

根据基金合同，本组合暂不投资国债期货。

### 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合约。

### 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 日在菏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，经菏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。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是大型控股型企业，一直专注于医药健康产业，经过多年发展，规模与效益持续扩大。季报业绩超市场预期，传统中药和王老吉齐发力，有望持续高增长。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。

报告期内本基金投资的合力泰（002217）于 2017 年 3 月 21 日公告称，公司对于与比亚迪股份有限公司实际发生的超出预计范围内的日常关联交易，未按照相关规定重新提交董事会及股东大会审议并披露，违反了《上市公司信息披露管理办法》相关规定，收到山东证监局出具警示函的监管措施。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是行业仅有的几家拥有智能终端全产业链的公司，产能不断扩张，业绩快速增长，电子标签潜力大。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。

报告期内本基金投资的赣锋锂业（002460）于 2017 年 4 月 23 日公告称，公司在经营过程中从未取得工业盐酸生产许可证的供应商处采购工业盐酸，违反了有关规定，收到新余市市场和监督管理局的《行政处罚决定书》。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是中国深加工锂产品行业的龙头企业，是全球最大的金属锂生产供应商，已经申请国家专利 38 项，拥有非专利技术近百项，主持制定和修订国家标准 3 项。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。

报告期内本基金投资的万华化学（600309）于 2017 年 7 月 6 日公告称，公司在大修停车处理过程中，MDI 缓冲罐发生爆炸，造成 4 人死亡、4 人受伤，直接经济损失 573.62 万元。经烟台市政府调查，认定该次事故是一起较大生产安全责任事故。烟台市安监局对万华化学公司负责人处上一年收入 40%的罚款，对万华化学公司处以 80 万元罚款。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是国内 MDI 制造龙头企业，亚洲最大的 MDI 制造企业。公司盈利能力强，十月份聚合 MDI 直销价格和纯 MDI 价格上涨，将

实质拉动原材料价差，业绩有望继续提升。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。

其余六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	693,236.60
2	应收证券清算款	642,777.21
3	应收股利	-
4	应收利息	16,258.32
5	应收申购款	234,235.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,586,507.67

### 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

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	601003	柳钢股份	48,416,391.66	3.79	重大资产重组
2	600332	白云山	56,666,708.94	4.43	重大资产重组
3	600309	万华化学	37,240,841.68	2.91	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
4,310	270,024.37	977,341,185.52	83.98%	186,463,859.65	16.02%

### 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	670,042.89	0.0576%

### 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年4月28日)基金份额总额	264,112,228.69
本报告期期初基金份额总额	284,951,967.98
本报告期基金总申购份额	1,936,253,916.87
减：本报告期基金总赎回份额	1,057,400,839.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,163,805,045.17

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

本基金本报告期内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 80,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 2 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	
中泰证券(原齐鲁)	2	1,142,846,160.31	15.50%	911,286.12	15.79%	-
申万宏源	2	1,054,570,018.32	14.31%	445,366.30	7.72%	-
华泰证券	1	1,009,082,351.18	13.69%	939,757.05	16.29%	-
东吴证券	2	836,856,981.53	11.35%	610,157.69	10.57%	-
中信建投	1	783,144,706.23	10.62%	720,597.94	12.49%	-
东北证券	1	702,793,044.36	9.53%	499,897.92	8.66%	-
方正证券	1	609,977,365.60	8.28%	555,874.08	9.63%	-
东兴证券	2	534,835,408.72	7.26%	465,283.98	8.06%	-
民族证券	2	290,425,378.12	3.94%	243,252.52	4.22%	-
中金公司	2	268,073,827.24	3.64%	249,659.52	4.33%	-
东方证券	1	135,543,647.82	1.84%	126,231.89	2.19%	-
兴业证券	2	2,995,850.68	0.04%	2,790.01	0.05%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券(原齐鲁)	-	-	1,300,000,000.00	100.00%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,083,560.00	100.00%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

## 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/1/6-2017/2/22 2017/7/5-2017/11/20	36,329,541.25	358,564,997.18	332,838,687.37	62,055,851.06	5.33%
	2	2017/3/2-2017/3/6	45,828,597.62	43,492,605.12	43,492,605.12	45,828,597.62	3.94%
	3	2017/6/30-2017/7/4	36,528,767.12	198,372,281.04	79,940,732.44	154,960,315.72	13.31%
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。

注：申购份额包含基金转换入份额。

## 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