

海富通精选证券投资基金
2017 年年度报告
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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计意见.....	18
6.2 形成审计意见的基础.....	18
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	18
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	19
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55

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	56
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
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	56
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	56
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12	投资组合报告附注	57
§9	基金份额持有人信息	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§10	开放式基金份额变动	58
§11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4	基金投资策略的改变	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8	其他重大事件	61
12	影响投资者决策的其他重要信息	65
§13	备查文件目录	66
13.1	备查文件目录	66
13.2	存放地点	67
13.3	查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通精选证券投资基金
基金简称	海富通精选混合
基金主代码	519011
交易代码	519011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 8 月 22 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,409,627,922.15 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行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	本基金的投资策略分两个层次：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。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。
业绩比较基准	MSCI China A 指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险程度适中的品种。本基金力争通过适度主动的资产配置和积极主动的精选证券，识别和控制风险，实现风险限度内的超额回报。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	陆志俊
	联系电话	021-38650891	95559

电子邮箱	wrxi@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话	40088-40099	95559
传真	021-33830166	021-62701216
注册地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	张文伟	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金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办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、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	175,533,393.32	124,351,033.46	953,604,084.72
本期利润	216,633,683.50	-30,816,116.68	863,876,806.88

加权平均基金份额 本期利润	0.0402	-0.0081	0.2128
本期加权平均净值 利润率	8.91%	-1.40%	34.87%
本期基金份额净值 增长率	8.84%	-2.89%	26.97%
3.1.2 期末数据和 指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	220,866,429.83	532,796,440.19	661,969,517.52
期末可供分配基金 份额利润	0.0648	0.0980	0.2113
期末基金资产净值	1,558,456,971.90	2,685,181,126.01	2,024,334,194.74
期末基金份额净值	0.4571	0.4940	0.6461
3.1.3 累计期末指 标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值 增长率	518.04%	467.86%	484.76%

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	-1.42%	1.00%	-0.25%	0.54%	-1.17%	0.46%
过去六个月	6.55%	0.94%	3.34%	0.48%	3.21%	0.46%
过去一年	8.84%	0.83%	7.42%	0.44%	1.42%	0.39%
过去三年	34.19%	1.45%	9.54%	1.11%	24.65%	0.34%
过去五年	53.24%	1.25%	42.00%	1.01%	11.24%	0.24%

自基金合同生效起至今	518.04%	1.26%	206.27%	1.12%	311.77%	0.14%
------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

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

海富通精选证券投资基金
 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
 (2003 年 8 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日)

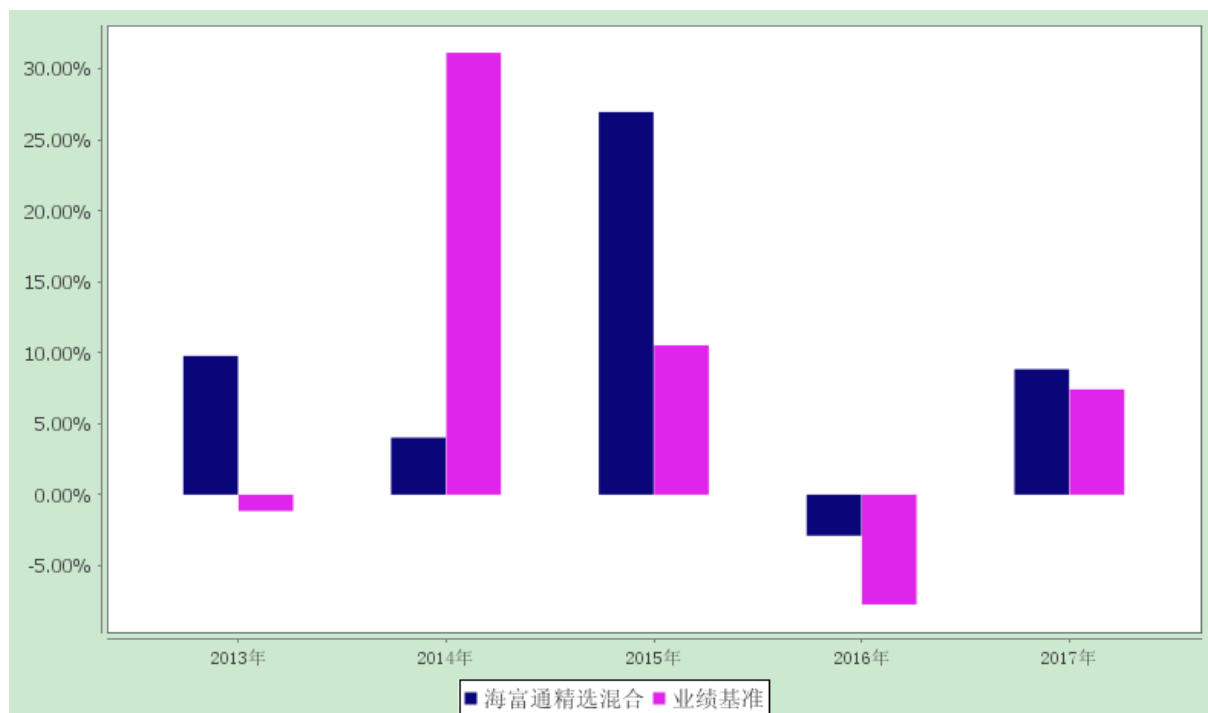


注：1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。本基金自 2007 年 6 月 28 日至 2007 年 9 月 29 日,为持续营销后建仓期。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十八条(三)、(六)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

2、为了能更公允地体现基金投资业绩,海富通基金管理有限公司自 2007 年 1 月 1 日起调整海富通精选基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为 MSCI China A 指数,相应的基准权重不变。

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

海富通精选证券投资基金
 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年	0.750	585,669,489.60	119,263,213.13	704,932,702.73	-
2016年	1.330	508,934,477.86	194,566,738.28	703,501,216.14	-
2015年	0.100	25,677,692.04	22,757,891.42	48,435,583.46	-
合计	2.180	1,120,281,659.50	336,587,842.83	1,456,869,502.33	-

§ 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		
王智慧	本基金的基金经理；海富通精选贰号混合基金经理；海富通沪港深混合基金经理；总经理	2016-04-11	-	15 年	管理学博士。持有基金从业人员资格证书。曾在华宝兴业基金管理有限公司、中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团股份有限公司、国元证券有限责任公司从事投资研究及管理工作。2012

	助理				年 1 月至 2015 年 11 月任华宝大盘精选混合基金经理，2012 年 2 月至 2015 年 11 月任华宝医药生物混合型基金经理，2013 年 2 月至 2015 年 11 月任华宝兴业多策略股票基金经理。2015 年 11 月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2016 年 4 月起兼任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通沪港深混合基金经理。
李志	本基金的基金经理助理；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；海	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。

	富通改革驱动混合基金基金经理助理。				
陶敏	本基金的基金经理助理；海富通股票混合基金基金经理助理；海富通收益增长混合基金基金经理助理；海富通强化回报混合基金基金经理助理；海富通风格优势混合基金基金经理助理；海富通精选贰号混合基金基金经理助理；海富通领先成长混合基金基金经理助理；海富通中小盘混合基金基金经理助理；海富通国策导向混合基金基金经理助理；海富通内需热点混合基金基金经理助理；海富通改革驱动混合基金基金经理助理	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 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，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有

关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

报告期内，本基金报告期维持中性偏积极的仓位策略。全年较好地把握了年初的周期性行业、年中的新能源车产业链、消费电子产业链方面的投资机会。相比而言，对于白酒、白电等消费龙头白马股的投资机会把握不够坚定。

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 8.84%，同期基金业绩比较基准收益率为 7.42%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.42 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。

2018 年，本基金将采取积极仓位策略，同时进一步优化组合的结构与风格，在保持优质白马等核心配置的同时，着眼于政策趋势与经济的提质升级，寻找并布局于具有产业竞争优势且治理结构良好、财务结构健康的优势成长企业的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过现场检查、系统监控、人员询问、重点抽查等一系列方式开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、持续完善公司的规章制度，健全内部控制体系，落实内控责任。

监察稽核部组织各部门结合新业务和新法规的要求，对内部制度和流程进行更新，为公司业务开展提供有效的制度保障，并及时更新合规注意事项卡，以强化岗位职责，满足业务发展和相关法规要求，为基金持有人谋求最大利益提供有力的保障。

二、加强对公司和基金日常运作的合规管理

本报告期内，监察稽核部坚持以法律法规和公司管理制度为依据，对公司和基金日常运作的各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，确保了基金运作的诚信和合法合规性。本报告期内，公司监察稽核的范围涉及公司治理、投资管理、营销与销售、后台运营管理、人力资源等各个方面。此外，监察稽核部根据新颁布的法规、监管要求并结合公司内部控制的需要，对公司各部门的业务有重点地开展专项检查和专项审计，严格控制各部门的主要风险，加强并完善公司的内部控制状况。通过事前、事中、事后的

全方位合规审核及内部审计，公司对治理结构、投资交易、销售及客户服务体系、信息安全控制、基金运营控制、分支机构管理及人力资源管理等方面的内部规章制度和各项业务流程予以了完善；同时强化了现有规章制度的执行力度，并很好的落实了相关建议。

三、有效推进反洗钱工作

本报告期内，监察稽核部结合反洗钱法规及公司业务特点，根据新法规要求完善反洗钱内部控制制度及流程，并牵头对反洗钱系统进行升级改造，强化对大额交易和可疑交易方面的监控。同时还按照法规规定，定期登陆反洗钱系统，对系统筛选的可疑交易进行人工识别和复核，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。

四、加强投资者教育，培养投资者风险意识和投资理念

本报告期内，监察稽核部会同相关部门鼓励投资者进行长期投资，持续不断的和投资者进行沟通，利用网络互动平台、平面媒体专栏及举办财富接力活动等多种渠道、多种媒介积极推进投资者教育工作，努力倡导“长期持有、理性投资”的投资理念，培养广大投资者的风险意识、切实加强保护了广大基金持有人的合法权益。

五、强化法规学习，开展内控培训，培养员工的风险防范意识。

本报告期内，监察稽核部及时将新颁布的各项法律法规进行解读，并提供给全体员工学习，同时定期对全体员工进行内控培训，剖析风险案例，培训内容涉及投资交易、市场销售业务、流动性新规政策落实、合规管理办法政策落实和销售适当性新规政策落实等方面。通过培训，员工的合规意识有所增强，主动控制业务风险的积极性也得到了提高。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

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，基金收益每年至少分配一次，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成。

本基金报告期内进行过一次利润分配。以截止 2017 年 03 月 01 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2017 年 03 月 20 日完成权益登记，单位分红金额为 0.075 元，合计利润分配金额 704,932,702.73 元。本次分红符合基金合同规定。

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

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

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

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

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 704,932,702.73 元，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 21652 号

海富通精选证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了海富通精选证券投资基金(以下简称“海富通精选基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了海富通精选基金 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。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海富通精选基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通精选基金的基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估海富通精选基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算海富通精选基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通精选基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对海富通精选基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海富通精选基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
薛竞、都晓燕

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2018 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通精选证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	58,348,730.53	233,304.25
结算备付金		3,188,512.78	132,481,771.06
存出保证金		1,294,412.68	1,359,468.60
交易性金融资产	7.4.7.2	1,476,660,000.60	2,469,399,252.43
其中：股票投资		1,158,270,700.60	1,910,790,352.43
基金投资		-	-
债券投资		318,389,300.00	558,608,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	100,000,000.00
应收证券清算款		120,885,264.03	1,611,886.55
应收利息	7.4.7.5	6,257,133.29	18,096,663.98
应收股利		-	-
应收申购款		383,999.10	29,599.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,667,018,053.01	2,723,211,945.90
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	26,782,425.68
应付赎回款		103,788,128.39	862,106.83
应付管理人报酬		2,137,327.30	3,538,703.54
应付托管费		356,221.22	589,783.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,809,740.68	5,857,556.34
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	469,663.52	400,243.57
负债合计		108,561,081.11	38,030,819.89
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,034,679,940.93	1,649,537,393.85
未分配利润	7.4.7.10	523,777,030.97	1,035,643,732.16
所有者权益合计		1,558,456,971.90	2,685,181,126.01
负债和所有者权益总计		1,667,018,053.01	2,723,211,945.90

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4571 元，基金份额总额 3,409,627,922.15 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通精选证券投资基金

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	附注号	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
一、收入		284,404,919.80	28,474,136.85
1.利息收入		18,388,241.77	18,601,404.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,501,399.18	1,644,509.68
债券利息收入		16,564,838.84	16,815,697.13

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		322,003.75	141,198.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		222,792,922.84	164,474,333.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	207,787,633.64	157,042,580.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-6,953,815.16	-2,709,838.89
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	21,959,104.36	10,141,591.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	41,100,290.18	-155,167,150.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,123,465.01	565,548.79
减：二、费用		67,771,236.30	59,290,253.53
1. 管理人报酬		36,523,722.98	33,108,585.13
2. 托管费		6,087,287.17	5,518,097.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	24,714,403.47	20,209,908.62
5. 利息支出		-	7,539.50
其中：卖出回购金融资产支出		-	7,539.50
6. 其他费用	7.4.7.20	445,822.68	446,122.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		216,633,683.50	-30,816,116.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		216,633,683.50	-30,816,116.68

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通精选证券投资基金

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)	1,649,537,393.85	1,035,643,732.16	2,685,181,126.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	216,633,683.50	216,633,683.50
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)	-614,857,452.92	-23,567,681.96	-638,425,134.88
其中：1.基金申购款	1,535,137,754.59	970,991,243.80	2,506,128,998.39
2.基金赎回款	-2,149,995,207.51	-994,558,925.76	-3,144,554,133.27
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)	-	-704,932,702.73	-704,932,702.73
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,034,679,940.93	523,777,030.97	1,558,456,971.90
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)	950,742,256.62	1,073,591,938.12	2,024,334,194.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-30,816,116.68	-30,816,116.68
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)	698,795,137.23	696,369,126.86	1,395,164,264.09
其中：1.基金申购款	1,121,672,734.77	1,070,640,600.53	2,192,313,335.30
2.基金赎回款	-422,877,597.54	-374,271,473.67	-797,149,071.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生	-	-703,501,216.14	-703,501,216.14

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）	1,649,537,393.85	1,035,643,732.16	2,685,181,126.01

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

海富通精选证券投资基金(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[2003]第 85 号《关于同意海富通精选证券投资基金设立的批复》核准，由海富通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《海富通精选证券投资基金基金契约》(后更名为《海富通精选证券投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 8 月 22 日募集成立。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 3,698,432,268.39 元，已经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 110 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通精选证券投资基金招募说明书》和《关于对海富通精选基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 7 月 4 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 3.295543296，并于 2007 年 7 月 5 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通精选证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市 的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：股票投资 50%-80%，债券投资 20%-50%，权证投资 0%-3%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：MSCI China A 指数 X 65% + 上证国债指数 X 35%。

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》、《海富通精选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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵

销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投

资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)于2017年9月22日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年9月22日起，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，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”)，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证指数有限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。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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。该估值技术变更使本基金2017年12月31日的基金资产净值及2017年度净损益减少1,320,049.70元,相关影响非重大。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	58,348,730.53	233,304.25
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	58,348,730.53	233,304.25

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,135,520,795.77	1,158,270,700.60	22,749,904.83
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	10,300.00	10,300.00	0.00
	银行间市场	319,282,071.51	318,379,000.00	-903,071.51
	合计	319,292,371.51	318,389,300.00	-903,071.51
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,454,813,167.28	1,476,660,000.60	21,846,833.32
项目	上年度末			
	2016 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,924,222,410.96	1,910,790,352.43	-13,432,058.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	7,003,500.00	6,990,900.00	-12,600.00
	银行间市场	557,426,798.33	551,618,000.00	-5,808,798.33
	合计	564,430,298.33	558,608,900.00	-5,821,398.33
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,488,652,709.29	2,469,399,252.43	-19,253,456.86

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末	
	2016 年 12 月 31 日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	100,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	7,624.88	14,978.18
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,434.80	11,016.80
应收债券利息	6,247,491.15	17,991,860.47
应收买入返售证券利息	-	78,196.68
应收申购款利息	0.06	0.05
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	582.40	611.80
合计	6,257,133.29	18,096,663.98

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,809,115.68	5,856,221.34
银行间市场应付交易费用	625.00	1,335.00
合计	1,809,740.68	5,857,556.34

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	69,663.52	243.57
预提费用	400,000.00	400,000.00
合计	469,663.52	400,243.57

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,435,909,792.50	1,649,537,393.85
本期申购	5,059,036,587.67	1,535,137,754.59
本期赎回（以“-”号填列）	-7,085,318,458.02	-2,149,995,207.51
本期末	3,409,627,922.15	1,034,679,940.93

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	532,796,440.19	502,847,291.97	1,035,643,732.16
本期利润	175,533,393.32	41,100,290.18	216,633,683.50
本期基金份额交易产生的变动数	217,469,299.05	-241,036,981.01	-23,567,681.96
其中：基金申购款	454,362,950.45	516,628,293.35	970,991,243.80
基金赎回款	-236,893,651.40	-757,665,274.36	-994,558,925.76
本期已分配利润	-704,932,702.73	-	-704,932,702.73
本期末	220,866,429.83	302,910,601.14	523,777,030.97

7.4.7.11 存款利息收入

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

活期存款利息收入	581,800.97	767,857.23
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	839,764.36	819,994.16
其他	79,833.85	56,658.29
合计	1,501,399.18	1,644,509.68

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

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
卖出股票成交总额	8,537,339,652.21	6,491,009,910.85
减：卖出股票成本总额	8,329,552,018.57	6,333,967,330.07
买卖股票差价收入	207,787,633.64	157,042,580.78

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,239,893,221.44	742,169,212.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,213,780,733.92	719,317,719.77
减：应收利息总额	33,066,302.68	25,561,331.47
买卖债券差价收入	-6,953,815.16	-2,709,838.89

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	21,959,104.36	10,141,591.49
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	21,959,104.36	10,141,591.49

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年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
1.交易性金融资产	41,100,290.18	-155,167,150.14
——股票投资	36,181,963.36	-150,295,607.41
——债券投资	4,918,326.82	-4,871,542.73
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	41,100,290.18	-155,167,150.14

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	1,798,279.63	565,147.21
基金转换费收入	325,185.38	401.58
合计	2,123,465.01	565,548.79

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减,赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成,其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

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
交易所市场交易费用	24,705,903.47	20,205,033.62
银行间市场交易费用	8,500.00	4,875.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	24,714,403.47	20,209,908.62

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

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
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,600.00	1,600.00
银行划款手续费	8,222.68	8,522.78
合计	445,822.68	446,122.78

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年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
海通证券	6,146,528,924.37	38.24%	6,098,787,736.84	44.86%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
海通证券	1,511,389.50	7.75%	6,326,030.10	22.57%

7.4.10.1.4 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	占当期佣	期末应付佣金余	占期末应付

	佣金	金总量的比例	额	佣金总额的比例
海通证券	5,642,538.57	38.27%	1,410,499.58	77.97%
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
海通证券	5,616,599.40	44.90%	3,565,497.27	60.88%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	36,523,722.98	33,108,585.13
其中：支付销售机构的客户维护费	5,189,237.52	6,233,718.27

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。

7.4.10.2.2 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	6,087,287.17	5,518,097.50

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	30,195,269.25	30,195,269.25
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	-	-
报告期末持有的基金份额	30,195,269.25	30,195,269.25
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.89%	0.56%

注：1、期间申购/买入总份额含转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人于 2007 年 8 月 13 日运用固有资金申购本基金 3000 万元，申购费为 1000 元。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末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。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	58,348,730.53	581,800.97	233,304.25	767,857.23

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**7.4.10.7.1 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须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润 分配合计	备注
		场 内	场 外					
1	2017-03-20	-	2017-03-20	0.750	585,669,489.60	119,263,213.13	704,932,702.73	-
合计				0.750	585,669,489.60	119,263,213.13	704,932,702.73	-

注：根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成。

本基金报告期内进行过一次利润分配。以截止 2017 年 03 月 01 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2017 年 03 月 20 日完成权益登记，单位分红金额为 0.075 元，合计利润分配金额 704,932,702.73 元。本次分红符合基金合同规定。

7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
60316	科华	2017-	2018-	新股	16.75	16.75	1,239	20,75	20,75	-

1	控股	12-28	01-05	未上市				3.25	3.25	
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
002400	省广股份	2016-09-21	2018-09-24	非公开发行	10.45	4.95	3,473,815	36,288,005.91	17,195,384.25	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	648,004	18,826,403.88	20,826,848.56	-
300730	科创信息	2017-12-25	停牌核查	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017-12-28	停牌自查	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的多层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0007%(2016 年 12 月 31 日：无)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	199,241,000.00	-
合计	199,241,000.00	-

注：未评级部分为政策性金融债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	10,300.00	-
未评级	119,138,000.00	-
合计	119,148,300.00	-

注：未评级部分为政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的

处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个 月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面 余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理 办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日 起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理 部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间 内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由 本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券 的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司 发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流 通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认 定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基 金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出 回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投 资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进 行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变 现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度； 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严 格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管 理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建

立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	58,348,730.53	-	-	-	58,348,730.53
结算备付金	3,188,512.78	-	-	-	3,188,512.78
存出保证金	1,294,412.68	-	-	-	1,294,412.68
交易性金融资产	318,379,000.00	-	10,300.00	1,158,270,700.60	1,476,660,000.60
应收证券清算款	-	-	-	120,885,264.03	120,885,264.03
应收申购款	-	-	-	383,999.10	383,999.10

应收利息	-	-	-	6,257,133.29	6,257,133.29
资产总计	381,210,655.99	-	10,300.00	1,285,797,097.02	1,667,018,053.01
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,137,327.30	2,137,327.30
应付托管费	-	-	-	356,221.22	356,221.22
应付交易费用	-	-	-	1,809,740.68	1,809,740.68
应付赎回款	-	-	-	103,788,128.39	103,788,128.39
其他负债	-	-	-	469,663.52	469,663.52
负债总计	-	-	-	108,561,081.11	108,561,081.11
利率敏感度缺口	381,210,655.99	-	10,300.00	1,177,236,015.91	1,558,456,971.90
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	233,304.25	-	-	-	233,304.25
结算备付金	132,481,771.06	-	-	-	132,481,771.06
存出保证金	1,359,468.60	-	-	-	1,359,468.60
交易性金融资产	337,011,900.00	221,597,000.00	-	1,910,790,352.43	2,469,399,252.43
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,611,886.55	1,611,886.55
应收利息	-	-	-	18,096,663.98	18,096,663.98
应收申购款	-	-	-	29,599.03	29,599.03
资产总计	571,086,443.91	221,597,000.00	-	1,930,528,501.99	2,723,211,945.90
负债					
应付证券清算款	-	-	-	26,782,425.68	26,782,425.68
应付赎回款	-	-	-	862,106.83	862,106.83
应付管理人报酬	-	-	-	3,538,703.54	3,538,703.54

应付托管费	-	-	-	589,783.93	589,783.93
应付交易费用	-	-	-	5,857,556.34	5,857,556.34
其他负债	-	-	-	400,243.57	400,243.57
负债总计	-	-	-	38,030,819.89	38,030,819.89
利率敏感度缺口	571,086,443.91	221,597,000.00	-	1,892,497,682.10	2,685,181,126.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约35	减少约72
	市场利率下降25个基点	增加约35	增加约72

注：金额为约数，精确到万元。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资50%-80%、债券投资20%-50%、权证投资0%-3%。此外，本基金的基金管理人每日对

本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,158,270,700.6 0	74.32	1,910,790,352.4 3	71.16
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,158,270,700.6 0	74.32	1,910,790,352.4 3	71.16

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 6,429	增加约 9,931
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 6,429	减少约 9,931

注：金额为约数,精确到万元。

7.4.14 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 1,120,099,959.59 元，属于第二层次的余额为 356,560,041.01 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 1,599,671,770.61 元，第二层次 869,727,481.82 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	1,158,270,700.60	69.48
	其中：股票	1,158,270,700.60	69.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	318,389,300.00	19.10
	其中：债券	318,389,300.00	19.10
	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	61,537,243.31	3.69
8	其他各项资产	128,820,809.10	7.73
9	合计	1,667,018,053.01	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	785,067,688.12	50.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	16,143.20	0.00

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	36,158,868.00	2.32
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	77,956,552.15	5.00
J	金融业	172,486,416.48	11.07
K	房地产业	33,842,085.00	2.17
L	租赁和商务服务业	34,784,384.25	2.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,938,671.40	0.70
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	7,019,892.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	1,158,270,700.60	74.32

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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600104	上汽集团	3,809,686	122,062,339.44	7.83
2	002050	三花智控	5,514,733	101,140,203.22	6.49
3	002008	大族激光	1,698,178	83,889,993.20	5.38
4	002142	宁波银行	4,663,154	83,050,772.74	5.33
5	600885	宏发股份	1,109,128	45,884,625.36	2.94
6	601336	新华保险	530,061	37,210,282.20	2.39
7	000963	华东医药	671,100	36,158,868.00	2.32
8	002400	省广股份	6,773,815	34,784,384.25	2.23
9	600584	长电科技	1,618,434	34,521,197.22	2.22
10	600383	金地集团	2,679,500	33,842,085.00	2.17
11	601877	正泰电器	1,286,500	33,641,975.00	2.16
12	600276	恒瑞医药	476,106	32,841,791.88	2.11

13	600352	浙江龙盛	2,733,500	32,009,285.00	2.05
14	002384	东山精密	1,051,489	29,925,376.94	1.92
15	601939	建设银行	3,772,920	28,976,025.60	1.86
16	600804	鹏博士	1,554,600	26,474,838.00	1.70
17	601601	中国太保	561,307	23,249,335.94	1.49
18	600332	白云山	648,004	20,826,848.56	1.34
19	300316	晶盛机电	971,000	20,303,610.00	1.30
20	600563	法拉电子	396,100	20,125,841.00	1.29
21	000858	五粮液	240,600	19,219,128.00	1.23
22	002304	洋河股份	164,249	18,888,635.00	1.21
23	300024	机器人	915,100	17,222,182.00	1.11
24	002440	闰土股份	873,219	17,193,682.11	1.10
25	300401	花园生物	390,615	17,187,060.00	1.10
26	300241	瑞丰光电	934,500	16,933,140.00	1.09
27	000513	丽珠集团	253,940	16,874,313.00	1.08
28	000538	云南白药	165,170	16,812,654.30	1.08
29	600498	烽火通信	556,300	16,038,129.00	1.03
30	002174	游族网络	555,200	12,380,960.00	0.79
31	000888	峨眉山 A	1,012,660	10,906,348.20	0.70
32	300170	汉得信息	829,300	9,868,670.00	0.63
33	603799	华友钴业	121,700	9,763,991.00	0.63
34	600183	生益科技	484,200	8,357,292.00	0.54
35	603877	太平鸟	306,000	8,295,660.00	0.53
36	002410	广联达	412,600	8,086,960.00	0.52
37	002493	荣盛石化	563,100	8,080,485.00	0.52
38	601233	桐昆股份	352,101	7,918,751.49	0.51
39	300271	华宇软件	526,000	7,826,880.00	0.50
40	300144	宋城演艺	376,200	7,019,892.00	0.45
41	002405	四维图新	258,400	6,819,176.00	0.44
42	300365	恒华科技	204,264	6,464,955.60	0.41
43	300502	新易盛	189,300	5,487,807.00	0.35
44	002240	威华股份	131,800	1,953,276.00	0.13
45	002460	赣锋锂业	8,100	581,175.00	0.04
46	300323	华灿光电	26,878	438,111.40	0.03
47	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.02
48	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.01
49	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.00
50	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.00
51	300730	科创信息	821	34,112.55	0.00
52	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
53	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
54	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
55	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
56	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00

57	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
58	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
59	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
60	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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	600104	上汽集团	270,533,397.08	10.08
2	600110	诺德股份	173,427,641.63	6.46
3	000725	京东方 A	155,449,099.83	5.79
4	600804	鹏博士	140,636,333.60	5.24
5	300008	天海防务	139,219,459.97	5.18
6	002142	宁波银行	122,891,542.95	4.58
7	603993	洛阳钼业	121,791,169.29	4.54
8	000709	河钢股份	120,429,555.60	4.48
9	000338	潍柴动力	115,990,031.66	4.32
10	601377	兴业证券	110,583,782.17	4.12
11	603799	华友钴业	103,849,431.88	3.87
12	002384	东山精密	103,298,627.89	3.85
13	601688	华泰证券	95,524,809.24	3.56
14	002008	大族激光	94,993,978.36	3.54
15	002050	三花智控	91,732,579.36	3.42
16	601336	新华保险	89,782,905.35	3.34
17	601111	中国国航	87,781,246.78	3.27
18	002240	威华股份	83,922,568.60	3.13
19	601186	中国铁建	82,461,471.93	3.07
20	600109	国金证券	80,885,217.33	3.01
21	600566	济川药业	80,184,513.80	2.99
22	002027	分众传媒	79,505,608.49	2.96
23	600703	三安光电	77,993,841.27	2.90
24	600584	长电科技	76,480,455.54	2.85
25	000063	中兴通讯	74,525,413.53	2.78
26	002456	欧菲科技	71,797,636.71	2.67
27	000661	长春高新	66,131,342.35	2.46
28	000951	中国重汽	65,377,426.67	2.43
29	600498	烽火通信	65,364,738.31	2.43
30	601601	中国太保	63,661,653.99	2.37
31	601233	桐昆股份	61,335,717.62	2.28

32	000848	承德露露	57,273,495.55	2.13
33	600884	杉杉股份	56,746,106.51	2.11
34	000065	北方国际	56,666,501.25	2.11
35	600219	南山铝业	56,457,128.00	2.10
36	600521	华海药业	56,436,898.65	2.10
37	600068	葛洲坝	55,898,605.57	2.08
38	001979	招商蛇口	55,562,811.16	2.07
39	002460	赣锋锂业	54,909,785.84	2.04
40	600863	内蒙华电	54,848,605.58	2.04
41	601888	中国国旅	53,776,927.14	2.00

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	000725	京东方 A	198,064,868.55	7.38
2	600104	上汽集团	173,653,697.22	6.47
3	601233	桐昆股份	170,700,657.28	6.36
4	600110	诺德股份	168,151,341.18	6.26
5	603993	洛阳钼业	141,658,508.07	5.28
6	000338	潍柴动力	140,264,480.49	5.22
7	603799	华友钴业	131,951,929.26	4.91
8	600703	三安光电	130,416,125.05	4.86
9	000709	河钢股份	125,393,317.49	4.67
10	300008	天海防务	118,728,181.36	4.42
11	601688	华泰证券	111,390,411.04	4.15
12	002240	威华股份	102,569,575.60	3.82
13	601377	兴业证券	99,006,422.32	3.69
14	600804	鹏博士	94,559,779.73	3.52
15	600566	济川药业	92,847,666.82	3.46
16	601600	中国铝业	91,949,995.18	3.42
17	000063	中兴通讯	88,435,198.34	3.29
18	002456	欧菲科技	88,273,999.95	3.29
19	601111	中国国航	84,628,241.31	3.15
20	002304	洋河股份	83,726,084.82	3.12
21	601997	贵阳银行	83,280,655.25	3.10
22	002384	东山精密	82,622,775.55	3.08
23	002460	赣锋锂业	82,285,324.65	3.06
24	601186	中国铁建	81,842,375.42	3.05
25	000887	中鼎股份	81,463,321.17	3.03

26	002466	天齐锂业	80,699,500.98	3.01
27	002027	分众传媒	78,991,402.07	2.94
28	002353	杰瑞股份	74,965,809.88	2.79
29	600742	一汽富维	74,215,842.77	2.76
30	000951	中国重汽	73,116,771.76	2.72
31	600109	国金证券	72,555,213.43	2.70
32	000661	长春高新	68,215,006.72	2.54
33	600691	阳煤化工	66,559,964.18	2.48
34	300323	华灿光电	65,548,006.88	2.44
35	600884	杉杉股份	62,536,532.92	2.33
36	600519	贵州茅台	62,082,874.25	2.31
37	000903	云内动力	61,525,792.11	2.29
38	000800	一汽轿车	60,233,195.33	2.24
39	300136	信维通信	59,085,728.99	2.20
40	600219	南山铝业	57,280,413.00	2.13
41	001979	招商蛇口	56,838,042.38	2.12
42	601336	新华保险	56,766,286.00	2.11
43	002564	天沃科技	56,645,850.29	2.11
44	600366	宁波韵升	56,395,304.52	2.10
45	000778	新兴铸管	55,201,046.77	2.06
46	600068	葛洲坝	54,670,746.51	2.04
47	000848	承德露露	54,603,232.11	2.03
48	000018	神州长城	53,786,478.20	2.00

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	7,540,850,403.38
卖出股票的收入（成交）总额	8,537,339,652.21

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	318,379,000.00	20.43

	其中：政策性金融债	318,379,000.00	20.43
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）	10,300.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	318,389,300.00	20.43

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	170410	17 农发 10	900,000	89,523,000.00	5.74
2	170408	17 农发 08	600,000	59,820,000.00	3.84
3	150409	15 农发 09	500,000	49,915,000.00	3.20
4	150223	15 国开 23	500,000	49,305,000.00	3.16
5	170401	17 农发 01	300,000	29,994,000.00	1.92

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

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

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	1,294,412.68
2	应收证券清算款	120,885,264.03
3	应收股利	-
4	应收利息	6,257,133.29
5	应收申购款	383,999.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,820,809.10

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	流通受限情况说 明
----	------	------	-----------------	--------------	--------------

				例(%)	
1	002400	省广股份	17,195,384.25	1.10	非公开发行

§ 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
109,651	31,095.27	302,372,870.59	8.87%	3,107,255,051.56	91.13%

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	318,541.20	0.0093%

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(2003年8月22日)基金份额总额	3,698,432,268.39
本报告期期初基金份额总额	5,435,909,792.50
本报告期基金总申购份额	5,059,036,587.67

减：本报告期基金总赎回份额	7,085,318,458.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,409,627,922.15

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

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 100,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 15 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	6,146,528,924.37	38.24%	5,642,538.57	38.27%	-
长江证券	1	2,026,134,615.66	12.60%	1,886,939.12	12.80%	-
招商证券	1	1,323,259,753.12	8.23%	1,205,889.31	8.18%	-
国金证券	1	1,243,887,557.19	7.74%	1,133,557.64	7.69%	-
国泰君安	2	1,117,292,588.15	6.95%	1,030,510.08	6.99%	-
中信建投	1	792,102,135.97	4.93%	737,684.42	5.00%	-
华创证券	1	745,288,380.06	4.64%	679,183.04	4.61%	-
申万宏源	2	741,062,666.77	4.61%	690,151.30	4.68%	-
华泰证券	1	517,035,185.47	3.22%	481,509.51	3.27%	-
东方证券	2	355,206,618.77	2.21%	323,699.46	2.20%	-
川财证券	1	315,091,653.68	1.96%	230,423.98	1.56%	-
国元证券	2	282,565,971.46	1.76%	263,151.71	1.78%	-
兴业证券	2	264,510,127.56	1.65%	246,337.48	1.67%	-
平安证券	1	205,004,134.75	1.28%	190,921.29	1.30%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内新租用太平洋证券一个券商交易单元。

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
海通证券	1,511,389.50	7.75%	-	-	-	-
长江证券	2,904,837.10	14.89%	700,000,000.00	41.42%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	4,999,500.00	25.63%	120,000,000.00	7.10%	-	-
中信建投	10,090,832.30	51.73%	460,000,000.00	27.22%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	300,000,000.00	17.75%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	110,000,000.00	6.51%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司旗下基金	《中国证券报》、《上	2017-01-01

	2016 年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	海证券报》和《证券时报》	
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-12
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-12
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-13
5	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-17
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-18
7	海富通基金管理有限公司关于参加凤凰金信（银川）投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-01-18
8	海富通精选证券投资基金第十九次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-15
9	海富通基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-04
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-10
11	海富通基金管理有限公司关于参加深圳市金斧子投资咨询有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-10
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-02-23
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增首创证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-03
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加首创证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-03
15	海富通基金管理有限公司关于参加上海华夏财富投资管理有限公司申购费率优	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券	2017-03-21

	惠活动的公告	时报》	
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-21
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续在中国工商银行股份有限公司开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-03-31
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-07
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-07
20	海富通基金管理有限公司关于参加南京苏宁基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-07
21	海富通旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-22
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-11
23	海富通基金管理有限公司关于参加北京蛋卷基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-11
24	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-16
25	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-19
26	海富通基金管理有限公司关于参加上海基煜基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-19
27	海富通基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-05-19
28	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-01
29	海富通旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-30

30	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-07-01
31	海富通基金管理有限公司旗下基金 2017 年半年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-07-01
32	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华西证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-07-20
33	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-07-31
34	海富通基金管理有限公司关于参加一路财富（北京）信息科技有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-08-09
35	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中民财富管理（上海）有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-08-15
36	海富通基金管理有限公司关于参加中民财富管理（上海）有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-08-15
37	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加财通证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-08-23
38	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-08-28
39	海富通基金管理有限公司关于新任公司总经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-09-13
40	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加江苏江南农村商业银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-09-19
41	海富通基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-09-21
42	海富通基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加平安银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-09-23
43	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国国际金融股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-12-22
44	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2018 倾心回馈”	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券	2017-12-29

	基金定投优惠活动的公告	时报》	
45	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-12-29
46	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续在中国农业银行开展基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-12-29
47	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续在浙商银行开展基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-12-29
48	海富通基金管理有限公司关于旗下资管产品运营过程中发生应税收入缴纳增值税及附加税费的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-12-30

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	2017/3/15-2017/3/21	-	1,994,015,952.14	1,994,015,952.14	-	0.00%

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”。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （一）中国证券监督管理委员会批准设立海富通精选证券投资基金的文件
- （二）海富通精选证券投资基金基金合同

- (三) 海富通精选证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通精选证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 报告期内海富通精选证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一八年三月二十七日