

**海富通季季通利理财债券型证券投资基金**  
**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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

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

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

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

本报告期自 2017 年 7 月 14 日（基金合同生效日）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	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
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	17
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合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	18
§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	19
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	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况	41
8.2 债券回购融资情况	42
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	42

8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	43
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	43
8.9 投资组合报告附注 .....	43
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	44
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
11.4 基金投资策略的改变 .....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	47
11.9 其他重大事件 .....	47
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>48</b>
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>49</b>
13.1 备查文件目录 .....	49
13.2 存放地点 .....	50
13.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通季季通利理财债券型证券投资基金	
基金简称	海富通季季通利理财债券	
基金主代码	004577	
交易代码	004577	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 7 月 14 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	-份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通季季通利理财债券 A	海富通季季通利理财债券 B
下属分级基金的交易代码	004577	004578

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力求基金资产安全性的基础上，通过合理的资产配置和个券选择，为投资者提供稳定的资产回报。
投资策略	本基金将以组合久期与运作期匹配作为基本原则，将严格采用买入并持有策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余运作期的固定收益类工具。在集中申购期内，主要采用流动性管理策略。本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对各类资产的利差水平进行判断，从而决定资产配置比例。
业绩比较基准	-
风险收益特征	本基金为理财债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险与预期收益低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	奚万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张文伟	陈四清

## 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	<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

## 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 7 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	
	海富通季季通利理财债券 A	海富通季季通利理财债券 B

本期已实现收益	11,572,722.69	191,350.89
本期利润	11,572,722.69	191,350.89
本期净值收益率	0.7128%	0.7389%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2017 年末</b>	
	海富通季季通利理财债券 A	海富通季季通利理财债券 B
期末基金资产净值	-	-
期末基金份额净值	-	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2017 年末</b>	
	海富通季季通利理财债券 A	海富通季季通利理财债券 B
累计净值收益率	0.7128%	0.7389%

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,由于理财债券型证券投资基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3、本基金合同于 2017 年 7 月 14 日生效,合同生效期间的数据和指标按实际存续期计算。

4、2017 年 10 月 11 日终,本基金暂停下一运作期运作。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 1. 海富通季季通利理财债券 A:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5735%	0.0038%	-	-	-	-
2017.7.14-2017.10.11	0.7128%	0.0036%	-	-	-	-

#### 2. 海富通季季通利理财债券 B:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去三个月	0.5995%	0.0030%	-	-	-	-
2017.7.14-2017.10.11	0.7389%	0.0030%	-	-	-	-

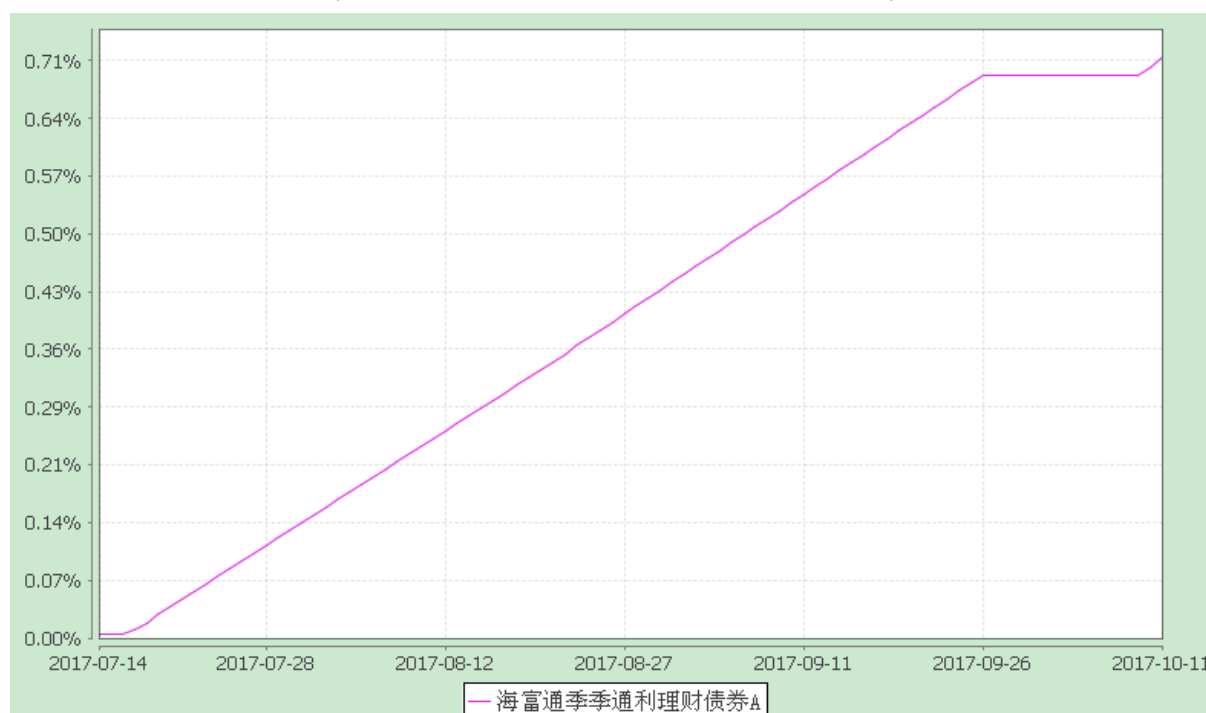
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通季季通利理财债券型证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

#### 1. 海富通季季通利理财债券 A

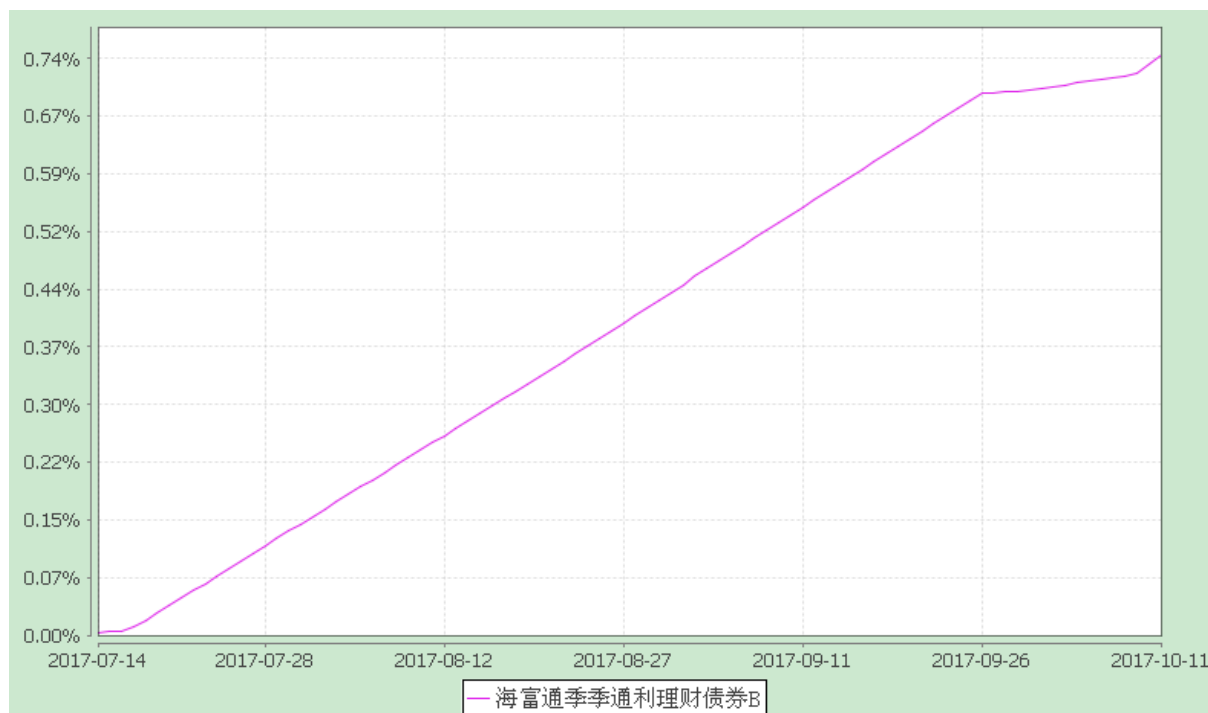
(2017 年 7 月 14 日至 2017 年 10 月 11 日)



#### 2. 海富通季季通利理财债券 B

(2017 年 7 月 14 日至 2017 年 10 月 11 日)





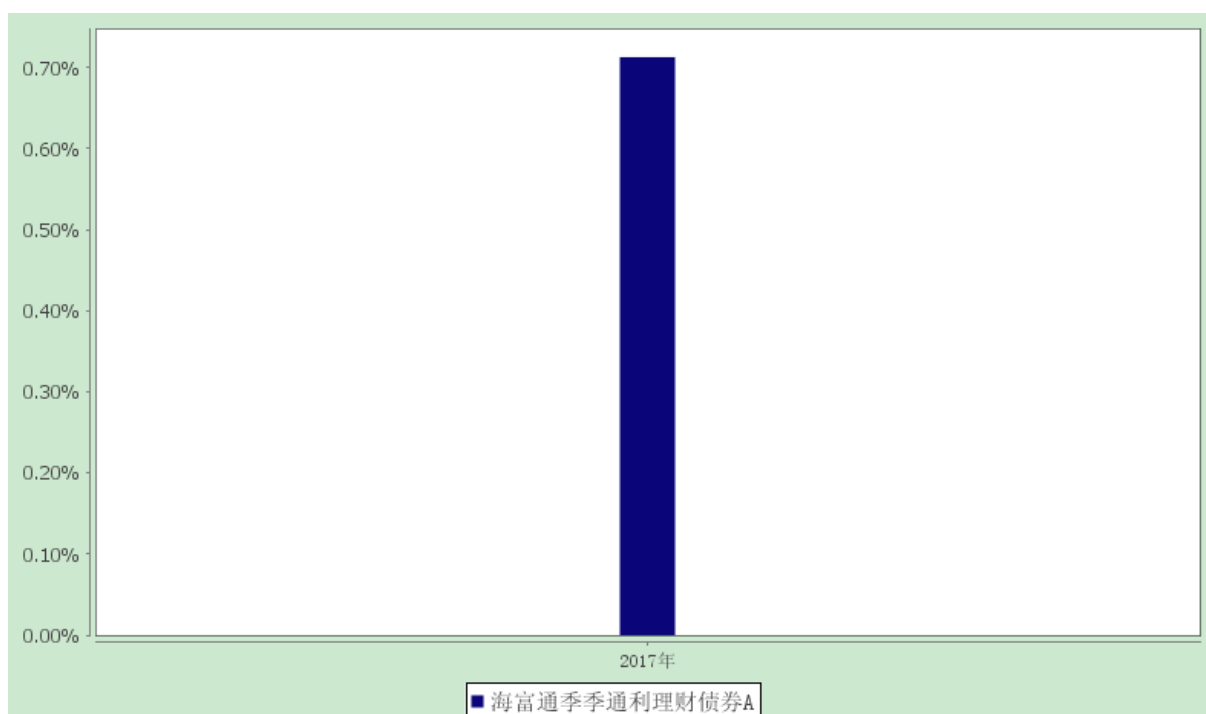
注：1、本基金合同于 2017 年 7 月 14 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
 2、按基金合同规定，本基金已在第一个运作期开始后的 10 个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关规定。  
 3、本基金第一期运作期为 2017 年 7 月 14 日至 2017 年 9 月 27 日。截至第二期集中申购期最后一日即 2017 年 10 月 11 日日终，本基金的基金资产净值加上本基金集中申购期最后一日的申购申请金额后的余额低于 5000 万元且基金份额持有人数量不满 200 人，根据基金合同约定，本基金管理人决定暂停本基金下一运作期运作。截至报告期末，本基金仍处于暂停运作状态。

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

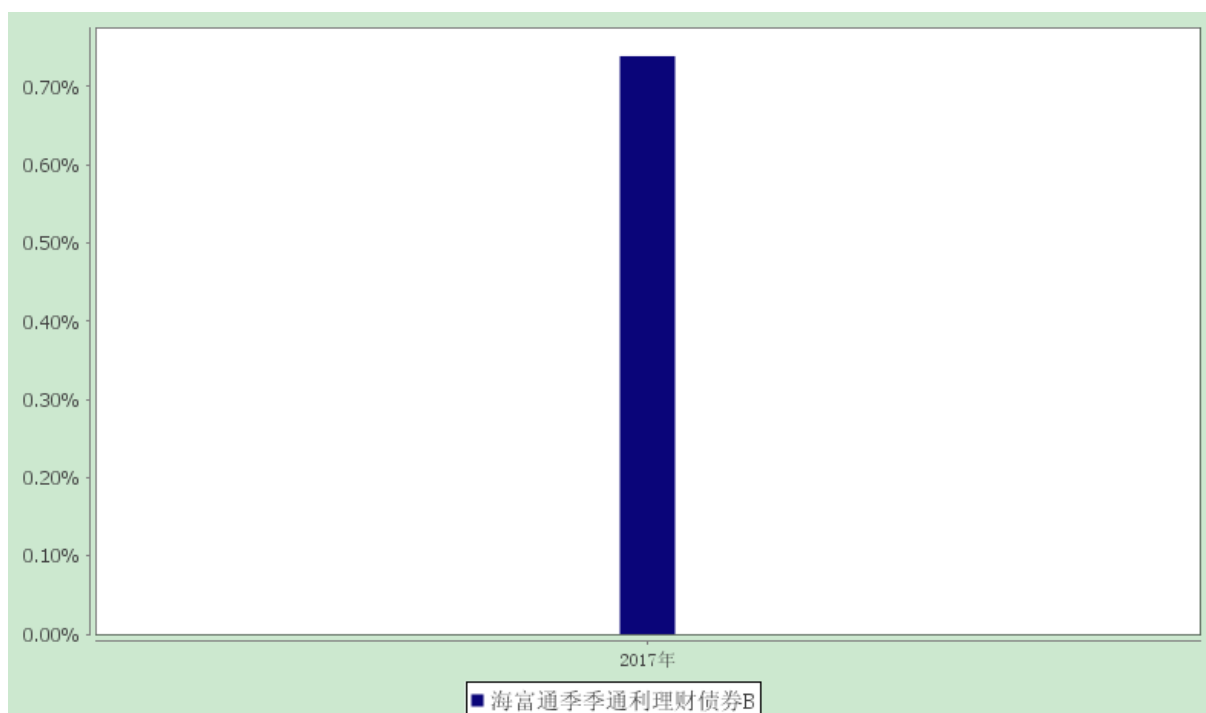
#### 海富通季季通利理财债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图

##### 1. 海富通季季通利理财债券 A



## 2. 海富通季季通利理财债券 B



注：图中列示的 2017 年度基金净值收益率按该年度本基金实际存续期 7 月 14 日（基金合同生效日）起至 10 月 11 日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

海富通季季通利理财债券 A：

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2017	-	11,572,722.69	-	11,572,722.69	-
合计	-	11,572,722.69	-	11,572,722.69	-

**海富通季季通利理财债券 B:**

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2017	57,589.46	215,525.93	-81,764.50	191,350.89	-
合计	57,589.46	215,525.93	-81,764.50	191,350.89	-

**§ 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		
谈云飞	本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通养老收益混合基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通	2017-07-14	-	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月任海富通纯债债券、海富通双福分级债券、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通养老收益混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通

	新内需混合基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通欣盛定开混合基金经理；海富通欣享混合基金经理。					强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通季季通利理财债券基金经理。
--	--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 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、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年的债券市场延续跌势。宏观层面看，全年经济增长平稳显韧性，供给侧改革、棚改货币化推动固定资产投资维持较高增速，出口得益于全球经济复苏成为拉动国内经济的主要动力；通胀全年维持低位，人民币汇率总体稳定，货币政策主要目标在于去杠杆和去泡沫，因此延续了中性偏紧的基调。同时金融监管全面收紧，抑制同业链条，引导资金脱虚向实。在这种情况下，十年期国债收益率全年呈现波浪式上升的态势，利率于一季度、二季度和四季度经历三次快速上行，并在四季度达到 4% 的水平，创下近几年新高。2017 年市场流动性整体处于紧平衡状态，央行货币政策延续去年四季度以来的“稳健中性”，投放相对审慎，央行今年的操作体现出缩短放长的特征。在操作利率方面，央行分别在春节前后以及美联储 3 月加息后两次上调公开市场逆回购和 MLF 等货币市场工具操作利率。利率超预期上调叠加央行实质从紧的货币政策，使得市场资金价格中枢明显上行，3 个月 SHIBOR 报价也自年初 3.5 开始一路上行至年底的 4.9 的水平。3 个月期限的同业存款、同业存单的利率也居高不下。

本基金首个运作期为 2017 年 7 月 14 日至 2017 年 9 月 27 日，根据基金合同，基金

只能投资于到期日不超过 9 月 27 日的资产。由于 7 月初的资金价格和短期债券、存单、存款价格水平偏低，本基金所配置的逆回购、存款收益率并不理想，且新基金开设银行间账户需要一段时间，导致首个运作期的收益偏低。

本基金在 4 季度暂停运作，未做投资安排。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值收益率为 0.7128%，本基金 B 类份额净值收益率为 0.7389%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济基本面看，2018 年经济或继续保持平稳增长，全年 GDP 增速预计在 6.6%-6.8%。一季度由于受采暖季限产扰动和地产短周期下行影响，经济阶段性承压，但二季度以后经济内生动能可能有所修复，GDP 或小幅回升。分项来看，18 年制造业投资可能出现结构性修复，出口继续保持较高增速，基建投资仍能有效托底，此三项或是 2018 年经济的支持项，而地产投资和汽车消费或形成拖累，但下滑幅度预计较为温和。总体看 18 年经济依然保持较强韧性。通胀方面，PPI 受需求放缓和高基数影响大概率将出现回落，而 CPI 可能会取代 PPI 成为 18 年的通胀主线，预计 CPI 中枢较 17 年将出现显著抬升，但整体通胀压力仍较为可控，原油价格是最大的不确定因素。政策方面，18 年金融防风险和实体去杠杆仍将持续推进，货币政策短期继续保持中性偏紧的基调，且不排除会进一步上调政策利率，但如果下半年出现实体融资利率过高，通胀增速回落的情况，货币政策也有边际转松的可能；金融强监管仍将延续，资管新规等制度细则将陆续落地，银行理财、券商资管等规模趋于回落，对债券市场的影响深远，有待进一步观察。此外，18 年诸多海外因素也不容忽视，美国税改的效果、美股可能出现的泡沫、地缘政治局势等都会对汇率及全球资本市场产生较大影响，值得关注。长端利率预计仍会维持高位震荡，监管和通胀是市场担忧所在，不过一旦出现预期差则会产生交易性机会。信用债方面，资管新规对信用债的影响是结构性的，在当前绝对收益率水平处于历史高位的情况下高等级信用债的信用利差或将保持平稳，具有一定配置价值，中低等级信用利差仍有走扩压力。流动性方面，央行多次强调要控制好货币供给的阀门，银行的流动性指标严格执行，且银行同业部门将在一定时间内处于降杠杆过程中，市场流动性的周期性波动依然显著，月末、季末的时点紧张还将继续。

#### 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的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

2017 年 10 月 11 日,本基金暂停下一运作期运作,归投资者享有的收益已全部通过赎回的方式进行支付。

#### 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

截至 2017 年 10 月 11 日(第二期集中申购期最后一日),本基金的基金资产净值加上本基金集中申购期最后一日的申购申请金额后的余额低于 5000 万元且基金份额持有人数量不满 200 人,根据基金合同约定,本基金管理人决定暂停下一运作期运作。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对海富通季季通利理财债券型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托

管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 21649 号

海富通季季通利理财债券型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

我们审计了海富通季季通利理财债券型证券投资基金(以下简称“海富通季季通利理财债券基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间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,公允反映了海富通季季通利理财债券基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间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,我们独立于海富通季季通利理财债券基金,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

海富通季季通利理财债券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季季通利理财债券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季季通利理财债券基金、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季季通利理财债券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季季通利理财债券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季季通利理财债券基金不能持续经营。

(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：海富通季季通利理财债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-
银行存款	7.4.7.1	122,694.13
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	-
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	24.50
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	86,281.37
资产总计		209,000.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		-
应付托管费		-
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
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	209,000.00
负债合计		209,000.00
<b>所有者权益:</b>		-
实收基金	7.4.7.9	-
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		-
负债和所有者权益总计		209,000.00

注：基金合同成立于 2017 年 7 月 14 日，上年度可比区间无比较数据。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通季季通利理财债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2017 年 7 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>13,682,299.04</b>
1.利息收入		13,682,299.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,403,519.70
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,278,779.34
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-
<b>减：二、费用</b>		<b>1,918,225.46</b>
1. 管理人报酬		709,728.28
2. 托管费		284,148.89
3. 销售服务费		700,601.94
4. 交易费用	7.4.7.15	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.16	223,746.35

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		<b>11,764,073.58</b>
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>11,764,073.58</b>

注：本财务报表的实际编制期间为 2017 年 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日，上年度可比区间无比较数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通季季通利理财债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 14 日（基金合同生效日）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）	1,704,281,569.99	-	1,704,281,569.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,764,073.58	11,764,073.58
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）	-1,704,281,569.99	-	-1,704,281,569.99
其中：1.基金申购款	312,589.46	-	312,589.46
2.基金赎回款	-1,704,594,159.45	-	-1,704,594,159.45
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）	-	-11,764,073.58	-11,764,073.58
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本财务报表的实际编制期间为 2017 年 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日，上年度可比区间无比较数据。

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

海富通季季通利理财债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2014]962 号《关于核准海富通季季通利理财债券型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2017]939 号《关于同意海富通季季通利理财债券型证券投资基金延期募集备案的回函》注册，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《海富通季季通利理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,704,040,141.59 元，已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(2017)第 699 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通季季通利理财债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)于 2017 年 7 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,704,281,569.99 份基金份额，其中认购资金利息折合 241,428.40 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据在运作期结束时登记机构是否对基金份额进行强制赎回，分为 A、B 两类基金份额，单独设置基金代码。若投资人选择持有 A 类基金份额，则在每个运作期最后一个工作日(赎回开放日)，登记机构将对 A 类基金份额全部进行强制赎回；若投资人选择持有 B 类基金份额，则在每个运作期最后一工作日(赎回开放日)，如基金份额持有人不进行赎回，则其所持有的 B 类基金份额将进入下一运作期。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通季季通利理财债券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法律法规及监管机构允许投资的固定收益类工具，具体包括现金，协议存款、通知存款、银行定期存款、大额存单，债券回购，短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、中期票据、资产支持证券等，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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金不投资可转换债券，但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。

根据本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司 2017 年 10 月 12 日的《海富通季季通利理财债券型证券投资基金关于暂停下一运作期运作的公告》，本基金的第一期运作期为 2017 年 7 月 14 日至 2017 年 9 月 27 日，本基金第二期运作期集中申购期为 2017 年 9 月 28 日至 2017 年 10 月 11 日。截至第二期集中申购期最后一日即 2017 年 10 月 11 日日终，本基金的基金资产净值加上本基金集中申购期最后一日的申购申请金额后的余额低于 5000 万元且基金份额持有人数量不满 200 人，根据本基金基金合同约定，本基金管理人决定暂停本基金下一运作期运作。本基金管理人将拒绝投资人在 2017 年 10 月



11 日的申购申请,对于在 2017 年 10 月 11 日日终留存的基金份额,按人民币 1.00 元的基金份额净值予以强制赎回。

于 2017 年 12 月 31 日,本基金仍处于暂停运作期状态。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通季季通利理财债券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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本基金的财务报表编制以持续经营为基础。

#### **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 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的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 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 7 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

##### **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。对于取得债券投资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。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(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。每份基金份额面值为 1.00 元。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确认。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额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。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资。本基金以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，在每个运作期的最后一个工作日集中支付。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须作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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的

补充通知》及其他相关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，包括买卖债券的差价收入，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。

#### 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
活期存款	122,694.13
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	122,694.13

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

###### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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
应收活期存款利息	24.50
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	24.50

**7.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
其他应收款	86,281.37
待摊费用	-
合计	86,281.37

注：其他应收款为本基金暂停运作期间，由基金管理人承担的本基金产生的相关费用总额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

本基金本报告期末应付交易费用无余额。

**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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	209,000.00
合计	209,000.00

**7.4.7.9 实收基金****海富通季季通利理财债券 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年7月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,665,557,118.81	1,665,557,118.81
本期申购	5,000.00	5,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,665,562,118.81	-1,665,562,118.81
本期末	-	-

**海富通季季通利理财债券 B**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年7月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	38,724,451.18	38,724,451.18
本期申购	307,589.46	307,589.46
本期赎回（以“-”号填列）	-39,032,040.64	-39,032,040.64
本期末	-	-

注：1.本基金自 2017 年 4 月 26 日至 2017 年 7 月 7 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 1,704,040,141.59 元，折合为 1,704,040,141.59 份海富通季季通利理财债券基金份额，其中 A 类基金份额 1,665,323,811.59 份，B 类基金份额 38,716,330.00 份。根据《海富通季季通利理财债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 241,428.40 元在本基金成立后，折算为 241,428.40 份基金份额，其中 A 类基金份额 223,272.27 份，B 类基金份额 8,121.18 份，划入基金份额持有人账户。

2.根据本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司 2017 年 10 月 12 日的《海富通季季通利理财债券型证券投资基金关于暂停下一运作期运作的公告》，根据本基金基金合同约定，本基金的基金管理人决定，本基金暂停下一运作期运作。对于在 2017 年 10 月 11 日日终留存的基金份额按人民币 1.00 元的基金份额净值强制赎回。2017 年 10 月 12 日，本基金份额持有人的相应全部赎回款(含未付收益)从托管账户划出。

**7.4.7.10 未分配利润****海富通季季通利理财债券 A**

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	11,572,722.69	-	11,572,722.69
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-11,572,722.69	-	-11,572,722.69
本期末	-	-	-

## 海富通季季通利理财债券 B

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	191,350.89	-	191,350.89
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-191,350.89	-	-191,350.89
本期末	-	-	-

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	274,256.65
定期存款利息收入	9,121,350.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,913.05
其他	-
合计	9,403,519.70



**7.4.7.12 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**7.4.7.13 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**7.4.7.15 交易费用**

本基金本报告期无交易费用。

**7.4.7.16 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年7月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
审计费用	48,526.31
信息披露费	148,245.60
债券托管账户维护费	13,500.00
其他	9,626.34
银行划款手续费	3,848.10
合计	223,746.35

**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**

截至本财务报表批准报出日，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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 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**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易，上年度可比区间无比较数据。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，上年度可比区间无比较数据。

**7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，上年度可比区间无比较数据。

**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7月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	709,728.28
其中：支付销售机构的客户维护费	586,896.61

注：1、支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 7 月 14 日，上年度可比区间无比较数据。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年7月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	284,148.89

注：1、支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 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 0.08% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2017 年 7 月 14 日，上年度可比区间无比较数据。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年7月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通季季通利 理财债券 A	海富通季季通利理财 债券 B	合计
中国银行	324,488.08	13,815.62	338,303.70
海富通基金	-	0.76	0.76
合计	324,488.08	13,816.38	338,304.46

注：1.支付基金销售机构的海富通季季通利理财债券 A 和海富通季季通利理财债券 B 的销售服务费均按前一日该类基金资产净值 0.20% 的年费率计提。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

2.基金合同成立于 2017 年 7 月 14 日，上年度可比区间无比较数据。

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易，上年度可比区间无比较数据。

#### 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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金，上年度可比区间无比较数据。

##### 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金，上年度可比区间无比较数据。

#### 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7月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	122,694.13	274,256.65

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

2、基金合同成立于 2017 年 7 月 14 日，上年度可比区间无比较数据。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券，上年度可比区间无比较数据。

**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**

本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项，上年度可比区间无比较数据。

**7.4.11 利润分配情况****1、海富通季季通利理财债券 A**

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
-	11,572,722.69	-	11,572,722.69	-

**2、海富通季季通利理财债券 B**

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
57,589.46	215,525.93	-81,764.50	191,350.89	-

**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**

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。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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**

本基金为理财债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益低于混合型基金和股票型基金。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在力求基金资产安全性的基础上，通过合理的资产配置和个券选择，为投资者提供稳定的资产回报。

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三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约责任，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。

本公司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中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

#### 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。

由于本基金运作期内封闭，在每个运作期结束前公布下一运作期的具体时间安排，滚动运作，针对定期开放时兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人会在运作期内保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。

#### 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》且于基金开放期内按照《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。

在运作期内，本基金以组合久期与运作期匹配作为基本原则，严格采用买入并持有策略，本基金投资的各项金融工具的到期日不得晚于该运作期的最后一日。

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，本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期。

本基金投资于同一公司发行的证券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金的存款银行是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%，持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

于开放期内，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。

本基金主要投资于定期银行存款等，因此存在相应的利率风险。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。

##### 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	6个月以内	6个月-1年	不计息	合计
资产				
银行存款	122,694.13	-	-	122,694.13
应收利息	-	-	24.50	24.50
其他资产	-	-	86,281.37	86,281.37
资产总计	122,694.13	-	86,305.87	209,000.00
负债				
其他负债	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	-	-	209,000.00	209,000.00

利率敏感度缺口	122,694.13	-	-122,694.13	-
---------	------------	---	-------------	---

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者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金主要投资于定期银行存款，因此无重大其他价格风险。

### 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，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，因此无属于第一层次、第二层次或第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### (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。

(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	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	122,694.13	58.71
4	其他各项资产	86,305.87	41.29
5	合计	209,000.00	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	-
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	53
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

**8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离**

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	-

以上数据按交易日统计。

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

**8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**8.9 投资组合报告附注****8.9.1 基金计价方法说明**

2007年7月1日基金实施新会计准则后,本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

**8.9.2** 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。

**8.9.3 期末其他各项资产构成**

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	24.50
4	应收申购款	-
5	其他应收款	86,281.37
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	86,305.87

## § 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

2017 年 10 月 11 日日终，本基金暂停基金下一运作期运作。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	海富通季季通利理财 债券 A	0
	海富通季季通利理财 债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	海富通季季通利理财 债券 A	0
	海富通季季通利理财 债券 B	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通季季通利理财债 券 A	海富通季季通利理财债 券 B
基金合同生效日（2017 年 7 月 14 日）基金份额总额	1,665,557,118.81	38,724,451.18
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,000.00	307,589.46
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,665,562,118.81	39,032,040.64
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

基金合同生效日起至报告期期末 期末基金份额总额	-	-
----------------------------	---	---

注：2017 年 10 月 11 日日终，本基金暂停下一运作期运作。

## § 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。

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。本年度应支付的审计费用是 50,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 1 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	
中信证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

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	成交金	占当期回	成交金额	占当期权证

		债券成交总额的比例	额	购成交总额的的比例		成交总额的比例
中信证券	-	-	1,152,900,000.00	99.57%	-	-
上海证券	-	-	5,000,000.00	0.43%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值未超过 0.5%。

### 11.9 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	海富通季季通利理财债券型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-04-22
2	海富通基金管理有限公司关于海富通季季通利理财债券型证券投资基金新增销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-23
3	关于海富通季季通利理财债券型证券投资基金新增工商银行作为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-06-26
4	海富通基金管理有限公司关于海富通季季通利理财债券型证券投资基金提前结束募集的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-07-07
5	海富通季季通利理财债券型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-07-15
6	关于海富通季季通利理财债券型证券投资基金第一运作期投资组合构建情况说明的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-07-29
7	关于海富通季季通利理财债券型证券投资基金第一个运作期相关情况的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-08-02
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国银河证券股份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》	2017-08-28
9	海富通基金管理有限公司关于新任公司	《中国证券报》、《上海	2017-09-13

	总经理的公告	《证券报》和《证券时报》	
10	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
11	关于海富通季季通利理财债券型证券投资基金 2017 年第一期运作期赎回开放日、第二期运作期集中申购及运作期相关安排的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-09-25
12	关于海富通季季通利理财债券型证券投资基金第一期运作期收益支付的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-09-30
13	海富通季季通利理财债券型证券投资基金关于暂停下一运作期运作的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2017-10-12
14	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
个人	1	2017/9/28-2017/10/11	2,750,123.75	269,108.53	3,019,232.28	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>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</p>							



购及转换转入申请。

注：本基金合同生效日为2017年7月14日，期初份额指基金合同生效日持有份额。

## 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”。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通季季通利理财债券型证券投资基金的文件
- （二）海富通季季通利理财债券型证券投资基金基金合同

- (三) 海富通季季通利理财债券型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通季季通利理财债券型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) 报告期内海富通季季通利理财债券型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