

海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金
2018 年半年度报告摘要
2018 年 6 月 30 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：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通沪港深混合
基金主代码	519139
交易代码	519139
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 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	156,658,658.41 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金以投资目标为中心，将定性和定量的分析方法运用于资产配置，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，包括大类资产的历史回报、历史波动率等制定本基金在股票、债券、现金、衍生品等资产之间的初步配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，再根据基本面、资金面、估值等具体因素，持续、动态、优化投资组合的资产配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40% +恒生指数收益率×40% +中债综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	wrxj@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-105,665.32
本期利润	-6,772,901.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0432
本期基金份额净值增长率	-3.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.2070
期末基金资产净值	189,087,836.32
期末基金份额净值	1.2070

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）。

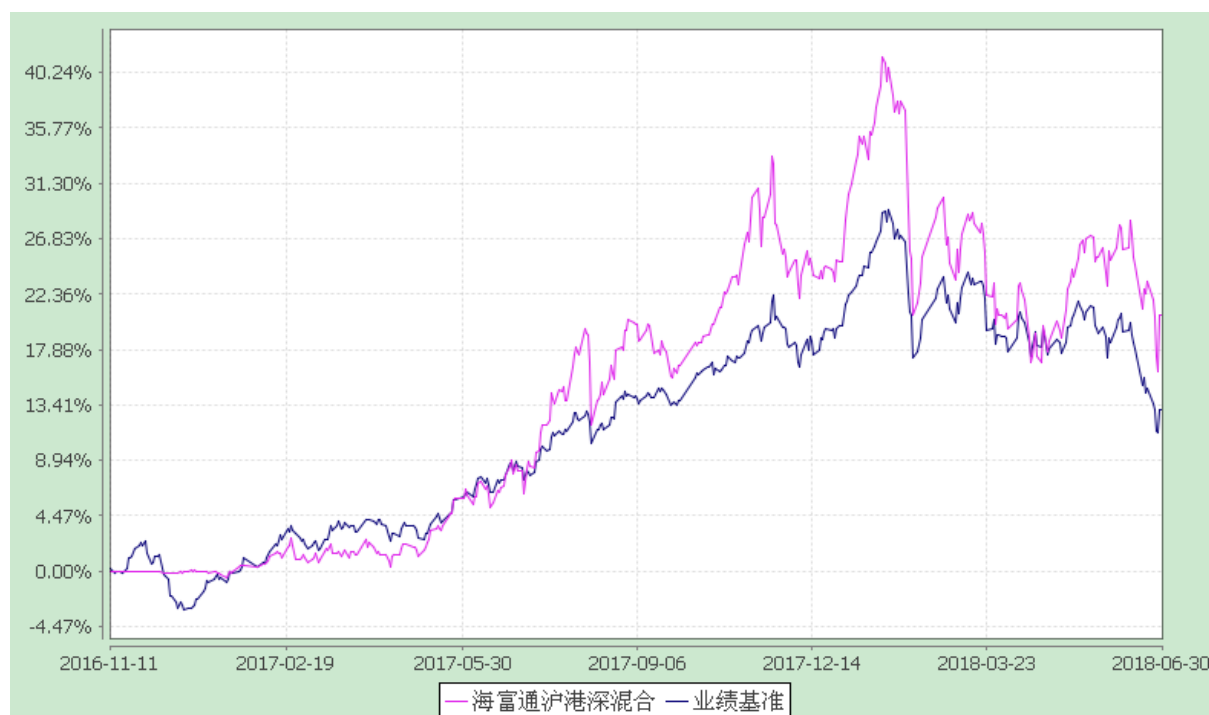
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-4.08%	1.53%	-4.93%	0.93%	0.85%	0.60%
过去三个月	-0.01%	1.30%	-5.13%	0.83%	5.12%	0.47%
过去六个月	-3.46%	1.41%	-5.72%	0.89%	2.26%	0.52%
过去一年	11.65%	1.23%	4.10%	0.73%	7.55%	0.50%
自基金合同 生效起至今	20.70%	0.99%	12.97%	0.63%	7.73%	0.36%

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

海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2016 年 11 月 11 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2016 年 11 月 11 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 54 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、海富通安颐收益混合型证券投资基金（原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）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日 期	离任日期		
张炳炜	本基金的基金 经理；海富通中国海 外混合（QDII） 基金经理；海富通强化 回报混合基金经理；海 富通大中华混合（QDII） 基金经理；海富通欣悦 混合基金经 理。	2016-11- 11	-	9 年	硕士，持有基金从业人员 资格证书。曾任交银施罗 德基金管理有限公司数量 分析师，2011 年 7 月加入 海富通基金管理有限公司， 任股票分析师。2015 年 6 月起任海富通强化回报混 合基金经理。2016 年 2 月 起兼任海富通大中华混合 （QDII）和海富通中国海 外混合（QDII）基金经理。 2016 年 11 月起兼任海富通 沪港深混合基金经理。 2017 年 7 月起兼任海富通 欣悦混合基金经理。
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 通精选混合基金经理； 总经理助理。	2016-11- 30	-	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 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。
高崢	本基金的基金经理	2017-08-28	-	10 年	经济学硕士。持有基金从业人员资格证书。历任德勤华永会计师事务所审计部职员，光大证券股份有限公司行业研究员，中金公司研究部执行总经理、化工行业研究团队负责人。2017 年 3 月加入海富通基金管理有限公司，任权益投资部基金经理助理。2017 年 8 月起任海富通沪港深混合的基金经理。

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为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

3、本公司于 2018 年 8 月 4 日发布公告，自 2018 年 8 月 1 日起，张炳炜先生不再担任本基金的基金经理。

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 公平交易制度的执行情况

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、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、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。

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、投资部门、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，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 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。

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 2018 年上半年，A 股市场整体呈现震荡下跌的走势，各大指数全线下挫，上证综指收于 2847.42 点，上半年下跌 13.90%，深证成指报 9379.47 点，跌幅达 15.04%。中小板指和创业板指分别报收 6477.76 点和 1606.71 点，分别下挫 14.26% 和 8.33%。

具体来看，年初沪指迎来开门红，市场情绪高涨，上冲至年内最高点 3587.03 点后开始回调。受到美股负面以及信托资金降杠杆影响，2 月市场经历了深度回调，直至春节前才企稳反弹，市场风格也由前期表现强势的价值白马股切换至成长股。随后市场呈现区间震荡走势，3 月下旬受美联储加息叠加贸易摩擦影响，市场避险情绪浓厚，股指开始出现回调。4 月市场持续疲弱，但仍表现出一定的结构性行情，医药、钢铁等板块表现亮眼。5 月在资管新规落地、A 股正式启动纳入 MSCI 以及中美贸易磋商取得进展等多重利好下，主要指数震荡上行。随后美国单方面再挑贸易战使得市场悲观情绪加剧，指数开启震荡下行态势。6 月延续了 5 月的悲观情绪，各大指数持续下探，全月跌幅明显。

行业方面，在 29 个中信一级行业分类中，仅餐饮旅游（10.15%）、医药（4.46%）和食品饮料（1.82%）录得涨幅，其余行业均呈现下跌，综合（-32.13%）、电力设备（-27.00%）和通信（-26.66%）跌幅居前。

港股整体滞后于 A 股，但同样呈现震荡下跌的走势，2018 年开年，港股市场在周期和金融的带领下一度强势上涨，创下多年以来新高。进入 2 月，港股市场受外国剧烈波动影响而大跌。春节过后，港股市场一度随着美股市场企稳有所反弹，但进入 3 月，随着中美贸易摩擦的升温，全球市场再度出现恐慌，港股也因此受到明显波及。4 月受中美贸易摩擦边际上升温的影响，投资者情绪谨慎，市场基本维持震荡行情；进入 5 月，贸易摩擦边际上有所缓和，港股反弹，但中下旬信用违约频发再度打压风险偏好，叠加海外市场波动的影响，港股转为下跌。6 月初市场小幅反弹，但投资者情绪依然谨慎；随后中美双方决定互相加征关税，贸易摩擦升级；国内继续去杠杆、央行定向降准力度不及预期、人民币大幅贬值、国开行或收紧棚改融资等因素也压制了风险偏好，港股大幅下挫，恒生指数跟随 A 股大幅破位下跌，抹掉了年初以来的涨幅，使指数回到了 2017 年中左右的水平。整体来看，上半年恒生指数和恒生国企指数累计下跌 3.22% 和 5.43%。基金在上半年主要以调整结构为主，降低了宏观相关度较高的周期板块配置比例，提升了公用事业和消费等板块的配置比例，整体组合结构更为均衡。

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-3.46%，同期基金业绩比较基准收益率为-5.72%，基

金净值跑赢业绩比较基准 2.26 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

2018 年以来，中国经济持续面临内外部的考验，内部压力主要来自于去杠杆政策延续对于实体部门信用的收缩，而外部压力主要来自于中美贸易争端对出口端的影响，以及美联储持续加息对于外汇部门和国内金融资产估值的冲击。不过，2018 年 7 月以来宏观政策发生了一定变化：央行通过窗口指导，给予额外的 MLF 资金用于支持贷款投放和信用债投资；资管新规细则出台，公募理财产品门槛从 5 万降低至 1 万，银行现金类产品允许摊余成本估值，过渡期内金融机构自主可控确定整改计划，公募产品在期限匹配、限额管理的前提下可以投资非标，这一系列细节上的宽松适度缓解了银行处置非标和委外的压力；7 月 23 日召开的国务院常务会议提出积极财政政策要更加积极，稳健的货币政策要松紧适度。

展望下半年，在货币、财政政策综合作用下，我们认为中国经济虽然仍有下行压力，但政策对冲之后下行压力会有所减轻。尽管出口端受到贸易战影响可能有一定幅度下滑，但基建投资适度扩张带来的固定资产投资企稳和减税政策带来的民营投资、居民消费回暖可以保障中国经济平稳运行。此外，我们认为政策的目的是托住经济，而非强刺激。

对于下半年的资本市场，我们认为受益于政策放松，风险偏好会从目前极低的水平企稳甚至回升，流动性也会缓解。市场不会再陷入之前由于巨大不确定性带来的恐慌之中。随着人民币汇率企稳，港股市场的压力也将有所缓和。市场结构方面，龙头企业在各自行业内竞争力强化、强者恒强的格局将延续，长期看这些龙头企业将构筑成中国经济的“核心资产”；以创业板为代表的新兴成长行业经历了几年持续调整压力，部分细分行业的景气开始具备相对比较优势，如果中报业绩增速能够得到验证，并且下半年的业绩趋势仍可持续，那么有可能成为市场新的优势板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，

以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金报告期内未进行过利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2017 年 12 月 28 日至 2018 年 6 月 30 日，已连续超过六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人拟通过基金转型的方式解决。解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在海富通沪港深灵活配置混合型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

本报告期内，海富通基金管理有限公司在海富通沪港深灵活配置混合型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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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沪港深灵活配置混合型证券投资基金的半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半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	30,517,212.98	13,977,045.10
结算备付金		1,740,553.66	3,713,037.53
存出保证金		142,376.01	2,999,946.79
交易性金融资产	6.4.7.2	151,904,235.94	178,726,970.83
其中：股票投资		151,904,235.94	178,726,970.83
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,542,001.30	970,346.41
应收利息	6.4.7.5	5,316.64	8,633.46
应收股利		1,913,550.80	35,200.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		191,765,247.33	200,431,180.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		1,879,575.91	3,411,468.59
应付赎回款		-	3,358.28
应付管理人报酬		239,896.77	217,007.30
应付托管费		39,982.82	36,167.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	339,437.02	555,510.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	178,518.49	216,004.27
负债合计		2,677,411.01	4,439,517.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	156,658,658.41	156,760,379.57
未分配利润	6.4.7.10	32,429,177.91	39,231,283.35
所有者权益合计		189,087,836.32	195,991,662.92
负债和所有者权益总计		191,765,247.33	200,431,180.12

注：1、报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2070 元，基金份额总额 156,658,658.41 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-3,718,068.63	19,751,095.35
1.利息收入		115,780.36	623,722.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	115,780.36	430,198.22
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		-	193,524.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,833,071.89	9,732,808.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-47,704.11	8,078,551.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,880,776.00	1,654,257.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,667,236.04	9,141,253.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	315.16	253,310.10
减：二、费用		3,054,832.73	3,285,567.69
1. 管理人报酬		1,469,030.27	1,546,975.56
2. 托管费		244,838.40	257,829.26
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,157,421.33	1,299,805.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	183,542.73	180,956.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,772,901.36	16,465,527.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,772,901.36	16,465,527.66

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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)	156,760,379.57	39,231,283.35	195,991,662.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-6,772,901.36	-6,772,901.36
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)	-101,721.16	-29,204.08	-130,925.24
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-101,721.16	-29,204.08	-130,925.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	156,658,658.41	32,429,177.91	189,087,836.32
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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)	230,022,926.96	-129,965.59	229,892,961.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	16,465,527.66	16,465,527.66
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)	-94,978,737.64	-5,378,049.07	-100,356,786.71
其中：1.基金申购款	19,646,650.30	396,033.34	20,042,683.64
2.基金赎回款	-114,625,387.94	-5,774,082.41	-120,399,470.35

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	135,044,189.32	10,957,513.00	146,001,702.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]第 1647 号《关于准予海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》组织基金发售。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 230,010,422.60 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（2016）第 1389 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 230,023,025.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 12,603.19 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、证券公司发行的短期公司债及其他经中国证监会允许投资的债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%（其中，投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票比例为基金资产的 0-95%）；每个交易日日终在

扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40% +恒生指数收益率×40% +中债综合财富指数收益率×20%。

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 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 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》、《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年上半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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30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	371,383,213.23	55.66%	747,693,566.11	100.00%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

海通证券	-	-	713,000,000.00	100.00%
------	---	---	----------------	---------

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	315,183.16	55.20%	83,596.29	24.63%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	637,157.06	100.00%	328,432.42	100.00%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,469,030.27	1,546,975.56
其中：支付销售机构的客户维护 费	323.48	73.37

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 1.50% 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	244,838.40	257,829.26

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30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	30,517,212.98	87,754.28	14,591,129.11	327,066.35
合计	30,517,212.98	87,754.28	14,591,129.11	327,066.35

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 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。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 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	151,904,235.94	79.21
	其中：股票	151,904,235.94	79.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	32,257,766.64	16.82
8	其他各项资产	7,603,244.75	3.96
9	合计	191,765,247.33	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	3,470,352.00	1.84
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,299,076.10	16.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,274,912.50	3.32
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,431,889.02	3.40
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,644,430.00	1.93
S	综合	-	-
	合计	50,120,659.62	26.51

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	5,441,536.02	2.88
非日常生活消费品	11,591,731.32	6.13
金融	32,582,328.78	17.23
日常消费品	10,458,824.12	5.53
医疗保健	6,034,403.94	3.19
房地产	20,294,087.27	10.73
能源	10,335,554.47	5.47
公用事业	5,045,110.40	2.67
合计	101,783,576.32	53.83

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	H00998	中信银行	2,344,000	9,703,271.62	5.13
2	H03968	招商银行	317,500	7,749,459.04	4.10
3	H00939	建设银行	1,262,000	7,713,943.45	4.08
4	H06818	中国光大银行	2,610,000	7,415,654.67	3.92
5	000963	华东医药	130,050	6,274,912.50	3.32
6	H01093	石药集团	302,000	6,034,403.94	3.19
7	H00291	华润啤酒	172,000	5,525,002.92	2.92
8	H01088	中国神华	346,500	5,439,537.87	2.88
9	H01193	华润燃气	176,000	5,045,110.40	2.67
10	H02319	蒙牛乳业	220,000	4,933,821.20	2.61

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	00027	银河娱乐	12,785,582.65	6.52
2	06818	中国光大银行	9,274,271.43	4.73
3	02319	蒙牛乳业	9,079,242.54	4.63
4	00189	东岳集团	8,309,438.29	4.24
5	02899	紫金矿业	8,028,056.75	4.10
6	00868	信义玻璃	7,465,201.81	3.81
7	01088	中国神华	6,989,121.63	3.57
8	00291	华润啤酒	6,303,439.94	3.22
9	002648	卫星石化	6,176,911.13	3.15
10	603659	璞泰来	5,981,271.00	3.05
11	00857	中国石油股份	5,241,958.80	2.67
12	01171	兖州煤业股份	5,039,602.97	2.57
13	601233	桐昆股份	4,780,992.28	2.44
14	000963	华东医药	4,756,895.00	2.43
15	00817	中国金茂	4,590,066.98	2.34
16	01347	华虹半导体	4,498,922.07	2.30
17	00388	香港交易所	4,377,002.31	2.23
18	02001	新高教集团	4,374,802.96	2.23
19	01193	华润燃气	4,223,422.68	2.15
20	601155	新城控股	4,207,058.00	2.15
21	000338	潍柴动力	4,163,419.00	2.12
22	600048	保利地产	4,031,461.50	2.06
23	600585	海螺水泥	3,963,465.00	2.02

24	02018	瑞声科技	3,922,596.26	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。

7.4.2 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	00027	银河娱乐	9,861,518.80	5.03
2	002027	分众传媒	9,367,419.24	4.78
3	00813	世茂房地产	8,978,155.45	4.58
4	000725	京东方 A	8,494,693.74	4.33
5	000513	丽珠集团	7,415,408.60	3.78
6	00966	中国太平	7,133,639.15	3.64
7	00884	旭辉控股集团	7,037,676.84	3.59
8	00868	信义玻璃	6,975,885.48	3.56
9	00688	中国海外发展	6,966,551.49	3.55
10	601318	中国平安	6,844,537.17	3.49
11	01208	五矿资源	6,776,191.67	3.46
12	01766	中国中车	6,773,417.23	3.46
13	00960	龙湖地产	6,357,705.20	3.24
14	00700	腾讯控股	5,942,840.45	3.03
15	000333	美的集团	5,580,287.81	2.85
16	01347	华虹半导体	5,544,472.81	2.83
17	00857	中国石油股份	5,451,186.60	2.78
18	06818	中国光大银行	5,369,701.94	2.74
19	002648	卫星石化	5,351,913.10	2.73

20	600332	白云山	5,329,621.54	2.72
21	600352	浙江龙盛	5,274,058.00	2.69
22	002041	登海种业	5,253,355.00	2.68
23	00732	信利国际	5,244,677.66	2.68
24	06030	中信证券	5,234,369.21	2.67
25	02899	紫金矿业	5,075,892.49	2.59
26	01093	石药集团	4,992,539.40	2.55
27	601233	桐昆股份	4,984,549.56	2.54
28	06886	HTSC	4,424,732.31	2.26
29	600585	海螺水泥	4,264,289.00	2.18
30	03908	中金公司	4,194,835.77	2.14
31	000338	潍柴动力	4,117,972.00	2.10
32	00189	东岳集团	4,029,791.77	2.06
33	601600	中国铝业	3,978,684.00	2.03
34	600887	伊利股份	3,945,941.45	2.01
35	600406	国电南瑞	3,930,450.00	2.01
36	02338	潍柴动力	3,926,732.10	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。

7.4.3 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	323,545,921.94
卖出股票的收入（成交）总额	343,653,716.59

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。

7.5 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。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的招商银行（600036）因存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等违规行为，于 2018 年 5 月 4 日受到中国银行保险监督管理委员会

的处罚，罚没合计 6573.024 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：公司一季报靓丽，基本面持续优秀，盈利增速领先股份行；净利息收入增速进一步提升，息差同比大幅提升；结构优化，不良率下行。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 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	142,376.01
2	应收证券清算款	5,542,001.30
3	应收股利	1,913,550.80
4	应收利息	5,316.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,603,244.75

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
159	985,274.58	156,624,005.64	99.98%	34,652.77	0.02%

8.2 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	49.04	0.0000%

8.3 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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月11日）基金份额总额	230,023,025.79
本报告期期初基金份额总额	156,760,379.57
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	101,721.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	156,658,658.41

注：总申购份额含转换入份额(如有)，总赎回份额含转换出份额(如有)。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	371,383,213.23	55.66%	315,183.18	55.20%	-
中金公司	1	142,954,166.08	21.43%	114,363.17	20.03%	-
长江证券	1	108,697,968.82	16.29%	101,230.49	17.73%	-
东方证券	2	39,225,620.71	5.88%	35,746.46	6.26%	-
国泰君安	2	4,938,669.60	0.74%	4,500.61	0.79%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内未新增交易单元，退租江海证券 1 只交易单元。

2、(1)交易单元的选择标准

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

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择:

<1> 推荐。投资部业务人员推荐,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

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

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

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2018/1/1-2018/6/30	48,532,350.87	-	-	48,532,350.87	30.98%
	2	2018/1/1-2018/6/30	40,130,829.12	-	-	40,130,829.12	25.62%
	3	2018/1/1-2018/6/30	35,003,500.00	-	-	35,003,500.00	22.34%
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>							

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。

11.2 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 61 只公募基金。截至 2018 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 574.03 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 2018 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 32 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 2018 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 401 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 2018 年 6 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 443 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”。2018 年 3 月，国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金。

海富通基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日