

**海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）**  
**2018年半年度报告**  
**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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	14
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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
<b>§5 托管人报告</b> .....	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 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告</b> .....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	39
7.8 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.....	40
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金融衍生品投资明细.....	40
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	40

7.11 投资组合报告附注 .....	40
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
8.4 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 .....	42
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
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 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>48</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）
基金简称	海富通美元债(QDII)
场内简称	美元债
基金主代码	501300
交易代码	501300
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年11月28日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	129,309,464.52份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017年2月16日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球债券市场，在严格控制组合风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过分析各区域、国家的宏观经济环境、景气程度、总体经济指标、政治形势、货币政策、利差变化、利率水平、汇率水平等，确定基金资产在国家与地区间的配置及投资情况。
业绩比较基准	90%×巴克莱资本美国综合债券指数收益率+10%×商业银行税后活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为债券型基金，主要投资于全球市场的各类美元债券，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高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

## 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	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	wrxj@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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

## 2.5 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》
登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任	北京市西城区太平桥大街17号

	公司	
--	----	--

### §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	-6,276,162.81
本期利润	-3,761,499.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0249
本期加权平均净值利润率	-2.67%
本期基金份额净值增长率	-1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-6,351,053.02
期末可供分配基金份额利润	-0.0491
期末基金资产净值	122,958,411.50
期末基金份额净值	0.9509
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-4.91%

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

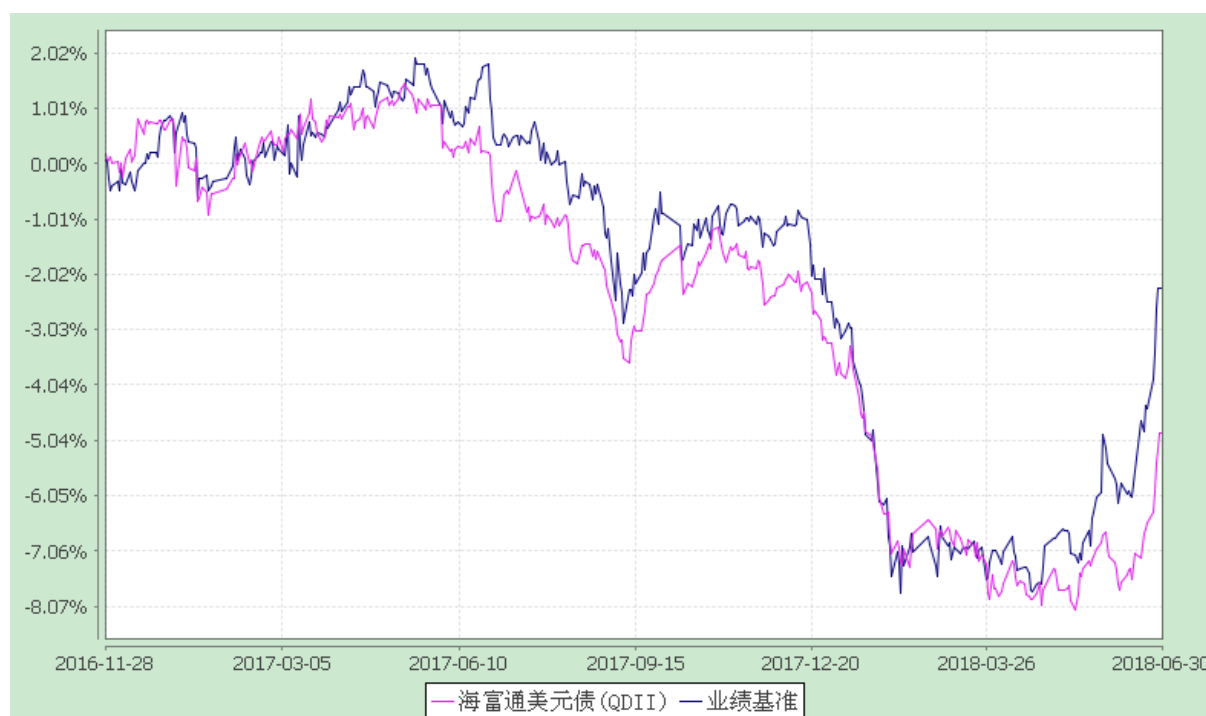
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.23%	0.25%	3.39%	0.37%	-1.16%	-0.12%
过去三个月	3.08%	0.22%	5.16%	0.31%	-2.08%	-0.09%
过去六个月	-1.71%	0.25%	0.27%	0.33%	-1.98%	-0.08%
过去一年	-3.89%	0.22%	-2.60%	0.30%	-1.29%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-4.91%	0.22%	-2.26%	0.29%	-2.65%	-0.07%

### 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

海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）  
 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28日至2018年6月30日）



注：本基金合同于2016年11月28日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第四部分（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		
陈轶平	本基金的基金经理；海富通瑞丰一年定开债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通一年定开债券基金经理；海富通上证可质押城投债ETF基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通上证周期产业债ETF基金经理；海富通瑞利债	2016-11-28	-	9年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资副总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任

	<p>券基金经理；海富通瑞合纯债基金经理；海富通富睿混合基金经理；海富通欣悦混合基金经理；海富通瑞福一年定开债券基金经理；海富通瑞祥一年定开债券基金经理；海富通恒丰定开债券基金经理。固定收益投资副总监。</p>				<p>海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益</p>
--	---	--	--	--	--

					<p>债券基金 经理。</p> <p>2016 年 11 月起兼任 海富通美 元债 (QDII) 基金经 理。2017 年 1 月起 兼任海富 通上证周 期产业债 ETF 基金 经理。</p> <p>2017 年 2 月起兼任 海富通瑞 利债券基 金经理。</p> <p>2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼 任海富通 富源债券 基金经 理。2017 年 3 月起 兼任海富 通瑞合纯 债基金经 理。2017 年 5 月起 兼任海富 通富睿混 合基金经 理。2017 年 7 月起 兼任海富 通欣悦混 合、海富 通瑞福一 年定开债 券、海富 通瑞祥一</p>
--	--	--	--	--	--

					年定开债券基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。
陆丛凡	本基金的基金经理助理；海富通上证可质押城投债ETF基金经理助理；海富通聚利债券基金经理助理；海富通上证周期产业债ETF基金经理助理；海富通富睿混合基金经理助理；海富通恒丰定开债券基金经理助理。	2017-02-07	-	6年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益定量分析师，2015年4月加入海富通基金管理有限公司。2015年6月起任海富通上证可质押城投债ETF的基金经理助理。2016年9月起任海富通聚利债券的基金经理助理。2017年2月起任海富通美元债（QDII）和海富通上证周期产业债ETF的基金经理助

					理。2017年5月起任海富通富睿混合的基金经理助理。2018年5月起任海富通恒丰定开债券基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

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为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在6月美联储议息会议上，美联储上调基准利率25BP至1.75%-2.00%的区间。此外，美联储官员对美国经济增长充满信心，暗示今年年内可能还有两次加息。5月10年期美国国债收益率大幅抬升至3.1%，但贸易摩擦的升级引发了市场的避险情绪，上半年末10年期美国国债收益率收于2.86%。除了对中国出口商品征收关税的计划外，美国还宣布限制中国对美国公司的投资。市场担心报复行动将导致中国和其他发达经济体之间爆发全面的贸易战，从而影响经济增长并引发通货膨胀。上半年10年期美国国债收益率上涨了45BP，而对政策利率更为敏感的2年期美国国债收益率上涨65BP至2.53%。

上半年美元债市场颇为动荡。投资级债券受到美国国债收益率上行和信用利差走扩的影响，其中长久期债券受冲击最大，表现不及短久期债券。中国发行人发行的高收益债券在过去几个月表现不佳。中国国储能源化工集团发行的美元债违约令众多投资者措手不及，并引发市场对中国国企的政府支持力度的担忧。市场对地方政府融资平台的担忧在蔓延，所在省份资质较弱的地方融资平台发行的债券面临抛售压力。部分民营发行人再次出现公司治理问题，这亦无助于提振市场情绪。部分B评级的高收益债券价格大幅下跌，截至6月底，已出现部分1美元面值的债券价格已跌至60-70美分的情况。

上半年，在市场较弱的情况下，我们采取防守性的策略来应对市场的下跌。我们在抛售一些高收益债券的同时，加重了投资级债券的仓位。对于投资级债券，我们将原来持有的长久期债券换成了短久期债券。为了最大限度地降低政策风险和个别发行人的负面风险，投资组合分散投资于不同的行业和发行人。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-1.71%，同期业绩比较基准收益率为0.27%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在就业市场强劲和核心通胀接近美联储目标的背景下，美联储年内可能还会有两次加息。欧央行也宣布将在年底前结束其为期三年的债券购买计划。经过多年的量化宽松政策，发达经济体的货币政策正在收紧。虽然今年以来美国国债收益率处于上行趋势，但受贸易战引发的避险情绪推动，临近6月底美国国债收益率有所下行。在发达经济体之间的贸易摩擦结束后，美国国债收益率走势可能会反转。因此，在避险情绪下受益最大的美国国债收益率长期可能面临上行压力。

4月起，美元开始走强，美元对主要国家和新兴市场的汇率出现大幅反弹。6月人民币兑美元的汇率贬值幅度就超过了3%。美元的走强和美国国债收益率的上行可能引发包括亚洲在内的新兴市场资金的进一步流出。美元的走强也增加了美元债务多但美元收入少的发行人的偿债负担。

今年以来在岸债券市场的违约率有所上升。在政府去杠杆化的背景下，违约事件可能从民营企业蔓延到国有企业，从在岸债券扩散到离岸债券。事实上，有报道称已有地方政府融资平台出现信托贷款的违约。最近，惠誉下调了江苏省部分地方政府融资平台的评级。考虑到地方政府融资平台存在政策不确定和财务指标偏弱的问题，投资者会密切关注地方政府融资平台在紧信用的市场中再融资的能力。对于高收益债而言，目前投资者并不青睐控股公司结构复杂、商业模式不透明和发行离岸债券时间短的发行人，而在中国流动性收紧的背景下，这种趋势可能会继续下去。

中国房地产开发商在 2-3 年前发行了大量在岸债券，但由于政策收紧，多数开发商的再融资面临收紧。2017 年，地产商大举开展土地储备业务，增加了流动性压力。因此开发商争相发行需要发改委审批的离岸美元债。某家开发商在第一轮发行两个月后发行了第二轮债券，但票面利率高出 1.5%。开发商在一级市场提供的丰厚收益导致了二级市场的回调。由于许多开发商仍有大量未使用的发债额度，开发商将会抓住美元债市场的机会。尽管近期没有房地产行业政策放松的迹象，但销售依然强劲，且美元债市场的发债历史相对较长，投资者对房地产高收益债更为放心。

对中国而言，利率风险和信用风险仍是今年需要关注的两个主要风险。鉴于美国国债收益率普遍较低，我们在期限配置上保持守势，更多地关注 3 年期或更短的债券。在投资级债券中，我们更偏好 BBB 级债券，因为这些债券相比于 A 级债券存在溢价。至于中国高收益的房地产债券，供给压力依然存在，我们更倾向于选择再融资压力较小的大中型开发商。在各种紧缩措施下，大型开发商可能会从行业整合中获益。在经历了 2018 年上半年的大幅调整后，一些高收益债券的收益率变得具有吸引力。我们将密切关注市场机遇，投资于基本面坚实的但价格受到打压的债券。

#### 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

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）(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、基金份额申购赎回价格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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2018年6月30日	2017年12月31日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	13,267,624.23	15,153,576.20
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	110,300,706.99	169,735,678.95
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		110,300,706.99	169,735,678.95
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,848,122.66	2,350,773.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>125,416,453.88</b>	<b>187,240,028.88</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,132,357.34	8,911,702.62
应付管理人报酬		90,825.42	144,984.71
应付托管费		25,229.27	40,273.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		16,839.41	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	192,790.94	414,835.90
<b>负债合计</b>		<b>2,458,042.38</b>	<b>9,511,796.75</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	129,309,464.52	183,718,639.47
未分配利润	6.4.7.10	-6,351,053.02	-5,990,407.34
<b>所有者权益合计</b>		<b>122,958,411.50</b>	<b>177,728,232.13</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>125,416,453.88</b>	<b>187,240,028.88</b>

注：报告截止日2018年06月30日，基金份额净值0.9509元，基金份额总额129,309,464.52份。其中下属人民币基金份额参考净值人民币0.9509元，份额总额65,030,088.57份；下属美元基金份额参考净值美元0.1437元，份额总额64,279,375.95份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）

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
<b>一、收入</b>		<b>-2,759,038.86</b>	<b>-2,545,314.66</b>
1.利息收入		3,589,221.63	5,369,950.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,684.08	14,221.27
债券利息收入		3,580,537.55	5,355,729.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,079,670.85	-1,988,634.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-9,079,670.85	-1,988,634.12
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,514,662.83	-3,495,386.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		151,943.96	-2,543,396.38
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	64,803.57	112,152.00
<b>减：二、费用</b>		<b>1,002,461.12</b>	<b>1,712,538.08</b>
1. 管理人报酬		629,895.42	1,195,606.06
2. 托管费		174,970.97	332,112.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		12,889.96	-
7. 其他费用	6.4.7.19	184,704.77	184,819.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,761,499.98</b>	<b>-4,257,852.74</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,761,499.98</b>	<b>-4,257,852.74</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）

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）	183,718,639.47	-5,990,407.34	177,728,232.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,761,499.98	-3,761,499.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-54,409,174.95	3,400,854.30	-51,008,320.65

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	80,840.21	-5,318.42	75,521.79
2.基金赎回款	-54,490,015.16	3,406,172.72	-51,083,842.44
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)	129,309,464.52	-6,351,053.02	122,958,411.50
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)	263,399,284.82	1,600,929.98	265,000,214.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,257,852.74	-4,257,852.74
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)	-7,484,983.32	-64,269.89	-7,549,253.21
其中：1.基金申购款	16,879,876.54	84,111.82	16,963,988.36
2.基金赎回款	-24,364,859.86	-148,381.71	-24,513,241.57
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)	255,914,301.50	-2,721,192.65	253,193,108.85

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

海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）（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 2277 号《关于准予海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）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《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，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 139,713,588.15 元，美元 17,977,789.63 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 1495 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 11 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 263,399,284.82 份，其中认购资金利息折合 42,026.34 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。境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》和《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》的相关规定，本基金的基金份额包括人民币份额和美元现汇份额，投资者可使用人民币或美元提交本基金的认购/申购申请，其中使用人民币认购/申购的份额将被确认为人民币份额，使用美元认购/申购的份额将被确认为美元现汇份额。本基金通过场外、场内两种方式公开发售，美元份额(以下若无特别说明，均指美元现汇份额)仅通过场外公开发售。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)[2017]35 号文审核同意，本基金 14,122,415.00 份人民币基金份额于 2017 年 2 月 16 日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为境内境外市场。境内，本基金主要投资于依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、其他依法上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，货币市场工具以及经中国证监会批准允许基金投资的其他境内金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。境外，本基金主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括 ETF）；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他境外金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于美元债券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年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、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $90\% \times$ 巴克莱资本美国综合债券指数收益率 $+10\% \times$ 商业银行税后活期存款基准利率。

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(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》、《海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）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[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]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：

(a)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。

(b)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(c)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(d)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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	13,267,624.23
定期存款	-
其他存款	-
合计	13,267,624.23

注：于2018年6月30日，银行存款中包含的外币余额为：美元活期存款1,951,212.69元（折合人民币12,910,393.88元）。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约			



债券	交易所市场	115,236,998.56	110,300,706.99	-4,936,291.57
	银行间市场	-	-	-
	合计	115,236,998.56	110,300,706.99	-4,936,291.57
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		115,236,998.56	110,300,706.99	-4,936,291.57

### 6.4.7.3 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。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	161.45
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	1,847,961.21
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,848,122.66

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末应付交易费用无余额。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,321.17
预提费用	184,469.77
合计	192,790.94

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,718,639.47	183,718,639.47
本期申购	80,840.21	80,840.21
本期赎回（以“-”号填列）	-54,490,015.16	-54,490,015.16
本期末	129,309,464.52	129,309,464.52

注：截至2018年6月30日止，本基金于上交所上市的基金份额为18,941,572.00份（2017年12月31日：21,663,509.00份），托管在场外未上市交易的基金份额为110,367,892.52份（2017年12月31日：162,055,130.47份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.10 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	-132,007.09	-5,858,400.25	-5,990,407.34
本期利润	-6,276,162.81	2,514,662.83	-3,761,499.98
本期基金份额交易产生的变动数	764,797.01	2,636,057.29	3,400,854.30

其中：基金申购款	-789.15	-4,529.27	-5,318.42
基金赎回款	765,586.16	2,640,586.56	3,406,172.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,643,372.89	-707,680.13	-6,351,053.02

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	8,684.08
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	-
其他	-
合计	8,684.08

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	86,059,662.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	93,927,015.31
减：应收利息总额	1,212,317.76
买卖债券差价收入	-9,079,670.85

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	2,514,662.83
——股票投资	-
——债券投资	2,514,662.83
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	2,514,662.83

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	64,803.57
合计	64,803.57

注：本基金赎回费收入归入基金财产部分具体见本基金基金合同、招募说明书（更新）等法律文件规定。

**6.4.7.18 交易费用**

本基金本报告期无交易费用。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	235.00

合计	184,704.77
----	------------

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 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。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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
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
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外资产托管人

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

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管理费	629,895.42	1,195,606.06
其中：支付销售机构的客户维护费	273,496.25	589,229.65

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 0.9% 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 0.9% / 当年天数。

#### 6.4.10.2 基金托管费

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托管费	174,970.97	332,112.81

注：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 0.25% 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。

#### 6.4.10.3 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与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,229,548.61	8,684.08	8,928,682.29	14,221.27

中银香港	10,038,075.62	-	9,443,032.28	-
------	---------------	---	--------------	---

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，其中由中国银行保管的银行存款按适用利率计息，由中银香港保管的银行存款不计息。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 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其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 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。

###### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，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高于货币市场基金，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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产长期稳定增值，力争实现高于业绩比较基准的投资收益。

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。

#### 6.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行以及境外次托管行中银香港，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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采用标准普尔、惠誉国际提供的债券信用评级信息统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 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 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	97,396,153.51	123,616,837.95
未评级	12,904,553.48	46,118,841.00
合计	110,300,706.99	169,735,678.95

注：未评级部分为标准普尔、惠誉国际未评级债券。



### 6.4.13.3 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上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 2018 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### 6.4.13.3.1 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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金境内投资部分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)。本基金境外投资部分持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的 20% (在基金托管账户的存款可以不受上述限制)，本基金持有同一机构 (政府、国际金融组织除外) 发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

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 6.4.12。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。本基金境内投资部分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%，境外投资部分持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

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。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	3,229,548.61	-	-	10,038,075.62	13,267,624.23
交易性金融资产	6,714,922.68	97,143,928.72	6,441,855.59	-	110,300,706.99
应收利息	-	-	-	1,848,122.66	1,848,122.66
<b>资产总计</b>	<b>9,944,471.29</b>	<b>97,143,928.72</b>	<b>6,441,855.59</b>	<b>11,886,198.28</b>	<b>125,416,453.88</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	2,132,357.34	2,132,357.34
应付管理人报酬	-	-	-	90,825.42	90,825.42
应付托管费	-	-	-	25,229.27	25,229.27
应交税费	-	-	-	16,839.41	16,839.41
其他负债	-	-	-	192,790.94	192,790.94
<b>负债总计</b>				<b>2,458,042.38</b>	<b>2,458,042.38</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>9,944,471.29</b>	<b>97,143,928.72</b>	<b>6,441,855.59</b>	<b>9,428,155.90</b>	<b>122,958,411.50</b>
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	13,390,516.07	-	-	1,763,060.13	15,153,576.20
交易性金融资产	20,173,885.10	128,281,668.69	21,280,125.16	-	169,735,678.95
应收利息	-	-	-	2,350,773.73	2,350,773.73
<b>资产总计</b>	<b>33,564,401.17</b>	<b>128,281,668.69</b>	<b>21,280,125.16</b>	<b>4,113,833.86</b>	<b>187,240,028.88</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	8,911,702.62	8,911,702.62
应付管理人报酬	-	-	-	144,984.71	144,984.71
应付托管费	-	-	-	40,273.52	40,273.52
其他负债	-	-	-	414,835.90	414,835.90
<b>负债总计</b>				<b>9,511,796.75</b>	<b>9,511,796.75</b>

利率敏感度缺口	33,564,401.17	128,281,668.69	21,280,125.16	-5,397,962.89	177,728,232.13

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加约72	增加约137
	市场利率上升25个基点	减少约72	减少约136

注：金额为约数，精确到万元。

#### 6.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	美元折合人民币	合计
<b>以外币计价的资产</b>		
银行存款	12,910,393.88	12,910,393.88
交易性金融资产	110,300,706.99	110,300,706.99
应收利息	1,848,001.04	1,848,001.04
<b>资产合计</b>	<b>125,059,101.91</b>	<b>125,059,101.91</b>
<b>以外币计价的负债</b>		
应付赎回款	1,862,248.42	1,862,248.42
其他负债	7,018.49	7,018.49
<b>负债合计</b>	<b>1,869,266.91</b>	<b>1,869,266.91</b>

资产负债表外汇风险敞口净额	<b>123,189,835.00</b>	<b>123,189,835.00</b>
项目	上年度末	
	2017年12月31日	
	美元折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	12,729,634.14	12,729,634.14
交易性金融资产	169,735,678.95	169,735,678.95
应收利息	2,349,988.57	2,349,988.57
资产合计	<b>184,815,301.66</b>	<b>184,815,301.66</b>
以外币计价的负债		
应付赎回款	2,391,138.48	2,391,138.48
其他负债	9,011.77	9,011.77
负债合计	<b>2,400,150.25</b>	<b>2,400,150.25</b>
资产负债表外汇风险敞口净额	<b>182,415,151.41</b>	<b>182,415,151.41</b>

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值5%	增加约 616	增加约 912
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	减少约 616	减少约 912

注：金额为约数，精确到万元。

#### 6.4.13.4.3 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的债券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%。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。

于2018年06月30日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

**6.4.14 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	110,300,706.99	87.95
	其中：债券	110,300,706.99	87.95
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,267,624.23	10.58
8	其他各项资产	1,848,122.66	1.47
9	合计	125,416,453.88	100.00

**7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布**

本基金本报告期末未持有权益投资。

**7.3 期末按行业分类的权益投资组合**

本基金本报告期末未持有权益投资。

**7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细**

本基金本报告期末未持有权益投资。

**7.5 报告期内权益投资组合的重大变动****7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细**

本基金本报告期末未买入权益资产。

**7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细**

本基金本报告期末未卖出权益资产。

**7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额**

本基金本报告期末未进行权益投资。

**7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
BBB+至 BBB-	45,970,813.48	37.39
BB+至 BB-	32,703,140.99	26.60
B+至 B-	18,722,199.04	15.23
未评级	12,904,553.48	10.50

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、惠誉等机构提供的债券信用评级信息，未提供评级信息的可适用内部评级。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	USY39656A A40	ICBCAS 6 PERP	10,000	6,776,060.06	5.51
2	XS116044439 1	CIFIHG 7 3/4 06/05/20	10,000	6,714,922.68	5.46
3	XS110374879 1	CTIH 5.45 PERP	10,000	6,671,319.28	5.43
4	XS116565935 7	HARAM 4 1/2	10,000	6,663,842.52	5.42

		01/16/20			
5	XS129453583 3	WEICHA 4 1/8 09/30/20	10,000	6,636,648.30	5.40

注：（1）债券代码为 ISIN 或当地市场代码。

（2）外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留 2 位小数。

**7.8 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。

**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金融衍生品投资明细**  
本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**  
本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1** 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。

**7.11.2** 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。

#### 7.11.3 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	应收股利	-
4	应收利息	1,848,122.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,848,122.66



**7.11.4 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。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**§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
678	190,721.92	9,607,333.42	7.43%	119,702,131.10	92.57%

**8.2 期末上市基金前十名持有人**

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	徐德权	3,028,336.00	15.99%
2	杨岚	2,960,240.00	15.63%
3	孟繁强	1,000,000.00	5.28%
4	高惠民	985,114.00	5.20%
5	夏风光	714,207.00	3.77%
6	何赛珠	700,440.00	3.70%
7	黄亚娥	662,643.00	3.50%
8	沈燕	540,609.00	2.85%
9	黄小兰	515,200.00	2.72%
10	曾幼朔	499,900.00	2.64%

注：持有人为场内持有人。

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

**8.4 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 28 日）基金 份额总额	263,399,284.82
本报告期期初基金份额总额	183,718,639.47
本报告期基金总申购份额	80,840.21
减：本报告期基金总赎回份额	54,490,015.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	129,309,464.52

**§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	
Citigroup Global Markets Limited, London.	-	-	-	-	-	-
Nomura International plc	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-
CICC HK SEC. LTD.	-	-	-	-	-	-
CSI Global	-	-	-	-	-	-

Markets Limited						
HUATAI FINANCIAL HOLDINGS (HONG KONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	-	-
GUOTAI JUNAN SECURITIES (HONG KONG) LIMITED	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-
BANK OF CHINA (HONG KONG)	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更，CITIC Securities International Company Limited 更名为 CSI Global Markets Limited。

## 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。

## 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Citigroup Global Markets Limited, London.	26,608,841.51	22.50%	-	-	-	-	-	-
Nomura International plc	24,818,283.37	20.99%	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	21,960,777.46	18.57%	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International plc	12,913,042.92	10.92%	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS (ASI	9,997,932.99	8.46%	-	-	-	-	-	-

A) SEC URI TIE S LIM ITE D									
CIC C HK SEC. LTD.	6,33 9,80 6.82	5.36%	-	-	-	-	-	-	-
CSI Glob al Mar kets Limi ted	6,31 2,65 3.48	5.34%	-	-	-	-	-	-	-
HUA TAI FIN AN CIA L HOL DIN GS (HO NG KO NG) LIM ITE D	6,17 8,68 2.86	5.23%	-	-	-	-	-	-	-
Stan dard Char tered Ban k	3,11 3,88 8.97	2.63%	-	-	-	-	-	-	-
GU OTA I	-	-	-	-	-	-	-	-	-

JUN AN SEC URI TIE S (HO NG KO NG) LIM ITE D								
J.P. Mor gan Secu rities (Asi a Pacif ic) Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
BA NK OF CHI NA (HO NG KO NG)	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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 QDII、FOF 基金 2017 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》	2018-01-03
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-24
3	海富通基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费率率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-24

4	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）节假日暂停申购、赎回业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-27
5	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）节假日暂停申购、赎回业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-05-18
6	海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）节假日暂停申购、赎回业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-06-27

## §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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）的文件
- （二）海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同
- （三）海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）招募说明书
- （四）海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）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）报告期内海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 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。

### 12.3 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  
二〇一八年八月二十四日