

**海富通大中华精选混合型证券投资基金**  
**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.....	5
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.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
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.....	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	41
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43

7.11 投资组合报告附注 .....	43
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
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 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通大中华精选混合型证券投资基金
基金简称	海富通大中华混合（QDII）
基金主代码	519602
交易代码	519602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 27 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	31,911,109.16 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于在海外证券市场交易的大中华公司的优质股票,追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对全球宏观经济和大中华地区区域经济的基本面分析,采用自上而下的策略对资产进行有效资产配置;对股票的选择采用自下而上的“三站式”精选策略,挖掘定价合理,具备竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	MSCI 金龙净总收益指数
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,属于中高风险水平的投资品种。同时,本基金投资的目标市场是海外市场,除了需要承担市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险等海外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	姓名	奚万荣	王永民

负责人	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrx@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	BNP Paribas Asset Management Partners UK Limited	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	法国巴黎资产管理英国有限公司	中国银行（香港）有限公司
注册地址		5, Aldermanbury Square London EC2V 7BP, United Kingdom	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		5, Aldermanbury Square London EC2V 7BP, United Kingdom	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

注：本公司于 2018 年 1 月 31 日发布公告，自 2018 年 2 月 1 日起，法国巴黎资产管理英国有限公司不再担任本基金的境外投资顾问。

## 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	5,958,659.67
本期利润	1,980,170.98
加权平均基金份额本期利润	0.0504
本期加权平均净值利润率	4.16%
本期基金份额净值增长率	5.66%
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	1,953,105.48
期末可供分配基金份额利润	0.0612
期末基金资产净值	39,918,232.00
期末基金份额净值	1.251
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	25.10%

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	①—③	②—④

				④		
过去一个月	0.24%	1.12%	-1.07%	1.01%	1.31%	0.11%
过去三个月	6.11%	1.19%	1.36%	0.90%	4.75%	0.29%
过去六个月	5.66%	1.27%	-0.06%	1.09%	5.72%	0.18%
过去一年	23.01%	1.17%	11.89%	0.93%	11.12%	0.24%
过去三年	30.31%	1.62%	32.35%	1.05%	-2.04%	0.57%
自基金合同生效起至今	25.10%	1.41%	56.02%	1.06%	-30.92%	0.35%

### 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

海富通大中华精选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  
 (2011 年 1 月 27 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：1、按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，截至建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围、（九）投资限制中规定的各项比例；

2、本基金按照全球投资表现标准（GIPS）计算和表述投资业绩。



## §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；海富通强化回报混合基金经理；海富通中国海外混合(QDII)基金经理；海富通沪港深混合基金经理；海富通欣悦混合基金经理。	2016-02-04	-	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 基金经理。
卜正伦	本基金的 基金经 理；海富 通中国海 外混合 (QDII) 基金经理	2016-08-16	-	13 年	中国籍， 硕士，持 有基金从 业人员资 格证书。 历任永丰 金证券、 富邦证 券、海富 通资产管 理(香港) 有限公司 分析师。 2016 年 8 月起任海 富通大中 华混合 (QDII) 和海富通 中国海外 混合 (QDII) 基金经 理。

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。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所 任职务	证券从业 年限	说明
Colin Walsh GRAHAM	法国巴黎资产管理 (原法国巴黎投资管 理)英国有限公司多 重资产主动资产配 置总监、首席投资官	21 年	英国国籍，伦敦布鲁内尔大学管理 学和数学理科学士。历任 Mercer (美世咨询)精算顾问、BlackRock (贝莱德集团)全球多资产策略团 队联席主管。2014 年 3 月起担任法 国巴黎资产管理(原法国巴黎投资 管理)英国有限公司多重资产主动

			资产配置总监、首席投资官。
--	--	--	---------------

注：本公司于 2018 年 1 月 31 日发布公告，自 2018 年 2 月 1 日起，法国巴黎资产管理英国有限公司不再担任本基金的境外投资顾问。

#### 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

2018 年上半年，市场受到外围市场系统性风险的影响，波动较大，且整体处于震荡下行趋势。年初由于预期中国经济仍保持良好韧性，金融机构体质持续好转，资金明显由科网等成长板块转入银行等蓝筹板块，推动整体指数向上。唯 2 至 3 月间随着美联储加息预期加速，以及对于美国发起的贸易战疑虑增加，整体市场出现较大的波动。二季度随着季报公布，焦点多由贸易战转移。期间美国商务部对中兴通讯启动禁令，引发了市场的恐慌情绪。但市场仍表现出一定的结构性行情，港股中医药、电子等板块表现仍亮眼。唯 5 月下旬开始，由于美国单方面挑起贸易战，使得市场悲观情绪加剧，A 股市场再次出现震荡下跌，影响到整体市场信心，海外中国股票市场也同步逐渐走低；6 月延续了 5 月的悲观情绪，降低风险偏好的动作明显，推动市场在下月快速走低。总结上半年恒生指数下跌 3.22%。

上半年市场资金受到波动较大及贸易战因素影响，大幅降低风险偏好，同时国际资金也多转向相对安全的货币，致发达国家市场明显要好于新兴国家市场，海外中国股票市场表现虽然较新兴市场整体要好，仍较发达国家要差。报告期内基金仍根据业绩及估值比较，寻求具有价值的股票，超配包括电子、医药板块，减持汽车板块，同时继续低配银行、地产等板块。

#### 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 5.66%，同期业绩比较基准收益率-0.06%，基金净值跑赢业绩比较基准 5.72 个百分点。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年，中国经济将面临内外部两个方向的考验。内部考验主要来自于去杠杆政策延续对于实体部门信用收缩的压力，而外部考验主要来自于中美贸易争端的影响，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压力。

展望下半年，预期中国海外市场仍会在企业盈利增速的正面支撑与宏观各方面负面冲击的估值调整之间来回拉锯，中报公布期间可能有较大波动。宏观经济各方面的不确定性带来了股市风险偏好的迅速回落，但从乐观的角度看，本轮供给侧改革政策下宏观经济并未过热，同时“去杠杆”政策在长期将能够带来中国经济的长期稳健发展和信用风险溢价的逐步回落。我们认为在这一波改革过程基本面佳的成长板块包括医药、软件服务、高端电子制造等仍具有较佳增长潜力，特别在强者恒强的格局下，相关板块中的龙头企业优势将更为明显。下半年本组合策略上仍将以基本面为出发点，以这些成长板块的龙头作为“核心资产”以获取其成长过程的超额利润。

#### 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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对海富通大中华精选混合型证券投资基金(以下称“本基金”)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：海富通大中华精选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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	20,249,842.59	5,940,656.19
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	33,136,413.50	45,520,851.12
其中：股票投资		33,136,413.50	45,520,851.12
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,421.32	566.25
应收股利		143,028.11	9,000.00
应收申购款		31,962.70	157,330.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>53,564,668.22</b>	<b>51,628,404.10</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		2,205,549.83	-
应付赎回款		11,222,195.30	512,514.82
应付管理人报酬		61,786.10	79,576.22
应付托管费		10,297.71	13,262.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	146,607.28	156,407.72
<b>负债合计</b>		<b>13,646,436.22</b>	<b>761,761.50</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	31,911,109.16	42,977,639.17
未分配利润	6.4.7.10	8,007,122.84	7,889,003.43
<b>所有者权益合计</b>		<b>39,918,232.00</b>	<b>50,866,642.60</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>53,564,668.22</b>	<b>51,628,404.10</b>

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.251 元，基金份额总额 31,911,109.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通大中华精选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
<b>一、收入</b>		<b>2,693,675.92</b>	<b>11,556,389.56</b>
1.利息收入		15,376.38	5,878.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,376.38	5,878.58
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,622,206.85	3,248,212.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,297,475.93	2,624,174.99
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		-	-



衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	324,730.92	624,037.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,978,488.69	8,330,892.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-13,484.14	-34,749.20
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	48,065.52	6,155.49
<b>减：二、费用</b>		<b>713,504.94</b>	<b>977,791.00</b>
1. 管理人报酬		425,476.55	579,819.81
2. 托管费		70,912.77	96,636.63
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	107,272.97	163,358.28
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	6.4.7.19	109,842.65	137,976.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,980,170.98</b>	<b>10,578,598.56</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,980,170.98</b>	<b>10,578,598.56</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通大中华精选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）	42,977,639.17	7,889,003.43	50,866,642.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,980,170.98	1,980,170.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-11,066,530.01	-1,862,051.57	-12,928,581.58

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	25,084,554.72	6,354,781.74	31,439,336.46
2.基金赎回款	-36,151,084.73	-8,216,833.31	-44,367,918.04
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)	31,911,109.16	8,007,122.84	39,918,232.00
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)	69,670,279.95	-9,668,246.35	60,002,033.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,578,598.56	10,578,598.56
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)	-3,056,287.94	190,841.88	-2,865,446.06
其中：1.基金申购款	5,412,325.21	-198,450.33	5,213,874.88
2.基金赎回款	-8,468,613.15	389,292.21	-8,079,320.94
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)	66,613,992.01	1,101,194.09	67,715,186.10

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

海富通大中华精选混合型证券投资基金(原名为海富通大中华精选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1760 号文核准,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通大中华精选股票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 821,474,865.11 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 821,766,293.97 份基金份额,其中认购资金利息折合 291,428.86 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,海富通大中华精选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为海富通大中华精选混合型证券投资基金。

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《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金(ETF)等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以全球除内地股票市场以外的具有“大中华概念”上市公司为主要投资对象。“大中华概念”的股票需满足以下三个条件之一:1)上市公司注册在大中华区域(中国内地、香港、台湾、澳门);2)上市公司中至少百分之三十股权(占总股本)由大中华区域的股东持有;3)公司最近一个会计年度至少百分之五十之营业额来自大中华区域。本基金的投资比例为:股票及其他权益类证券占基金资产的 60%-95%;现金、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—40%,其中基金保留的现金的比例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:MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

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》、《海富通大中华精选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[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	20,249,842.59
定期存款	-
其他存款	-
合计	20,249,842.59

注：于 2018 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为：港币活期存款 5,615,564.33（折合人民币 4,734,482.29 元）；台币活期存款 4,936,357.00（折合人民币 1,071,800.24 元）；美金活期存款 24,651.36（折合人民币 163,108.19 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	24,367,827.42	33,136,413.50	8,768,586.08
贵金属投资-金交所 黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	24,367,827.42	33,136,413.50	8,768,586.08

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 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	3,421.32
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	3,421.32

**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	39,989.23
预提费用	106,618.05
合计	146,607.28

**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	42,977,639.17	42,977,639.17
本期申购	25,084,554.72	25,084,554.72
本期赎回（以“-”号填列）	-36,151,084.73	-36,151,084.73
本期末	31,911,109.16	31,911,109.16

#### 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	-5,580,330.76	13,469,334.19	7,889,003.43
本期利润	5,958,659.67	-3,978,488.69	1,980,170.98
本期基金份额交易产生的变动数	1,574,776.57	-3,436,828.14	-1,862,051.57
其中：基金申购款	-280,312.11	6,635,093.85	6,354,781.74
基金赎回款	1,855,088.68	-10,071,921.99	-8,216,833.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,953,105.48	6,054,017.36	8,007,122.84

#### 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
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	900.46
合计	15,376.38

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	31,780,477.83
减：卖出股票成本总额	25,483,001.90
买卖股票差价收入	6,297,475.93

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	324,730.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	324,730.92

#### 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	-3,978,488.69
——股票投资	-3,978,488.69
——债券投资	-
——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	-3,978,488.69

#### 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	48,065.52
合计	48,065.52

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

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	107,272.97
银行间市场交易费用	-
合计	107,272.97

#### 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	32,232.48
信息披露费	74,385.57
其他	1,354.60
银行汇划费	1,870.00
合计	109,842.65

#### 6.4.7.20 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。

## 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 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	425,476.55	579,819.81
其中：支付销售机构的客户维护费	152,784.17	193,084.71

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8% 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 1.8% / 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	70,912.77	96,636.63

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 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 0.30% / 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

本基金本报告期内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

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	17,299,884.66
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	17,299,884.66
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	25.97%

注：1.基金管理人于 2014 年 11 月 13 日运用自有资金申购本基金 1500 万元，申购费为 1000 元。

2.基金管理人于 2017 年下半年度内赎回共计 17,299,884.66 份，赎回总金额人民币 17,529,083.62 元，由于持有期超过两年，该基金相关适用的赎回费率为零，无赎回费；符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

#### 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	14,280,742.88	14,474.73	12,938,485.81	5,877.00
中国银行(香港)	4,870,195.16	1.19	2,965,343.65	-

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按适用利率计息。

#### 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

#### 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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

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。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2017 年 12 月 31 日：同)。

### 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 6 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

##### 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	14,280,734.81	-	-	5,969,107.78	20,249,842.59
交易性金融资产	-	-	-	33,136,413.50	33,136,413.50
应收申购款	-	-	-	31,962.70	31,962.70
应收股利	-	-	-	143,028.11	143,028.11
应收利息	-	-	-	3,421.32	3,421.32
<b>资产总计</b>	<b>14,280,734.81</b>			<b>39,283,933.41</b>	<b>53,564,668.22</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	--	--	61,786.10	61,786.10
应付托管费	-	--	--	10,297.71	10,297.71
应付赎回款	-	--	--	11,222,195.30	11,222,195.30
应付证券清算款	-	--	--	2,205,549.83	2,205,549.83
其他负债	-	--	--	146,607.28	146,607.28
<b>负债总计</b>				<b>13,646,436.22</b>	<b>13,646,436.22</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>14,280,734.81</b>			<b>25,637,497.19</b>	<b>39,918,232.00</b>
<b>上年度末</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>2017 年 12 月 31 日</b>					
<b>资产</b>					
银行存款	1,919,046.42	-	-	4,021,609.77	5,940,656.19
交易性金融资产	-	-	-	45,520,851.12	45,520,851.12
应收申购款	-	-	-	157,330.54	157,330.54
应收股利	-	-	-	9,000.00	9,000.00
应收利息	-	-	-	566.25	566.25
<b>资产总计</b>	<b>1,919,046.42</b>			<b>49,709,357.68</b>	<b>51,628,404.10</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	79,576.22	79,576.22
应付托管费	-	-	-	13,262.74	13,262.74
应付赎回款	-	-	-	512,514.82	512,514.82
其他负债	-	-	-	156,407.72	156,407.72
<b>负债总计</b>				<b>761,761.50</b>	<b>761,761.50</b>



利率敏感度缺口	1,919,046.42	-	48,947,596.18	50,866,642.60
---------	--------------	---	---------------	---------------

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

于 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 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	港币折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	163,108.19	4,734,482.29	1,071,800.24	5,969,390.72
交易性金融资产	4,163,641.12	23,546,307.58	5,426,464.80	33,136,413.50
应收股利	-	58,958.12	61,749.99	120,708.11
<b>资产合计</b>	<b>4,326,749.31</b>	<b>28,339,747.99</b>	<b>6,560,015.03</b>	<b>39,226,512.33</b>
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	2,205,549.83	-	2,205,549.83
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>2,205,549.83</b>	<b>-</b>	<b>2,205,549.83</b>
<b>资产负债表 外汇风险敞口净额</b>	<b>4,326,749.31</b>	<b>26,134,198.16</b>	<b>6,560,015.03</b>	<b>37,020,962.50</b>
项目	上年度末			

	2017年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	39,349.28	2,656,105.36	1,353,205.65	4,048,660.29
交易性金融资产	5,080,595.34	33,500,221.77	6,940,034.01	45,520,851.12
<b>资产合计</b>	<b>5,119,944.62</b>	<b>36,156,327.13</b>	<b>8,293,239.66</b>	<b>49,569,511.41</b>
以外币计价的负债				
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>5,119,944.62</b>	<b>36,156,327.13</b>	<b>8,293,239.66</b>	<b>49,569,511.41</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 185	增加约 248
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	减少约 185	减少约 248

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股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的 60%-95%，银行存款及现金等高流动性资产占基金资产的 5%-40%。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票 投资	33,136,413.50	83.01	45,520,851.12	89.49
交易性金融资产—基金 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金 属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投 资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	33,136,413.50	83.01	45,520,851.12	89.49

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 162	增加约 98
	2. 业绩比较基准(附注	减少约 162	减少约 98

	6.4.1)下降 5%		
--	-------------	--	--

金额为约数，精确到万元。

#### 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	33,136,413.50	61.86
	其中：普通股	28,972,772.38	54.09
	存托凭证	4,163,641.12	7.77
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	20,249,842.59	37.80
8	其他各项资产	178,412.13	0.33
9	合计	53,564,668.22	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	23,546,307.58	58.99
中国台湾	5,426,464.80	13.59
美国	4,163,641.12	10.43
合计	33,136,413.50	83.01

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	16,443,226.27	41.19
金融	6,003,293.55	15.04
非日常生活消费品	5,641,073.64	14.13
医疗保健	2,911,730.16	7.29
房地产	1,178,653.80	2.95
工业	958,436.08	2.40
合计	33,136,413.50	83.01

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	SUNNY OPTIC	舜宇光学科技(集	2382 HK	香港交易所	中国香港	27,000	3,323,500.20	8.33

	AL TECHN OLOGY (GROU P) COMPA NY LIMITE D	团)有限 公司						
2	TENCE NT HOLDI NGS LIMITE D	腾讯控股 有限公司	700 HK	香港交 易所	中国香港	10,000	3,320,127.80	8.32
3	ALIBA BA GROUP HLDG LTD-SP ONSOR ED ADR	阿里巴巴 集团控制 有限公司	BABA US	纽约交 易所	美国	2,400	2,946,186.72	7.38
4	PING AN INSUR ANCE GROUP CO-H	中国平安 保险(集 团)股份 有限公司	2318 HK	香港交 易所	中国香港	40,000	2,434,872.80	6.10
5	TAIWA N SEMIC ONDU CTOR MANUF AC	台积电股 份有限公 司	2330 TT	台湾交 易所	中国台湾	45,000	2,115,327.93	5.30
6	CSPC PHARM ACEUT ICAL GROUP LTD	石药集团 有限公司	1093 HK	香港交 易所	中国香港	100,000	1,998,147.00	5.01
7	HOLY STONE ENTER	禾伸堂股 份有限公 司	3026 TT	台湾交 易所	中国台湾	30,000	1,595,859.41	4.00

	PRISE CO LTD							
8	ZHONG SHENG GROUP HOLDI NGS LTD	中升集团 控股有限 公司	881 HK	香港交 易所	中国香港	70,000	1,389,850.35	3.48
9	MINTH GROUP LIMITE D	敏实集团 有限公司	425 HK	香港交 易所	中国香港	46,000	1,285,643.19	3.22
10	CHINA MERCH ANTS BANK- H	招商银行 股份有限 公司	3968 HK	香港交 易所	中国香港	50,000	1,220,387.25	3.06
11	TAL EDUCA TION GROUP -ADR	好未来教 育集团	TAL US	纽约交 易所	美国	5,000	1,217,454.40	3.05
12	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港交 易所	中国香港	20,000	1,156,733.20	2.90
13	SHENZ HOU INTER NATIO NAL GROUP HOLDI NGS LTD	申洲国际 集团控股 有限公司	2313 HK	香港交 易所	中国香港	12,000	979,850.82	2.45
14	LARGA N PRECIS ION CO LTD	大立光股 份有限公 司	3008 TT	台湾交 易所	中国台湾	1,000	974,885.54	2.44
15	SHENZ HEN INTL HOLDI NGS	深圳国际 控股有限 公司	152 HK	香港交 易所	中国香港	70,000	958,436.08	2.40
16	SINO	中国生物	1177 HK	香港交	中国香港	90,000	913,583.16	2.29

	BIOPH ARMA CEUTI CAL LTD.	制药有限 公司		易所				
17	GALAX Y ENTER TAINM ENT GROUP LTD	银河娱 乐集团有 限公司	27 HK	香港交 易所	中国香港	15,000	768,274.88	1.92
18	AAC TECHN OLOGIES HOLDI NGS IN	瑞声科技 控股有限 公司	2018 HK	香港交 易所	中国香港	8,000	745,300.40	1.87
19	CATCH ER TECHN OLOGY CO LTD	可成科技 股份有限 公司	2474 TT	台湾交 易所	中国台湾	10,000	740,391.92	1.85
20	LONGF OR PROPE RTIES	龙湖地产 有限公司	960 HK	香港交 易所	中国香港	40,000	713,262.60	1.79
21	HONG KONG EXCHA NGES & CLEAR	香港交易 及结算所 有限公司	388 HK	香港交 易所	中国香港	3,500	696,400.60	1.74
22	HUA HONG SEMIC ONDUCT OR LIMITE D	华虹半导 体有限公 司	1347 HK	香港交 易所	中国香港	30,000	681,646.35	1.71
23	INDUS TRIAL AND COMM	中国工商 银行股份 有限公司	1398 HK	香港交 易所	中国香港	100,000	494,899.70	1.24



	ERCIAL BANK OF CHINA LTD							
24	COUNT RY GARDE N HOLDI NGS CO. LTD	碧桂园控 股有限公 司	2007 HK	香港交 易所	中国香港	40,000	465,391.20	1.17

## 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	1,417,846.85	2.79
2	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	881 HK	1,415,564.75	2.78
3	HOLY STONE ENTERPRISE CO LTD	3026 TT	1,363,767.41	2.68
4	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	1,343,160.91	2.64
5	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	1,184,411.74	2.33
6	SHENZHEN INTL HOLDINGS	152 HK	1,162,213.81	2.28
7	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	962,593.69	1.89
8	SINO BIOPHARMACEUTI CAL	1177 HK	939,448.30	1.85
9	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	919,255.36	1.81

10	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2601 HK	825,727.24	1.62
11	LARGAN PRECISION CO LTD	3008 TT	767,489.84	1.51
12	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	522 HK	761,317.86	1.50
13	MINTH GROUP LTD	425 HK	738,663.55	1.45
14	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1347 HK	655,186.73	1.29
15	CONCRAFT HOLDING CO LTD	4943 TT	640,863.91	1.26
16	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2007 HK	558,466.67	1.10
17	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	518,079.32	1.02
18	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	362,929.20	0.71
19	FIT HON TENG LTD	6088 HK	277,684.49	0.55
20	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	165,500.53	0.33

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。

### 7.5.2 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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	1,840,531.87	3.62
2	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	1,675,990.78	3.29
3	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	1,529,815.60	3.01
4	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	1,424,669.34	2.80
5	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	1,329,343.82	2.61
6	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	1,251,196.24	2.46
7	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	291 HK	1,239,575.89	2.44
8	MEDIATEK INC	2454 TT	1,231,142.68	2.42
9	HOLY STONE ENTERPRISE CO LTD	3026 TT	1,153,054.26	2.27
10	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2474 TT	1,133,479.13	2.23
11	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	1,083,808.43	2.13
12	IND & COMM BK OF CHINA-H	1398 HK	1,082,917.16	2.13

13	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	1,061,055.64	2.09
14	BRILLIANCE CHINA AUT	1114 HK	984,567.62	1.94
15	NETEASE INC-ADR	NTES US	916,513.63	1.80
16	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	871,857.80	1.71
17	FLEXIUM INTERCONNECT INC	6269 TT	832,331.43	1.64
18	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	819,501.08	1.61
19	CK ASSET HOLDINGS LTD	1113 HK	814,745.43	1.60
20	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	768,634.85	1.51

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	17,077,052.97
卖出收入（成交）总额	31,780,477.83

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 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。

**7.11.2** 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	143,028.11
4	应收利息	3,421.32
5	应收申购款	31,962.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	178,412.13

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §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	持有人结构
----------	-------	-------

	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,499	7,092.93	3,887,247.28	12.18%	28,023,861.88	87.82%

## 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	1,349.54	0.0042%

## 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（2011年1月27日）基金 份额总额	821,766,293.97
本报告期期初基金份额总额	42,977,639.17
本报告期基金总申购份额	25,084,554.72
减：本报告期基金总赎回份额	36,151,084.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	31,911,109.16

## §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	
UBS Securities Asia Limited	-	4,509,972.00	9.23%	4,509.99	8.61%	-
CITIC Securities International Company Limited	-	1,422,035.23	2.91%	1,706.44	3.26%	-
BOCOM International Securities Limited	-	4,325,212.57	8.85%	6,487.83	12.38%	-
YUANTA	-	2,626,208.81	5.38%	4,201.93	8.02%	-

SECURITIES (HONG KONG) COMPANY LIMITED						
MasterLink Securities Corp.	-	6,899,106.70	14.12%	6,893.63	13.16%	-
China Industrail Securities	-	2,451,664.37	5.02%	2,942.00	5.62%	-
SINOLINK SECURITIES (HK)	-	3,228,898.18	6.61%	3,874.68	7.40%	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	4,857,311.46	9.94%	4,152.12	7.93%	-
CICC HK SEC. LTD.	-	4,845,852.83	9.92%	4,209.35	8.03%	-
UOB Kay Hian (HongKong) Limited	-	2,607,020.41	5.34%	2,607.02	4.98%	-
China Merchants Sec (HK) Co Ltd	-	5,414,218.38	11.08%	5,414.23	10.33%	-
ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	5,542,598.52	11.34%	5,195.92	9.92%	-
CCB International Securities Limited	-	127,431.39	0.26%	191.15	0.36%	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities	-	-	-	-	-	-

Group Limited						
ShenYin WanGuo (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY CO. INTERNATIONAL PLC	-	-	-	-	-	-
The Bank of New York Company Inc.	-	-	-	-	-	-
BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
Fubon Bank (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities(HK) Limited	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-



Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金交易单元无变化。

## 2、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。

## 3、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
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI C Securities Inter	-	-	-	-	-	-	-	-

natio nal Com pany Limi ted									
BOC OM Inter natio nal Secu rities Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-	-
YU ANT A SEC URI TIE S (HO NG KO NG) CO MPA NY LIM ITE D	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mast erLi nk Secu rities Corp .	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Indu strail Secu rities	-	-	-	-	-	-	-	-	-

SIN OLI NK SEC URI TIE S(H K)	-	-	-	-	-	-	-	-
GOL DM AN SAC HS (ASI A) SEC URI TIE S LIM ITE D	-	-	-	-	-	-	-	-
CIC C HK SEC. LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
UO B Kay Hian (Hon gKo ng) Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Mer chan ts Sec (HK ) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

ICB C I N T E R N A T I O N A L S E C U R I T I E S L I M I T E D	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB I n t e r n a t i o n a l S e c u r i t i e s L i m i t e d	-	-	-	-	-	-	-	-	-
F i r s t S h a n g h a i S e c u r i t i e s L i m i t e d	-	-	-	-	-	-	-	-	-
H a i t o n g I n t e r n a t i o n a l S e c u r i t i e s G r o u p L i m i t e d	-	-	-	-	-	-	-	-	-
S h e n Y i n W a n G u o (H.K)	-	-	-	-	-	-	-	-	-

.)Li mite d									
Deut sche Secu rities Asia Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cath ay Secu rities Corp orati on	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MO RG AN STA NLE Y CO. INT ERN ATI ON AL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
The Ban k of New York Com pany Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC I Secu rity Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Asia	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Limited								
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubon Bank (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities (Hong Kong)	-	-	-	-	-	-	-	-

Limited								
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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参加中泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-01-30
3	关于海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金解聘境外投资顾问的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-01-31
4	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-02-09

	公告		
5	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-02-24
6	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
7	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的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-24
8	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-27
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-30
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续在中国工商银行股份有限公司开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-03-30
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-04-25
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中天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》	2018-05-04
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-05-17
14	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-05-18
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华宝证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-06-06
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-06-14
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东海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》	2018-06-14
18	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-06-27
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分	《中国证券报》、《上海	2018-06-30



	基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券报》和《证券时报》	
20	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2018-06-30

## §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	2018/1/1-2018/5/28	9,008,108.11	-	9,008,108.11	0.00	0.00%
	2	2018/6/27-2018/6/27	0.00	7,860,849.06	7,860,849.06	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购及转换转入申请。</p>							

### 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大中华精选混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通大中华精选混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通大中华精选混合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) 报告期内海富通大中华精选混合型证券投资基金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