

**海富通欣益灵活配置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：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 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 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> .....                        | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 15 |
| 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.....             | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 17 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 18 |
| 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.....       | 19 |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 19 |
| 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..... | 19 |
| 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.....     | 19 |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | 19 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 19 |
| 6.2 利润表.....                                 | 21 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 22 |
| 6.4 报表附注.....                                | 24 |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 45 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 49 |
| 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.....      | 49 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 50 |
| 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.....   | 50 |
| 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.....      | 50 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 50 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 50 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 50 |

|  |    |
|--|----|
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....              | 52 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 52 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 52 |
| 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..... | 52 |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b> .....              | 53 |
| <b>§10 重大事件揭示</b> .....                | 53 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 53 |
| 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.....  | 53 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 53 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 54 |
| 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.....     | 54 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 54 |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 56 |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....        | 57 |
| <b>§12 备查文件目录</b> .....                | 59 |
| 12.1 备查文件目录.....                       | 59 |
| 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            | 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金 |                  |
| 基金简称            | 海富通欣益混合            |                  |
| 基金主代码           | 519221             |                  |
| 交易代码            | 519221             |                  |
| 基金运作方式          | 契约型、开放式            |                  |
| 基金合同生效日         | 2016 年 9 月 7 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      | 195,579,733.74 份   |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 海富通欣益混合 A          | 海富通欣益混合 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 519222             | 519221           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 90,596,807.28 份    | 104,982,926.46 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。   |
| 投资策略   | 本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；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，从而做出权益类资产的具体仓位选择。债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，在市场创新和变化中寻找投资机会，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式，确定和构造合理的债券组合。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%  |
| 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。 |
|--|------|

### 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<br>负责人 | 姓名   | 奚万荣                              | 陆志俊                   |
|             | 联系电话 | 021-38650891                     | 95559                 |
|             | 电子邮箱 | wrxi@hftfund.com                 | luzj@bankcomm.com     |
| 客户服务电话      |      | 40088-40099                      | 95559                 |
| 传真          |      | 021-33830166                     | 021-62701216          |
| 注册地址        |      | 上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号 |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号 |
| 邮政编码        |      | 200120                           | 200120                |
| 法定代表人       |      | 张文伟                              | 彭纯                    |

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 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公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## §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） |                |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
|               | 海富通欣益混合 A                            | 海富通欣益混合 C      |
| 本期已实现收益       | 2,259,270.42                         | 4,635,503.76   |
| 本期利润          | 1,533,199.27                         | 641,539.98     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0285                               | 0.0058         |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.60%                                | 0.55%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.50%                                | 0.14%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018 年 6 月 30 日)                |                |
|               | 海富通欣益混合 A                            | 海富通欣益混合 C      |
| 期末可供分配利润      | 5,239,387.18                         | 1,934,272.39   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0578                               | 0.0184         |
| 期末基金资产净值      | 95,836,194.46                        | 106,917,198.85 |
| 期末基金份额净值      | 1.058                                | 1.018          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2018 年 6 月 30 日)                |                |
|               | 海富通欣益混合 A                            | 海富通欣益混合 C      |
| 基金份额累计净值增长率   | 11.16%                               | 6.95%          |

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

海富通欣益混合 A

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①—③ | ②—④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

|            | 增长率①   | 增长率标准差② | 基准收益率③ | 基准收益率标准差④ |       |        |
|------------|--------|---------|--------|-----------|-------|--------|
| 过去一个月      | -0.22% | 0.29%   | -1.83% | 0.37%     | 1.61% | -0.08% |
| 过去三个月      | 0.69%  | 0.21%   | -1.53% | 0.34%     | 2.22% | -0.13% |
| 过去六个月      | 3.50%  | 0.28%   | -0.95% | 0.34%     | 4.45% | -0.06% |
| 过去一年       | 9.62%  | 0.25%   | 1.84%  | 0.28%     | 7.78% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.16% | 0.20%   | 3.66%  | 0.26%     | 7.50% | -0.06% |

## 海富通欣益混合 C

| 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      | -0.32%   | 0.27%       | -1.83%     | 0.37%         | 1.51% | -0.10% |
| 过去三个月      | 0.52%    | 0.20%       | -1.53%     | 0.34%         | 2.05% | -0.14% |
| 过去六个月      | 0.14%    | 0.21%       | -0.95%     | 0.34%         | 1.09% | -0.13% |
| 过去一年       | 5.69%    | 0.20%       | 1.84%      | 0.28%         | 3.85% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.95%    | 0.17%       | 3.66%      | 0.26%         | 3.29% | -0.09% |

### 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

海富通欣益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

#### 1. 海富通欣益混合 A

(2016 年 9 月 7 日至 2018 年 6 月 30 日)





## 2. 海富通欣益混合 C

(2016 年 9 月 7 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2016 年 9 月 7 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<br>(助理) 期限 |            | 证券从<br>业年限 | 说明  |
|-----|---|----------------------|------------|------------|---|
|     |   | 任职日期                 | 离任日期       |            |   |
| 陈甄璞 | 本基金的基金经理；海富通东财大数据混合基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通量化先锋股票基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通量化多因子混合基金经理；时任量化投资部总监。 | 2016-09-07           | 2018-05-03 | 10 年       | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任复旦金仕达计算机有限公司高级程序员、部门经理，东方证券股份有限公司高级开发经理，IBM 中国有限公司高级咨询顾问，历任海富通基金管理有限公司量化分析师、投资经理、量化投资部副总监、量化投资部总监。2014 年 11 月至 2018 年 5 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2015 年 4 月至 2016 年 6 月兼任海富通养老收益混合(现海富通安颐收益混合)和海富通新内需混合基金经理。2016 年 1 月至 2018 年 5 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2016 年 9 月至 2018 年 5 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 5 月兼任海富通欣享混合基金经理。2018 年 2 月至 2018 年 5 月兼任海富通量化先锋股票基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 5 月兼任海富通创业板增强和海富通量化多因子混合基金经理。 |
| 杜晓海 | 本基金的基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通富睿混  | 2018-04-09           | -          | 18 年       | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公   |

|     |   |            |   |     |   |
|-----|---|------------|---|-----|---|
|     | 合基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通东财大数据混合基金经理；海富通量化先锋股票基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通量化多因子混合基金经理；量化投资部总监 |            |   |     | 司量化投资部总监。2016年6月起任海富通新内需混合和海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016年9月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017年4月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2018年3月起兼任海富通富祥混合基金经理。2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通东财大数据混合、海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合、海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。 |
| 谈云飞 | 本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通货币基金基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通欣荣混合                           | 2016-09-07 | - | 13年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。2005年4月至2014年6月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年7月至2015年10月任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015年1月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015年4月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016年2月起兼任海富通货币基金基金经理。2016年4月至2017年6月兼任海富通纯    |

|     |   |            |            |     |  |
|-----|---|------------|------------|-----|--|
|     | 基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通季季通利理财债券基金经理。 |            |            |     | 债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通季季通利理财债券基金经理。  |
| 夏妍妍 | 本基金的基金经理；海富通一年定开债券基金经理；海富通融丰定开债券基金经理。           | 2018-01-05 | -          | 3 年 | 上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，任固定收益分析师。2016 年 1 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券的基金经理助理。2016 年 1 月至 2018 年 1 月兼任海富通双福债券、海富通养老收益混合（现海富通安颐收益混合）、海富通一年定开债券、海富通纯债债券的基金经理助理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣益混合的基金经理助理。2018 年 1 月起任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定开债券和海富通融丰定开债券基金经理。 |
| 金晓鸣 | 本基金的基金经理助理；海富通                                  | 2018-01-29 | 2018-06-28 | 9 年 | 经济学学士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 7 月加入海富通基金管理有  |

|     |  |            |   |      |   |
|-----|--|------------|---|------|---|
|     | <p>上证非周期 ETF 联接基金经理助理；海富通上证周期 ETF 基金经理助理；海富通上证周期 ETF 联接基金经理助理；海富通阿尔法对冲混合基金经理助理；海富通东财大数据混合基金经理助理；海富通上证非周期 ETF 基金经理助理；海富通欣享混合基金经理助理。</p> |            |   |      | <p>限公司，先后在运营部和权益投资部任职，2014 年 11 月至 2018 年 6 月任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通上证非周期 ETF 联接的基金经理助理。2018 年 1 月至 2018 年 6 月兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通东财大数据混合、海富通欣益混合、海富通欣享混合的基金经理助理。</p>  |
| 朱斌全 | <p>本基金基金经理助理；海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理助理；海富通新内需混合基金经理助理；海富通富睿混合基金经理助理；海富通富祥混合基金经理助理；海富通阿尔法对冲混合基金经理助理；海富通欣享混</p>                        | 2018-05-15 | - | 11 年 | <p>理学硕士，CFA，持有基金从业人员资格证书。历任上海涅柔斯投资管理有限公司美国股票交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员，高级交易员，量化分析师，量化投资部投资经理。2018 年 5 月起任海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)、海富通新内需混合、海富通富睿混合、海富通富祥混合、海富通阿尔法对冲混合、海富通欣益混合、海富通欣享混合、海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通创业板增强、海富通量化多因子混合的基金经理助理。</p> |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  | 合基金经理助理；海富通量化前锋股票基金经理助理；海富通稳固收益债券基金经理助理；海富通创业板增强基金经理助理；海富通量化多因子混合基金经理助理。 |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

本报告期，基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

债券市场方面，上半年的债券市场呈现利率牛市、信用分化的特征。从宏观层面看，上半年政策仍延续“去杠杆”的思路，经济总体保持韧性但边际趋弱，通胀表现温和。具体来看，上半年工业生产相对旺盛，制造业投资尤其是中上游行业在盈利驱动下有所回暖，而基建投资受非标和融资渠道收紧的影响逐月下滑；房地产投资虽在前期土地购置费的支撑下保持高增速，但在政策和资金压力下动能也在转弱。融资方面，资管新规后表外融资渠道的收缩并未伴随着表内信贷增速的明显上行，社融增速出现下滑，“紧信用”对实体的压力正在逐步显现。此外，上半年中美贸易摩擦不断，外围环境的变化也对经济产生一定的不确定性。在这种宏观背景下，上半年央行货币政策态度产生了边际变化，为对冲金融收紧和经济下行的风险，央行实行稳健偏松的货币政策，并多次定向降准，缓解银行负债端压力和支持小微企业融资。上半年债券市场的资金面整体保持平稳，而无风险利率呈现震荡下行的态势，半年的时间 10 年期国债收益率下行 41BP，10 年期国开债收益率下行 57BP，利率债呈现“小牛市”。而信用债却出现分化，上半年民营企业债券违约事件频发，城投非标逾期等负面消息不断，市场一直笼罩在违约阴影下，风险偏好急剧下降，信用利差也随之大幅走扩，3 年期 AA 级企业债信用利差抬升 23BP。可转债方面，上半年转债市场呈现出先扬后抑的走势，转债供给的增多、股市的大幅波动给转债正股和估值都带来不小的压力，而信用风险的叠加使得低价券杀跌更为严重。上半年中证转债指数跌 2.17%。

本基金债券部分上半年整体维持中高等级信用债的杠杆策略，追求稳定收益和流动



性管理。在基础配置仓位之上，适度结合基本面和资金面情况进行利率债波段交易以增厚收益。整体来看，债券部分规避了信用风险，获得了稳定较高收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣益灵活配置混合 A 净值增长率为 3.50%，同期业绩比较基准收益率为-0.95%，基金净值跑赢业绩比较基准 4.45 个百分点。海富通欣益灵活配置混合 C 净值增长率为 0.14%，同期业绩比较基准收益率为-0.95%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.09 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。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。

本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

债券市场方面，从基本面看，下半年经济存在一些回落压力。土地购置费支撑房地产投资的效应大概率在下半年逐步消退，在房地产企业融资渠道受限、棚户区改造规模增速放缓的背景下，下半年房地产投资或有所转弱。下半年财政支出和地方债发行或加速，基建投资增速或保持相对平稳甚至小幅反弹。而在中美贸易摩擦、欧美经济走势分化等背景下，外需存在一定的变数。通胀方面，下半年通胀中枢或较 2017 年温和抬升，

市场对通胀的预期已明显弱化，关注原油价格和中美贸易摩擦等不确定因素的影响。政策方面，紧信用环境下实体经济融资难度和成本提高，为对冲经济的下滑，下半年货币政策或延续稳健偏松和灵活操作，定向降准仍有空间，但在美联储加息和人民币汇率可能承压的背景下，货币政策或面临一定制约。上半年受资本充足率、信贷额度和行业等方面的限制，表外融资渠道转表内的过程并不顺畅，下半年信贷政策存在结构性放松的可能。在上述判断下，我们认为下半年利率仍有进一步下行的机会和空间，可积极参与利率债交易，但要把握节奏，密切关注资管新规细则落地的影响和人民币汇率的走势。信用债方面，低资质企业非标转标和直接融资预计仍然比较困难，叠加下半年信用债到期和回售压力较大，信用负面事件对市场的冲击或仍未结束，信用策略总体仍以防守为主，但亦要观察可能出现的政策托底带来的机会。可转债方面，估值已接近历史底部但股市风险未消，与上半年相同的是，情绪化引起的大幅波动将是交易机会和风险的集中体现，而不同于上半年的个券行情，下半年市场的 beta 机会可能会更多显现。

2018 年下半年，本基金债券部分资产配置将秉承绝对收益的目标，维持适度杠杆。考虑到目前信用债期限利差较大、评级利差已较年初明显走扩，本基金将积极把握信用债个券机会，在控制信用风险的前提下，争取提高组合的配置收益。同时，积极关注利率债的交易性机会，并配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

#### 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

根据基金合同的规定，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%。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2018 年 6 月 1 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2018 年 6 月 8 日完成权益登记，A 类基金单位分红金额为 0.054

元，合计利润分配金额 4,892,175.01 元，其中现金形式发放总额为 4,892,108.97 元，再投资形式发放总额为 66.04 元，C 类基金单位分红金额为 0.052 元，合计利润分配金额 5,195,529.45 元，其中现金形式发放总额为 86.73 元，再投资形式发放总额为 5,195,442.72 元。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

本报告期内，本基金自 2018 年 1 月 24 日至 2018 年 3 月 31 日，已连续四十五个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

### §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

2018 年上半年度，基金托管人在海富通欣益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

2018 年上半年度，海富通基金管理有限公司在海富通欣益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。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 10,087,704.46 元，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的真实、准确和完整发表意见

2018 年上半年度，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通欣益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<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：         |         | -                      | -                        |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 1,213,949.11           | 5,134,290.97             |
| 结算备付金       |         | 2,440,599.12           | 7,012,294.20             |
| 存出保证金       |         | 50,992.54              | 54,596.94                |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 244,122,833.24         | 251,465,823.61           |
| 其中：股票投资     |         | 30,708,875.24          | 32,441,048.11            |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | 213,413,958.00         | 219,024,775.50           |
| 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 | 14,994,142.49          | 63,000,000.00            |
| 应收证券清算款     |         | 19,169,664.62          | 6,133,089.49             |
| 应收利息        | 6.4.7.5 | 3,676,090.23           | 3,218,200.87             |
| 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>285,668,271.35</b>  | <b>336,018,296.08</b>    |
| 负债和所有者权益    | 附注号     | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>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   |         | 63,200,000.00          | 25,200,000.00            |
| 应付证券清算款     |         | 19,316,276.03          | 6,079,950.23             |
| 应付赎回款       |         | 29.86                  | 10.56                    |
| 应付管理人报酬     |         | 105,445.32             | 158,146.77               |
| 应付托管费       |         | 26,361.31              | 39,536.68                |
| 应付销售服务费     |         | 19,111.71              | 19,442.82                |
| 应付交易费用      | 6.4.7.7 | 55,667.26              | 186,725.19               |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费          |          | 24,428.92      | -              |
| 应付利息          |          | -10,960.87     | 28,319.24      |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 178,518.50     | 360,000.00     |
| 负债合计          |          | 82,914,878.04  | 32,072,131.49  |
| <b>所有者权益：</b> |          | -              | -              |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 195,579,733.74 | 283,503,758.92 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 7,173,659.57   | 20,442,405.67  |
| 所有者权益合计       |          | 202,753,393.31 | 303,946,164.59 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 285,668,271.35 | 336,018,296.08 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 195,579,733.74 份，其中海富通欣益混合基金 A 类份额 90,596,807.28 份，海富通欣益混合基金 C 类份额 104,982,926.46 份。A 类份额净值 1.058 元，C 类份额净值 1.018 元。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通欣益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                                 | 上年度可比期间                            |
|------------------|----------|------------------------------------|------------------------------------|
|                  |          | 2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 |
| <b>一、收入</b>      |          | <b>3,889,117.40</b>                | <b>13,284,301.23</b>               |
| 1.利息收入           |          | 4,132,840.01                       | 10,902,159.79                      |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.11 | 64,617.40                          | 955,308.58                         |
| 债券利息收入           |          | 3,903,736.60                       | 9,723,501.96                       |
| 资产支持证券利息收入       |          | -                                  | -                                  |
| 买入返售金融资产收入       |          | 164,486.01                         | 223,349.25                         |
| 其他利息收入           |          | -                                  | -                                  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 4,475,927.40                       | -9,432,912.67                      |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.12 | 4,387,047.11                       | -4,539,440.06                      |
| 基金投资收益           |          | -                                  | -                                  |
| 债券投资收益           | 6.4.7.13 | -364,763.55                        | -4,963,766.38                      |
| 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 | -                   | -777,780.00         |
| 股利收益                       | 6.4.7.16 | 453,643.84          | 848,073.77          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.17 | -4,720,034.93       | 11,565,027.66       |
| 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 | 384.92              | 250,026.45          |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>1,714,378.15</b> | <b>4,425,733.90</b> |
| 1. 管理人报酬                   |          | 521,936.99          | 1,775,120.94        |
| 2. 托管费                     |          | 130,484.28          | 443,780.22          |
| 3. 销售服务费                   |          | 116,559.07          | 142,313.30          |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19 | 183,106.55          | 596,647.28          |
| 5. 利息支出                    |          | 553,792.59          | 1,268,569.62        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 553,792.59          | 1,268,569.62        |
| 6.税金及附加                    |          | 10,065.18           | -                   |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20 | 198,433.49          | 199,302.54          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>2,174,739.25</b> | <b>8,858,567.33</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>2,174,739.25</b> | <b>8,858,567.33</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣益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）          | 283,503,758.92                  | 20,442,405.67 | 303,946,164.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -                               | 2,174,739.25  | 2,174,739.25   |

|  |  |                |                 |
|--|--|----------------|-----------------|
| 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)      | -87,924,025.18                             | -5,355,780.89  | -93,279,806.07  |
| 其中：1.基金申购款                             | 133,142,288.90                             | 12,097,494.24  | 145,239,783.14  |
| 2.基金赎回款                                | -221,066,314.08                            | -17,453,275.13 | -238,519,589.21 |
| 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) | -  | -10,087,704.46 | -10,087,704.46  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 195,579,733.74                             | 7,173,659.57   | 202,753,393.31  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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)                        | 499,220,253.42                             | -292,265.96    | 498,927,987.46  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -  | 8,858,567.33   | 8,858,567.33    |
| 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)      | 97,240,886.32                              | -370,348.86    | 96,870,537.46   |
| 其中：1.基金申购款                             | 546,438,221.15                             | 3,672,430.11   | 550,110,651.26  |
| 2.基金赎回款                                | -449,197,334.83                            | -4,042,778.97  | -453,240,113.80 |
| 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)                        | 596,461,139.74                             | 8,195,952.51   | 604,657,092.25  |

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

海富通欣益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 939 号《关于准予海富通欣益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《海富通欣益灵活配置混合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 400,035,458.76 元,业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 1161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 400,125,466.20 份,其中认购资金利息折合 90,007.44 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《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是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)、权证、股指期货等权益类品种,债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等),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的相关规定。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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。

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》、《海富通欣益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[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]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。

(b)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。

(c)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。

(d)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。

(e)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<br>2018 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 1,213,949.11           |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 1,213,949.11           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |               |             |
|-------------------|------------------------|---------------|-------------|
|                   | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动      |
| 股票                | 30,990,546.07          | 30,708,875.24 | -281,670.83 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -             | -           |

|        |       |                |                |               |
|--------|-------|----------------|----------------|---------------|
| 债券     | 交易所市场 | 113,890,335.73 | 113,247,958.00 | -642,377.73   |
|        | 银行间市场 | 100,695,574.93 | 100,166,000.00 | -529,574.93   |
|        | 合计    | 214,585,910.66 | 213,413,958.00 | -1,171,952.66 |
| 资产支持证券 |       | -              | -              | -             |
| 基金     |       | -              | -              | -             |
| 其他     |       | -              | -              | -             |
| 合计     |       | 245,576,456.73 | 244,122,833.24 | -1,453,623.49 |

### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                      | -         |
| 银行间市场 | 14,994,142.49          | -         |
| 合计    | 14,994,142.49          | -         |

#### 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<br>2018 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 910.41                 |
| 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  | 987.62                 |
| 应收债券利息     | 3,659,895.54           |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | 14,276.05              |
| 应收申购款利息    | -                      |

|            |              |
|------------|--------------|
| 应收黄金合约拆借孳息 | -            |
| 其他         | 20.61        |
| 合计         | 3,676,090.23 |

#### 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

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 50,900.02         |
| 银行间市场应付交易费用 | 4,767.24          |
| 合计          | 55,667.26         |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 0.01              |
| 预提费用        | 178,518.49        |
| 合计          | 178,518.50        |

#### 6.4.7.9 实收基金

海富通欣益混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 183,588,692.34             | 183,588,692.34  |
| 本期申购          | 90,604,977.36              | 90,604,977.36   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -183,596,862.42            | -183,596,862.42 |
| 本期末           | 90,596,807.28              | 90,596,807.28   |

## 海富通欣益混合 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 99,915,066.58              | 99,915,066.58  |
| 本期申购          | 42,537,311.54              | 42,537,311.54  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -37,469,451.66             | -37,469,451.66 |
| 本期末           | 104,982,926.46             | 104,982,926.46 |

注：申购含红利再投份额；申购含转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 海富通欣益混合 A

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 13,065,343.98  | 603,476.62    | 13,668,820.60  |
| 本期利润           | 2,259,270.42   | -726,071.15   | 1,533,199.27   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,695,286.67  | -3,375,171.01 | -5,070,457.68  |
| 其中：基金申购款       | 12,190,788.98  | -2,767,925.92 | 9,422,863.06   |
| 基金赎回款          | -13,886,075.65 | -607,245.09   | -14,493,320.74 |
| 本期已分配利润        | -4,892,175.01  | -             | -4,892,175.01  |
| 本期末            | 8,737,152.72   | -3,497,765.54 | 5,239,387.18   |

## 海富通欣益混合 C

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           | 6,446,597.96  | 326,987.11    | 6,773,585.07  |
| 本期利润           | 4,635,503.76  | -3,993,963.78 | 641,539.98    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -22,046.90    | -263,276.31   | -285,323.21   |
| 其中：基金申购款       | 3,824,747.30  | -1,150,116.12 | 2,674,631.18  |
| 基金赎回款          | -3,846,794.20 | 886,839.81    | -2,959,954.39 |

|         |               |               |               |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已分配利润 | -5,195,529.45 | -             | -5,195,529.45 |
| 本期末     | 5,864,525.37  | -3,930,252.98 | 1,934,272.39  |

#### 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  | 20,180.88                       |  |
| 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 | 12,145.10                       |  |
| 其他        | 32,291.42                       |  |
| 合计        | 64,617.40                       |  |

#### 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   | 58,986,645.67                   |  |
| 减：卖出股票成本总额 | 54,599,598.56                   |  |
| 买卖股票差价收入   | 4,387,047.11                    |  |

#### 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   | 296,525,696.82       |  |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 291,205,769.86       |  |
| 减：应收利息总额                | 5,684,690.51         |  |
| 买卖债券差价收入                | -364,763.55          |  |

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 453,643.84                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 453,643.84                 |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产              | -4,720,034.93              |
| ——股票投资                 | -4,493,841.24              |
| ——债券投资                 | -226,193.69                |
| ——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                   | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                          |
| 合计                     | -4,720,034.93              |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 384.92                     |
| 合计      | 384.92                     |

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。

#### 6.4.7.19 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 | 177,491.55           |
| 银行间市场交易费用 | 5,615.00             |
| 合计        | 183,106.55           |

#### 6.4.7.20 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      | 29,752.78            |
| 信息披露费     | 148,765.71           |
| 债券托管账户维护费 | 18,000.00            |
| 其他        | 600.00               |
| 银行划款手续费   | 1,315.00             |
| 合计        | 198,433.49           |

### 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    |
| 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。

#### 6.4.10 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>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  | 29,032,185.59              | 25.00%       | 54,470,277.92                   | 14.07%       |

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券成交总额的比例 |
| 海通证券  | 100,680,298.10             | 80.86%       | 96,822,086.85                   | 65.13%       |

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 555,100,000.00 | 29.60%         | -    | -              |

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>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  | 26,987.67                       | 25.11%     | 5,967.57  | 11.72%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>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  | 49,639.15                       | 14.30%     | 49,639.15 | 38.11%       |

#### 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>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  | 521,936.99                 | 1,775,120.94                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 85.59                      | 80.10                           |

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 0.60% 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 0.60% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 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<br>6月30日 | 2017年1月1日至2017年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------|--------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 130,484.28               | 443,780.22               |

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 0.15% 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  $\times$  0.15% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日      |            |            |
|--------------------|---------------------------------|------------|------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                    | 海富通欣益混合<br>A                    | 海富通欣益混合 C  | 合计         |
| 交通银行               | -                               | 1.81       | 1.81       |
| 海富通基金              | -                               | 116,552.18 | 116,552.18 |
| 合计                 | -                               | 116,553.99 | 116,553.99 |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |            |            |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                    | 海富通欣益混合<br>A                    | 海富通欣益混合 C  | 合计         |
| 交通银行               | -                               | 3.06       | 3.06       |
| 海富通基金              | -                               | 142,309.57 | 142,309.57 |
| 合计                 | -                               | 142,312.63 | 142,312.63 |

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值  $\times$  0.2%  $\div$  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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>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  | 1,213,949.11               | 20,180.88 | 35,744,481.81                   | 104,088.22 |

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。

**6.4.10.6 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须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

海富通欣益混合 A

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日        | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额     | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计       | 备注 |
|----|------------|------------|---------------|--------------|-----------|--------------|----|
| 1  | 2018-06-08 | 2018-06-08 | 0.540         | 4,892,108.97 | 66.04     | 4,892,175.01 | -  |
| 合计 |            |            | 0.540         | 4,892,108.97 | 66.04     | 4,892,175.01 | -  |

海富通欣益混合 C

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日        | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额    | 利润分配合计       | 备注 |
|----|------------|------------|---------------|----------|--------------|--------------|----|
| 1  | 2018-06-08 | 2018-06-08 | 0.520         | 86.73    | 5,195,442.72 | 5,195,529.45 | -  |
| 合计 |            |            | 0.520         | 86.73    | 5,195,442.72 | 5,195,529.45 | -  |

#### 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

本基金本报告期末持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有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

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 63,200,000.00 元，于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管

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

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

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

#### 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交通银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2018年6月30日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | 20,068,000.00       |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | 9,952,000.00        |
| 合计     | -                 | 30,020,000.00       |

注：未评级部分为国债、短期融资券、金融债。

**6.4.13.2 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2018年6月30日 | 上年末<br>2017年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | -                 | -                  |
| A-1 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | -                 | 92,396,800.00      |
| 合计     | -                 | 92,396,800.00      |

**6.4.13.3 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<br>2018年6月30日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 98,812,300.00     | 48,494,000.00       |
| AAA 以下 | 73,589,860.00     | 48,113,975.50       |
| 未评级    | 41,011,798.00     | -                   |
| 合计     | 213,413,958.00    | 96,607,975.50       |

注：未评级部分为金融债。

**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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分股票资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产

均能以合理价格适时变现。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。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 63,200,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。



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

#### 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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              | 1,213,949.11         | -                     | -                    | -                    | 1,213,949.11          |
| 结算备付金             | 2,440,599.12         | -                     | -                    | -                    | 2,440,599.12          |
| 存出保证金             | 50,992.54            | -                     | -                    | -                    | 50,992.54             |
| 交易性金融资产           | 24,286,798.00        | 168,615,160.00        | 20,512,000.00        | 30,708,875.24        | 244,122,833.24        |
| 买入返售金融资产          | 14,994,142.49        | -                     | -                    | -                    | 14,994,142.49         |
| 应收证券清算款           | -                    | -                     | -                    | 19,169,664.62        | 19,169,664.62         |
| 应收利息              | -                    | -                     | -                    | 3,676,090.23         | 3,676,090.23          |
| <b>资产总计</b>       | <b>42,986,481.26</b> | <b>168,615,160.00</b> | <b>20,512,000.00</b> | <b>53,554,630.09</b> | <b>285,668,271.35</b> |
| <b>负债</b>         |                      |                       |                      |                      |                       |
| 卖出回购金融资产款         | 63,200,000.00        | -                     | -                    | -                    | 63,200,000.00         |
| 应付证券清算款           | -                    | -                     | -                    | 19,316,276.03        | 19,316,276.03         |
| 应付赎回款             | -                    | -                     | -                    | 29.86                | 29.86                 |
| 应付管理人报酬           | -                    | -                     | -                    | 105,445.32           | 105,445.32            |

|                          |                |                |               |               |                |
|--------------------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 26,361.31     | 26,361.31      |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 19,111.71     | 19,111.71      |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -             | 55,667.26     | 55,667.26      |
| 应付税费                     | -              | -              | -             | 24,428.92     | 24,428.92      |
| 应付利息                     | -              | -              | -             | -10,960.87    | -10,960.87     |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 178,518.50    | 178,518.50     |
| 负债总计                     | 63,200,000.00  | -              | -             | 19,714,878.04 | 82,914,878.04  |
| 利率敏感度缺口                  | -20,213,518.74 | 168,615,160.00 | 20,512,000.00 | 33,839,752.05 | 202,753,393.31 |
| 上年度末<br>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                     | 5,134,290.97   | -              | -             | -             | 5,134,290.97   |
| 结算备付金                    | 7,012,294.20   | -              | -             | -             | 7,012,294.20   |
| 存出保证金                    | 54,596.94      | -              | -             | -             | 54,596.94      |
| 交易性金融资产                  | 152,372,775.50 | 66,652,000.00  | -             | 32,441,048.11 | 251,465,823.61 |
| 买入返售金融资产                 | 63,000,000.00  | -              | -             | -             | 63,000,000.00  |
| 应收证券清算款                  | -              | -              | -             | 6,133,089.49  | 6,133,089.49   |
| 应收利息                     | -              | -              | -             | 3,218,200.87  | 3,218,200.87   |
| 资产总计                     | 227,573,957.61 | 66,652,000.00  | 0.00          | 41,792,338.47 | 336,018,296.08 |
| 负债                       |                |                |               |               |                |
| 卖出回购金融资产款                | 25,200,000.00  | -              | -             | -             | 25,200,000.00  |
| 应付证券清算款                  | -              | -              | -             | 6,079,950.23  | 6,079,950.23   |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -             | 10.56         | 10.56          |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | 158,146.77    | 158,146.77     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 39,536.68     | 39,536.68      |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 19,442.82     | 19,442.82      |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -             | 186,725.19    | 186,725.19     |
| 应付利息                     | -              | -              | -             | 28,319.24     | 28,319.24      |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 360,000.00    | 360,000.00     |

|         |                |               |      |               |                |
|---------|----------------|---------------|------|---------------|----------------|
| 负债总计    | 25,200,000.00  | 0.00          | 0.00 | 6,872,131.49  | 32,072,131.49  |
| 利率敏感度缺口 | 202,373,957.61 | 66,652,000.00 | 0.00 | 34,920,206.98 | 303,946,164.59 |

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

| 项目 | 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<br>2018年6月30日            | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | 减少约 154                      | 减少约 56              |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 增加约 156                      | 增加约 57              |

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%，权证投资 0%-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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<br>2018 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                              |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|------------------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基<br>金资<br>产净<br>值比<br>例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 30,708,875.24          | 15.15                    | 32,441,048.11            | 10.67                        |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 其他            | -                      | -                        | -                        | -                            |
| 合计            | 30,708,875.24          | 15.15                    | 32,441,048.11            | 10.67                        |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 15.15%，因此除市场利率和外汇汇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<br>比例(%) |
|----|------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资 | 30,708,875.24 | 10.75            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：股票             | 30,708,875.24  | 10.75  |
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 213,413,958.00 | 74.71  |
|   | 其中：债券             | 213,413,958.00 | 74.71  |
|   | 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          | 14,994,142.49  | 5.25   |
|   | 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      | 3,654,548.23   | 1.28   |
| 8 | 其他各项资产            | 22,896,747.39  | 8.02   |
| 9 | 合计                | 285,668,271.35 | 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 22,932,682.04 | 11.31        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 493,884.00    | 0.24         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 697,212.50    | 0.34         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 186,008.90    | 0.09         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 174,735.00    | 0.09         |
| J  | 金融业              | 4,023,525.00  | 1.98         |
| K  | 房地产业             | 1,796,591.00  | 0.89         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 404,236.80    | 0.20         |
| 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     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 30,708,875.24 | 15.15 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600309 | 万华化学 | 60,000  | 2,725,200.00 | 1.34         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 3,500   | 2,560,110.00 | 1.26         |
| 3  | 002415 | 海康威视 | 47,700  | 1,771,101.00 | 0.87         |
| 4  | 002008 | 大族激光 | 28,496  | 1,515,702.24 | 0.75         |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 24,800  | 1,452,784.00 | 0.72         |
| 6  | 600779 | 水井坊  | 21,857  | 1,207,162.11 | 0.60         |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 19,200  | 1,002,624.00 | 0.49         |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 33,600  | 888,384.00   | 0.44         |
| 9  | 600019 | 宝钢股份 | 106,100 | 826,519.00   | 0.41         |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 120,000 | 786,000.00   | 0.39         |
| 11 | 000858 | 五粮液  | 9,704   | 737,504.00   | 0.36         |
| 12 | 600585 | 海螺水泥 | 21,646  | 724,708.08   | 0.36         |
| 13 | 000963 | 华东医药 | 14,450  | 697,212.50   | 0.34         |
| 14 | 000002 | 万科A  | 25,500  | 627,300.00   | 0.31         |
| 15 | 000338 | 潍柴动力 | 70,821  | 619,683.75   | 0.31         |
| 16 | 600176 | 中国巨石 | 60,360  | 617,482.80   | 0.30         |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 47,100  | 574,620.00   | 0.28         |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 8,900   | 541,654.00   | 0.27         |
| 19 | 600887 | 伊利股份 | 19,145  | 534,145.50   | 0.26         |
| 20 | 600741 | 华域汽车 | 22,100  | 524,212.00   | 0.26         |
| 21 | 000895 | 双汇发展 | 19,000  | 501,790.00   | 0.25         |
| 22 | 600900 | 长江电力 | 30,600  | 493,884.00   | 0.24         |
| 23 | 601009 | 南京银行 | 60,900  | 470,757.00   | 0.23         |
| 24 | 000651 | 格力电器 | 9,800   | 462,070.00   | 0.23         |
| 25 | 603833 | 欧派家居 | 3,600   | 459,108.00   | 0.23         |
| 26 | 600867 | 通化东宝 | 19,080  | 457,347.60   | 0.23         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 27 | 600276 | 恒瑞医药 | 5,991  | 453,878.16 | 0.22 |
| 28 | 000898 | 鞍钢股份 | 78,800 | 438,916.00 | 0.22 |
| 29 | 001979 | 招商蛇口 | 22,600 | 430,530.00 | 0.21 |
| 30 | 600535 | 天士力  | 16,620 | 429,128.40 | 0.21 |
| 31 | 601398 | 工商银行 | 80,000 | 425,600.00 | 0.21 |
| 32 | 002027 | 分众传媒 | 42,240 | 404,236.80 | 0.20 |
| 33 | 000513 | 丽珠集团 | 7,970  | 350,281.50 | 0.17 |
| 34 | 002304 | 洋河股份 | 2,419  | 318,340.40 | 0.16 |
| 35 | 300741 | 华宝股份 | 7,600  | 302,328.00 | 0.15 |
| 36 | 002007 | 华兰生物 | 9,400  | 302,304.00 | 0.15 |
| 37 | 600104 | 上汽集团 | 8,500  | 297,415.00 | 0.15 |
| 38 | 300003 | 乐普医疗 | 8,000  | 293,440.00 | 0.14 |
| 39 | 002035 | 华帝股份 | 11,700 | 285,831.00 | 0.14 |
| 40 | 002440 | 闰土股份 | 21,150 | 247,243.50 | 0.12 |
| 41 | 601877 | 正泰电器 | 9,400  | 209,808.00 | 0.10 |
| 42 | 600566 | 济川药业 | 4,300  | 207,217.00 | 0.10 |
| 43 | 603816 | 顾家家居 | 2,700  | 198,477.00 | 0.10 |
| 44 | 000538 | 云南白药 | 1,800  | 192,528.00 | 0.09 |
| 45 | 600004 | 白云机场 | 14,210 | 186,008.90 | 0.09 |
| 46 | 600518 | 康美药业 | 7,800  | 178,464.00 | 0.09 |
| 47 | 002311 | 海大集团 | 8,300  | 175,130.00 | 0.09 |
| 48 | 600570 | 恒生电子 | 3,300  | 174,735.00 | 0.09 |
| 49 | 002597 | 金禾实业 | 8,500  | 172,380.00 | 0.09 |
| 50 | 601155 | 新城控股 | 5,300  | 164,141.00 | 0.08 |
| 51 | 300296 | 利亚德  | 7,100  | 91,448.00  | 0.05 |

## 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  | 601318 | 中国平安 | 9,147,776.08 | 3.01            |
| 2  | 002008 | 大族激光 | 2,007,487.00 | 0.66            |
| 3  | 002415 | 海康威视 | 1,995,148.00 | 0.66            |
| 4  | 000002 | 万科 A | 1,744,846.00 | 0.57            |
| 5  | 600048 | 保利地产 | 1,697,561.00 | 0.56            |
| 6  | 601888 | 中国国旅 | 1,438,569.00 | 0.47            |
| 7  | 600779 | 水井坊  | 1,422,069.00 | 0.47            |
| 8  | 600028 | 中国石化 | 1,399,111.00 | 0.46            |
| 9  | 600004 | 白云机场 | 1,152,692.50 | 0.38            |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 1,076,800.00 | 0.35            |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 11 | 600600 | 青岛啤酒  | 1,053,508.00 | 0.35 |
| 12 | 000338 | 潍柴动力  | 1,048,635.00 | 0.35 |
| 13 | 601288 | 农业银行  | 1,035,000.00 | 0.34 |
| 14 | 601939 | 建设银行  | 1,024,200.00 | 0.34 |
| 15 | 000333 | 美的集团  | 998,362.28   | 0.33 |
| 16 | 600036 | 招商银行  | 997,762.00   | 0.33 |
| 17 | 600887 | 伊利股份  | 997,632.00   | 0.33 |
| 18 | 002304 | 洋河股份  | 997,417.00   | 0.33 |
| 19 | 600585 | 海螺水泥  | 997,325.00   | 0.33 |
| 20 | 000858 | 五 粮 液 | 994,938.00   | 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。

#### 7.4.2 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  | 601318 | 中国平安 | 6,998,490.00 | 2.30           |
| 2  | 600048 | 保利地产 | 5,750,404.00 | 1.89           |
| 3  | 600009 | 上海机场 | 3,982,500.00 | 1.31           |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 3,888,092.00 | 1.28           |
| 5  | 600332 | 白云山  | 3,839,171.50 | 1.26           |
| 6  | 600887 | 伊利股份 | 3,727,811.92 | 1.23           |
| 7  | 600741 | 华域汽车 | 2,781,121.00 | 0.92           |
| 8  | 002415 | 海康威视 | 2,480,000.00 | 0.82           |
| 9  | 601888 | 中国国旅 | 1,530,532.35 | 0.50           |
| 10 | 600028 | 中国石化 | 1,381,094.00 | 0.45           |
| 11 | 601600 | 中国铝业 | 1,284,293.00 | 0.42           |
| 12 | 600600 | 青岛啤酒 | 1,109,470.00 | 0.37           |
| 13 | 600019 | 宝钢股份 | 1,073,592.00 | 0.35           |
| 14 | 600004 | 白云机场 | 1,006,526.86 | 0.33           |
| 15 | 601288 | 农业银行 | 982,434.00   | 0.32           |
| 16 | 000002 | 万 科A | 938,374.00   | 0.31           |
| 17 | 002304 | 洋河股份 | 816,727.10   | 0.27           |
| 18 | 600138 | 中青旅  | 762,222.06   | 0.25           |
| 19 | 002008 | 大族激光 | 633,594.97   | 0.21           |
| 20 | 601933 | 永辉超市 | 611,936.00   | 0.20           |

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 | 57,361,266.93 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 58,986,645.67 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 41,011,798.00  | 20.23        |
|    | 其中：政策性金融债 | 41,011,798.00  | 20.23        |
| 4  | 企业债券      | 101,941,000.00 | 50.28        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 69,403,000.00  | 34.23        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,058,160.00   | 0.52         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 213,413,958.00 | 105.26       |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称         | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 180406    | 18 农发 06     | 200,000 | 20,512,000.00 | 10.12        |
| 2  | 122436    | 15 远洋 02     | 200,000 | 19,558,000.00 | 9.65         |
| 3  | 180204    | 18 国开 04     | 100,000 | 10,251,000.00 | 5.06         |
| 4  | 018005    | 国开 1701      | 102,100 | 10,248,798.00 | 5.05         |
| 5  | 101800154 | 18 外滩 MTN001 | 100,000 | 10,113,000.00 | 4.99         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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万华化学（600309）于 2017 年 7 月 6 日公告称，公司在大修停车处理过程中，MDI 缓冲罐发生爆炸，造成 4 人死亡、4 人受伤，直接经济损失 573.62 万元。经烟台市政府调查，认定该次事故是一起较大生产安全责任事故。烟台市安监局对万华化学公司负责人处上一年收入 40% 的罚款，对万华化学公司处以 80 万元罚款。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是国内 MDI 制造龙头企业，亚洲最大的 MDI 制造企业。公司盈利能力强，十月份聚合 MDI 直销价格和纯 MDI 价格上涨，将实质拉动原材料价差，业绩有望继续提升。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。

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。

其余八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   | 50,992.54     |
| 2  | 应收证券清算款 | 19,169,664.62 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 3,676,090.23  |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 22,896,747.39 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 113011 | 光大转债 | 253,700.00 | 0.13         |

**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

| 份额级别          | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例  | 持有份额      | 占总份<br>额比例 |
| 海富通欣<br>益混合 A | 191          | 474,328.83       | 90,576,086.9<br>6  | 99.98%      | 20,720.32 | 0.02%      |
| 海富通欣<br>益混合 C | 36           | 2,916,192.4<br>0 | 104,980,023.<br>26 | 100.00<br>% | 2,903.20  | 0.00%      |
| 合计            | 227          | 861,584.73       | 195,556,110.<br>22 | 99.99%      | 23,623.52 | 0.01%      |

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

| 项目                   | 份额级别      | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从<br>业人员持有本基金 | 海富通欣益混合 A | 97.64     | 0.0001%  |
|                      | 海富通欣益混合 C | 9.85      | 0.0000%  |
|                      | 合计        | 107.49    | 0.0001%  |

**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  | 份额级别      | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|-----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、<br>基金投资和研部门<br>负责人持有本开放式<br>基金 | 海富通欣益混合 A | 0                 |
|   | 海富通欣益混合 C | 0                 |
|   | 合计        | 0                 |
| 本基金基金经理持有                                 | 海富通欣益混合 A | 0                 |

|        |           |   |
|--------|-----------|---|
| 本开放式基金 | 海富通欣益混合 C | 0 |
|        | 合计        | 0 |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 海富通欣益混合 A      | 海富通欣益混合 C      |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016 年 9 月 7 日）基金份额总额 | 350,101,283.31 | 50,024,182.89  |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 183,588,692.34 | 99,915,066.58  |
| 本报告期基金总申购份额                   | 90,604,977.36  | 42,537,311.54  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 183,596,862.42 | 37,469,451.66  |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 90,596,807.28  | 104,982,926.46 |

注：总申购份额含红利再投、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 |    |
| 长江证券      | 1      | 54,549,345.18 | 46.96%       | 50,801.73 | 47.27%     | -  |
| 海通证券      | 2      | 29,032,185.59 | 25.00%       | 26,987.67 | 25.11%     | -  |
| 国泰君安      | 2      | 18,364,750.86 | 15.81%       | 16,735.90 | 15.57%     | -  |
| 东方证券      | 2      | 14,204,960.18 | 12.23%       | 12,945.11 | 12.05%     | -  |
| 光大证券      | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投      | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券      | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 平安证券      | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源(原申万) | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券      | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券      | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券      | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中金公司      | 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，退租德邦证券 1 只交易单元，江海证券 1 只交易单元，中信证券 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 |              |
|------|----------------|--------------|------------------|--------------|------|--------------|
|      | 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 |
| 长江证券 | 15,110,705.00  | 12.14%       | 1,295,500,000.00 | 69.09%       | -    | -            |
| 海通证券 | 100,680,298.10 | 80.86%       | 555,100,000.00   | 29.60%       | -    | -            |
| 国泰君安 | 8,725,154.37   | 7.01%        | 24,500,000.00    | 1.31%        | -    | -            |
| 东方证券 | -              | -            | -                | -            | -    | -            |
| 光大证券 | -              | -            | -                | -            | -    | -            |
| 中信建投 | -              | -            | -                | -            | -    | -            |
| 兴业证券 | -              | -            | -                | -            | -    | -            |
| 平安证券 | -              | -            | -                | -            | -    | -            |
| 申万   | -              | -            | -                | -            | -    | -            |

|                     |   |   |   |   |   |   |
|---------------------|---|---|---|---|---|---|
| 宏源<br>(原<br>申<br>万) |   |   |   |   |   |   |
| 国金<br>证券            | - | - | - | - | - | - |
| 华创<br>证券            | - | - | - | - | - | - |
| 川财<br>证券            | - | - | - | - | - | - |
| 中金<br>公司            | - | - | - | - | - | - |
| 国元<br>证券            | - | - | - | - | - | - |
| 太平<br>洋证<br>券       | - | - | - | - | - | - |
| 华泰<br>证券            | - | - | - | - | - | - |
| 招商<br>证券            | - | - | - | - | - | - |

### 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》 | 2018-01-01 |
| 2  | 海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告                            | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-01-08 |
| 3  | 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                          | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-01-09 |
| 4  | 海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告                            | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-01-29 |
| 5  | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告                  | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-02-02 |
| 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 | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-03-30 |



|    |   |                        |            |
|----|---|------------------------|------------|
|    | 公告  |                        |            |
| 9  | 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                            | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-04-11 |
| 10 | 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                            | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-05-05 |
| 11 | 海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告                              | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-05-15 |
| 12 | 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金第一次分红公告                             | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 | 2018-06-07 |
| 13 | 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》 | 2018-06-30 |

## §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              | 2018/1/1-2018/6/30     | 99,911,349.90 | 5,068,673.36 | -             | 104,980,023.26 | 53.68% |
|       | 2              | 2018/1/1-2018/1/8      | 84,205,357.14 | -            | 84,205,357.14 | 0.00           | 0.00%  |
|       | 3              | 2018/1/1-2018/1/4      | 99,205,357.14 | -            | 99,205,357.14 | 0.00           | 0.00%  |

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

#### 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 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，中国证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欣益灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通欣益灵活配置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) 报告期内海富通欣益灵活配置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