

**海富通国策导向混合型证券投资基金**  
**2017 年年度报告摘要**  
**2017 年 12 月 31 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	海富通国策导向混合
基金主代码	519033
交易代码	519033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 16 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	208,552,319.28 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将从受益于国家政策,尤其是产业政策的行业中,精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极投资,同时辅以适度的资产配置,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将以政策受益作为投资主线,资产配置将利用多因素分析,着重考虑国家的宏观经济政策影响,如财政政策和货币政策等;行业配置与个股精选将着重以国家的产业政策为主要考虑因素,深入挖掘受益于国家政策的上市公司的价值。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566

传真	021-33830166	010-66594942
----	--------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	16,714,570.72	-8,132,446.58	59,457,012.95
本期利润	51,980,689.51	-34,018,275.04	740,468.41
加权平均基金份额本期利润	0.2550	-0.1274	0.0042
本期基金份额净值增长率	26.89%	-13.85%	-17.75%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2593	0.1486	0.7966
期末基金资产净值	304,093,381.30	262,243,759.36	202,342,435.80
期末基金份额净值	1.458	1.149	1.946

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.69%	1.51%	-0.34%	0.66%	-1.35%	0.85%
过去六个月	18.15%	1.72%	4.04%	0.59%	14.11%	1.13%
过去一年	26.89%	1.45%	9.00%	0.54%	17.89%	0.91%
过去三年	-10.09%	1.98%	7.93%	1.37%	-18.02%	0.61%
过去五年	112.10%	1.89%	45.21%	1.24%	66.89%	0.65%
自基金合同生效起至今	112.74%	1.76%	35.07%	1.21%	77.67%	0.55%

#### 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

海富通国策导向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的历史走势对比图  
 (2011年11月16日至2017年12月31日)

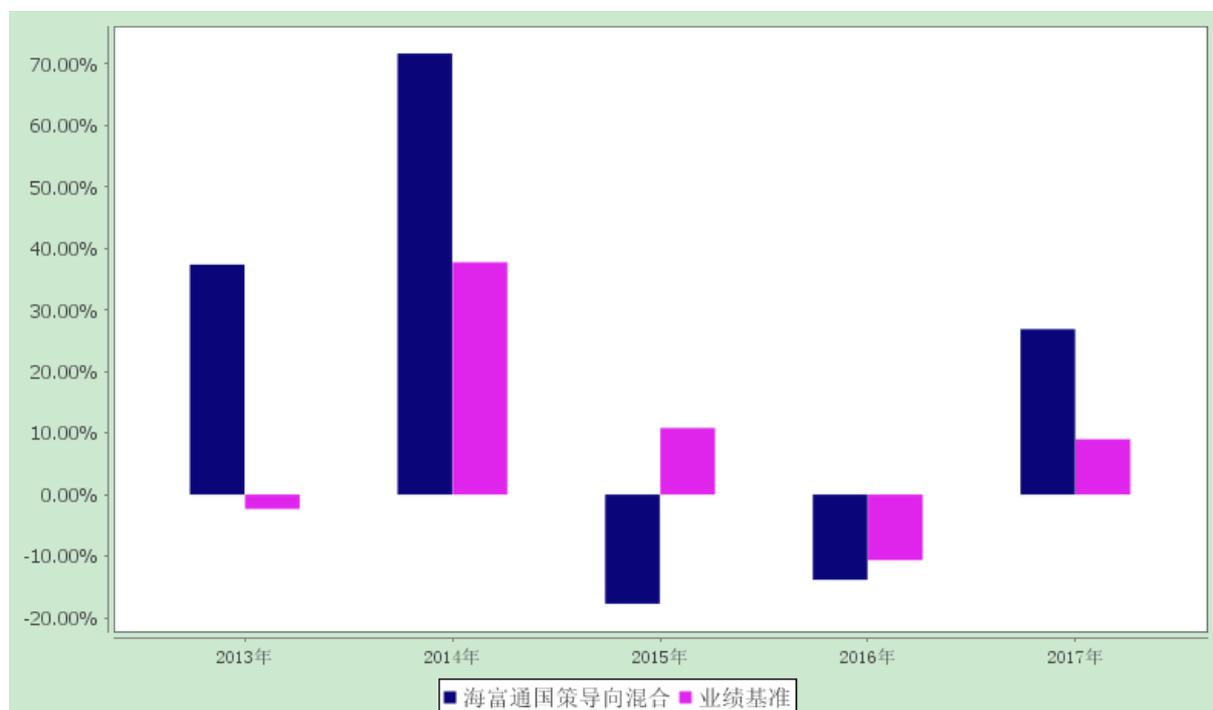


注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（二）投资范围、（七）投资限制中规定的各项比例。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通国策导向混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	5.670	1,717,658,673.71	16,217,883.98	1,733,876,557.69	-
2015 年	-	-	-	-	-
合计	5.670	1,717,658,673.71	16,217,883.98	1,733,876,557.69	-

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 52 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣盛定期开放混合型证券投资基金、海富通富源债券型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通欣悦灵活配置混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福一年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施敏佳	本基金的基	2016-02-02	-	6 年	硕士，持有基金

	金经理；海富通风格优势混合基金经理；海富通中小盘混合基金经理。				从业人员资格证书。2006年8月至2009年5月任普华永道中天会计师事务所有限公司高级审计员，2009年5月至2011年1月任展讯通信(上海)有限公司内审主管，2011年1月至2013年6月任东方证券股份有限公司分析师，2013年6月加入海富通基金管理有限公司，担任股票分析师。2015年10月起任海富通风格优势混合基金经理。2016年2月起兼任海富通国策导向混合基金经理。2017年6月起兼任海富通中小盘混合基金经理。
李志	本基金的基金经理助理；海富通精选混合基金经理助理；海富通收益增长混合基金经理助理；海富通股票混合基金经理助理；海富通强化回报混合基金经理助理；海富通风格优势混合基金经	2016-07-14	2017-05-15	7年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任上海申银万国证券研究所有限公司助理分析师，汇丰晋信基金管理有限公司研究员，2015年12月加入海富通基金管理有限公司，任股票相对收益组合部分分析师。2016年7月至2017年5月任海富通精选混合、海富通收益增长

	理助理；海富通精选贰号混合基金经理助理；海富通领先成长混合基金经理助理；海富通中小盘混合基金经理助理；海富通内需热点混合基金经理助理；海富通改革驱动混合基金经理助理。				混合、海富通股票混合、海富通强化回报混合、海富通风格优势混合、海富通精选贰号混合、海富通领先成长混合、海富通中小盘混合、海富通国策导向混合、海富通内需热点混合和海富通改革驱动混合的基金经理助理。2017年5月起任海富通领先成长混合基金经理。
陶敏	本基金的基金经理助理；海富通精选混合基金经理助理；海富通股票混合基金经理助理；海富通收益增长混合基金经理助理；海富通强化回报混合基金经理助理；海富通风格优势混合基金经理助理；海富通精选贰号混合基金经理助理；海富通领先成长混合基金经理助理；海富通中小盘混合基金经理助理；海富	2017-06-01	-	12年	工商管理硕士。持有基金从业人员资格证书。2004年7月至2008年8月任华泰柏瑞基金管理有限公司基金清算与注册登记经理，2010年7月至2015年7月任光大保德信基金管理有限公司行业研究员和策略研究员。2015年7月加入海富通基金管理有限公司，历任权益投资部行业研究员、周期组组长。2017年6月起任海富通精选混合、海富通收益增长混合、海富通股票混合、海富通强化回报混合、海富通风格优势混合、海富通精选贰号混

	通内需热点混合基金经理助理；海富通改革驱动混合基金经理助理				合、海富通领先成长混合、海富通中小盘混合、海富通国策导向混合、海富通内需热点混合和海富通改革驱动混合的基金经理助理。
--	-------------------------------	--	--	--	------------------------------------------------------------

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 公平交易制度和控制方法

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3

日内、5 日内) 公司管理的不同投资组合间交易的样本, 对其进行了 95% 置信区间, 假设溢价率为 0 的 T 分布检验, 结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明, 报告期内公司对旗下各投资组合公平对待, 不存在利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2017 年, A 股市场整体“稳中有进”, 但分化较为显著, 各大指数的表现也很好的反映了这一点。2017 年以上证 50 为代表的大盘蓝筹股高歌猛进, 全年累计上涨 25.08%, 而创业板指则一路震荡, 最终仍下跌 10.67%。同期上证综指上涨 6.56%, 深证成指和中小板指分别上涨 8.48% 和 16.73%。

金融监管是 2017 年 A 股市场最重要的政策变量, 在防风险、去杠杆、“脱虚向实”等的导向之下, 再融资新规、减持新规等相继发布, 高杠杆收购、操纵股价等违规行为也受到了严厉的处罚, IPO 提速的同时也加强了审核的力度。2017 年的 A 股市场也在不断探索前进, 6 月 A 股被正式纳入 MSCI, 进一步与国际市场接轨。

回顾全年的走势, 年初以来, 沪深股指维持小幅震荡上行的行情。上证 50 和沪深 300 上涨超过 20%, 但大部分个股却损失惨重。二季度初始雄安新区概念引发了市场的高度关注, 带动指数持续上涨, 整体呈现先抑后扬的走势。白马龙头股继续上攻, 创业板和次新股出现大幅调整, 市场呈现明显的“一九行情”。三季度市场整体恢复震荡上行趋势, 热点层出不穷, 市场情绪较二季度有所回暖, 大盘蓝筹依然备受青睐, 周期股也强势爆发。但后续上涨乏力, 利率中枢不断抬升导致估值预期出现调整, 资金追高动能不足, 叠加临近年底机构获利了结等因素, 大消费板块集体回调, 带动指数快速下跌。最终上证综指收于 3307.17 点, 深证成指收于 11040.45 点, 中小板指和创业板指报 7554.86 点和 1752.65 点。

板块方面, 在中信证券 29 个一级行业分类中, 半数飘红, 其中食品饮料 (55.72%)、家电 (36.64%)、煤炭 (29.34%)、银行 (27.81%) 和非银行金融 (18.53%) 涨幅居前, 纺织服装 (-22.77%)、传媒 (-20.35%)、国防军工 (-18.61%)、计算机 (-17.49%) 和轻工制造 (-13.13%) 跌幅居前。

在全年的操作中, 本基金陆续重点配置了新能源汽车、电子等行业, 取得了一定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为 26.89%，同期基金业绩比较基准收益率为 9.00%，基金净值跑赢业绩比较基准 17.89 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

展望 2018 年全年，预计中国经济仍将保持较好韧性，虽然地产和基建的小幅回落、2+26 城环保限产对短期经济会带来小幅下行压力，但居民消费稳中升级、全球经济复苏带来外需稳中向好、制造业投资提升均是经济增长的重要支撑。通胀水平总体平稳、温和，物价结构可能出现新的分化，PPI 对 CPI 的传导、大宗商品如石油、农产品等可能成为新的涨价因素，要警惕通胀走高的风险。而房地产相关的价格上涨、供给侧改革触发的价格波动可能有所弱化。

宏观政策方面，积极的财政政策取向不变，但会调整优化财政支出结构；稳健的货币政策要保持中性，管住货币供给总闸门；守住不发生系统性金融风险的底线；结构性政策要发挥更大作用，更好地服务实体经济。因此，金融监管仍然是全年的主线，而更好地服务和促进实体经济是目前宏观监管政策的主要目标。

2017 年，泛消费、大金融、周期品行业及白马蓝筹表现较好，这与经济平稳复苏、企业业绩改善、金融监管抑制高估值成长股泡沫是密切相关的。2018 年全年，我们仍看好股票市场的表现，主要的逻辑是从盈利、估值、流动性三要素来看，A 股企业盈利稳定增长，估值在全球来看并不贵，流动性虽然受金融监管影响，整体货币环境不宽松，但理财新规带来的资产配置转向可能给股票市场带来新的增量。我们预计价值投资仍是市场的主线。市场将继续围绕业绩增长、价值发现的方向进行演绎。投资策略来看：第一，由于新增资金（海外资金和理财资金）的属性偏好低估值高分红的品种，因此，低估值品种的价值提升和重估可能是全年的主线逻辑；第二，目前各传统、新兴行业均显著出现龙头企业竞争力突出、市场占有率不断提升的状况，而且大部分龙头的估值依然具备优势（相对于行业内的非龙头公司），因此优选龙头依然是较好的策略之一；第三，随着经济复苏进入第三年，我们可以去挖掘较晚进入复苏周期或行业复苏可持续的细分行业和个股，也可关注全球经济回暖引发通胀中枢的回升的涨价机会；第四，我们可以在调整时间较长、未来符合经济转型或政策鼓励方向的“偏成长”的细分行业加大挖掘、配置力度，十九大报告、中央经济工作会议文件已经给出了很好的方向指引。

在新的一年里，本基金操作上仍将自下而上精选优质成长股，除了关注热点行业诸如新能源汽车产业链、风电产业链的配置机会外，也会关注计算机、传媒、机械、电子、化工等领域内估值合理的潜力成长股。

#### 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期末可供分配利润的 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。

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

本基金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”）在海富通国策导向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《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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：海富通国策导向混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	20,811,579.35	33,893,485.54
结算备付金	1,924,017.28	2,368,197.45
存出保证金	173,034.82	178,853.04
交易性金融资产	283,267,752.34	217,726,294.56
其中：股票投资	282,845,852.34	217,726,294.56
基金投资	-	-
债券投资	421,900.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	5,860,247.18	14,968,938.47

应收利息	4,573.27	6,788.99
应收股利	-	-
应收申购款	90,048.59	9,244.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	312,131,252.83	269,151,802.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,214,941.21	5,238,559.91
应付赎回款	857,209.21	48,891.97
应付管理人报酬	387,995.10	363,849.71
应付托管费	64,665.85	60,641.61
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,140,175.32	826,034.23
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	372,884.84	370,065.41
负债合计	8,037,871.53	6,908,042.84
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	208,552,319.28	228,317,259.87
未分配利润	95,541,062.02	33,926,499.49
所有者权益合计	304,093,381.30	262,243,759.36
负债和所有者权益总计	312,131,252.83	269,151,802.20

注: 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.458 元, 基金份额总额 208,552,319.28 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通国策导向混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>64,048,022.90</b>	<b>-21,336,888.17</b>
1.利息收入	193,642.00	1,246,752.51
其中：存款利息收入	193,611.13	1,246,752.51
债券利息收入	30.87	-
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）	28,319,502.27	-1,129,528.65
其中：股票投资收益	26,733,839.27	-2,049,895.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	78.05	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,585,584.95	920,366.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	35,266,118.79	-25,885,828.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	268,759.84	4,431,716.43
<b>减：二、费用</b>	<b>12,067,333.39</b>	<b>12,681,386.87</b>
1. 管理人报酬	3,997,569.22	5,352,587.12
2. 托管费	666,261.59	892,097.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,006,646.84	6,042,956.85
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-

6. 其他费用	396,855.74	393,745.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>51,980,689.51</b>	<b>-34,018,275.04</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>51,980,689.51</b>	<b>-34,018,275.04</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通国策导向混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	228,317,259.87	33,926,499.49	262,243,759.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,980,689.51	51,980,689.51
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）	-19,764,940.59	9,633,873.02	-10,131,067.57
其中：1.基金申购款	163,686,079.77	76,742,617.15	240,428,696.92
2.基金赎回款	-183,451,020.36	-67,108,744.13	-250,559,764.49
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）	208,552,319.28	95,541,062.02	304,093,381.30
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	103,962,368.13	98,380,067.67	202,342,435.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-34,018,275.04	-34,018,275.04
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）	124,354,891.74	1,703,441,264.55	1,827,796,156.29
其中：1.基金申购款	3,008,115,908.19	2,382,516,547.38	5,390,632,455.57
2.基金赎回款	-2,883,761,016.45	-679,075,282.83	-3,562,836,299.28
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）	-	-1,733,876,557.69	-1,733,876,557.69
五、期末所有者权益（基金净值）	228,317,259.87	33,926,499.49	262,243,759.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

海富通国策导向混合型证券投资基金(原海富通国策导向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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1339 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《海富通国策导向股票型证券投资基金基金合同》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 553,165,647.55 元,已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 421 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通国策导向股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 553,281,127.23 份基金份额,其中认购资金利息折合 115,479.68 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。

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

通国策导向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国策导向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》和《海富通国策导向混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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)。基金投资组合中股票、权证资产占基金资产的 60%~95%,其中权证投资占基金资产净值的 0%~3%,现金、债券、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,在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:MSCI 中国 A 股指数×80%+上证国债指数×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2018 年 3 月 23 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会(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》、《海富通国策导向混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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与最近一期年度报告相一致,本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年9月22日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中央国债登记结算有限责任公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人

所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 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。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,997,569.22	5,352,587.12
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,024,736.16	953,414.77

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	666,261.59	892,097.81

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31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	20,811,579.35	154,921.69	33,893,485.54	959,208.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
7.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128028	赣锋转债	2017-12-21	2018-01-19	老股东配债	100.00	100.00	4,219	421,900.00	421,900.00	-

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601600	中国铝业	2017-09-12	重大资产重组	6.67	2018-02-26	7.28	2,546,134	19,414,065.48	16,982,713.78	-
002919	名臣健康	2017-12-28	停牌自查	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
300364	中文在线	2017-12-28	重大事项	9.23	2018-01-05	10.00	561,997	5,692,248.44	5,187,232.31	-
300730	科创信息	2017-12-25	停牌自查	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 260,527,398.05 元，第二层次的余额为 22,740,354.29 元，无属于第三层次的余额。(2016 年 12 月 31 日：第一层次 175,305,949.42 元，第二层次 42,420,345.14 元，无属于第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	282,845,852.34	90.62
	其中：股票	282,845,852.34	90.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	421,900.00	0.14
	其中：债券	421,900.00	0.14
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,735,596.63	7.28
8	其他各项资产	6,127,903.86	1.96

9	合计	312,131,252.83	100.00
---	----	----------------	--------

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	5,890,559.82	1.94
B	采矿业	-	-
C	制造业	236,952,703.61	77.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,870,472.05	2.92
J	金融业	14,159,702.00	4.66
K	房地产业	8,434,210.10	2.77
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
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	8,489,738.36	2.79
S	综合	-	-
	合计	282,845,852.34	93.01

### 8.2.2 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。

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002202	金风科技	1,486,702	28,024,332.70	9.22
2	300274	阳光电源	1,483,580	27,846,796.60	9.16
3	002460	赣锋锂业	376,290	26,998,807.50	8.88
4	002531	天顺风能	3,285,800	26,614,980.00	8.75
5	300618	寒锐钴业	112,504	26,525,068.08	8.72
6	002456	欧菲科技	1,090,015	22,443,408.85	7.38
7	000651	格力电器	487,200	21,290,640.00	7.00
8	601600	中国铝业	2,546,134	16,982,713.78	5.58
9	000333	美的集团	262,000	14,522,660.00	4.78
10	601318	中国平安	157,900	11,049,842.00	3.63

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 网站的年度报告正文。

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动****8.4.1 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	603799	华友钴业	90,788,312.67	34.62
2	002460	赣锋锂业	85,149,211.64	32.47
3	002497	雅化集团	81,200,390.61	30.96
4	603993	洛阳钼业	77,734,608.30	29.64
5	002466	天齐锂业	69,749,880.41	26.60
6	300450	先导智能	66,319,573.48	25.29
7	600703	三安光电	47,497,398.68	18.11
8	002456	欧菲科技	45,856,464.66	17.49
9	601231	环旭电子	45,300,393.38	17.27
10	300618	寒锐钴业	43,219,472.16	16.48
11	002241	歌尔股份	39,203,412.65	14.95
12	000933	神火股份	38,950,624.08	14.85
13	600779	水井坊	38,744,616.95	14.77
14	300274	阳光电源	37,929,844.97	14.46
15	000807	云铝股份	34,432,307.25	13.13
16	603612	索通发展	33,662,573.34	12.84
17	601336	新华保险	33,489,988.20	12.77

18	002635	安洁科技	32,131,388.85	12.25
19	000651	格力电器	32,029,696.62	12.21
20	002531	天顺风能	31,843,973.72	12.14
21	600338	西藏珠峰	28,792,685.77	10.98
22	002202	金风科技	28,012,774.74	10.68
23	600104	上汽集团	27,667,564.39	10.55
24	300323	华灿光电	24,790,365.16	9.45
25	601318	中国平安	24,777,567.00	9.45
26	000858	五粮液	24,752,950.87	9.44
27	000333	美的集团	24,526,980.17	9.35
28	600884	杉杉股份	24,472,688.73	9.33
29	002714	牧原股份	22,178,008.48	8.46
30	603626	科森科技	21,188,073.32	8.08
31	601600	中国铝业	20,541,185.48	7.83
32	000049	德赛电池	20,338,647.50	7.76
33	603359	东珠景观	20,287,974.58	7.74
34	300136	信维通信	19,874,989.32	7.58
35	002597	金禾实业	19,822,057.36	7.56
36	300299	富春股份	18,785,132.82	7.16
37	601668	中国建筑	18,701,310.36	7.13
38	002236	大华股份	18,336,460.63	6.99
39	600507	方大特钢	17,591,338.29	6.71
40	600068	葛洲坝	17,549,344.26	6.69
41	000063	中兴通讯	17,326,217.00	6.61
42	601012	隆基股份	17,078,133.18	6.51
43	002008	大族激光	16,397,415.02	6.25
44	002384	东山精密	15,552,637.90	5.93
45	000002	万科 A	15,283,065.56	5.83
46	600362	江西铜业	15,243,142.95	5.81
47	002200	云投生态	15,129,603.72	5.77
48	000799	酒鬼酒	14,784,789.23	5.64
49	300238	冠昊生物	14,730,356.62	5.62
50	600595	中孚实业	14,655,900.00	5.59
51	600782	新钢股份	13,900,410.88	5.30
52	600808	马钢股份	13,502,189.00	5.15
53	600208	新湖中宝	12,908,627.00	4.92
54	002709	天赐材料	12,814,424.98	4.89
55	000878	云南铜业	12,608,514.30	4.81
56	002508	老板电器	12,540,607.12	4.78
57	600588	用友网络	12,386,160.99	4.72
58	300409	道氏技术	12,302,632.69	4.69
59	300115	长盈精密	12,258,807.30	4.67
60	601688	华泰证券	12,130,784.00	4.63
61	600036	招商银行	12,089,826.15	4.61

62	600967	内蒙一机	11,906,658.74	4.54
63	600141	兴发集团	11,746,125.44	4.48
64	000711	京蓝科技	11,608,336.70	4.43
65	000656	金科股份	11,474,512.93	4.38
66	300327	中颖电子	11,245,366.55	4.29
67	600309	万华化学	11,140,134.90	4.25
68	002035	华帝股份	11,047,887.80	4.21
69	002051	中工国际	10,901,806.34	4.16
70	600547	山东黄金	10,793,396.73	4.12
71	300457	赢合科技	10,754,467.38	4.10
72	002174	游族网络	10,573,065.78	4.03
73	002555	三七互娱	10,182,444.43	3.88
74	300433	蓝思科技	10,161,940.91	3.87
75	002234	民和股份	10,088,781.65	3.85
76	300308	中际旭创	9,984,689.81	3.81
77	002415	海康威视	9,812,977.00	3.74
78	000596	古井贡酒	9,739,029.72	3.71
79	600219	南山铝业	9,307,406.00	3.55
80	000065	北方国际	9,280,487.78	3.54
81	600282	南钢股份	8,943,911.80	3.41
82	300009	安科生物	8,878,154.59	3.39
83	601699	潞安环能	8,771,178.55	3.34
84	300303	聚飞光电	8,758,267.00	3.34
85	601222	林洋能源	8,475,347.93	3.23
86	002340	格林美	8,343,553.29	3.18
87	601155	新城控股	8,271,947.48	3.15
88	002458	益生股份	8,257,777.05	3.15
89	001979	招商蛇口	8,256,711.77	3.15
90	600741	华域汽车	8,187,762.99	3.12
91	300573	兴齐眼药	8,037,247.00	3.06
92	600132	重庆啤酒	8,020,424.52	3.06
93	600801	华新水泥	7,981,681.00	3.04
94	300418	昆仑万维	7,700,629.53	2.94
95	300242	明家联合	7,587,041.71	2.89
96	300447	全信股份	7,548,888.84	2.88
97	002036	联创电子	7,431,417.08	2.83
98	600499	科达洁能	7,342,329.00	2.80
99	000983	西山煤电	7,329,481.00	2.79
100	300699	光威复材	7,251,144.46	2.77
101	002746	仙坛股份	7,249,758.17	2.76
102	002640	跨境通	7,244,595.00	2.76
103	000338	潍柴动力	7,230,746.00	2.76
104	002717	岭南园林	7,228,779.98	2.76
105	600809	山西汾酒	7,221,694.23	2.75

106	000820	神雾节能	7,171,919.95	2.73
107	000928	中钢国际	7,150,150.08	2.73
108	300316	晶盛机电	7,091,147.00	2.70
109	600958	东方证券	7,015,492.00	2.68
110	300219	鸿利智汇	6,886,549.00	2.63
111	600750	江中药业	6,886,328.22	2.63
112	300197	铁汉生态	6,837,731.43	2.61
113	002431	棕榈股份	6,722,567.00	2.56
114	600569	安阳钢铁	6,705,223.08	2.56
115	600519	贵州茅台	6,683,862.00	2.55
116	300082	奥克股份	6,610,144.38	2.52
117	002745	木林森	6,591,316.00	2.51
118	603833	欧派家居	6,586,751.30	2.51
119	002475	立讯精密	6,478,754.00	2.47
120	601169	北京银行	6,418,236.00	2.45
121	002273	水晶光电	6,409,772.29	2.44
122	300070	碧水源	6,382,717.00	2.43
123	000980	众泰汽车	6,234,998.00	2.38
124	600030	中信证券	6,230,855.00	2.38
125	600651	飞乐音响	6,215,570.47	2.37
126	300577	开润股份	6,188,307.64	2.36
127	300364	中文在线	6,069,164.40	2.31
128	300568	星源材质	5,985,719.81	2.28
129	002601	龙麟佰利	5,949,935.25	2.27
130	600466	蓝光发展	5,929,561.00	2.26
131	600549	厦门钨业	5,888,826.55	2.25
132	000402	金融街	5,869,456.10	2.24
133	300648	星云股份	5,827,461.54	2.22
134	600231	凌钢股份	5,720,281.00	2.18
135	603358	华达科技	5,667,768.75	2.16
136	002624	完美世界	5,581,609.16	2.13
137	000408	藏格控股	5,492,103.00	2.09
138	002310	东方园林	5,473,736.00	2.09
139	600516	方大炭素	5,410,890.00	2.06
140	000825	太钢不锈	5,344,108.00	2.04
141	000568	泸州老窖	5,282,761.72	2.01

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。

#### 8.4.2 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	603799	华友钴业	101,601,748.94	38.74
2	603993	洛阳钼业	83,190,073.16	31.72
3	002497	雅化集团	78,728,648.42	30.02
4	002466	天齐锂业	75,552,194.17	28.81
5	300450	先导智能	73,711,718.30	28.11
6	002460	赣锋锂业	68,042,118.94	25.95
7	002635	安洁科技	54,729,082.30	20.87
8	600703	三安光电	49,188,802.98	18.76
9	601231	环旭电子	45,992,431.79	17.54
10	002241	歌尔股份	40,415,868.09	15.41
11	000933	神火股份	38,103,896.30	14.53
12	603612	索通发展	33,777,500.03	12.88
13	000807	云铝股份	33,609,850.93	12.82
14	300083	劲胜智能	31,586,581.37	12.04
15	601336	新华保险	31,559,730.46	12.03
16	600779	水井坊	30,003,245.06	11.44
17	600338	西藏珠峰	28,751,665.50	10.96
18	600104	上汽集团	28,139,952.09	10.73
19	300299	富春股份	27,198,366.68	10.37
20	300618	寒锐钴业	26,191,309.75	9.99
21	002456	欧菲科技	25,557,188.01	9.75
22	600884	杉杉股份	24,840,285.02	9.47
23	000858	五粮液	24,797,216.15	9.46
24	300323	华灿光电	23,851,035.20	9.09
25	600576	祥源文化	23,368,211.91	8.91
26	000018	神州长城	22,873,880.73	8.72
27	603626	科森科技	22,346,864.23	8.52
28	002234	民和股份	20,332,105.07	7.75
29	300238	冠昊生物	19,994,585.03	7.62
30	300136	信维通信	19,990,373.72	7.62
31	000049	德赛电池	19,975,659.75	7.62
32	002597	金禾实业	19,336,499.44	7.37
33	601012	隆基股份	18,809,849.49	7.17
34	002236	大华股份	18,163,960.12	6.93
35	600507	方大特钢	17,692,581.29	6.75
36	603359	东珠景观	17,683,175.95	6.74
37	601668	中国建筑	17,601,665.95	6.71
38	000063	中兴通讯	17,304,641.58	6.60
39	603658	安图生物	17,162,479.23	6.54
40	002008	大族激光	16,751,244.38	6.39
41	300115	长盈精密	16,442,932.21	6.27
42	002714	牧原股份	16,364,452.04	6.24

43	000002	万科 A	16,008,449.75	6.10
44	002458	益生股份	15,625,334.82	5.96
45	600068	葛洲坝	15,533,309.33	5.92
46	601318	中国平安	15,432,819.46	5.88
47	300447	全信股份	15,261,247.94	5.82
48	600362	江西铜业	15,255,075.23	5.82
49	000799	酒鬼酒	14,250,218.25	5.43
50	600595	中孚实业	14,073,560.20	5.37
51	002200	云投生态	14,067,286.76	5.36
52	002508	老板电器	13,356,259.78	5.09
53	600782	新钢股份	13,313,310.46	5.08
54	002709	天赐材料	13,161,366.86	5.02
55	600208	新湖中宝	12,792,643.16	4.88
56	600967	内蒙一机	12,359,729.68	4.71
57	600036	招商银行	12,324,016.77	4.70
58	600808	马钢股份	12,322,130.55	4.70
59	000333	美的集团	12,286,498.52	4.69
60	000878	云南铜业	12,012,817.30	4.58
61	600309	万华化学	11,977,229.00	4.57
62	000711	京蓝科技	11,878,717.82	4.53
63	601688	华泰证券	11,867,149.43	4.53
64	300409	道氏技术	11,783,651.04	4.49
65	300274	阳光电源	11,421,532.20	4.36
66	002035	华帝股份	11,259,366.54	4.29
67	300011	鼎汉技术	11,252,118.98	4.29
68	600141	兴发集团	11,100,589.03	4.23
69	000651	格力电器	11,060,766.24	4.22
70	000656	金科股份	10,963,334.08	4.18
71	600547	山东黄金	10,740,445.99	4.10
72	002384	东山精密	10,706,085.61	4.08
73	300308	中际旭创	10,674,537.81	4.07
74	300457	赢合科技	10,598,562.03	4.04
75	300433	蓝思科技	10,529,526.32	4.02
76	300327	中颖电子	10,441,078.46	3.98
77	603160	汇顶科技	10,356,361.23	3.95
78	000596	古井贡酒	9,944,978.10	3.79
79	002555	三七互娱	9,918,072.02	3.78
80	002340	格林美	9,100,463.93	3.47
81	300303	聚飞光电	9,082,057.21	3.46
82	600282	南钢股份	9,034,944.00	3.45
83	002051	中工国际	9,011,372.70	3.44
84	300009	安科生物	8,992,950.94	3.43
85	000065	北方国际	8,972,976.32	3.42
86	601699	潞安环能	8,950,250.15	3.41

87	600219	南山铝业	8,918,995.77	3.40
88	300573	兴齐眼药	8,222,386.33	3.14
89	002108	沧州明珠	8,195,730.69	3.13
90	600499	科达洁能	8,117,975.00	3.10
91	001979	招商蛇口	8,114,908.93	3.09
92	300418	昆仑万维	8,091,486.90	3.09
93	600801	华新水泥	8,052,184.69	3.07
94	600741	华域汽车	8,018,988.32	3.06
95	600132	重庆啤酒	7,902,385.43	3.01
96	300456	耐威科技	7,830,137.73	2.99
97	000338	潍柴动力	7,559,108.14	2.88
98	002036	联创电子	7,538,537.93	2.87
99	300316	晶盛机电	7,234,135.00	2.76
100	000983	西山煤电	7,224,024.27	2.75
101	300699	光威复材	7,185,976.00	2.74
102	600809	山西汾酒	7,181,711.58	2.74
103	300197	铁汉生态	7,169,742.07	2.73
104	002717	岭南园林	7,163,635.18	2.73
105	000820	神雾节能	7,143,427.49	2.72
106	300219	鸿利智汇	7,095,266.82	2.71
107	300242	明家联合	7,056,837.16	2.69
108	002174	游族网络	7,056,238.09	2.69
109	002640	跨境通	7,007,922.20	2.67
110	600519	贵州茅台	6,962,986.64	2.66
111	600750	江中药业	6,932,795.52	2.64
112	002431	棕榈股份	6,918,788.50	2.64
113	002531	天顺风能	6,883,514.00	2.62
114	002746	仙坛股份	6,827,245.28	2.60
115	000980	众泰汽车	6,735,283.54	2.57
116	600958	东方证券	6,707,023.00	2.56
117	002475	立讯精密	6,686,609.76	2.55
118	600569	安阳钢铁	6,676,442.68	2.55
119	002102	冠福股份	6,607,311.71	2.52
120	300496	中科创达	6,604,217.98	2.52
121	300082	奥克股份	6,533,326.22	2.49
122	601169	北京银行	6,488,695.50	2.47
123	000928	中钢国际	6,437,298.00	2.45
124	002745	木林森	6,417,627.14	2.45
125	600030	中信证券	6,391,348.32	2.44
126	300577	开润股份	6,359,045.95	2.42
127	300207	欣旺达	6,346,277.38	2.42
128	002273	水晶光电	6,322,903.01	2.41
129	600651	飞乐音响	6,314,562.00	2.41
130	000639	西王食品	6,253,801.63	2.38

131	300070	碧水源	6,249,057.44	2.38
132	600588	用友网络	6,195,331.18	2.36
133	603833	欧派家居	6,177,952.85	2.36
134	300141	和顺电气	6,008,005.93	2.29
135	600466	蓝光发展	5,935,079.01	2.26
136	300568	星源材质	5,896,270.18	2.25
137	600549	厦门钨业	5,849,245.00	2.23
138	002601	龙蟠佰利	5,784,023.46	2.21
139	600231	凌钢股份	5,761,459.00	2.20
140	000568	泸州老窖	5,480,794.82	2.09
141	002624	完美世界	5,458,539.09	2.08
142	002078	太阳纸业	5,423,419.00	2.07
143	002310	东方园林	5,420,693.54	2.07
144	600516	方大炭素	5,392,903.99	2.06
145	300648	星云股份	5,372,237.00	2.05
146	002507	涪陵榨菜	5,368,608.15	2.05
147	600919	江苏银行	5,366,020.55	2.05
148	000408	藏格控股	5,357,267.00	2.04
149	600138	中青旅	5,354,083.00	2.04
150	300566	激智科技	5,338,565.90	2.04
151	000402	金融街	5,321,724.48	2.03
152	603358	华达科技	5,262,428.52	2.01

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。

#### 8.4.3 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	2,846,788,582.21
卖出股票的收入（成交）总额	2,843,668,982.49

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。

#### 8.5 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	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	421,900.00	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	421,900.00	0.14

### 8.6 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	128028	赣锋转债	4,219	421,900.00	0.14

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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投资。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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合约。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

**8.11.2 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。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 报告期内本基金投资的赣锋锂业（002460）于 2017 年 4 月 23 日公告称，公司在经营过程中从未取得工业盐酸生产许可证的供应商处采购工业盐酸，违反了有关规定，收到新余市市场和质量监督管理局的《行政处罚决定书》。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是中国深加工锂产品行业的龙头企业，是全球最大的金属锂生产供应商，已经申请国家专利 38 项，拥有非专利技术近百项，主持制定和修订国家标准 3 项。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。

**8.12.2** 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。

**8.12.3 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	173,034.82
2	应收证券清算款	5,860,247.18
3	应收股利	-
4	应收利息	4,573.27
5	应收申购款	90,048.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,127,903.86

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601600	中国铝业	16,982,713.78	5.58	重大资产重组

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
11,997	17,383.71	83,437,977.24	40.01%	125,114,342.04	59.99%

**9.2 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	64,117.33	0.0307%

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2011 年 11 月 16 日)基金份额总额	553,281,127.23
本报告期期初基金份额总额	228,317,259.87
本报告期基金总申购份额	163,686,079.77
减: 本报告期基金总赎回份额	183,451,020.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	208,552,319.28

注: 总申购份额含转换入份额, 总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2017 年 2 月 4 日, 海富通基金管理有限公司发布公告, 经公司第五届董事会第十次临时会议审议通过, 同意刘颂先生辞去公司总经理职务, 并决定由公司董事长张文伟先生代为履行总经理职务。

2、2017 年 9 月 13 日, 海富通基金管理有限公司发布公告, 经公司第五届董事会第五次会议审议通过, 聘任任志强先生担任公司总经理职务, 同时公司董事长张文伟先生不再代行总经理职务。

基金托管人:

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内, 本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 70,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的年限是 7 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	1,243,276,125.47	21.87%	900,361.21	24.61%	-
长江证券	1	1,025,565,002.01	18.04%	626,929.37	17.14%	-
申万宏源	2	927,897,160.25	16.32%	390,863.50	10.68%	-
渤海证券	1	914,604,212.59	16.09%	650,559.42	17.78%	-
上海证券	1	434,932,634.25	7.65%	405,053.69	11.07%	-
中信建投	2	357,410,869.06	6.29%	222,611.28	6.08%	-
银河证券	1	307,247,362.62	5.40%	157,096.04	4.29%	-
中金公司	2	189,915,701.60	3.34%	175,956.03	4.81%	-
华创证券	1	182,455,212.58	3.21%	75,043.84	2.05%	-
国金证券	1	101,944,907.50	1.79%	54,162.78	1.48%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增上海证券 1 个交易单元。

#### 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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期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
天风证券	4,078.40	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/1/1-2017/12/31	83,286,507.50	-	-	83,286,507.50	39.94%
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</p>							

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 56 只公募基金。截至 2017 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 507.14 亿元人民币。

2004 年末开始，海富通及子公司为 QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至 2017 年 12 月 31 日，投资咨询及海外业务规模超过 41 亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，截至 2017 年 12 月 31 日，海富通为近 80 家企业超过 376 亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，截至 2017 年 12 月 31 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 417 亿元。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 2 月，海富通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2016 年 3 月，国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通基金管理有限公司“固定收益投资金牛基金公司”。

海富通基金管理有限公司  
二〇一八年三月二十七日

