海富通大中华精选混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日
基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通大中华混合(QDII)
基金主代码	519602
交易代码	519602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月27日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	31,911,109.16份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	葛万荣	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 境外投资顾问和境外资产托管人

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

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

2.5 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	5,958,659.67
本期利润	1,980,170.98
加权平均基金份额本期利润	0.0504
本期基金份额净值增长率	5.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0612
期末基金资产净值	39,918,232.00
期末基金份额净值	1.251

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

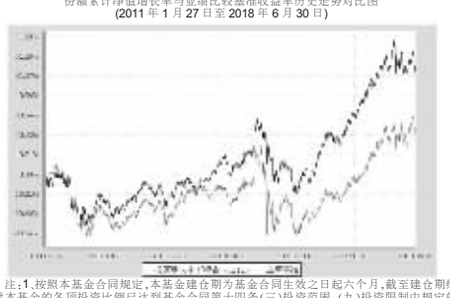
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.24%	1.12%	-1.07%	1.01%	1.31%	0.11%
过去三个月	6.11%	1.19%	1.36%	0.90%	4.75%	0.29%
过去六个月	5.66%	1.27%	-0.06%	1.09%	5.72%	0.18%
过去一年	23.01%	1.17%	11.89%	0.93%	11.12%	0.24%
过去三年	30.31%	1.62%	32.35%	1.05%	-2.04%	0.57%
自基金合同生效起至今	25.10%	1.41%	56.02%	1.06%	-30.92%	0.35%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通大中华精选混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年1月27日至2018年6月30日)



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

2.本基金按照全球投资表现标准(GIPS)计算和表述投资业绩。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准,由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司(现更名为"法国巴黎资产管理BE控股公司")于2003年4月1日共同发起设立。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理54只公募基金:海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安顺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、海富通纯合纯债债券型证券投资基金、海富通稳合型证券投资基金、海富通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)、海富通量化前锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张炳伟	本基金的基金经理;海富通强化回报混合基金经理;海富通中国海外混合(QDII)基金经理;海富通沪港深混合基金经理;海富通欣悦混合基金经理。	2016-02-04	-	9年	硕士,持有基金从业人员资格证书。曾任交银施罗德基金管理有限公司数量分析师,2011年7月加入海富通基金管理有限公司,任股票分析师。2015年6月起任海富通强化回报混合基金经理。2016年2月起兼任海富通大中华混合(QDII)和海富通中国海外混合(QDII)基金经理。2016年11月起兼任海富通沪港深混合基金经理。2017年7月起兼任海富通欣悦混合基金经理。
卜正伦	本基金的基金经理;海富通中国海外混合(QDII)基金经理	2016-08-16	-	13年	中国籍,硕士,持有基金从业人员资格证书。历任永丰金证券、富邦证券、海富通资产管理(香港)有限公司分析师。2016年8月起任海富通大中华混合(QDII)和海富通中国海外混合(QDII)基金经理。

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

2.证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

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

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

4.3 管理人对投资决策委员会、投资决策流程、决策依据、内部控制原则等情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和运作分析

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

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

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为5.66%,同期业绩比较基准收益率-0.06%,基金净值跑赢业绩比较基准5.72个百分点。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年下半年,中国经济将面临内外部压力的考验。内部考验主要来自于去杠杆政策延续对于实体部门信用收缩的压力,而外部考验主要来自于中美贸易争端的影响,以及美联储持续加息对于外汇部门和国内金融资产估值的压力。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配,但符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对海富通大中华精选混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:海富通大中华精选混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	20,249,842.59	5,940,656.19
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	33,136,413.50	45,520,851.12
其中:股票投资		33,136,413.50	45,520,851.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资			
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,421.32	566.25
应收股利		143,028.11	9,000.00
应收申购款		31,962.70	157,330.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		53,564,668.22	51,628,404.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,205,549.83	-
应付赎回款		11,222,195.30	512,514.82
应付管理人报酬		61,786.10	79,576.22
应付托管费		10,297.71	13,262.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	146,607.28	156,407.72
负债合计		13,646,436.22	761,761.50
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	31,911,109.16	42,977,639.17
未分配利润	6.4.7.10	8,007,122.84	7,889,003.43
所有者权益合计		39,918,232.00	50,866,642.60
负债和所有者权益总计		53,564,668.22	51,628,404.10

注:1.报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.251元,基金份额总额31,911,109.16份。

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

6.2 利润表

会计主体:海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		2,693,675.92	11,556,389.56
1.利息收入		15,376.38	5,878.58
其中:存款利息收入	6.4.7.11	15,376.38	5,878.58
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"号填列)		6,622,206.85	3,248,212.53
其中:股票投资收益	6.4.7.12	6,297,475.93	2,624,174.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益			
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	324,730.92	624,037.54
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	-3,978,488.69	8,330,892.16
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-13,484.14	-34,749.20
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	48,065.52	6,155.49
减:二、费用		713,504.94	977,791.00
1.管理人报酬		425,476.55	579,819.81
2.托管费		70,912.77	96,636.63
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	107,272.97	163,358.28
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用	6.4.7.19	109,842.65	137,976.28
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,980,170.98	10,578,598.56
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,980,170.98	10,578,598.56

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	42,977,639.17	7,889,003.43	50,866,642.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	1,980,170.98	1,980,170.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-11,066,530.01	-1,862,051.57	-12,928,581.58
其中:1.基金申购款	25,084,554.72	6,354,781.74	31,439,336.46
2.基金赎回款	-36,151,084.73	-8,216,833.31	-44,367,918.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	31,911,109.16	8,007,122.84	39,918,232.00

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	69,670,279.95	-9,668,246.35	60,002,033.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	10,578,598.56	10,578,598.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-3,056,287.94	190,841.88	-2,865,446.06
其中:1.基金申购款	5,412,325.21	-198,450.33	5,213,874.88
2.基金赎回款	-8,468,613.15	389,292.21	-8,079,320.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	66,613,992.01	1,101,194.09	67,715,186.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通大中华精选混合型证券投资基金(原名为海富通大中华精选股票型证券投资基金,以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1760号文核准,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币821,474,865.11元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第15号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》于2011年1月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为821,766,293.97份基金份额,其中认购资金利息折合291,428.86份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,海富通大中华精选股票型证券投资基金于2015年8月7日公告后更名为海富通大中华精选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金(ETF)等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以全球除内地股票市场以外的具有"大中华概念"上市公司为主要投资对象。"大中华概念"的股票需满足以下三个条件之一:1)上市公司注册在大中华区域(中国内地、香港、台湾、澳门);2)上市公司中最少百分之三十股权(占总股本)由大中华区域的股东持有;3)公司最近一个会计年度至少百分之五十之营业额来自大中华区域。本基金的投资比例为:股票及其他权益类证券占基金资产的60%-95%;现金、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%—40%,其中基金保留的现金的比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:MSCI金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于2018年8月24日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期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

本报告期在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(海富通")	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(中国银行")	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(中银香港")	基金境外资产托管人

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	425,476.55	579,819.81
其中:支付销售机构的客户维护费	152,784.17	193,084.71

注:支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.8%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.8%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,912.77	96,636.63

注:支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值X0.30%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
报告期初持有的基金份额	-	17,299,884.66
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	17,299,884.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	25.97%

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

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

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	14,280,742.88	14,474.73	12,938,485.81	5,877.00
中国银行(香港)	4,870,195.16	1.19	2,965,343.65	-

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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	33