海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF) 2018年年度报告摘要

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:二〇一九年三月三十日

§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2019年3月28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2018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	海富通聚优精选混合FOF
基金主代码	005220
交易代码	005220
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年11月6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	1,135,867,337.03份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制投资组合风险的前提下,优选基金投资组合,力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要投资于开放式股票型及混合型基金,构建本基金的核心组合,具体策略如下:首先,本基金在历届获得“中国基金业金牛奖”单只基金奖项的基金中筛选出所有开放式股票型基金和开放式混合型基金。然后,从收益能力、稳定性、风险水平和管理人角度对基金进行评分做二次筛选。最后,基金经理在金牛基金库中按照本基金的投资决策程序审核精选出一定数量的基金,并持续跟踪基金组合情况进行必要调整。另外,在管理人判断市场是否具有明显的趋势性投资机会的基础上,本基金适度投资其他类型基金,从而努力获取超额收益或降低组合风险。基于流动性管理和有效利用基金资产的需要,本基金将投资于流动性较好的固定收益类资产。在债券组合的具体构造和调整上,本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为基金中基金,不同于股票型基金、混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的预期收益和风险水平低于股票型FOF,高于债券型FOF与货币型FOF,属于较高风险、较高收益的基金品种。

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	http://www.hftfund.com
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	2018年	2017年11月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日
本期已实现收益	-89,626,823.36	3,347,494.19
本期利润	-248,111,352.86	-8,601,258.48
加权平均基金份额本期利润	-0.1908	-0.0042
本期基金份额净值增长率	-21.12%	-0.14%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2123	-0.0014
期末基金资产净值	894,713,079.11	1,911,816,828.36
期末基金份额净值	0.7877	0.9986

注:1、本期已实现收益指期基金本期利息收入、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)。

4、本基金合同生效日为2017年11月6日,合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

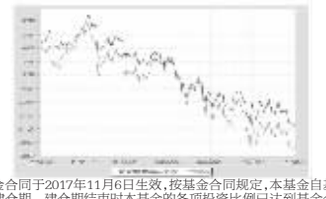
3.2 基金净值表现

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	-11.51%	1.45%	-8.29%	1.13%	-3.22%	0.32%
过去六个月	-14.61%	1.33%	-9.34%	1.04%	-5.27%	0.29%
过去一年	-21.12%	1.20%	-16.83%	0.93%	-4.29%	0.27%
自基金合同生效起至今	-21.23%	1.14%	-16.28%	0.89%	-4.95%	0.25%

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

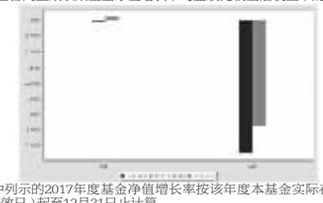
海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年11月6日至2018年12月31日)



注:本基金合同于2017年11月6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。

3.2.3 自基金合同生效以来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

海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:图中列示的2017年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期11月6日(基金合同生效日)起至12月31日止计算。

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
2018年	-	-	-	-	-
2017年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金合同于2017年11月6日生效,2017年及2018年均未实施利润分配。

§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12月31日,本基金管理人共管理58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、海富通精选或弓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、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)、海富通护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、上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金。

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		
孙陶然	本基金的基金经理	2017-11-06	2018-06-25	7年	斯坦福大学硕士,持有基金从业人员资格证书。2006年6月至2008年8月任职于美国纽约雷曼兄弟投资银行担任高级分析师。2008年8月至2010年8月任职于美国巴克莱银行担任助理副总裁。2010年10月至2012年10月任职于光大证券担任执行董事。2012年11月加入海富通基金管理有限公司,历任衍生品分析师、香港子公司投资顾问负责人。2017年11月至2018年6月任海富通聚优精选混合FOF基金经理。
姜萍	本基金的基金经理	2017-11-15	-	15年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任交通银行哈尔滨分行信贷业务科长、兴安证券研究发展部研究员、机构业务部高级项目经理、证券投资部投资经理助理,中信建投证券资产管理部FOF投资顾问、研究发展部基金分析师。2017年6月加入海富通基金管理有限公司,2017年11月起任海富通聚优精选混合FOF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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、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,保证本投资期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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同向交易的样本,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。

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,全球资产几乎都经历了大幅波动,剧烈程度堪比历史性表现。A股市场,贯穿全年最大的不确定是中美贸易谈判悬而未决,而国内主动去杠杆导致的信用收缩暂告一段落,7月之后国家推出一系列稳经济的政策组合,对冲经济下行压力,但股票市场在投资者悲观情绪下仍然超卖。

资产配置方面,我们积极配置于偏股混合型基金,仅配置4%多的国开债、期间或持有7%以内的可转债。按契约规定,本产品投资于股票型、混合型基金的占比不得低于70%、不投资ODII基金,主要聚焦精选股混基金,可用于投资债券基金的仓位比例在20%左右,如按2018年债券市场平均回报计,固收至少可贡献收益1.5%。

本基金没有配置债券基金的原因是,年初认为在金融去杠杆背景下,市场将面临货币政策边际收紧和金融严监管,预计利率高位,企业债务违约风险上升,而实际情况是信用债违约潮确实出现,但中美贸易战的突发因素打破了原有的紧缩节奏,央行保持了货币独立性没有跟随美联储加息,年内通过多次降准增加流动性以稳定国内经济,并容忍人民币汇率适度贬值(我国外债较低,有3万多亿美元外储支撑,决定了人民币汇率无大幅贬值之虞)。由于货币政策传导机制一时受阻,银行间流动性充裕与实体经济流动性不足并存,与之对照为利率债结构牛市与股市的股权质押爆仓两极分化,而我们对此变化预判不足,没有在2-4月份,配置债券基金的较佳时机,加大对债券资产的投资比例。

下半年,叠加海外市场波动和经济下行压力有所显现,债券作为“避险资产”则是赚投资者避险情绪的钱了,而股票持续回调,估值接近历史低位,具有持续分红能力的公司股息率已超过国债收益率,配置价值又开始倾向于优质的股票资产。

如前所述,鉴于2018全年资产价格大幅波动对潜在投资价值的重置,上半年买入股票资产与下半年卖出犯错的几率都会很高。因为股票估值压缩比较扎实,特别是7月份后,宏观政策逆周期调节效果一旦出现边际改善,市场存在大幅下跌后风险偏好修复的机会。

本基金应对策略是基于蓝筹股估值趋甚至低估的判断,保持仓位基本稳定不做过多择时,聚焦结构调整和精选基金,对子基金既频换手,调整子基金的依据主要来自于资产估值比较、基本面的确定性和前景、基金经理的变化,以及应对本基金赎回的流动性安排。

投资者可以通过以往季报了解我们的逻辑,总体而言,一月份大比例减持了市场热捧的消费品基金,陆续增加低估值金融资产、高股息资源品基金的配置。但不理想的是,市场正担心去杠杆环境下金融企业的资产质量问题,市场价格继续予以净资产折扣,下半年相对高点减持了重仓医药的子基金,增持政策受益、预期改善、极具估值优势的基金,以及加回估值回落、基本面更确定的消费品基金。

但市场单边下跌持续到年底,本基金净值波动较大的10月份、12月份,主要是由银行保险、消费品等蓝筹白马股的恐慌性下跌造成,全年较业绩基准有一定差距。我们认为,投资仍在波动中前进,以2018年极端的单一市场风格评价结果过于短期,在爱国者的人眼里可能只是其中一个小浪花,忽略短期可承受的波动,更关注如何借助市场给予的历史性低估机会,为未来行情好转进行甄别布局。

狭义的股债汇资产配置投资周期一般是3-5年,如果从PE、产业周期、房地产、大宗商品的角度甚至更长,10-20年才能正确评价资产配置的结果。活跃的资本市场不会给我们那么奢侈的检验时间,但3年也应该是基本时限,最好是5年以上。这也是现在很多定开基金设定的一个时间,大体给出一个反映比较全面的投资周期。定开型产品制度性安排规避了投资者的追涨杀跌,而普通开放式产品,特别还是开放式FOF产品,本身是需要长周期的结果检验,投资者必须保持一定耐心,在市场好转之前,避免低点赎回,有利于改变FOF“短债长投”的被动模式,当然本基金也要充分重视客户投资体验与逢低布局、业绩回报之间的平衡。

2018年也是对投资理念检验的一年。股市落差超1000点的冲高回落、各行业政策氛围突变,非常考验基金经理的定价能力、策略执行定力与投资风格稳定。我们所投的子基金基金经理表现出色,他们管理几十亿甚至百亿以上的规模,仍能从容前瞻地应对市场的不确定,清晰明确地执行价值型投资策略,换手率始终保持大幅低于市场平均水平,体现出精准的选股能力。结合2017年(价值发现偏进攻能力)-2018年(波动风险偏防御能力)的优异表现,凭借2018年市场给予的难得布局机会,相信2019年仍能为持有人创造稳健回报。

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-21.12%,同期业绩比较基准收益率为-16.83%,基金净值跑输业绩比较基准4.29个百分点。跑输基准是因为2018年单边下跌背景和蓝筹股四季度集中调整所致。

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年中美贸易战是中国经济攻坚进程的外部压力,但也激发了全社会上下对原有模式穷则思变的深度探讨,中国企业过去已经经历了N轮周期的磨砺,各领域已成长很多具备实力的优质公司,还需要积极面对外部变化反求诸己,回归主业做强做专,后续在国家深化改革、释放制度红利中脱颖而出,无论对实体企业还是资产管理行业,都是如此。

2019年1月新增信贷和社融数据大超预期,随着各项政策措施的落实,市场信心逐步恢复,我国经济二季度有望企稳。股市与经济的关系长期是晴雨表,短期不一定一一对应,但是绝对是信心与预期的晴雨表。

我们对持有内需为主、业绩稳定、估值安全、有竞争优势的行业龙头的基金未来表现有信心,只不过请持有人保持一些耐心和坚守,本基金与旗下所投资的基金经理都在尽自己最大努力,积极寻找危中有机,争取有利于持有人中长期回报。

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

一、本基金本报告期内无应分配的收益。

二、已实施的利润分配:无。

三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.8 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“托管人”)在海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)(以下称“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,完全履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:海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	24,129,196.61	162,099,741.58
结算备付金	-	8,090,983.17
存出保证金	112,984.82	179,101.64
交易性金融资产	872,545,033.85	1,790,062,846.67
其中:股票投资	-	-
基金投资	824,532,435.05	1,790,062,846.67
债券投资	48,012,598.80	-
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,193,375.70	37,416.76
应收股利	23,006.98	635,446.41
应收申购款	218,013.68	2,500,615.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	898,221,611.64	1,983,606,152.07
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	34,261,323.13
应付赎回款	2,187,126.91	35,547,732.22
应付管理人报酬	784,919.34	1,678,293.63
应付托管费	121,912.55	182,795.84
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	414,573.73	119,178.89
负债合计	3,508,532.53	71,789,323.71
所有者权益:		
实收基金	1,135,867,337.03	1,914,483,681.48
未分配利润	-241,154,257.92	-2,666,853.12
所有者权益合计	894,713,079.11	1,911,816,828.36
负债和所有者权益总计	898,221,611.64	1,983,606,152.07

注:1、报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.7877元,基金份额总额1,135,867,337.03份。于2017年12月31日,基金份额净值0.9986元,基金份额总额1,914,483,681.48份。

2、基金合同成立于2017年11月6日。

7.2 利润表

会计主体:海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年11月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	-226,222,399.43	-5,056,478.92
1.利息收入	1,193,282.13	694,249.80
其中:存款利息收入	694,902.24	458,179.47
债券利息收入	478,749.76	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	19,630.13	236,070.33
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-71,731,130.10	5,244,958.12
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-132,651,481.34	1,271.93
债券投资收益	773,870.91	-
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	60,146,480.33	5,243,686.19
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-158,484,529.50	-11,948,752.67
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,799,978.04	953,065.83
减:二、费用	21,888,953.43	3,544,779.56
1. 管理人报酬	11,984,100.79	3,084,435.52
2. 托管费	1,506,974.73	371,523.55
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,928,940.01	11,100.26
5. 利息支出	58,824.43	-
其中:卖出回购金融资产支出	58,824.43	-
6. 税金及附加	63.25	-
7. 其他费用	410,050.22	77,720.23
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-248,111,352.86	-8,601,258.48
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-248,111,352.86	-8,601,258.48

注:本财务报表的实际编制期间为2018年度和2017年11月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	1,914,483,681.48	-2,666,853.12	1,911,816,828.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-248,111,352.86	-248,111,352.86
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)	-778,616,344.45	9,623,948.06	-768,992,396.39
其中:1.基金申购款	168,187,408.37	-2,199,900.07	165,987,508.30
2.基金赎回款	-946,803,752.82	11,823,848.13	-934,979,904.69
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)	1,135,867,337.03	-241,154,257.92	894,713,079.11
项目	上年度可比期间 2017年11月6日(基金合同生效日)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)	2,159,466,781.16	-	2,159,466,781.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,601,258.48	-8,601,258.48
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)	-244,983,099.68	5,934,405.36	-239,048,694.32
其中:1.基金申购款	15,088,979.66	-157,641.90	14,931,337.76
2.基金赎回款	-260,072,079.34	6,092,047.26	-253,980,032.08
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)	1,914,483,681.48	-2,666,853.12	1,911,816,828.36

注:本财务报表的实际编制期间为2018年度和2017年11月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

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

海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)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[2017]第1632号《关于准予海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)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《海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)基金合同》组织基金发售。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2,158,489,351.62元,已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第980号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2017年11月06日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,159,466,781.16份基金份额,其中认购资金利息折合977,429.54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《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(以下简称“证券投资基金”,包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、指数型基金、ETF等)份额,债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具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)。本基金不投资ODII基金。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。基金的投资组合比例为:本基金投资于证券投资基金份额的比例不低于本基金资产的80%,投资于股票型、混合型基金份额的比例合计为本基金资产的70%—95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券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:沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。

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2019年3月28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》、《海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)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2018年度和2017年11月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间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12月31日及2017年12月31日的财务状况以及2018年度和2017年11月6日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2018年度和2017年11月6日(基金合同生效日)至2017年12月31止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的基金投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的基金投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承