海富通东财大数据灵活配置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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	海富通东财大数据混合
基金主代码	519132
交易代码	519132
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年1月29日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	35,972,299.95份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过灵活有效的资产配置策略和个股精选策略,实现基金资产的稳健,持续增值。
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;其次结合东方财富大数据指标及其他证券市场趋势指标,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。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目标管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	葛方雄	郭明
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		400 88-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798

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	2017年	2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
本期已实现收益	-2,975,569.20	6,775,773.25
本期利润	-502,526.67	5,655,258.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0112	0.0327
本期基金份额净值增长率	1.74%	3.60%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0537	0.0362
期末基金资产净值	37,905,373.23	66,473,693.90
期末基金份额净值	1.054	1.036

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	4.67%	0.94%	3.07%	0.49%	1.60%	0.45%
过去六个月	9.34%	0.77%	5.99%	0.42%	3.35%	0.35%
过去一年	1.74%	0.76%	12.93%	0.38%	-11.19%	0.38%
自基金合同生效起至今	5.40%	0.83%	25.23%	0.53%	-19.83%	0.30%

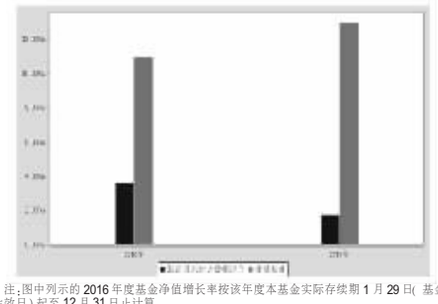
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通东财大数据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的历史走势对比图
(2016年1月29日至2017年12月31日)

注:本基金同于2016年1月29日生效,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

海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金
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2016年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期1月29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
2017年	-	-	-	-	-
2016年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金过去两年未发生利润分配的情况。

§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投股公司")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、海富通精选武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		
陈甄瑛	本基金的基金经理;海富通阿尔法对冲基金基金经理;海富通欣益混合基金经理;海富通欣享混合基金经理;量化投资部总监	2016-01-29	-	9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,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,现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2014年11月起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和海富通新内需混合基金经理,2016年1月起兼任海富通东财大数据混合基金经理,2016年9月起兼任海富通欣益混合基金经理,2017年3月起兼任海富通欣享混合基金经理。

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1月29日发布公告,自2018年1月29日起,增聘金晓鸣先生担任本基金的基金经理助理。

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,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。一季度除了创业板指表现为下跌外,其余三大指数均以阳线报收,但行业板块方面分化较为严重。二季度初始维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,在申信证券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。

2017年相对2016年在资本市场的投资风格上有较大的转变,全年上证50跑赢创业板指35.75%,海富通量化模型也逐步跟随调整参数来适应A股市场大盘蓝筹的上涨行情。由于模型需要足够的历史数据来验证策略,模型在下半年转向大盘股,因此本基金的业绩表现也是下半年好于上半年。本基金在整个三、四季度按照量化模型均衡配置行业权重,但是注重低估值因子和质量因子的正向暴露,因此优质大盘股和周期股的配置得到提高,改善了业绩表现,但是全年与业绩基准相比仍有一定差距。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为1.74%,同期业绩比较基准收益率为12.93%,基金净值跑输业绩比较基准11.19个百分点。跑输原因主要是上半年量化模型风格偏向小盘,跑输指数较多,下半年模型调整偏向大盘,但未能弥补上半年的负差额收益。

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,而更好地服务和发展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),因此优选龙头依然会是较好的策略之一;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。

预计2018年A股市场很有可能继续维持行业龙头股强势的格局,本基金考虑在上半年利用大盘蓝筹多因子增强量化模型,结合情绪择时指标体系,努力抓住大盘股和盈利增长显著股票的上涨波段,严格控制回撤风险。在下半年积极寻找潜力成长股的投资机会,建立中证500行业中性多因子增强量化模型。

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

本报告期内,本基金自2017年10月31日至2017年12月31日,已连续四十四个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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,本基金托管人在对海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金未出现任何违规行为。

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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:海富通东财大数据灵活配置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
资产:		
银行存款	7,662,547.50	8,505,112.22
结算备付金	213,845.10	893,395.20
存出保证金	37,107.91	146,868.97
交易性金融资产	30,401,816.08	58,058,364.97
其中:股票投资	30,401,816.08	58,058,364.97
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	64,330.11
应收利息	1,673.50	2,308.97
应收股利	-	-
应收申购款	1,704.13	2,960.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	38,318,694.22	67,673,341.00
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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	94,559.44	-
应付赎回款	39,565.61	274,806.42
应付管理人报酬	50,898.06	94,319.65
应付托管费	7,952.80	14,737.44
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	70,261.36	464,812.71
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,083.72	350,970.88
负债合计	413,320.99	1,199,647.10
所有者权益:		
实收基金	35,972,299.95	64,150,534.67
未分配利润	1,933,073.28	2,323,159.23
所有者权益合计	37,905,373.23	66,473,693.90
负债和所有者权益总计	38,318,694.22	67,673,341.00

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.054元,基金份额总额35,972,299.95份。

7.2 利润表

会计主体:海富通东财大数据灵活配置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29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	1,588,342.89	13,067,101.24
1.利息收入	85,906.30	842,174.47
其中:存款利息收入	69,807.02	724,041.65
债券利息收入	33.79	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	16,065.49	118,132.82
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,506,351.55	12,626,332.84
其中:股票投资收益	-1,990,860.82	12,425,308.59
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,763.21	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-349,120.00
股利收益	482,746.06	550,144.25
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,473,042.53	-1,120,514.52
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	535,745.61	719,108.45
减:二、费用	2,090,869.56	7,411,842.51
1.管理人报酬	720,505.23	2,609,178.55
2.托管费	112,578.83	407,684.21
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,089,157.50	4,034,981.75
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	168,628.00	359,998.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-502,526.67	5,655,258.73
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-502,526.67	5,655,258.73

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通东财大数据灵活配置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)	64,150,534.67	2,323,159.23	66,473,693.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-502,526.67	-502,526.67
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)	-28,178,234.72	112,440.72	-28,065,794.00
其中:1.基金申购款	47,232,507.56	-228,366.62	47,004,140.94
2.基金赎回款	-75,410,742.28	340,807.34	-75,069,934.94
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)	35,972,299.95	1,933,073.28	37,905,373.23

项目	上年度可比期间 2016年1月29日(基金合同生效日)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)	326,320,977.35	-	326,320,977.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	5,655,258.73	5,655,258.73
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)	-262,170,442.68	-3,332,099.50	-265,502,542.18
其中:1.基金申购款	18,621,417.08	1,308,822.45	19,930,239.53
2.基金赎回款	-280,791,859.76	-4,640,921.95	-285,432,781.71
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)	64,150,534.67	2,323,159.23	66,473,693.90

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

海富通东财大数据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[2015]3083号《关于准予海富通东财大数据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《海富通东财大数据灵活配置混合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326,201,647.16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112号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为326,320,977.35份基金份额,其中认购资金利息折合119,330.19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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通东财大数据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)。本基金的投资组合比例为:基金投资组合中股票资产占基金资产的0%~95%,权证投资占基金资产净值的0%~3%。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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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》、《海富通东财大数据灵活配置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
中国工商银行股份有限公司(「中国工商银行」)	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投股公司(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

本基金本报告期内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29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	720,505.23	2,609,178.55
其中:支付销售机构的客户维护费	406,943.73	1,764,588.47

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1.60%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 1.60%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

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29日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	112,578.83	407,684.21

注:支付基金托管人中国工商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。

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