海富通大中华精选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	42,977,639.17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	BNP Paribas Asset Management Partners UK Limited	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	法国巴黎资产管理英国有限公司	中国银行(香港)有限公司
注册地址		5, Aldermanbury Square London EC2V 7BP, United Kingdom	香港花园道1号中银大厦
办公地址		5, Aldermanbury Square London EC2V 7BP, United Kingdom	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	2015年
本期已实现收益	6,080,512.91	-14,571,808.62	-9,382,331.13
本期利润	18,393,763.50	872,061.11	-28,405,507.69
加权平均基金份额本期利润	0.3184	0.0113	-0.2698
本期基金份额净值增长率	37.51%	1.89%	-10.11%
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	-0.1298	-0.2417	-0.1554
期末基金资产净值	50,866,642.60	60,002,033.60	70,125,005.82
期末基金份额净值	1.184	0.861	0.845

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	5.15%	1.20%	4.50%	0.80%	0.65%	0.40%
过去六个月	16.42%	1.07%	11.95%	0.76%	4.47%	0.31%
过去一年	37.51%	0.93%	34.73%	0.68%	2.78%	0.25%
过去三年	25.96%	1.69%	47.26%	1.03%	-21.30%	0.66%
过去五年	41.29%	1.45%	68.85%	0.96%	-27.56%	0.49%
自基金合同生效起至今	18.40%	1.42%	56.10%	1.06%	-37.70%	0.36%

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2017年12月31日)

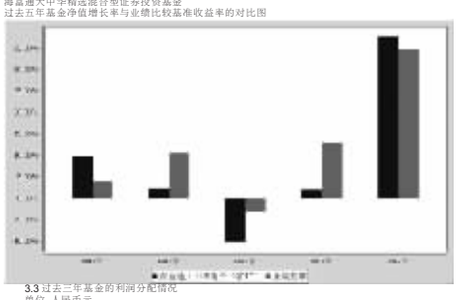
注:1.按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(三)投资范围、(九)投资限制中规定的各项比例;

2.本基金按照全球投资表现标准(GIPS)计算和表述投资业绩。

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

海富通大中华精选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	-	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金过去三年未发生利润分配。

§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投权公司")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、海富通新兴成长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、上证可转债绿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、海富通睿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、海富通聚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、海富通欣益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、海富通聚化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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张炳炜	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	-	12年	中国籍,硕士,持有基金从业人员资格证书。历任水丰金证券、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。

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	22年	英国国籍,伦敦布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。

4.4 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。

4.4.2 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投权、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、范畴度、交易占比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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017年,大中华股票市场表现亮眼。其中恒生指数高歌猛进,2017全年累计上涨35.99%,恒生国企指数则与24.64%,台湾加权指数上涨15.01%;相比同期上证综指上涨6.56%,深证成指和中小板指分别上涨8.48%和16.73%,港股明显有受到互连互通机制推动的正面影响,台股虽然幅度略低于港股,但受到全球流通市场资金对大中华市场的青睐,同样也有不错的表现。

回顾全年的走势,港股自二月起开始明显感受到南下资金涌入的效应,一路走高。由于两地市场仍有相当价差,港股估值较吸引,不少国内资金正式将香港市场列入配置,增加较大的投研资源配置。在此情况下,港股市场具有特殊成长题材的个股也得到更多关注,得到合理的评价。2017全年包括权益板块的保险、地产,以及具有成长题材的电子、汽车等等都有不小的涨幅。价投则是因为2017年市场关注iPhone新机发表,资金偏好成长性高的电子板块,最终恒生指数收于29919.15点,恒生国企指数收于11709.30点,台湾加权指数收于10642.86点。

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37.51%,同期业绩比较基准收益率34.73%,基金净值跑赢业绩比较基准2.78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

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年在大中华市场中,消费、大金融及电子表现较好,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,由于国内企业盈利稳定增长,港股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的增量。仓股部分由于半导体相关需求旺盛要国内企业稳定增长而维护扩张,预期仍有表现空间。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。

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

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。

4.9 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《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:海富通大中华精选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	5,940,656.19	17,541,591.48
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	45,520,851.12	43,100,406.78
其中:股票投资	45,520,851.12	43,100,406.78
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	-	695,533.34
应收利息	566.25	363.81
应收股利	9,000.00	-
应收申购款	157,330.54	4,403.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	51,628,404.10	61,342,299.26
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	-	793,349.93
应付赎回款	512,514.82	112,622.30
应付管理人报酬	79,576.22	93,385.73
应付托管费	13,262.74	15,564.31
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	156,407.72	325,343.39
负债合计	761,761.50	1,340,265.66
所有者权益:		
实收基金	42,977,639.17	69,670,279.95
未分配利润	7,889,003.43	-9,668,246.35
所有者权益合计	50,866,642.60	60,002,033.60
负债和所有者权益总计	51,628,404.10	61,342,299.26

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.184元,基金份额总额42,977,639.17份。

7.2 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: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
一、收入	20,123,927.31	2,748,836.77
1.利息收入	24,475.67	14,404.38
其中:存款利息收入	24,475.67	14,404.38
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"-"填列)	8,009,701.16	-13,274,904.21
其中:股票投资收益	7,079,961.89	-14,475,355.11
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	929,739.27	1,200,450.90
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	12,313,250.59	15,443,869.73
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-246,802.43	544,617.51
5.其他收入(损失以"-"号填列)	23,302.32	20,849.36
减:二、费用	1,730,163.81	1,876,775.66
1.管理人报酬	1,077,062.83	1,121,546.97
2.托管费	179,510.54	186,924.53
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	290,316.88	197,508.28
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	183,273.56	370,795.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	18,393,763.50	872,061.11
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	18,393,763.50	872,061.11

7.3 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: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)	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数(本期利润)	-	18,393,763.50	18,393,763.50
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)	-26,692,640.78	-836,513.72	-27,529,154.50
其中:1.基金申购款	34,966,547.97	4,311,490.08	39,278,038.05
2.基金赎回款	-61,659,188.75	-5,148,003.80	-66,807,192.55
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)	42,977,639.17	7,889,003.43	50,866,642.60
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)	83,026,692.45	-12,901,686.63	70,125,005.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	872,061.11	872,061.11
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)	-13,356,412.50	2,361,379.17	-10,995,033.33
其中:1.基金申购款	14,156,534.71	-2,280,992.73	11,875,541.98
2.基金赎回款	-27,512,947.21	4,642,371.90	-22,870,575.31
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)	69,670,279.95	-9,668,246.35	60,002,033.60

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%。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》、《海富通大中华精选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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[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《关于进一步明确金融机构开展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》及其他相关境内外税务法规和实务操作,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。自2016年5月1日起,金融业出缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)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,在境内不予征收营业税(于2016年5月1日前)或增值税(自2016年5月1日起)且暂不征收企业所得税。

(3)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。

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
中国银行(香港)有限公司("中银香港")	基金境外资产托管人
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
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
海通国际证券集团有限公司("海通国际证券")	海通证券间接控股子公司

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

金额单位:人民币元

关联方名称	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	
	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
海通国际证券	-	-	2,198,262.04	2.52%

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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
海通国际证券	2,260.95	2.10%	-	-

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	1,077,062.83	1,121,546.97
其中:支付销售机构的客户维护费	377,393.81	391,762.34

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X 1.8%/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1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	179,510.54	186,924.53

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X 0.30%/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固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

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
报告期初持有的基金份额	17,299,884.66	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	17,299,884.66	-
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	-	24.83%

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.基金管理人于报告期内赎回共计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。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,892,280.83	24,067.93	1,461,789.11	14,389.10
中国银行(香港)	2,668,404.12	-	11,205,095.22	-
合计	4,560,684.95	24,067.93	12,666,884.33	14,389.10

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