海富通沪港深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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	海富通沪港深混合
基金主代码	519139
交易代码	519139
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年11月11日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	156,760,379.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金以投资目标为中心，将定性和定量的分析方法运用于资产配置，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，包括大类资产的历史回报、历史波动率等制定本基金在股票、债券、现金、衍生品等资产之间的初步配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，再根据基本面、资金面、估值等具体因素，择续、动态、优化投资组合的资产配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%＋恒生指数收益率×40%＋中债综合财富指数收益率×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，属于中等风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	葛方荣	陆志俊
	联系电话	021-38650891	95559
	电子邮箱	wrxz@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216

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11月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
本期已实现收益	36,300,945.92	101,725.18
本期利润	41,339,239.30	-129,965.70
加权平均基金份额本期利润	0.2413	-0.0006
本期基金份额净值增长率	25.11%	-0.06%
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	0.2503	-0.0006
期末基金资产净值	195,991,662.92	229,892,961.37
期末基金份额净值	1.2503	0.9994

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)。

4.本基金合同生效日为2016年11月11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①②	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	7.21%	1.04%	5.36%	0.59%	1.85%	0.45%
过去六个月	15.65%	1.04%	10.41%	0.52%	5.24%	0.52%
过去一年	25.11%	0.80%	22.60%	0.47%	2.51%	0.33%
自基金合同生效起至今	25.03%	0.75%	19.83%	0.47%	5.20%	0.28%

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

海富通沪港深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

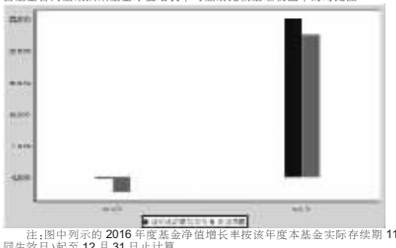
(2016年11月11日至2017年12月31日)

注：本基金合同于2016年11月11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

海富通沪港深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11月11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：本基金合同于2016年11月11日生效，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、海富通精选或梦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、海富通股息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		
张炳炜	本基金的基金经理；海富通中国海外混合(QDII)基金经理，海富通集化回报混合基金经理；海富通大中华混合(QDII)基金经理；海富通欣悦混合基金经理。	2016-11-11	-	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2月加入海富通基金管理有限公司，任投资分析师。2015年6月起任海富通国有回报混合基经理。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。
王智慧	本基金的基金经理；海富通精选或梦混合基金经理；海富通精选混合基金经理；总经理助理。	2016-11-30	-	15年	管理学博士，持有基金从业人员资格证书。曾在华宝兴业基金管理有限公司、中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江金盛集团股份有限公司固元证券有限责任公司从事投资研究及管理工作。2012年1月至2015年11月任华宝大盘精选混合基金经理，2012年2月至2015年11月任华宝医药生物混合型基金经理，2013年2月至2015年11月任华宝兴业多策略股票基金经理。2015年11月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2016年4月起兼任海富通精选混合和海富通精选或梦混合基金经理。2016年11月起兼任海富通沪港深混合基金经理。
高峰	本基金的基金经理	2017-08-28	-	10年	经济学硕士。持有基金从业人员资格证书。历任德勤华永会计师事务所审计部职员、光大证券股份有限公司行业研究员、中金公司研究部执行总经理、化工行业研究团队负责人。2017年3月加入海富通基金管理有限公司。2017年4月至2017年8月任海富通沪港深混合的基金经理助理。2017年8月起任海富通沪港深混合的基金经理。

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。

4.3.3 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。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。

2017年，恒生指数大幅跑赢全球，成长胜价值，板块分化显著，盈利为主要动力。恒生指数全年上涨36%，成为全球表现最佳的市场之一，不仅跑赢多数新兴市场，更是显著好于发达国家股市。市场风格方面，成长股好于价值股；同时板块之间分化十分显著，其中恒生国企指数年涨幅高达25%，由于金融权重占比较高，涨幅仍较恒生指数偏弱。分板块来看，表现最好的信息技术板块年全年涨幅高达92%，而电信板块却下跌了1%。2017年海外中资股市场出现的估值和盈利双轮驱动，还是2009年以来的首次。不过，尽管市盈率出现扩张，但企业盈利仍然是驱动市场上涨的主要因素。流动性方面，南下资金流入毋庸置疑是2017年H股市场流动性的主导因素。全年南向资金累计净流入规模达到3,400亿港元，明显高于2016年全年的2,460亿港元。海外资金流入规模相对较小，且多数为被动性流入。

回顾2017年，本基金在2季度完成建仓后仓位一直维持在较高水平。结构上，年初基于看好经济复苏持续，建仓配置部分周期板块，后续以A股银行保险与H股权重股，半年报后开始增配A股周期板块并获取了部分超额收益，在3季度未逐步将结构均衡化，后续配置行业结构较为均衡，个股以行业景气度向上的行业龙头为主。

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25.11%，同期业绩比较基准收益率为22.60%，基金净值跑赢业绩比较基准2.51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，从盈利、估值、流动性三要素来看，我们仍看好A股股票市场的表现，而2018年香港市场估值依然处于全球低位，海外资金的回流与南下资金的共振将带来继续上涨的动力。2018年我们将坚持同纬度选行业、跨市场选标的原则，做好跨市场的选股工作，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不断上板的回升的涨价机会；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、央视经济工作会议文件已经给出了很好的方向指引。

2018年，秉承"行业相对分散，个股适度集中；同维度选行业，跨市场选股票"的跨A/H市场的投资框架，本基金将加强风险控制，在全球进入加息周期之后将不断审视组合的资产质量与估值的匹配度。同时加强不同行业间的核心资产之间的比较与甄选，进一步深挖估值洼地的优质龙头资产。

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10%。

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

2017年度，基金托管人在海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017年度，海富通基金管理有限公司在海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2017年度，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：海富通沪港深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	13,977,045.10	18,810,684.82
结算备付金	3,713,037.53	-
存出保证金	2,999,946.79	-
交易性金融资产	178,726,970.83	8,954,664.00
其中：股票投资	178,726,970.83	8,954,664.00
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	-	100,000,000.00
应收证券清算款	970,346.41	102,438,557.46
应收利息	8,633.46	74,854.77
应收股利	35,200.00	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	200,431,180.12	230,278,761.05
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	3,411,468.59	-
应付赎回款	3,358.28	9.83
应付管理人报酬	217,007.30	292,004.13
应付托管费	36,167.89	48,667.36
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	555,510.87	17,027.20
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	216,004.27	28,091.16
负债合计	4,439,517.20	385,799.68
所有者权益：		
实收基金	156,760,379.57	230,022,926.96
未分配利润	39,231,283.35	-129,965.59
所有者权益合计	195,991,662.92	229,892,961.37
负债和所有者权益合计	200,431,180.12	230,278,761.05

注：1.报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.2503元，基金份额总额156,760,379.57份。于2016年12月31日，基金份额净值0.9994元，基金份额总额230,022,926.96份。

2.基金合同成立于2016年11月11日。

7.2 利润表

会计主体：海富通沪港深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11月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	48,220,323.06	471,645.65
1.利息收入	742,956.76	537,766.81
其中：存款利息收入	549,432.30	192,340.88
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	193,524.46	345,425.93
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	42,102,684.15	165,569.24
其中：股票投资收益	39,520,964.82	165,569.24
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	3,157.64	-
股利收益	2,578,561.69	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	5,038,293.38	-231,690.88
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	336,388.77	0.48
减：二、费用	6,881,083.76	601,611.35
1.管理人报酬	2,830,965.85	471,079.56
2.托管费	471,827.66	78,513.25
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,363,532.59	23,457.39
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	214,757.66	28,561.15
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	41,339,239.30	-129,965.70
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	41,339,239.30	-129,965.70

注：本财务报表的实际编制期间为2017年度和2016年11月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：海富通沪港深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)	230,022,926.96	-129,965.59	229,892,961.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	41,339,239.30	41,339,239.30
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)	-73,262,547.39	-1,977,990.36	-75,240,537.75
其中：1.基金申购款	142,462,043.30	28,973,058.08	171,435,101.38
2.基金赎回款	-215,724,590.69	-30,951,048.44	-246,675,639.13
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)	156,760,379.57	39,231,283.35	195,991,662.92

项目	上年度可比期间 2016年11月11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)	230,023,025.79	-	230,023,025.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-129,965.70	-129,965.70
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)	-98.83	0.11	-98.72
其中：1.基金申购款	19.73	-0.03	19.70
2.基金赎回款	-118.56	0.14	-118.42
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)	230,022,926.96	-129,965.59	229,892,961.37

注：本财务报表的实际编制期间为2017年度和2016年11月11日(基金合同生效日)至2016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：庄志强，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

海富通沪港深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[2016]第1647号《关于准予海富通沪港深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《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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230,010,422.60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(2016)第1389号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年11月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为230,023,025.79份基金份额，其中认购资金利息折合12,603.19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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通沪港深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)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、证券公司发行的短期公司债及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、国债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相关规定)。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。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为0-95%(其中，投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票比例为基金资产的0-95%)，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%＋恒生指数收益率×40%＋中债综合财富指数收益率×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》、《海富通沪港深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年度和2016年11月11日(基金合同生效日)至2016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2017年12月31日及2016年12月31日的财务状况以及2017年度和2016年11月11日(基金合同生效日)至2016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2017年度和2016年11月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

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股票投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入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。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

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为权证投资)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