海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金 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:杭州银行股份有限公司

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。

基金托管人杭州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	海富通瑞丰一年定开债券
基金主代码	519136
交易代码	519136
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年 8 月 15 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	杭州银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,500,245,368.35 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和追求基金资产长期稳定的基础上,通过积极主动的管理,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金为债券型基金,对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%。在此约束下,本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。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	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,属于货币市场基金,属于较低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	杭州银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚方荣	陈凯伦
	联系电话	021-38650891	0571-87253683
	电子邮箱	wxu@hftfund.com	chenkailun@hzbank.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95398
传真		021-33830166	0571-86475525

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 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	49,553,898.80	17,836,188.11
本期利润	14,720,981.47	-1,265,720.08
加权平均基金份额本期利润	0.0098	-0.0008
本期基金份额净值增长率	0.98%	-0.08%
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	-0.0026	-0.0008
期末基金资产净值	1,496,297,406.02	1,499,009,699.12
期末基金份额净值	0.9974	0.9992

注:1、本基金合同生效日为 2016 年 8 月 15 日,合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

2、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。

3、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。

4、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	-0.75%	0.05%	-0.69%	0.05%	-0.06%	0.00%
过去六个月	0.37%	0.05%	-0.14%	0.05%	0.51%	0.00%
过去一年	0.98%	0.07%	-0.34%	0.06%	1.32%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.90%	0.11%	-1.58%	0.08%	2.48%	0.03%

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

海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金

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

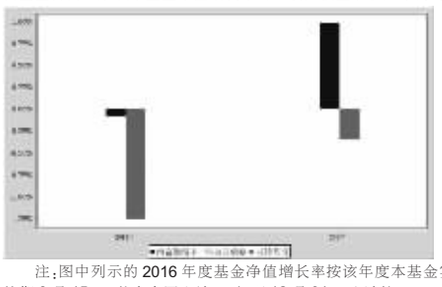
(2016 年 8 月 15 日至 2017 年 12 月 31 日)

注:本基金合同于 2016 年 8 月 15 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

海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金

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 8 月 15 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	0.116	17,402,846.64	0.22	17,402,846.86	-
2016年	-	-	-	-	-
合计	0.116	17,402,846.64	0.22	17,402,846.86	-

§ 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、海富通季季增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		
陈耽平	本基金的基金经理;海富通货币基金经理;海富通季季增利理财债券基金经理;海富通稳固收益债券基金经理;海富通一年定开债券基金经理;海富通上证可质押城投债ETF基金经理;海富通美元债(QDII)基金经理;海富通富祥混合基金经理;海富通上证周期产业债ETF基金经理;海富通瑞利债券基金经理;海富通瑞福债券基金经理;海富通瑞福分级债基金经理;海富通富睿混合基金经理;海富通欣悦混合基金经理;海富通瑞祥一年定开债券基金经理;海富通瑞利一年定开债券基金经理;固定收益投资部副总监。	2016-08-15	-	8年	博士,CFA。持有基金从业人员资格证书。历任Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师,瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事,2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监、现任固定收益投资部副总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月起任海富通货币基金经理。2014 年 8 月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF 基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳定增利债券(LOF)基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月起兼任海富通美元债(QDII)基金经理。2017 年 1 月起兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通富睿债券和海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017 年 7 月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。
刘田	本基金的基金经理助理;海富通聚利债券基金经理助理;海富通集利债券基金经理助理;海富通瑞利债券基金经理助理;海富通瑞合纯债基金经理助理;海富通添益货币基金经理助理。	2016-08-19	-	1年	管理学学士, 持有基金从业人员资格证书。曾任上海银行固业客户经理,2016 年 4 月加入海富通基金管理有限公司,2016 年 8 月至 2017 年 11 月任海富通聚益债券的基金经理助理。2016 年 8 月起任海富通瑞丰一年定开债券的基金经理助理。2016 年 9 月起兼任海富通聚利债券的基金经理助理。2016 年 12 月起兼任海富通集利债券的基金经理助理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券的基金经理助理。2017 年 4 月起兼任海富通瑞合纯债的基金经理助理。2017 年 11 月起兼任海富通添益货币的基金经理助理。

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 报告期内本基金投资策略和运作分析

2017 年的债券市场延续跌势。宏观层面看,全年经济增长平稳显韧性,供给侧改革、棚改货币化推动固定资产投资维持较高增速,出口得益于全球经济复苏成为拉动国内经济的主要动力; 通胀全年维持低位,人民币汇率总体稳定,货币政策主要目标在于去杠杆和去泡沫,因此延续了中性偏紧的基调。同时金融监管全面收紧,抑制同业链条,引导资金脱虚向实。在这种情况下,十年期国债收益率全年呈现波浪式上升的态势,利率于一季度、二季度和四季度经历三次快速上行, 并在四季度达到 4%的水平,创下近几年新高。具体来看,1 月下旬央行公告上调 MLF 利率为近几年来首次提高政策利率,随后央行又多次上调公开市场各期限逆回购及其他货币工具利率,资金利率中枢抬升,长端利率先上后下整体上行。4 月金融监管全面趋严,银监会连续出台包括 6 号文、46 号文、53 号文在内的多个文件, 以限制同业、理财业务的套利和资金空转行为,证监会、保监会也相继出台政策加强对券商资管资金池产品以及险资通道业务的监管。监管政策的密集出台使得市场悲观情绪再起,抛压严重,利率再次大幅走高。6 月为应对半年末的流动性和稳定经济需要,央行积极呵护资金面,高层也多发声注重监管协调,利率迎来一波修复,并在整个三季度保持平稳。然而进入 10 月,公布的月度经济数据大幅好于预期,叠加周小川行长关于"中国经济 GDP 增速下半年有望实现 7%"的发言,引发市场对经济增长韧性与通胀预期回升的担忧。十九大后维稳期效应消失,资管新规和商业银行流动性风险管理征求意见稿相继公布,加上存单利率的持续上升,美国税改和加息的稳步推进亦对国内债市构成压力。在多重利空因素的作用下,十年期国债收益率出现年内第三次大幅上行,并触及 4%的新高。随后各种利空预期有所消化,年底利率略有回落。纵观全年表现,利率债全线收跌,一年期国债收益率上行 114BP,十年期国债收益率上行 87BP,曲线变平。信用债走势和利率债类似,但阶段性表现分化,总体看全年信用利差小幅走扩但依然处于低位,评级间利差小幅压缩,中低评级信用债表现相对抗跌。可转债在政策的支持下迎来扩容,供给的放量对转债估值形成持续压制。可转债全年除了在三季度跟随股市上涨之外其余大部分时间都表现不佳,中证转债指数全年跌 0.16%。

本组合在纯债方面保持稳定,严控信用风险,持仓主要为高等级信用债券和利率债,积极进行久期管理。

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 0.98%,同期业绩比较基准收益率为 -0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济基本面看,2018 年经济或继续保持平稳增长, 全年 GDP 增速预计在 6.6%-6.8%。一季度由于受采暖季限产扰动和地产短周期下行影响, 经济阶段性承压, 但二季度以后经济内生动能可能有所修复,GDP 或小幅回升。分项来看,18 年制造业投资可能出现结构性修复,出口继续保持较高增速,基建投资仍能有效托底,此三项或是 2018 年经济的支持项,而地产投资和汽车消费或形成拖累,但下滑幅度预计较为温和。总体看 18 年经济依然保持较强韧性。通胀方面,PPI 受需求放缓和高基数影响大概率将出现回落,而 CPI 可能会取代 PPI 成为 18 年的通胀主线,预计 CPI 中枢较 17 年将出现显著抬升,但整体通胀压力仍较为可控,原油价格是最大的不确定因素。政策方面,18 年金融防风险和实体去杠杆仍将持续推进, 货币政策短期继续保持中性偏紧的基调,且不排除会进一步上调政策利率, 但如果下半年出现实体融资利率过高,通胀增速回落的情况,货币政策也有边际转松的可能;金融强监管仍将延续,资管新规等制度细则将陆续落地,银行理财、券商资管等规模趋于回落,对债券市场的影响深远,有待进一步观察。此外,18 年诸多海外因素也不容忽视,美国税改的效果、美股可能出现的泡沫、地缘政治局势等都会对汇率及全球资本市场产生较大影响,值得关注。总体看,我们认为 18 年的债市环境仍未转暖,中外货币收紧、通胀预期抬升、资金供需缺口等因素使得利率仍会维持高位且不排除有进一步上行可能,但幅度已相对有限,同时结构性机会增多,利率债波段交易的空间和胜算都会比 17 年要大;信用债资产支持证券增额响信用利差和期限利差都面临走扩压力,但票息价值依然较高;可转债估值水平已压缩至合理区间,跟随股市或有可为,但考验择券能力。

本组合在 2018 年一季度将根据经济基本面变化和监管落地情况,积极管理久期,构建高等级信用债和利率债基本配置。2018 年全年将以绝对收益为主要目标,获得较高的票息收益。

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,基金收益分配后基金份额不能低于面值。

本基金报告期内进行过一次利润分配,以截止 2017 年 11 月 15 日本基金的可供分配利润为基准, 于 2017 年 11 月 28 日完成权益登记,单位分红金额为 0.0116 元,合计利润分配金额 17,402,846.86 元。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

本报告期,杭州银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有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、利润分配情况、财务会计报告、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:海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金

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	5,861,960.26	412,985,419.52
结算备付金	13,719,785.45	3,091,874.06
存出保证金	36,625.09	161,642.72
交易性金融资产	1,577,179,261.00	1,795,295,200.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,577,179,261.00	1,795,295,200.00
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	286,537,289.79	300,000,000.00
应收证券清算款	2,000,000.00	-
应收利息	43,454,253.67	39,523,549.42
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,928,789,175.26	2,551,057,685.72
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	430,899,678.50	750,559,289.16
应付证券清算款	-	300,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	507,327.27	509,383.41
应付托管费	126,831.84	127,345.83
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,878.61	25,310.48
应交税费	-	-
应付利息	557,053.02	614,657.72
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	390,000.00	212,000.00
负债合计	432,491,769.24	1,052,047,986.60
所有者权益:		
实收基金	1,500,245,368.35	1,500,275,419.20
未分配利润	-3,947,962.33	-1,265,720.08
所有者权益合计	1,496,297,406.02	1,499,009,699.12
负债和所有者权益总计	1,928,789,175.26	2,551,057,685.72

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.9974 元,基金份额总额 1,500,245,368.35 份。

7.2 利润表

会计主体:海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金

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 8 月 15 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	34,741,935.73	4,271,687.15
1.利息收入	85,541,980.50	25,681,568.81
其中:存款利息收入	370,494.20	476,093.02
债券利息收入	84,279,406.89	24,221,550.48
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	892,079.41	983,925.31
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-15,967,127.44	-2,307,973.47
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-15,967,127.44	-2,307,973.47
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-34,832,917.33	-19,101,908.19
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	20,020,954.26	5,537,407.23
1.管理人报酬	6,015,930.38	2,293,782.23
2.托管费	1,503,982.63	573,445.53
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	91,916.21	127,852.76
5.利息支出	11,983,525.04	2,329,926.71
其中:卖出回购金融资产支出	11,983,525.04	2,329,926.71
6.其他费用	425,600.00	212,400.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	14,720,981.47	-1,265,720.08
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	14,720,981.47	-1,265,720.08

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金

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)	1,500,275,419.20	-1,265,720.08	1,499,009,699.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,720,981.47	14,720,981.47
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)	-30,050.85	-376.86	-30,427.71
其中:1.基金申购款	3,157.28	38.88	3,196.16
2.基金赎回款	-33,208.13	-415.74	-33,623.87
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)	-	-17,402,846.86	-17,402,846.86
五、期末所有者权益(基金净值)	1,500,245,368.35	-3,947,962.33	1,496,297,406.02

项目	上年度可比期间 2016年 8 月 15 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)	1,500,275,419.20	-	1,500,275,419.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,265,720.08	-1,265,720.08
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,500,275,419.20	-1,265,720.08	1,499,009,699.12

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

海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金 (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 1580 号《关于准予海富通瑞丰一年定期开放债券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《海富通瑞丰一年定期开放债券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证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,500,072,895.33 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 714 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,500,275,419.20 份,其中认购资金利息折合 202,523.87 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,基金托管人为杭州银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通瑞丰一年定期开放债券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国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款),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)。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金也不投资于可转换债券、可交换债券。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。基金的投资组合比例为:基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率。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》、《海富通瑞丰一年定期开放债券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

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[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) 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
杭州银行股份有限公司("杭州银行")	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 控股公司 (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