

**海富通强化回报混合型证券投资基金**  
**2015 年年度报告摘要**  
**2015 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十八日

## § 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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 2015 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	海富通强化回报混合
基金主代码	519007
交易代码	519007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 5 月 25 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	666,123,167.88 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	每年超越三年期定期存款（税前）加权平均收益率
投资策略	本基金认为，灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源，而收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。因此，本基金将运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率
风险收益特征	追求每年高于一定正回报的投资品种。属于适度风险、适中收益的混合型基金，其长期的预期收益和风险高于债券基金，低于股票基金。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	张燕
	联系电话	021-38650891	0755-83199084
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		40088-40099	95555
传真		021-33830166	0755-83195201

## 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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	397,127,562.81	153,067,715.32	118,719,844.65
本期利润	341,806,979.19	175,881,171.11	193,752,077.95
加权平均基金份额本期利润	0.3498	0.0907	0.0824
本期基金份额净值增长率	12.50%	18.13%	11.95%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0915	-0.1921	-0.3161
期末基金资产净值	605,205,764.12	1,317,177,356.80	1,614,542,946.67
期末基金份额净值	0.909	0.808	0.684

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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	----------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	12.78%	1.42%	0.70%	0.01%	12.08%	1.41%
过去六个月	-15.36%	2.28%	1.49%	0.01%	-16.85%	2.27%
过去一年	12.50%	2.26%	3.37%	0.01%	9.13%	2.25%
过去三年	48.77%	1.50%	12.31%	0.01%	36.46%	1.49%
过去五年	14.63%	1.34%	23.10%	0.01%	-8.47%	1.33%
自基金合同生效起至今	156.23%	1.44%	47.63%	0.01%	108.60%	1.43%

### 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

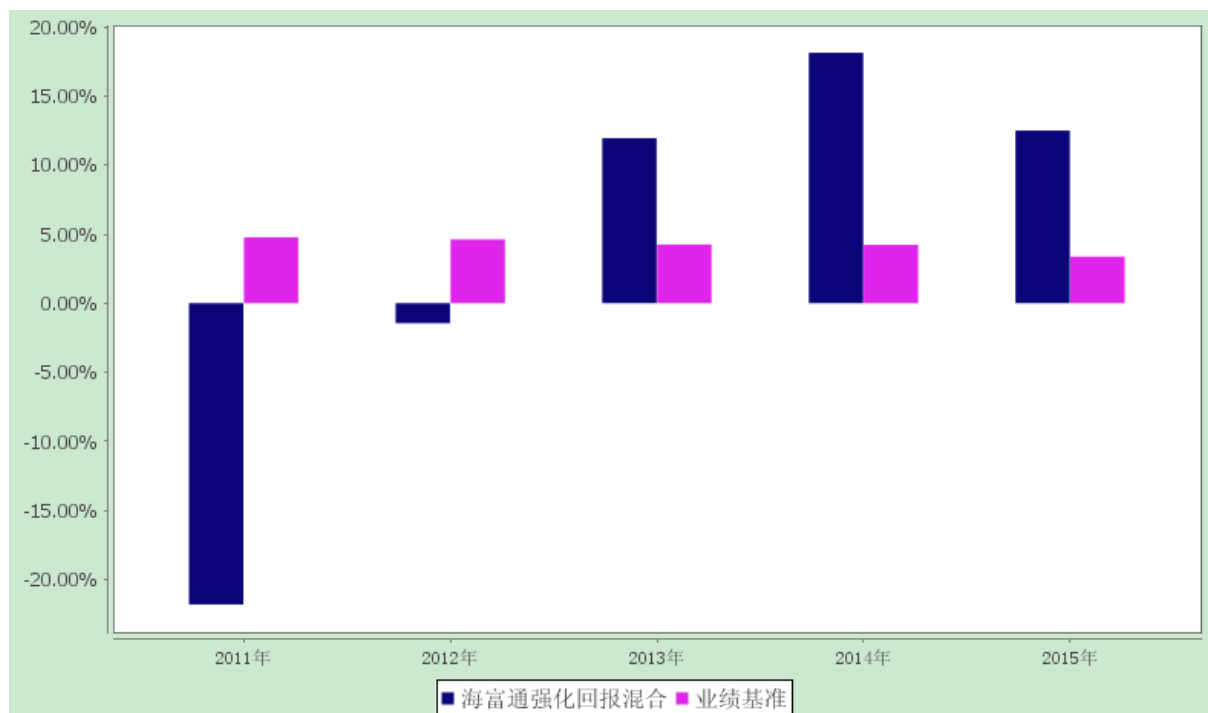
海富通强化回报混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2006年5月25日至2015年12月31日)



注：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。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(二)、(七)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

### 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

海富通强化回报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
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
2013	-	-	-	-	-
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“法国巴黎投资管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2015 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 31 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、海富通稳进增利债券型证券投资基金 (LOF)、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、海富通双利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。

#### 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		
谢志刚	本基金的基金经理；海富通养老收益混合基金经理；海富通领先成长股票和海富通国策导向股票基金经理	2014-01-07	2015-06-11	14 年	MBA、硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安证券研究所行业研究员、美国康奈尔资本公司助理投资经理、华宝兴业基金管理有限公司高级研究员、西蒙莫瑞中国基金公司研究总监、信诚基金管理有限公司 Eastspring China Dragon A Share Fund (QFII) 投资经理（该基金由信诚基金担任投资顾问），2013

					<p>年 9 月加入海富通基金管理有限公司,2013 年 10 月至 2015 年 6 月担任海富通养老收益混合基金经理,2014 年 1 月至 2015 年 6 月兼任海富通强化回报混合基金经理。2014 年 4 月至 2015 年 6 月兼任海富通领先成长股票和海富通国策导向股票基金经理。</p>
邵佳民	<p>本基金的基金经理;海富通稳健添利债券基金经理;海富通稳固收益债券基金经理;海富通稳进增利债券 (LOF) 基金经理;总经理助理</p>	2006-05-25	-	18 年	<p>硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003 年 4 月加入海富通基金管理有限公司,历任固定收益分析师、基金经理、固定收益组合管理部总监、投资副总监,现任总经理助理。2005 年 1 月至 2008 年 2 月任海富通货币基金经理,2006 年 5 月起任海富通强化回报混合基金经理,2008 年 10 月至 2015 年 1 月任海富通稳健添利债券基金经理,2010 年 11 月至 2015 年 1 月任海</p>



					富通稳固收益债券基金经理，2013 年 1 月至 2015 年 1 月任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。
张炳炜	本基金的基金经理	2015-06-03	-	7 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 月起兼任海富通中国海外混合（QDII）和海富通大中华混合（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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

从股市看，2015 年 A 股年线犹如一把正挂的利剑，刺痛了每一个投资者的心。

在 A 股历史中，2015 年注定是不平凡的一年，一、二季度，股指单边向上，直冲 5178.19 高点；三季度在去杠杆压力下，市场恐怖下跌，千股涨停后又现千股跌停，创下全年 2850.71 低点；四季度，市场热点密集轮动，三个月上证综指上涨 15.93%，深证成指上涨 26.80%。

虽然，2015 年全年市场形势严峻，投资者被“过山车”式的上涨下跌“颠”的晕眩。但 2015 年投资者只要自始至终坚持，还是能收获不错的收益。央行 5 次降息降准，市场流动性宽裕，再加上“资产荒”，使得 2015 全年股票市场有不俗表现。

全年来看，上证综指上涨 9.41%，报收 3539.18 点。深证成指上涨 14.98%，报收 12664.89 点。而被认为是中国未来经济转型方向的中小创表现良好，中小板指全年上涨 53.70%，报收 8393.83 点。创业板指全年上涨 84.41%，报收 2714.5 点。

就中信证券行业指数来看，传媒、计算机、轻工制造、通信、机械、电子元器件等

涨幅都翻了一番。而传统行业，诸如银行、非银行金融、煤炭等涨幅殿后，不足 10%。互联网营销、虚拟现实、智能电视等概念涨幅在两倍以上，次新股、网络游戏、网络安全、大数据、工业 4.0 等概念涨幅在一倍以上。

回顾本基金在报告期内的股票操作，结构上主要倾向于国防军工、智能制造、半导体等板块，获得了一定的超额收益，但由于三季度未能很好地控制仓位，导致净值回撤较大。

从债市看，2015 年经济基本面总体疲弱，在三期叠加的大背景下经济增速出现放缓，工业、投资等多项经济数据屡屡创下近年来的新低。而随着全球通缩风险蔓延、大宗商品下跌，2015 全年的通胀率一直处于一个较低的水平。在这种情况下政府一方面促转型调结构，提出了供给侧改革的思路，加快经济出清，另一方面也依旧显现出较强的稳增长意愿。首先，货币政策持续宽松，全年央行共实施了五次降准和五次降息，并持续通过 SLF、MLF 等定向手段向市场注入流动性。具体来看 2015 年存款准备金率共下调了 300BP，一年期贷款利率从去年底的 6% 下调至目前的 4.75%，一年期存款利率从 2.75% 下调至目前的 1.5%，同时打开浮动区间，形式上完成了利率市场化。其次，财政政策也积极发力，2015 年赤字率目标由 14 年的 2.1% 提升至 2.3%，并推出万亿地方债置换以及千亿专项金融债，希望拉动投资回升。宽货币和宽财政起到了一定的托底效果，但也受到一定制约，比如资金向实体传导不畅、地方财政和杠杆约束等问题，经济企稳仍需时日。

在此背景下，15 年债券市场延续了牛市行情，一方面资金利率得益于货币宽松总体保持低位平稳，下半年 7 天回购利率始终平稳维持 2.5% 左右水平，另一方面 6 月份以后股市断崖式回落，市场风险偏好急剧下降，大量资金涌入债市，带动利率债、信用债收益率大幅下行，期限利差和信用利差均迅速收窄。总体看全年 1 年期国债收益率下行 96BP，10 年期国债收益率下行 80BP，突破了自 08 年以来的历史低位，期限利差先扩后窄。而信用债在钱多缺资产的格局下表现更为出色，各评级、各期限品种全年都有 100BP 以上的下行幅度，尤其是在经济下行信用风险加大的情况下中短久期、中高评级信用债成为市场追捧对象，信用利差被压缩至历史低位，城投债也因为地方债置换安全度提高而投资情绪回暖。转债方面，一至五月转债受股市推动大幅上涨，众多券纷纷触发赎回退市，转债稀缺性进一步推升估值，然而六月股市剧烈震荡，转债在正股和估值双重压力下急剧下跌，归还了年初以来累积的回报，四季度股市虽有反弹，但转债受制于高估值弹性严重不足，全年中证转债指数跌 26.5%。

组合在第一季度对信用债增加投资，对转债进行了波段操作；二季度随着收益率的降低，减持了债券仓位；三季度债券配置水平保持在较低水平，主要以利率债和城投债为主；四季度增加了政策性金融债的投资，对城投债整体减仓，以提高组合的流动性。

#### 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 12.5%，同期业绩比较基准收益率为 3.37%，基金净值跑赢业绩比较基准 9.13 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

从股市看，2016 年，我国宏观经济将面临与前几年截然不同的、复杂多变的国际国内环境。站在国际视角，2016 年是国际金融危机后发达国家开始走出危机、美国进入加息周期的第一年，不同经济体的经济周期存在差异，国际资本流动预计将出现显著变化。从国内经济发展看，2016 年是我国全面建成小康社会决胜阶段的开局之年，也是推进结构性改革的攻坚之年；供给侧改革作为新一年的政策重点，有望重塑中国经济竞争力。同时，短期也可能带来意外的阵痛和风险，比如债务违约率可能在局部快速提升、淘汰落后产能导致失业率上升等问题。在全新形势下，我们对中国经济的长期走势充满信心，也对短期内风险可能局部爆发带来的经济波动存在一丝担忧。

从证券市场来看，目前 A 股市场整体估值不贵，但是结构性差异较大，低估值与高估值并存。同时，A 股市场本身制度环境的变化也给市场走势增添变数，注册制的推出、大股东减持规则的变化、上海证券交易所战略新兴板的设立等很有可能导致 A 股市场中长期估值中枢的改变。考虑到当前国内经济所面临的困难局面、国际市场的复杂格局以及中国资本市场自身的不断演变，我们认为 2016 年 A 股投资操作将面临较大的难度，应调低基金投资的预期收益。新的一年，我们将根据形势变化适当调整投资研究的重心，提升对宏观经济与全球市场的关注，并注意跳出前几年一直沿用的盈利模式和惯性思维框架，积极关注新形势、新机遇和新风险。在认清困难形势的同时，我们认为还应积极寻找结构性机会。一方面，供给侧改革将改善产能过剩行业的竞争格局，龙头公司有望从中受益从而提升投资价值；另一方面，在市场波动中顺应中国经济转型方向的成长股也会有被错杀的机会，在合适的价格上买入优质成长股也将是我们的主要策略之一。

2016 年在不确定中寻找确定性，本基金将力求为份额持有人获得较好的投资回报。

从债市看，当前经济仍未出现明显的见底信号，总需求不振，而供给端改革的作用短期难以体现，明年上半年可能出现工业增长、工业产能以及固定资产投资的进一步下行。但是，明年传统的稳增长政策尤其是积极财政政策可能会有所加码，下半年经济或许能逐步企稳，需待观察。

货币政策方面，目前利率市场化几近收官，降息政策边际效应递减，央行开始逐步构建一个适应新经济和金融环境的货币政策框架：从数量型调控转为价格型调控、从存贷款基准利率调控转变为利率走廊调控，在利率、汇率、金融稳定等多目标管理下明年货币政策难以出现大幅放水但也难以转向，总体仍会维持平稳和适度宽松，降准的空间会大于降息。

在这种环境下，我们对 2016 年债市保持谨慎乐观，基本面和资金面因素对债市仍相对有利，限制收益率出现大幅上行的可能，但 2016 年财政发力带来的挤出效应、宽货币转向宽信用可能性加大，也会制约收益率下行的速度和空间，因此债市可能呈现区间波动的特性。此外，股市和汇市的变化仍是最大的不确定因素，两者影响了国内和国际的资金的分配和流向，对债市形成阶段性扰动，尤其是目前贬值压力加大，需要保持密切关注。

未来,本组合债券部分将保持较低仓位,以中等久期、高等级债券为主,防范信用风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会,委员会成员具有 3 年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能,并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。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。估值工作小组充分听取相关部门的建议,并和相关托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告,以便估值委员会决策。估值政策经估值委员会审阅同意,并经本公司总裁办公会批准后实施。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。除了投资总监外,其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员,不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种,基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。对于在交易所上市的证券,采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种,采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

#### 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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人--招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《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,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

本报告期内基金管理人在投资运作、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,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守

了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：海富通强化回报混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	28,802,487.74	15,307,714.34
结算备付金	5,133,751.66	11,868,524.49
存出保证金	864,487.62	1,319,476.11
交易性金融资产	534,269,089.41	1,123,257,476.58
其中：股票投资	379,867,339.41	1,025,515,819.98
基金投资	-	-
债券投资	154,401,750.00	97,741,656.60
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	-	150,000,000.00
应收证券清算款	35,861,270.02	47,269,422.73
应收利息	5,118,941.50	2,634,206.89
应收股利	-	-
应收申购款	2,474.45	118,070.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	610,052,502.40	1,351,774,891.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2015 年 12 月 31 日</b>	<b>2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		
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	-	23,405,689.48
应付赎回款	635,575.95	4,147,208.21
应付管理人报酬	776,862.27	1,658,901.68
应付托管费	129,477.04	276,483.59
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,914,527.38	4,758,419.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	390,295.64	350,832.80
负债合计	4,846,738.28	34,597,535.08
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	666,123,167.88	1,630,435,696.04
未分配利润	-60,917,403.76	-313,258,339.24
所有者权益合计	605,205,764.12	1,317,177,356.80
负债和所有者权益总计	610,052,502.40	1,351,774,891.88

注: 报告截止日 2015 年 12 月 31 日, 基金份额净值 0.909 元, 基金份额总额 666,123,167.88

份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通强化回报混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>385,180,484.60</b>	<b>220,217,484.48</b>
1.利息收入	6,465,123.25	20,572,223.49
其中：存款利息收入	912,241.16	1,187,914.87
债券利息收入	5,005,716.94	16,559,342.82
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	547,165.15	2,824,965.80
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	433,951,338.41	176,591,557.58
其中：股票投资收益	429,396,560.10	147,389,811.34
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,133,582.34	27,048,418.90
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	3,421,195.97	2,153,327.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-55,320,583.62	22,813,455.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	84,606.56	240,247.62
<b>减：二、费用</b>	<b>43,373,505.41</b>	<b>44,336,313.37</b>
1. 管理人报酬	14,086,545.43	18,921,974.78
2. 托管费	2,347,757.57	3,153,662.42
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	26,502,427.10	21,253,250.46
5. 利息支出	-	558,646.37



其中：卖出回购金融资产支出	-	558,646.37
6. 其他费用	436,775.31	448,779.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>341,806,979.19</b>	<b>175,881,171.11</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>341,806,979.19</b>	<b>175,881,171.11</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通强化回报混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	1,630,435,696.04	-313,258,339.24	1,317,177,356.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	341,806,979.19	341,806,979.19
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）	-964,312,528.16	-89,466,043.71	-1,053,778,571.87
其中：1.基金申购款	77,923,541.53	1,162,457.84	79,085,999.37
2.基金赎回款	-1,042,236,069.69	-90,628,501.55	-1,132,864,571.24
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）	666,123,167.88	-60,917,403.76	605,205,764.12
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	2,360,626,710.65	-746,083,763.98	1,614,542,946.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	175,881,171.11	175,881,171.11
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）	-730,191,014.61	256,944,253.63	-473,246,760.98
其中：1.基金申购款	18,002,896.18	-4,784,275.81	13,218,620.37
2.基金赎回款	-748,193,910.79	261,728,529.44	-486,465,381.35
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）	1,630,435,696.04	-313,258,339.24	1,317,177,356.80

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：刘颂，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

海富通强化回报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”)证监基金字[2006]第 58 号《关于同意海富通强化回报混合型证券投资基金募集的批复》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《海富通强化回报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 2,563,360,601.57 元，已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(2006)第 63 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 5 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,564,312,627.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 952,025.45 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，基金托管人为招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《海富通强化回报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国内依法公开发行上市的股票、债券、货币市场金融工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置：股票资产 0%-95%，权证投资 0%-3%，债券 5%-95%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率。

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 2016 年 3 月 24 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》、《海富通强化回报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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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
法国巴黎投资管理 BE 控股公司 (BNP Paribas Investment Partners 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**

本基金本年度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**

本基金本年度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**

本基金本年度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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,086,545.43	18,921,974.78
其中：支付销售机构的客户维护费	3,151,177.04	4,155,384.86

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 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,347,757.57	3,153,662.42

注：支付基金托管人招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**

本基金本年度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金的情况**

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
招商银行	28,802,487.74	711,172.12	15,307,714.34	1,017,558.87

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	71.47	-	-	285,512	15,094,824.88	20,405,542.64	-
002065	东华软件	2015-12-21	重大事项	25.10	-	-	486,100	12,128,019.06	12,201,110.00	-

600584	长电科技	2015-11-30	重大事项	22.02	-	-	210,600	4,787,744.00	4,637,412.00	-
601018	宁波港	2015-08-04	重大事项	8.16	2016-02-22	7.34	542,100	4,530,735.00	4,423,536.00	-
000901	航天科技	2015-08-19	重大事项	42.12	2016-02-18	47.59	80,700	4,866,548.10	3,399,084.00	-
002383	合众思壮	2015-12-15	重大事项	40.35	2016-03-17	36.32	80,000	3,063,075.00	3,228,000.00	-
600749	西藏旅游	2015-11-30	重大事项	23.62	-	-	131,900	3,184,465.00	3,115,478.00	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 328,457,176.77 元，属于第二层次的余额为 205,811,912.64 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 937,553,359.40 元，第二层次 185,704,117.18 元，无属于第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根

据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用中证指数有限公司《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	379,867,339.41	62.27
	其中：股票	379,867,339.41	62.27
2	固定收益投资	154,401,750.00	25.31
	其中：债券	154,401,750.00	25.31
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-



6	银行存款和结算备付金合计	33,936,239.40	5.56
7	其他各项资产	41,847,173.59	6.86
8	合计	610,052,502.40	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,287,413.99	2.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	286,324,765.10	47.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,827,474.00	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	4,423,536.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,096,004.37	8.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,792,667.95	1.78
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,115,478.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	379,867,339.41	62.77

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600271	航天信息	285,512	20,405,542.64	3.37
2	002026	山东威达	1,006,700	17,738,054.00	2.93
3	002013	中航机电	773,051	17,517,335.66	2.89
4	300253	卫宁健康	415,267	17,391,381.96	2.87
5	600562	国睿科技	272,289	16,933,652.91	2.80
6	002149	西部材料	564,000	15,797,640.00	2.61
7	002171	楚江新材	650,395	15,596,472.10	2.58
8	300342	天银机电	331,784	15,262,064.00	2.52
9	600589	广东榕泰	835,900	14,034,761.00	2.32
10	600038	中直股份	258,810	13,647,051.30	2.25

注：1、2016年1月12日，300253 证券简称由“卫宁软件”变更为“卫宁健康”。

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 网站的年度报告正文。

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动****8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	233,342,549.74	17.72
2	601166	兴业银行	220,729,611.94	16.76
3	300104	乐视网	155,883,543.95	11.83
4	002236	大华股份	152,553,701.36	11.58
5	600048	保利地产	151,430,985.38	11.50
6	600999	招商证券	145,520,390.47	11.05
7	600685	中船防务	127,924,207.05	9.71
8	601688	华泰证券	118,802,715.85	9.02
9	000776	广发证券	116,790,746.46	8.87
10	000625	长安汽车	115,902,408.77	8.80
11	601628	中国人寿	109,688,541.35	8.33
12	000024	招商地产	98,312,770.01	7.46
13	600570	恒生电子	97,811,009.15	7.43
14	600525	长园集团	95,005,866.48	7.21
15	601555	东吴证券	85,926,457.04	6.52
16	600893	中航动力	83,871,412.60	6.37
17	600312	平高电气	83,386,928.42	6.33

18	002339	积成电子	81,527,299.94	6.19
19	000831	五矿稀土	81,202,510.26	6.16
20	002736	国信证券	79,785,884.98	6.06
21	601601	中国太保	79,560,636.63	6.04
22	600655	豫园商城	77,149,547.48	5.86
23	600645	中源协和	74,923,478.75	5.69
24	600030	中信证券	73,167,055.58	5.55
25	002013	中航机电	70,862,749.81	5.38
26	300083	劲胜精密	70,426,799.73	5.35
27	600562	国睿科技	69,862,109.65	5.30
28	002364	中恒电气	69,834,697.68	5.30
29	600038	中直股份	67,695,206.54	5.14
30	300070	碧水源	67,019,700.57	5.09
31	300380	安硕信息	67,009,628.78	5.09
32	600643	爱建集团	66,633,124.41	5.06
33	300253	卫宁健康	65,453,062.18	4.97
34	002440	闰土股份	62,934,638.20	4.78
35	601000	唐山港	60,532,229.14	4.60
36	600376	首开股份	59,501,331.08	4.52
37	002104	恒宝股份	57,840,747.24	4.39
38	600436	片仔癀	56,285,484.25	4.27
39	002276	万马股份	53,954,166.06	4.10
40	600686	金龙汽车	53,484,222.20	4.06
41	300136	信维通信	53,118,283.17	4.03
42	603019	中科曙光	53,114,000.23	4.03
43	002405	四维图新	50,927,593.43	3.87
44	600172	黄河旋风	50,125,643.28	3.81
45	300065	海兰信	50,125,332.22	3.81
46	601328	交通银行	49,458,857.05	3.75
47	002268	卫士通	48,735,967.31	3.70
48	002657	中科金财	48,241,727.18	3.66
49	002292	奥飞动漫	47,751,266.70	3.63
50	600115	东方航空	47,671,015.80	3.62
51	002665	首航节能	46,115,392.68	3.50
52	002299	圣农发展	44,866,052.79	3.41
53	000733	振华科技	44,830,103.51	3.40
54	000728	国元证券	43,395,494.06	3.29
55	300205	天喻信息	42,961,295.03	3.26
56	601009	南京银行	42,014,472.94	3.19
57	600498	烽火通信	39,974,524.75	3.03
58	002673	西部证券	39,565,580.57	3.00
59	002169	智光电气	38,919,568.12	2.95
60	000069	华侨城 A	38,355,526.84	2.91
61	601607	上海医药	38,293,600.04	2.91

62	300378	鼎捷软件	38,035,981.51	2.89
63	002439	启明星辰	37,829,953.04	2.87
64	601633	长城汽车	37,805,736.03	2.87
65	002030	达安基因	35,962,541.49	2.73
66	000001	平安银行	35,874,556.92	2.72
67	600158	中体产业	35,651,900.46	2.71
68	002466	天齐锂业	35,230,112.22	2.67
69	300203	聚光科技	35,220,269.65	2.67
70	600369	西南证券	34,276,226.57	2.60
71	300295	三六五网	34,154,995.15	2.59
72	000998	隆平高科	33,878,650.70	2.57
73	002026	山东威达	32,457,920.74	2.46
74	002383	合众思壮	32,125,824.05	2.44
75	600598	北大荒	32,116,656.76	2.44
76	002651	利君股份	32,101,193.21	2.44
77	600240	华业资本	31,865,613.09	2.42
78	000002	万科A	31,424,419.78	2.39
79	600705	中航资本	31,348,058.56	2.38
80	000028	国药一致	29,219,182.79	2.22
81	002456	欧菲光	28,492,019.07	2.16
82	002149	西部材料	28,343,520.36	2.15
83	601336	新华保险	28,256,442.99	2.15
84	000722	湖南发展	28,228,783.10	2.14
85	300033	同花顺	28,159,367.96	2.14
86	300067	安诺其	28,082,431.93	2.13
87	600168	武汉控股	27,110,188.55	2.06
88	601186	中国铁建	26,857,891.00	2.04
89	600010	宝钢股份	26,488,344.49	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	257,578,956.69	19.56
2	601318	中国平安	245,151,732.92	18.61
3	600048	保利地产	244,636,359.63	18.57
4	300104	乐视网	219,808,043.47	16.69
5	000625	长安汽车	189,367,072.55	14.38
6	002236	大华股份	157,113,369.80	11.93

7	600570	恒生电子	155,034,243.76	11.77
8	000024	招商地产	151,120,706.39	11.47
9	600525	长园集团	143,051,478.31	10.86
10	601688	华泰证券	139,690,343.98	10.61
11	600685	中船防务	133,146,243.04	10.11
12	600999	招商证券	129,613,058.37	9.84
13	601628	中国人寿	122,596,277.14	9.31
14	300380	安硕信息	116,207,249.70	8.82
15	000776	广发证券	112,069,203.00	8.51
16	601555	东吴证券	94,832,888.16	7.20
17	601328	交通银行	89,947,604.79	6.83
18	600030	中信证券	87,741,350.30	6.66
19	600655	豫园商城	87,074,177.61	6.61
20	600312	平高电气	83,636,066.49	6.35
21	000831	五矿稀土	83,139,798.14	6.31
22	002104	恒宝股份	82,510,239.93	6.26
23	600893	中航动力	81,952,519.93	6.22
24	601601	中国太保	80,771,951.82	6.13
25	002736	国信证券	79,613,977.36	6.04
26	600643	爱建集团	77,230,966.26	5.86
27	600645	中源协和	74,776,377.52	5.68
28	300136	信维通信	74,516,336.00	5.66
29	300083	劲胜精密	70,219,219.48	5.33
30	300070	碧水源	68,237,605.13	5.18
31	600436	片仔癀	68,123,849.54	5.17
32	002405	四维图新	67,950,766.41	5.16
33	603019	中科曙光	67,827,414.14	5.15
34	002339	积成电子	67,747,731.18	5.14
35	002440	闰土股份	64,221,142.04	4.88
36	600562	国睿科技	61,636,054.49	4.68
37	300253	卫宁健康	61,539,946.88	4.67
38	002665	首航节能	60,566,446.50	4.60
39	002013	中航机电	59,463,465.85	4.51
40	601766	中国中车	58,895,782.34	4.47
41	601000	唐山港	58,364,516.96	4.43
42	600376	首开股份	58,071,514.49	4.41
43	300065	海兰信	57,751,202.22	4.38
44	601006	大秦铁路	57,535,123.59	4.37
45	300378	鼎捷软件	54,989,883.00	4.17
46	002292	奥飞动漫	54,707,903.14	4.15
47	600240	华业资本	52,696,121.82	4.00
48	600038	中直股份	51,538,748.76	3.91
49	002276	万马股份	51,291,456.99	3.89
50	601186	中国铁建	49,519,353.54	3.76

51	002657	中科金财	48,594,367.52	3.69
52	600754	锦江股份	48,112,910.12	3.65
53	600115	东方航空	46,760,311.46	3.55
54	600498	烽火通信	45,621,528.63	3.46
55	002673	西部证券	45,544,216.83	3.46
56	002171	楚江新材	45,219,238.12	3.43
57	000728	国元证券	44,821,419.93	3.40
58	002030	达安基因	44,754,340.03	3.40
59	601009	南京银行	43,877,260.95	3.33
60	600503	华丽家族	43,140,966.72	3.28
61	600168	武汉控股	42,916,513.34	3.26
62	002364	中恒电气	42,779,484.02	3.25
63	300205	天喻信息	42,158,802.34	3.20
64	600172	黄河旋风	41,636,085.32	3.16
65	601607	上海医药	41,021,601.68	3.11
66	000157	中联重科	40,599,418.10	3.08
67	000401	冀东水泥	40,530,816.70	3.08
68	601633	长城汽车	40,312,878.11	3.06
69	600588	用友网络	39,759,875.16	3.02
70	000733	振华科技	39,095,141.14	2.97
71	601992	金隅股份	38,643,048.67	2.93
72	002299	圣农发展	38,283,306.76	2.91
73	000069	华侨城 A	37,693,930.61	2.86
74	000001	平安银行	37,310,906.31	2.83
75	600068	葛洲坝	37,052,458.94	2.81
76	600158	中体产业	36,603,201.33	2.78
77	002268	卫士通	35,893,532.98	2.73
78	300399	京天利	35,763,028.32	2.72
79	600686	金龙汽车	34,379,574.86	2.61
80	600369	西南证券	34,349,242.99	2.61
81	300067	安诺其	34,010,223.89	2.58
82	000651	格力电器	33,778,635.46	2.56
83	002439	启明星辰	32,491,871.98	2.47
84	002466	天齐锂业	32,468,128.79	2.46
85	000002	万科 A	32,030,237.39	2.43
86	600010	包钢股份	31,395,063.05	2.38
87	300033	同花顺	31,121,118.45	2.36
88	300203	聚光科技	30,953,758.31	2.35
89	002169	智光电气	30,732,198.35	2.33
90	300295	三六五网	30,393,487.95	2.31
91	002456	欧菲光	29,621,973.23	2.25
92	600259	广晟有色	29,608,004.03	2.25
93	300226	上海钢联	28,036,208.07	2.13
94	300347	泰格医药	28,011,646.18	2.13

95	600000	浦发银行	27,981,309.96	2.12
96	002383	合众思壮	27,847,469.36	2.11
97	000078	海王生物	27,744,217.89	2.11
98	600598	北大荒	27,451,624.13	2.08
99	002174	游族网络	27,169,593.70	2.06
100	600705	中航资本	27,148,743.56	2.06
101	300124	汇川技术	26,813,946.54	2.04
102	300170	汉得信息	26,758,777.55	2.03
103	601336	新华保险	26,434,339.95	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	8,848,840,285.11
卖出股票的收入（成交）总额	9,867,146,456.91

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	151,746,000.00	25.07
	其中：政策性金融债	151,746,000.00	25.07
4	企业债券	2,655,750.00	0.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	154,401,750.00	25.51

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	140210	14 国开 10	1,000,000	111,630,000.00	18.44
2	150411	15 农发 11	400,000	40,116,000.00	6.63
3	124722	14 包滨河	25,000	2,655,750.00	0.44

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。



**8.12.2** 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	864,487.62
2	应收证券清算款	35,861,270.02
3	应收股利	-
4	应收利息	5,118,941.50
5	应收申购款	2,474.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,847,173.59

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600271	航天信息	20,405,542.64	3.37	重大资产重组

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

35,492	18,768.26	2,455,151.52	0.37%	663,668,016.36	99.63%
--------	-----------	--------------	-------	----------------	--------

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年5月25日)基金份额总额	2,564,312,627.02
本报告期期初基金份额总额	1,630,435,696.04
本报告期基金总申购份额	77,923,541.53
减：本报告期基金总赎回份额	1,042,236,069.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	666,123,167.88

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年1月17日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司股东会审议通过，聘请俞涛先生担任本公司职工监事，高勇前先生不再担任本公司职工监事。

2015年2月14日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第三十六次临时会议审议通过，同意田仁灿先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长

张文伟先生代为履行总经理职务。

2015 年 4 月 8 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司 2015 年第四次临时股东大会审议通过，同意田仁灿先生辞去本公司董事职务，由简伟信(Vincent Camerlynck)先生继任本公司董事。

2015 年 5 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第三十六次临时会议审议通过，并向中国证券监督管理委员会报告，经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】753 号文核准批复。公司聘请刘颂先生任总经理，同时公司董事长张文伟先生不再代行总经理职务。

2015 年 7 月 14 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第四十二次临时会议审议通过，聘任奚万荣先生担任公司督察长，原公司督察长章明女士转任公司副总经理。

2015 年 8 月 20 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第四十五次临时会议审议通过，同意孟辉先生辞去公司副总经理职务。

2015 年 10 月 15 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司股东会审议通过，聘请陈虹女士担任本公司监事，奚万荣先生不再担任本公司监事。

2016 年 1 月 20 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第四届董事会第四十八次会议审议通过，同意戴德舜先生辞去公司副总经理职务。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 90,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 10 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

海富通基金管理有限公司（以下简称“公司”）于 2015 年 2 月 10 日收到上海证监局《关于对海富通基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行为期 6 个月的整改，上海证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内部控制和风险管理工作进行了全面梳理，彻底排查业务中存在的风险隐患，针对性的制定、实施整改措施，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。本报告期内，公司

已经完成了决定书中所指出问题的整改工作并通过了监管部门的检查验收。公司整改期于 2015 年 8 月 10 日正式结束，公司自该日起可以正常上报基金产品。除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	5,013,391,173.04	26.79%	3,593,966.38	24.48%	-
华创证券	1	3,017,468,893.27	16.12%	2,084,616.04	14.20%	-
中信建投	2	2,435,328,396.31	13.01%	1,703,367.16	11.60%	-
招商证券	1	2,209,199,809.18	11.80%	1,989,971.34	13.56%	-
国信证券	1	2,167,391,314.77	11.58%	1,978,858.35	13.48%	-
东北证券	1	1,569,763,269.65	8.39%	1,390,522.54	9.47%	-
中泰证券	1	712,997,244.20	3.81%	506,178.08	3.45%	-
瑞银证券	1	673,471,892.69	3.60%	595,954.26	4.06%	-
东方证券	2	526,592,702.53	2.81%	479,410.22	3.27%	-
中信证券	3	390,382,046.38	2.09%	355,399.36	2.42%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

#### 2、（1）交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

#### （2）交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司业总裁办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总裁办公会核准。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	12,148,540.26	33.75%	2,800,000,000.00	70.62%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	60,585.01	0.17%	365,000,000.00	9.21%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	16,609,342.27	46.15%	800,000,000.00	20.18%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	7,174,137.27	19.93%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基

金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 32 只公募基金。截至 2015 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 469 亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，截至 2015 年 12 月 31 日，海富通为近 80 家企业超过 349 亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，截至 2015 年 12 月 31 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 103 亿元。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。

2004 年末开始，海富通为 QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至 2015 年 12 月 31 日，投资咨询及海外业务规模超过 111 亿元人民币。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 2 月，海富通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自 2008 年启动“绿色与希望-橄榄枝公益环保计划”，针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠，向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。几年来，海富通的公益行动进一步升级，持续为上海民工小学学生捐献生活物资，并向安徽农村小学捐献图书室。此外，海富通还积极推进投资者教育工作，推出了以“幸福投资”为主题和特色的投资者教育活动，向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

海富通基金管理有限公司  
二〇一六年三月二十八日