

**海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金**  
**2015 年半年度报告**  
**2015 年 6 月 30 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：二〇一五年八月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 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。本半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 2015 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§7 投资组合报告</b>	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 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	48
7.9 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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.3 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 .....	50
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	50
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	51
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2 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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	56
<b>§12 备查文件目录</b> .....	57
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	海富通新内需混合
基金主代码	519130
交易代码	519130
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 27 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,386,889,088.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将从受益于国家扩大内需促进经济发展政策的热点行业中，精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极投资，同时利用灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期增值。
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日常管理。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股指数×50%+上证国债指数×50%
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	奚万荣	洪渊
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	40088-40099	95588	
传真	021-33830166	010-66105798	
注册地址	上海市浦东新区陆家嘴花园 石桥路66号东亚银行金融大 厦36-37层	北京市西城区复兴门内大街 55号	
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园 石桥路66号东亚银行金融 大厦36-37层	北京市西城区复兴门内大街 55号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	张文伟	姜建清	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和 《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网 址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任 公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	<b>报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）</b>
本期已实现收益	134,124,594.11
本期利润	84,514,900.71
加权平均基金份额本期利润	0.0402
本期加权平均净值利润率	2.98%
本期基金份额净值增长率	12.11%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2015 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配利润	2,736,832,131.24
期末可供分配基金份额利润	0.3705
期末基金资产净值	10,123,721,220.11
期末基金份额净值	1.370
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	37.00%

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
过去一个月	0.59%	0.07%	-3.93%	1.72%	4.52%	-1.65%
过去三个月	10.93%	0.66%	6.98%	1.32%	3.95%	-0.66%
过去六个月	12.11%	1.47%	17.73%	1.12%	-5.62%	0.35%
自基金合同生效起至今	37.00%	1.95%	31.88%	1.11%	5.12%	0.84%

### 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

海富通新内需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历史走势对比图  
 (2014 年 11 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2014 年 11 月 27 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年，截至报告日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。

## §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 6 月 30 日，本基金管理人共管理 32 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

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、海富通现金管理货币市场基金、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、海富通双利分级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		
顾晓飞	本基金的基金经理；海富通风格优势混合基金经理；海富通国策导向混合基金经理	2014-11-27	-	7 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 5 月至 2010 年 6 月任天隼投资咨询管理有限公司研究员，2010 年 6 月至 2011 年 7 月任天治基金管理有限公司研究员，2011 年 8 月至 2011 年 10 月任东吴基金管理有限公司研究员，2011 年 10 月至 2014 年 7 月任国泰基金管理有限公司研究员及基金经理助理，2014 年 8 月加入海富通基

					金管理有限公司。2014 年 8 月起任海富通国策导向混合基金经理。2014 年 12 月起兼任海富通新内需混合和海富通风格优势混合基金经理。
陈甄璞	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通养老收益混合基金经理	2015-04-29	-	7 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。1999 年 6 月至 2001 年 3 月任职于复旦金仕达计算机有限公司，2001 年 3 月至 2004 年 3 月任职于东方证券股份有限公司，2004 年 3 月至 2007 年 1 月任职于复旦金仕达计算机有限公司，2007 年 1 月至 2008 年 5 月任职于 IBM 中国有限公司，2008 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，担任量化分析师，2011 年 10 月起任投资经理。2014 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金基金经理。2015 年 4 月起兼任海富通养老收益混合和海富通新内需混合基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券	2015-04-29	-	10 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至

	基金经理； 海富通现金 管理货币基 金经理；海 富通稳健添 利债券基金 经理				2014 年 6 月就职于华宝兴 业基金管理有限公司，曾 任产品经理、研究员、专 户投资经理、基金经理助 理，2014 年 6 月加入海富 通基金管理有限公司。 2014 年 7 月起任海富通现 金管理货币基金经理。 2014 年 9 月起兼任海富通 季季增利理财债券基金经 理。2015 年 1 月起兼任海 富通稳健添利债券基金经 理。2015 年 4 月起兼任海 富通新内需混合基金经理。
刘石 开	本基金的基 金经理助理； 海富通养老 收益混合基 金经理助理； 海富通领先 成长混合基 金经理助理； 海富通阿尔 法对冲混合 基金经理助 理	2015-05-11	-	5 年	硕士，持有基金从业人员 资格证书，历任银联商务 有限公司业务管理部数据 分析员，长江证券股份有 限公司金融衍生产品部金 融工程师，2011 年 6 月加 入海富通基金管理有限公司，任权益投资部数量分 析研究员。现任海富通领 先成长混合、海富通阿尔 法对冲混合、海富通养老 收益混合、海富通新内需 混合基金经理助理。

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 公平交易制度的执行情况

报告期内，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。

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。

报告期内，公司在严格遵循独立投资决策流程和执行投资交易行为监控制度的基础上，对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、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）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，检验结果表明，在 T 日、T+3 日和 T+5 日不同循环期内，不管是买入或是卖出，公司各组合间买卖价差并不显著，表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待，不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

### 4.3.2 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。

## 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

从股市上看,对于 2015 年上半年市场走势,可以用一句话概括: 辛辛苦苦大半年,一月回到半年前。

今年始,大盘从 3258.63 点起步,经过两个多月的横盘整理后,从 3 月中旬开始发力,并于 6 月 12 日拿下 5178.19 高点,创 7 年多新高。期间经历了“5•28”一天 300 多点的跌幅。大盘创下新高后旋即掉头往下,在 6 月份余下的 11 个交易日里跌去 900 点,跌幅近 20%。投资者预设的反弹点位一再被击破,千股跌停局面频现。

政策方面,在暴跌之前,一带一路、自贸区、互联网+、中国制造 2015、京津冀、军工改革、国企改革等题材概念,在国家政策扶持下你方唱罢我登场;资金面上,今

年上半年，央行分别进行了 3 次降准和降息，尤其是 6 月 27 日，在市场跌跌不休的情况下，央行送出降息降准双礼包，但市场表现差强人意。

指数方面，虽然经历了 6 月中下旬的暴跌，四大指数涨幅还是喜人。创业板指涨幅远超主板，为 94.23%，紧随其后的是中小板指，涨幅 69.06%，上证综指和深证成指涨幅与前两个相比相对较小，分别为 32.23%和 30.17%。创业板、中小板涨幅较好与国家鼓励企业创新转型不无关系。从具体行业里面也可以看出端倪，就中信证券一级行业指数而言，今年上半年，计算机、通信、轻工制造和餐饮旅游等行业翻了一倍，而银行、券商和保险以及传统的煤炭、有色、钢铁等涨幅殿后。

IPO 新股发行方面，共发行 193 只新股，累计募集资金 1465.5 亿，由于平均首发市盈率只有 21.8 倍，所有的新股在上市初期都爆发了惊人的巨额涨幅，为网上和网下新股申购参与者带来显著收益。

本基金在上半年配置在蓝筹股上的比例较高，结构上金融地产建筑占主要仓位，6 月份以后参与新股网下申购并提高了现金管理的比重。

从债市看，上半年经济基本面总体疲弱，工业、投资等多项经济数据屡屡创下近年来的新低，一季度 GDP 增速 7%也已接近政府“底线”。在这种情况下政府显现出强烈的稳增长意愿，首先货币政策延续宽松，上半年央行接连实施了三次降准和三次降息，并持续通过 SLF、MLF 等定向手段向市场注入流动性；同时财政政策也积极发力，2015 年赤字率目标由去年的 2.1%提升至 2.3%，并推出万亿地方债置换，希望通过地方基建拉动投资。在此背景下，上半年债券市场却并没有走出去年下半年的大牛行情，一月到三月短端和长端利率都是先下后上，期限利差保持低位，四月降准之后短端利率开始大幅下降，7 天回购利率一度维持 2%以下，但是长端利率却始终处于区间震荡而无法突破下行。利率债收益率曲线从年初的“极度平坦”转变为目前的“极度陡峭”，宽货币释放的大量资金被淤积在银行间而未有效投向实体，降低实体经济融资成本的目标仍任重而道远。总体看上半年 1 年期国债收益率下行 152BP，10 年期国债收益率仅下行 2BP。信用债上半年表现相对出色，各评级、各期限品种都有 30BP 以上的下行幅度，尤其是中短久期、高评级信用债成为“息差”策略的主流品种而受到追捧，城投债也因为地方债置换安全度提高而投资情绪有所好转。转债方面，一至五月转债受股市推动大幅上涨，众多个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，上半年中证转债指数跌 12%。

本基金一季度未参与债券方面的投资，二季度本基金债券部分主要根据新股申购的节奏管理组合流动性，非打新期间操作以存款和配置短期短融为主。

#### 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 12.11%，同期业绩比较基准收益率为 17.73%，基

金净值跑输业绩比较基准 5.62 个百分点。基金跑输基准是因为在一季度没有及时预判大盘风格变化，及时调整行业配置，在涨幅较大的中小板和创业板几乎没有配置，5 月份以后降低了股票类资产的权重。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，政府预计将延续既有的货币政策和财政政策，一系列已出台的稳增长政策有望在三四季度对经济起到拉动作用，宏观经济将触底企稳。至于 A 股市场，鉴于资金杠杆效应导致了指数的暴涨暴跌，引发市场参与者的深刻反思，也降低了参与者的热情。随着资金杠杆的下降，市场对下半年资金面的乐观判断开始动摇，对市场走势构成制约，同时投资者对于估值和业绩的重新考量也可能触发投资风格的转变。

基于此，下半年 A 股市场预计将出现宽幅振荡格局。但在牛市格局下，类似振荡有望夯实市场基础，为今后上行创造条件，与此同时结构性机会预计将层出不穷。本基金将在抓住固定收益的投资机会的同时，做好股票的结构性上涨波段。

从债市看，当前债券市场正处于比较纠结的状态，一方面各项经济数据显示基本面仍未企稳，未来仍有下行压力；通胀维持低位，央行货币政策难以转向，而且从手段上看无论是定向工具的运用还是降准、降息都还有放松的空间；但另一方面，近期地产销售的边际改善、地方融资放松、基建托底等使得市场对下半年经济企稳和通胀反弹的预期在增强，加上地方债置换供给不断、利率市场化的推进、股市分流效应使得债券长端利率水平受到压制，而短端利率已无法更低。我们认为未来这种矛盾可能还将持续，而债市阶段性的走向仍取决于央行多目标管理下的操作。目前看货币宽松的大方向不会变，但经历了多次降息降准后未来货币政策的重点可能在于疏通传导，因此央行的操作会变得更为“平衡”，这种平衡包括短期和长期资金的平衡、利率和汇率的平衡。因此对于下半年的利率债来说可能仍会是一个区间波动的走势。信用债方面，今年信用风险持续发酵，下半年将进入评级下调高发期，重点关注煤炭、有色、机械设备等强周期行业。目前信用债收益率和利差均处于历史较低水平，未来收益率继续下行的弹性减弱，但信用债在强烈的套息需求下未来表现可能仍会好于利率债，信用利差或许难以大幅走扩。转债方面，股性主导下转债总体仍将跟随股市波动。目前看股市已进入震荡期，高估值下转债配置价值较低，且操作难度较大，下半年可积极关注新发行个券。

下半年，本基金债券部分短期内主要将配置流动性较好的短期限短融，以及短期存款。如果未来新股发行恢复，则回到新股申购的流动性管理工作上。

#### 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**

2015 年上半年，本基金托管人在对海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金的托管过程中，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	9,984,362,372.27	79,045,501.73
结算备付金		31,678,633.25	-
存出保证金		746,655.71	-
交易性金融资产	6.4.7.2	106,818,988.63	670,601,062.94
其中：股票投资		80,080,488.63	670,601,062.94
基金投资		-	-
债券投资		26,738,500.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		62,849,437.31	1,736,879.68
应收利息	6.4.7.5	4,264,644.71	16,437.78
应收股利		-	-
应收申购款		203,548.08	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>10,190,924,279.96</b>	<b>751,399,882.13</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		51,759,844.89	-
应付管理人报酬		12,557,716.29	978,312.32
应付托管费		2,092,952.71	163,052.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	541,289.99	1,793,296.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	251,255.97	35,862.50
负债合计		67,203,059.85	2,970,523.20
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	7,386,889,088.87	612,499,675.00
未分配利润	6.4.7.10	2,736,832,131.24	135,929,683.93
所有者权益合计		10,123,721,220.11	748,429,358.93
负债和所有者权益总计		10,190,924,279.96	751,399,882.13

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.370 元，基金份额总额 7,386,889,088.87

份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>112,700,125.44</b>
1.利息收入		16,681,110.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,942,028.43
债券利息收入		114,181.55
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,624,900.11
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		141,369,272.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	141,028,007.57
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	341,265.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-49,609,693.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,259,435.98
<b>减：二、费用</b>		<b>28,185,224.73</b>
1. 管理人报酬		20,533,114.27
2. 托管费		3,422,185.67
3. 销售服务费		-

4. 交易费用	6.4.7.19	4,048,058.10
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	181,866.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>84,514,900.71</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>84,514,900.71</b>

注：基金合同成立于 2014 年 11 月 27 日，上年度可比区间无比较数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	612,499,675.00	135,929,683.93	748,429,358.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	84,514,900.71	84,514,900.71
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）	6,774,389,413.87	2,516,387,546.60	9,290,776,960.47
其中：1.基金申购款	7,692,484,970.51	2,726,079,807.44	10,418,564,777.95
2.基金赎回款	-918,095,556.64	-209,692,260.84	-1,127,787,817.48
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	7,386,889,088.87	2,736,832,131.24	10,123,721,220.11

(基金净值)			
--------	--	--	--

注：基金合同成立于 2014 年 11 月 27 日，上年度可比区间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通新内需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”)证监基金字[2014]第 479 号《关于同意海富通新内需灵活配置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《海富通新内需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 612,311,169.88 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(2014)第 713 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 612,499,675.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 188,505.12 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《海富通新内需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%-100%；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。本基金将 80%以上的非现金投资于收益于内需增长的公司发行的股票和债券。

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 2015 年 8 月 27 日批准报出。

### 6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通新内需灵活配

置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的有关规定编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半年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 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 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。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 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债券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。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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止

的利息，单独确认为应收项目。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。

#### 6.4.4.5 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债券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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分

部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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、资产支持证券和私募债券除外)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 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、资产支持证券和私募债券除外), 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。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内不存在重大会计差错。

#### 6.4.6 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》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。自 2013 年 1 月 1 日起, 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, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	2,984,362,372.27
定期存款	7,000,000,000.00

存款期限 1 个月以内 (含 1 个月)	7,000,000,000.00
其他存款	-
合计	9,984,362,372.27

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	78,016,381.85	80,080,488.63	2,064,106.78
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	26,777,500.00	26,738,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	26,777,500.00	26,738,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	104,793,881.85	106,818,988.63	2,025,106.78

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	428,740.45
应收定期存款利息	3,111,111.09
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	12,829.77
应收债券利息	711,661.00
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	302.40
合计	4,264,644.71

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	541,289.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	541,289.99

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	66,310.26
预提费用	184,945.71
合计	251,255.97

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	612,499,675.00	612,499,675.00
本期申购	7,692,484,970.51	7,692,484,970.51
本期赎回 (以“-”号填列)	-918,095,556.64	-918,095,556.64
本期末	7,386,889,088.87	7,386,889,088.87

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	84,294,883.75	51,634,800.18	135,929,683.93
本期利润	134,124,594.11	-49,609,693.40	84,514,900.71
本期基金份额交易产生的变动数	2,774,988,045.20	-258,600,498.60	2,516,387,546.60
其中：基金申购款	2,979,046,276.53	-252,966,469.09	2,726,079,807.44
基金赎回款	-204,058,231.33	-5,634,029.51	-209,692,260.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,993,407,523.06	-256,575,391.82	2,736,832,131.24

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,789,826.73
定期存款利息收入	7,079,444.42
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	67,907.79
其他	4,849.49
合计	10,942,028.43

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	1,675,497,790.85
减：卖出股票成本总额	1,534,469,783.28
买卖股票差价收入	141,028,007.57

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	341,265.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	341,265.20

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-49,609,693.40
——股票投资	-49,570,693.40
——债券投资	-39,000.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
合计	-49,609,693.40

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	4,047,916.27
基金转换费收入	211,519.71
合计	4,259,435.98

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

2.本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	4,048,058.10
银行间市场交易费用	-
合计	4,048,058.10

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	30,317.50
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	2,783.48
合计	181,866.69

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易，上年度可比区间无比较数据。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，上年度可比区间无比较数据。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，上年度可比区间无比较数据。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,533,114.27
其中：支付销售机构的客户维护费	2,310,797.96

注：1、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。

2、基金合同成立于 2014 年 11 月 27 日, 上年度可比区间无比较数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	3,422,185.67	

注：1、支付基金托管人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。

2、基金合同成立于 2014 年 11 月 27 日, 上年度可比区间无比较数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易，上年度可比区间无比较数据。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金，上年度可比区间无比较数据。

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金，上年度可比区间无比较数据。

#### 6.4.10.5 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6月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	2,984,362,372.27	3,789,826.73

注：1、本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

2、基金合同成立于 2014 年 11 月 27 日, 上年度可比区间无比较数据。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未通过关联方购买其承销的证券，上年度可比区间无比较数据。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期本基金投资了基金托管人中国工商银行股份有限公司发行的股票。该项投资履行了相关的审批流程，不存在利益输送。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300480	光力科技	2015-06-25	2015-07-02	网下中签	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64	-
300487	蓝晓科技	2015-06-24	2015-07-02	网下中签	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00	-
300488	恒锋工具	2015-06-25	2015-07-01	网下中签	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-
300489	中飞股份	2015-06-24	2015-07-01	网下中签	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64	-
603838	四通股份	2015-06-23	2015-07-01	网下中签	7.73	7.73	18,119	140,059.87	140,059.87	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
132002	15 天集 EB	2015-06-10	2015-07-02	网下中签	100.00	100.00	11,210	1,121,000.00	1,121,000.00	-

## 6.4.12.2 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000709	河北钢铁	2015-06-08	重大事项	7.00	2015-08-24	6.30	49,200	307,008.00	344,400.00	-
000716	黑芝麻	2015-06-08	重大事项	23.69	2015-08-03	21.32	24,200	599,506.00	573,298.00	-
000761	本钢板材	2015-06-23	重大事项	7.75	2015-07-21	6.93	36,100	306,128.00	279,775.00	-
002209	达意隆	2015-06-08	重大事项	26.54	2015-07-13	23.89	21,700	594,844.00	575,918.00	-
002374	丽鹏股份	2015-06-30	重大事项	23.34	2015-07-13	22.50	19,300	601,075.00	450,462.00	-
002591	恒大高新	2015-06-24	重大事项	19.95	2015-07-17	17.96	32,000	618,378.03	638,400.00	-
002632	道明光学	2015-06-30	重大事项	22.50	2015-07-14	24.75	21,500	612,959.48	483,750.00	-
002639	雪人股份	2015-06-30	重大事项	38.30	-	-	15,200	593,290.00	582,160.00	-
002668	奥马电器	2015-06-29	重大事项	29.04	-	-	16,600	599,459.00	482,064.00	-
300316	晶盛机电	2015-06-24	非公开发行股票	25.90	-	-	26,300	605,327.00	681,170.00	-
300349	金卡股份	2015-06-18	重大事项	59.79	2015-08-19	53.81	10,800	623,939.00	645,732.00	-
300467	迅游科技	2015-06-25	重大事项	297.30	2015-07-02	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80	-
000024	招商地产	2015-04-03	重大事项	36.50	-	-	500,000	12,449,796.12	18,250,000.00	-
002530	丰东股份	2015-06-08	重大事项	16.69	-	-	31,900	607,451.00	532,411.00	-

600886	国投电力	2015-06-24	重大事项	14.87	-	-	22,700	308,705.00	337,549.00	-
--------	------	------------	------	-------	---	---	--------	------------	------------	---

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的四层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年末 2014年12月31日
AAA	25,617,500.00	-
AAA 以下	1,121,000.00	-
未评级	-	-
合计	26,738,500.00	-

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金

与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	9,984,362,372.27	-	-	-	9,984,362,372.27
结算备付金	31,678,633.25	-	-	-	31,678,633.25
存出保证金	746,655.71	-	-	-	746,655.71
交易性金融资产	25,617,500.00	1,121,000.00	-	80,080,488.63	106,818,988.63
应收证券清算款	-	-	-	62,849,437.31	62,849,437.31
应收申购款	-	-	-	203,548.08	203,548.08
应收利息	-	-	-	4,264,644.71	4,264,644.71
<b>资产总计</b>	<b>10,042,405,161.23</b>	<b>1,121,000.00</b>	<b>0.00</b>	<b>147,398,118.73</b>	<b>10,190,924,279.</b>

					96
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	12,557,716.29	12,557,716.29
应付托管费	-	-	-	2,092,952.71	2,092,952.71
应付交易费用	-	-	-	541,289.99	541,289.99
应付赎回款	-	-	-	51,759,844.89	51,759,844.89
其他负债	-	-	-	251,255.97	251,255.97
负债总计	-	-	-	67,203,059.85	67,203,059.85
利率敏感度缺口	10,042,405,161.23	1,121,000.00	0.00	80,195,058.88	10,123,721,220.11
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	79,045,501.73	-	-	-	79,045,501.73
交易性金融资产	-	-	-	670,601,062.94	670,601,062.94
应收证券清算款	-	-	-	1,736,879.68	1,736,879.68
应收利息	-	-	-	16,437.78	16,437.78
资产总计	79,045,501.73	0.00	0.00	672,354,380.40	751,399,882.13
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	978,312.32	978,312.32
应付托管费	-	-	-	163,052.07	163,052.07
应付交易费用	-	-	-	1,793,296.31	1,793,296.31
其他负债	-	-	-	35,862.50	35,862.50
负债总计	-	-	-	2,970,523.20	2,970,523.20
利率敏感度缺口	79,045,501.73	0.00	0.00	669,383,857.20	748,429,358.93

--	--	--	--	--	--

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产 0%-95%、债券资产 5%-95%、权证投资 0%-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	80,080,488.63	0.79	670,601,062.94	89.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属	-	-	-	-

投资				
衍生金融资产—权证投资		-	-	-
其他		-	-	-
合计	80,080,488.63	0.79	670,601,062.94	89.60

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
分析	1. 业绩比较基准 (附注 6.4.1)上升 5%	增加约 310	增加约 5032
	2. 业绩比较基准 (附注 6.4.1)下降 5%	减少约 310	减少约 5032

注: 影响金额为约数,精确到万元。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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	80,080,488.63	0.79
	其中: 股票	80,080,488.63	0.79
2	固定收益投资	26,738,500.00	0.26

	其中：债券	26,738,500.00	0.26
	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	10,016,041,005.52	98.28
7	其他各项资产	68,064,285.81	0.67
8	合计	10,190,924,279.96	100.00

## 7.2 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	484,279.65	0.00
B	采矿业	4,243,626.25	0.04
C	制造业	23,785,261.23	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,698,306.00	0.03
E	建筑业	1,497,822.72	0.01
F	批发和零售业	2,860,005.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	789,484.00	0.01
H	住宿和餐饮业	465,766.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,687,566.80	0.06
J	金融业	10,157,915.00	0.10
K	房地产业	22,293,777.00	0.22
L	租赁和商务服务业	3,380,562.30	0.03
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	912,505.00	0.01
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	80,080,488.63	0.79

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000024	招商地产	500,000	18,250,000.00	0.18
2	600718	东软集团	200,000	4,346,000.00	0.04
3	601166	兴业银行	215,600	3,719,100.00	0.04
4	600138	中青旅	150,000	3,168,000.00	0.03
5	600048	保利地产	223,400	2,551,228.00	0.03
6	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.02
7	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.02
8	601688	华泰证券	65,000	1,503,450.00	0.01
9	600109	国金证券	50,000	1,220,000.00	0.01
10	603589	口子窖	45,168	1,144,557.12	0.01
11	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.01
12	002776	柏堡龙	20,296	823,611.68	0.01
13	002755	东方新星	18,240	719,932.80	0.01
14	300099	尤洛卡	25,900	685,055.00	0.01
15	300316	晶盛机电	26,300	681,170.00	0.01
16	300349	金卡股份	10,800	645,732.00	0.01
17	002591	恒大高新	32,000	638,400.00	0.01

18	002639	雪人股份	15,200	582,160.00	0.01
19	002209	达意隆	21,700	575,918.00	0.01
20	000716	黑芝麻	24,200	573,298.00	0.01
21	600305	恒顺醋业	18,500	558,515.00	0.01
22	600861	北京城乡	29,200	558,304.00	0.01
23	000430	张家界	39,500	535,225.00	0.01
24	002530	丰东股份	31,900	532,411.00	0.01
25	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.01
26	601798	蓝科高新	30,000	493,800.00	0.00
27	600969	郴电国际	24,200	492,470.00	0.00
28	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.00
29	002632	道明光学	21,500	483,750.00	0.00
30	002668	奥马电器	16,600	482,064.00	0.00
31	601137	博威合金	18,600	478,020.00	0.00
32	000593	大通燃气	36,100	468,939.00	0.00
33	601007	金陵饭店	20,600	465,766.00	0.00
34	600613	神奇制药	18,200	461,188.00	0.00
35	600114	东睦股份	25,300	454,388.00	0.00
36	002374	丽鹏股份	19,300	450,462.00	0.00
37	600693	东百集团	34,700	432,015.00	0.00
38	600758	红阳能源	26,400	427,152.00	0.00
39	600604	市北高新	24,500	423,605.00	0.00
40	601011	宝泰隆	28,700	421,316.00	0.00
41	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.00
42	002770	科迪乳业	40,555	399,872.30	0.00
43	002427	尤夫股份	18,700	391,391.00	0.00

44	601799	星宇股份	10,100	386,224.00	0.00
45	600706	曲江文旅	18,000	377,280.00	0.00
46	000709	河北钢铁	49,200	344,400.00	0.00
47	600886	国投电力	22,700	337,549.00	0.00
48	601009	南京银行	14,800	337,440.00	0.00
49	600011	华能国际	23,900	335,317.00	0.00
50	600027	华电国际	29,700	330,264.00	0.00
51	000039	中集集团	10,000	323,000.00	0.00
52	000651	格力电器	5,000	319,500.00	0.00
53	601006	大秦铁路	22,100	310,284.00	0.00
54	601939	建设银行	43,400	309,442.00	0.00
55	000333	美的集团	8,200	305,696.00	0.00
56	601988	中国银行	60,700	296,823.00	0.00
57	000002	万科A	20,200	293,304.00	0.00
58	000402	金融街	20,400	288,252.00	0.00
59	601288	农业银行	77,500	287,525.00	0.00
60	000418	小天鹅A	12,000	286,800.00	0.00
61	601998	中信银行	37,100	286,041.00	0.00
62	000625	长安汽车	13,500	285,525.00	0.00
63	600036	招商银行	15,100	282,672.00	0.00
64	600019	宝钢股份	32,300	282,302.00	0.00
65	600016	民生银行	28,200	280,308.00	0.00
66	000761	本钢板材	36,100	279,775.00	0.00
67	601808	中海油服	10,000	279,400.00	0.00
68	601318	中国平安	3,400	278,596.00	0.00
69	600508	上海能源	17,600	276,848.00	0.00

70	000550	江铃汽车	7,500	275,250.00	0.00
71	600028	中国石化	38,900	274,634.00	0.00
72	601169	北京银行	20,600	274,392.00	0.00
73	600015	华夏银行	18,000	273,780.00	0.00
74	000001	平安银行	18,800	273,352.00	0.00
75	601991	大唐发电	34,100	272,118.00	0.00
76	000338	潍柴动力	8,500	269,110.00	0.00
77	601601	中国太保	8,900	268,602.00	0.00
78	601857	中国石油	23,700	268,521.00	0.00
79	601088	中国神华	12,800	266,880.00	0.00
80	600104	上汽集团	11,800	266,680.00	0.00
81	601818	光大银行	49,700	266,392.00	0.00
82	600600	青岛啤酒	5,600	260,904.00	0.00
83	601668	中国建筑	31,300	260,103.00	0.00
84	000600	建投能源	17,700	259,836.00	0.00
85	601666	平煤股份	34,100	258,137.00	0.00
86	600383	金地集团	20,400	258,060.00	0.00
87	600997	开滦股份	29,700	256,014.00	0.00
88	600004	白云机场	15,100	255,190.00	0.00
89	600123	兰花科创	21,400	251,664.00	0.00
90	600660	福耀玻璃	17,600	251,328.00	0.00
91	600723	首商股份	20,300	250,299.00	0.00
92	600348	阳泉煤业	24,200	248,050.00	0.00
93	601699	潞安环能	25,400	245,618.00	0.00
94	600827	百联股份	11,800	245,558.00	0.00
95	000531	穗恒运 A	17,400	243,600.00	0.00

96	600720	祁连山	22,700	240,393.00	0.00
97	600585	海螺水泥	11,200	240,240.00	0.00
98	600295	鄂尔多斯	20,000	240,000.00	0.00
99	600062	华润双鹤	9,200	239,568.00	0.00
100	600216	浙江医药	18,000	239,040.00	0.00
101	600971	恒源煤电	26,100	238,815.00	0.00
102	600230	沧州大化	15,200	238,792.00	0.00
103	600694	大商股份	4,300	237,704.00	0.00
104	600697	欧亚集团	7,600	235,448.00	0.00
105	600742	一汽富维	7,700	234,696.00	0.00
106	000521	美菱电器	26,000	234,520.00	0.00
107	600050	中国联通	31,900	233,827.00	0.00
108	601678	滨化股份	26,000	233,220.00	0.00
109	600166	福田汽车	26,400	233,112.00	0.00
110	600449	宁夏建材	17,900	231,089.00	0.00
111	600801	华新水泥	21,700	229,369.00	0.00
112	600823	世茂股份	17,600	229,328.00	0.00
113	600418	江淮汽车	16,200	228,096.00	0.00
114	600782	新钢股份	29,800	225,586.00	0.00
115	000422	湖北宜化	24,400	225,212.00	0.00
116	600548	深高速	26,200	224,010.00	0.00
117	600389	江山股份	7,100	221,804.00	0.00
118	000501	鄂武商 A	10,700	219,350.00	0.00
119	000635	英力特	14,700	215,796.00	0.00
120	600469	风神股份	11,900	215,152.00	0.00
121	002769	普路通	4,710	212,562.30	0.00

122	600729	重庆百货	6,600	212,388.00	0.00
123	600529	山东药玻	12,600	210,546.00	0.00
124	600308	华泰股份	28,600	209,638.00	0.00
125	300486	东杰智能	16,092	207,104.04	0.00
126	300482	万孚生物	7,942	182,983.68	0.00
127	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	0.00
128	300483	沃施股份	9,356	153,438.40	0.00
129	300481	濮阳惠成	11,296	148,542.40	0.00
130	603838	四通股份	18,119	140,059.87	0.00
131	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	0.00
132	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	0.00
133	603085	天成自控	11,690	122,394.30	0.00
134	300480	光力科技	7,263	52,874.64	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	601166	兴业银行	60,364,895.03	8.07
2	000776	广发证券	54,186,011.49	7.24
3	601688	华泰证券	44,676,394.00	5.97
4	600000	浦发银行	38,855,881.46	5.19
5	601985	中国核电	32,649,100.17	4.36
6	601988	中国银行	31,310,573.10	4.18
7	601318	中国平安	30,588,487.71	4.09

8	000002	万科A	29,370,172.92	3.92
9	601390	中国中铁	19,340,657.52	2.58
10	601818	光大银行	18,490,884.14	2.47
11	600109	国金证券	16,606,702.66	2.22
12	600999	招商证券	16,079,893.75	2.15
13	601628	中国人寿	15,071,324.72	2.01
14	601186	中国铁建	14,658,752.00	1.96
15	600048	保利地产	14,510,215.24	1.94
16	601668	中国建筑	14,346,427.00	1.92
17	600340	华夏幸福	13,685,801.90	1.83
18	000728	国元证券	10,671,257.00	1.43
19	600528	中铁二局	10,117,248.40	1.35
20	300007	汉威电子	10,038,003.00	1.34

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。

#### 7.4.2 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	601985	中国核电	124,320,620.39	16.61
2	000776	广发证券	92,240,338.32	12.32
3	601688	华泰证券	84,543,696.03	11.30
4	601390	中国中铁	79,692,292.95	10.65
5	601166	兴业银行	76,467,245.82	10.22
6	601318	中国平安	66,171,158.20	8.84
7	600109	国金证券	59,582,931.47	7.96

8	300162	雷曼光电	55,763,503.59	7.45
9	600999	招商证券	55,457,070.80	7.41
10	600048	保利地产	54,669,959.31	7.30
11	601668	中国建筑	54,608,065.28	7.30
12	601186	中国铁建	51,074,524.73	6.82
13	600068	葛洲坝	49,253,188.48	6.58
14	601818	光大银行	41,132,633.60	5.50
15	600000	浦发银行	38,263,090.71	5.11
16	601988	中国银行	29,201,094.54	3.90
17	000002	万科A	29,183,711.94	3.90
18	000528	柳工	24,166,332.36	3.23
19	601800	中国交建	20,955,466.91	2.80
20	600031	三一重工	20,849,113.09	2.79
21	000157	中联重科	20,702,599.95	2.77
22	000024	招商地产	19,368,259.14	2.59
23	600158	中体产业	18,477,253.92	2.47
24	000425	徐工机械	17,080,000.66	2.28

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。

#### 7.4.3 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	993,519,902.37
卖出股票的收入（成交）总额	1,675,497,790.85

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。

## 7.5 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	25,617,500.00	0.25
	其中：政策性金融债	25,617,500.00	0.25
4	企业债券	1,121,000.00	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	26,738,500.00	0.26

## 7.6 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	018001	国开 1301	250,000	25,617,500.00	0.25
2	132002	15 天集 EB	11,210	1,121,000.00	0.01

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本组合暂不投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同，本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同，本组合暂不投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的华泰证券（601688）于 2015 年 4 月 7 日公告称，根据中国证监会 2015 年 4 月 3 日召开的新闻发布会上对 2015 年第一季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，公司在融资融券业务开展中存在向不符合条件的客户融资融券、向风险承担能力不足的客户融资融券、未按照规定方式为部分客户开立融资融券信用账户等问题，违规情节较重，中国证监会对公司采取限期改正的行政监管措施。公司于 2015 年 4 月 24 日公告称，因违规为客户开立融资融券账户，收到安徽证监局下发的《关于对华泰证券股份有限公司合肥长江东大街证券营业部采取出具警示函措施的决定》。

对该股票的投资决策程序的说明：公司 2014 年净利润翻倍增长，且多项业务规模位居行业前列。2015 年有望在 H 股发行募资的助力下开展大量创新业务，进一步发展。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该股票被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	746,655.71
2	应收证券清算款	62,849,437.31
3	应收股利	-
4	应收利息	4,264,644.71
5	应收申购款	203,548.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,064,285.81

### 7.12.4 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债。

### 7.12.5 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	000024	招商地产	18,250,000.00	0.18	重大事项

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
794	9,303,386.76	7,360,863,973.46	99.65%	26,025,115.4 1	0.35%

## 8.2 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。

## 8.3 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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年11月27日）基金份 额总额	612,499,675.00
本报告期期初基金份额总额	612,499,675.00
本报告期基金总申购份额	7,692,484,970.51
减：本报告期基金总赎回份额	918,095,556.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,386,889,088.87

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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。

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。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

## 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 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。目前，公司已经完成相关整改工作并通过了监管部门的检查验收。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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
齐鲁证券	2	630,368,994.44	24.01%	447,814.29	21.58%	-
东方证券	1	405,238,824.16	15.43%	368,930.04	17.78%	-
中金公司	2	369,922,686.61	14.09%	327,347.01	15.78%	-
申万宏源	2	330,813,690.53	12.60%	135,766.90	6.54%	-
华泰证券	1	325,397,881.73	12.39%	296,238.94	14.28%	-
国金证券	1	274,346,821.62	10.45%	242,771.36	11.70%	-
方正证券	1	148,625,282.32	5.66%	131,518.96	6.34%	-
中信建投	1	140,782,423.60	5.36%	124,578.82	6.00%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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,并报公司业务管理委员会核准。

## 10.7.2 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
齐鲁证券	-	-	100,000,000.00	0.86%	-	-
东方证券	25,656,500.00	100.00%	11,586,500,000.00	99.14%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	海富通基金管理有限公司旗下基金 2014 年最后一个市场交易日基金资产 净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-01
2	关于海富通新内需灵活配置混合型证券 投资基金实行网上直销费率优惠的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-05
3	关于海富通新内需灵活配置混合型证券 投资基金在部分销售机构开展基金申购 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-06
4	关于海富通新内需灵活配置混合型证券 投资基金在部分销售机构开展基金申购 及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-06
5	海富通基金管理有限公司关于海富通新 内需灵活配置混合型证券投资基金在官 方淘宝店开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-08
6	海富通基金管理有限公司关于监事会成 员变更的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-17
7	海富通基金管理有限公司关于从业人员 在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-17
8	海富通基金管理有限公司关于海富通新 内需灵活配置混合型证券投资基金在官 方京东店开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-31
9	海富通基金管理有限公司关于旗下基金 持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-01-31
10	海富通基金管理有限公司关于与通联支 付网络服务股份有限公司合作开通基金 网上直销业务并实行申购费率优惠的公 告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-02-07
11	海富通基金管理有限公司关于总经理变 更的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-02-14
12	海富通基金管理有限公司关于从业人员 在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-02-17
13	海富通基金管理有限公司关于旗下基金 投资资产支持证券方案的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-03-05
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分 基金在中国工商银行开通基金转换业 务的公告	《中国证券报》、《 上海证券报》和《证 券时报》	2015-03-05

15	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-05
16	海富通基金管理有限公司关于海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金及海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-10
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在同花顺基金销售有限公司开展网上交易申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-10
18	海富通基金管理有限公司关于海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金及海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金在部分销售机构开展申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-11
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-11
20	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-21
21	海富通基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-25
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在本公司网上直销平台对支付宝用户实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-30
23	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续在中国工商银行股份有限公司开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-31
24	海富通基金管理有限公司关于变更公司董事的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-08
25	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-11
26	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-18
27	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-27

28	海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-30
29	海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购和转换转入的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-30
30	海富通基金管理有限公司关于新任公司总经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-04
31	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-09
32	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-12
33	海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和转换转入的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-12
34	海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购和转换转入的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-13
35	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台暂停通过银联支付渠道下的富滇银行、长沙银行办理基金开户及基金申购等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-14
36	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-16
37	海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和转换转入的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-21
38	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西藏同信证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-22
39	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在西藏同信证券股份有限公司开展网上交易申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-22
40	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-23
41	海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和转换转入的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-26
42	海富通新内需灵活配置混合型证券投资	《中国证券报》、《	2015-05-27

	基金暂停大额申购和转换转入的公告	《上海证券报》和《证券时报》	
43	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富(北京)信息科技有限公司网上申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-28
44	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-30
45	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-06
46	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财达证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-12
47	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国国际金融有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-12
48	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增太平洋证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-12
49	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-13
50	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-23
51	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-27

### §11 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 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 451 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 6 月 30 日，海富通为 80 多家企业超过 391 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 6 月 30 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 124 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 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 144 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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- （六）报告期内海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层本基金管理人办公地址。

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇一五年八月二十八日