

海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金
2016 年半年度报告摘要
2016 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：二〇一六年八月二十六日

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 2016 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通东财大数据混合
基金主代码	519132
交易代码	519132
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 29 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	198,367,335.70 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过灵活有效的资产配置策略和个股精选策略，实现基金资产的稳健、持续增值。
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；其次结合东方财富大数据指标及其他证券市场趋势指标，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	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
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

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月29日（基金合同生效日）至2016年6月30日）
本期已实现收益	-3,825,608.82
本期利润	4,519,195.53
加权平均基金份额本期利润	0.0189
本期基金份额净值增长率	3.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0041
期末基金资产净值	204,747,896.43
期末基金份额净值	1.032

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

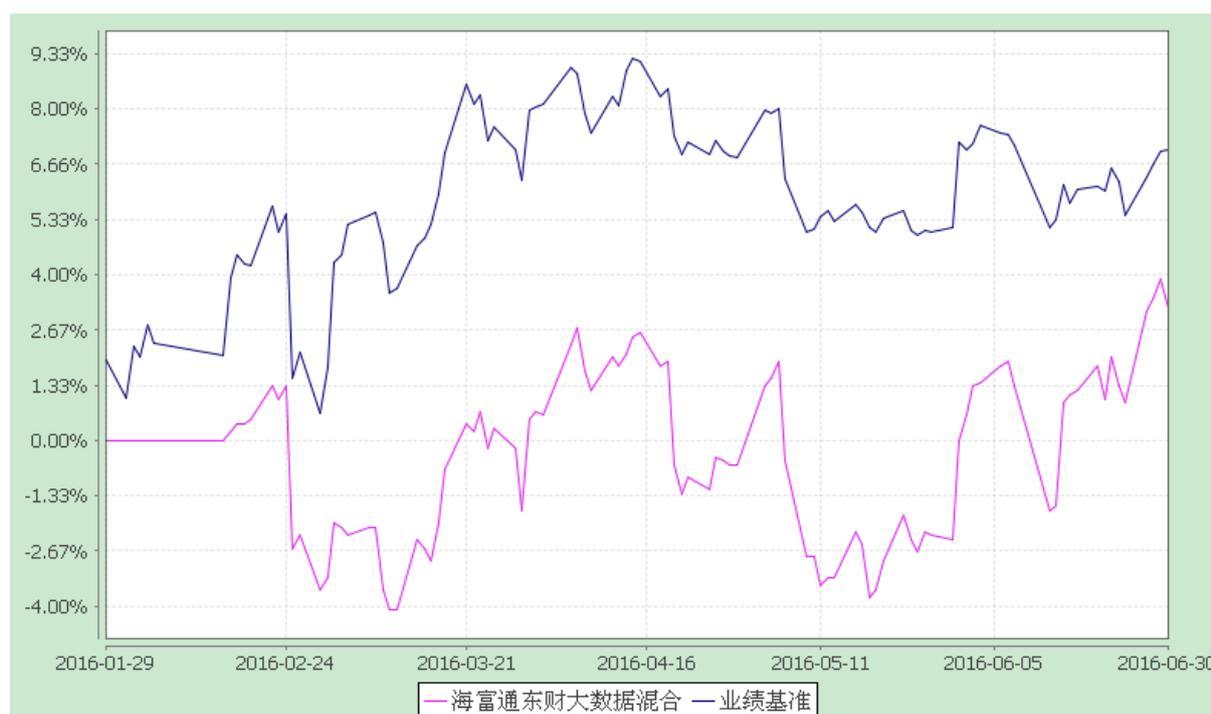
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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		
过去一个月	3.20%	1.13%	-0.17%	0.59%	3.37%	0.54%
过去三个月	2.48%	1.04%	-0.93%	0.60%	3.41%	0.44%
自基金合同 生效起至今	3.20%	1.02%	7.02%	0.84%	-3.82%	0.18%

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

海富通东财大数据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
 (2016 年 1 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 33 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、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		
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；海富通新内 需混合基金经	2016-01- 29	-	8 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任复旦金仕达计算机有限公司高级程序员、部门经理，东方证券股份有限公司高级开发经理，IBM 中国有限公司高级咨询顾问，海富通基

	理；海富通养老收益混合基金经理；量化投资部总监				金管理有限公司量化分析师、投资经理、量化投资部副总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2014 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2015 年 4 月至 2016 年 6 月兼任海富通养老收益混合和海富通新内需混合基金经理。2016 年 1 月起兼任海富通东财大数据混合基金经理。
--	-------------------------	--	--	--	---

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为：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 公平交易制度的执行情况

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

2016 上半年不乏制度改革和新政预期，两市走势亦跌宕起伏、初现曙光，国内外大事的频繁交织让市场关注度重新上升。2016 上半年上证综指收跌 17.22%，报收于 2929.61 点，最高点即 1 月 4 日开盘价 3538.69 点，最低点在 1 月 27 日盘中到达 2638.30 点，半年成交量 219.22 亿手，成交金额 238,987.4 亿元。两市共计 516 只个股于上半年录得涨幅，2339 只个股最终收跌。深证成指、中小板、创业板分别下跌 17.17%、17.88%和 17.92%。

2016 上半年，A 股在 1 月遭遇重挫，指数自开盘 3539 点下行至当月收盘价 2930 点，月度下跌逾 600 点，跌幅 22.65%。随后的 2 月与 3 月，市场开始逐步修正并在大宗商品涨势带领和两会改革预期升温下展开反弹，期间最高价 3028 点，涨幅 9.73%，但未能突破 3100 点关口。而二季度的行情以回调震荡为主题，风险情绪下降及存量博弈格局令行情维持低迷态势。6 月 MSCI 宣布延迟将中国 A 股纳入其新兴市场指数，以及英国公投退出欧盟等“黑天鹅”事件阻碍了 A 股的涨势，最终震荡收关。6 月沪指小幅上扬 0.45%收于 2930 点，深成指、中小板和创业板涨幅均逾 3%。

板块方面，上半年在 29 个中信一级行业分类中，只有食品饮料实现 2.38%正收益，八成跌幅逾 10%，其中传媒、餐饮旅游、交通运输、计算机跌幅居前，分别下跌 29.78%、27.26%、27.00%和 26.41%。

上半年市场行情是一个先抑后扬的走势，但是二月份以后的 A 股市场是在一个箱体上下震荡的。本基金在 2 月下旬开始正式建仓，3 月份完成建仓，4、5 月份利用大数据的择时信号择机加减仓。在 6 月份结构行情中，本基金综合使用多因子、事件驱动、大数据等量化选股模型主动选股，在上半年的震荡期间，本基金以风险控制为准，并努力抓住短暂的投资机会，为持有人获取投资收益。

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 3.20%，同期业绩比较基准收益率为 7.02%，基金净值跑输业绩比较基准 3.82 个百分点。主要原因是上半年的建仓时间较长，没有能够及时抓住市场上涨的时机，导致业绩跑输基准。

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，预计目前既有的货币政策和财政政策不会发生大的变化。上半年经过大量信贷的投放，基建投资维持高位，房地产市场销售也有起色，这些举措有望支撑宏观经济在三季度维持稳定，第四季度有可能面临一定的下行压力，预计届时会有

一定程度稳增长的措施出现，全年来看，中国宏观经济仍将维持弱势平稳的格局，经济增速上下风险都不大。下半年 CPI 预计维持在 2%-2.5% 左右，第四季度压力略大于第三季度，PPI 跌幅逐步收窄，这样的环境有利于企业盈利温和改善。供给侧改革是今年宏观政策的核心，其它调控政策均处于辅助、配合的角色。外围市场方面，英国脱欧造成了一些动荡，但这也在一定程度上延缓了美元加息进程，短期对中国经济和金融市场造成的冲击不大，长期潜在的影响还需要持续跟踪和关注。人民币汇率问题依然是潜在的市场风险因素。

目前 A 股市场的整体估值水平依然不高，但结构分化严重。金融、地产、汽车、家电、建筑等行业估值接近于历史低位，TMT、高端装备、新型服务业等新兴行业估值很高但比去年有较为显著的回落，资金宽松、经济转型的大背景下这些行业享受一定的估值溢价也较为合理。考虑到下半年宏观经济相对平稳、资金面维持宽松、部分行业和个股业绩有望微幅改善，A 股市场系统性风险不大。稳定增长型、业绩改善型、产业前景向好的新兴行业等板块均存在可供挖掘的结构性、波段性机会。

展望下半年，上证指数很有可能会在一个空间较大的箱体震荡，本基金将努力依托大数据择时量化模型，结合多因子等的量化选股体系，抓住股票的结构性上涨波段，严格控制回撤风险，积极判断行业增长趋势，追求低估值并有稳定增长的股票，争取为持有人提供相对稳定的收益。

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

2016 年上半年，本基金托管人在对海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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：海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	6,272,847.97

结算备付金		40,908,003.24
存出保证金		272,556.67
交易性金融资产	6.4.7.2	144,379,729.17
其中：股票投资		144,379,729.17
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		15,867,813.53
应收利息	6.4.7.5	29,021.36
应收股利		-
应收申购款		14,476.05
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		207,744,447.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日
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		1,880,519.27
应付管理人报酬		273,101.52
应付托管费		42,672.13
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	627,003.18
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	173,255.46
负债合计		2,996,551.56
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	198,367,335.70
未分配利润	6.4.7.10	6,380,560.73
所有者权益合计		204,747,896.43
负债和所有者权益总计		207,744,447.99

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0320 元，基金份额总额 198,367,335.70 份。

2、基金合同成立于 2016 年 1 月 29 日，上年度可比区间无比较数据。

3、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		8,660,483.19
1.利息收入		727,661.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	609,528.39
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		118,132.82
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-875,435.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-881,670.38
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	-349,120.00

股利收益	6.4.7.16	355,354.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,344,804.35
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	463,453.62
减：二、费用		4,141,287.66
1. 管理人报酬		1,634,137.60
2. 托管费		255,334.06
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,082,610.82
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	169,205.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,519,195.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,519,195.53

注：基金合同成立于 2016 年 1 月 29 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：海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 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）	326,320,977.35	-	326,320,977.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,519,195.53	4,519,195.53
三、本期基金份额交	-127,953,641.65	1,861,365.20	-126,092,276.45

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	3,297,081.44	-10,814.35	3,286,267.09
2.基金赎回款	-131,250,723.09	1,872,179.55	-129,378,543.54
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）	198,367,335.70	6,380,560.73	204,747,896.43

注：基金合同成立于 2016 年 1 月 29 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

海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016] 3083 号文核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通东财大数据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 326,201,647.16 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2016)第 112 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 326,320,977.35 份基金份额,其中认购资金利息折合 119,330.19 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为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《海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转换债券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存

款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票投资 0%-95%,权证投资 0%-3%,在每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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 8 月 25 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》、《海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

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。本财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间。

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。

6.4.4.7 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、托管费和销售服务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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)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。

(3)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),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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月29日（基金合同生效日）至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,634,137.60
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,083,122.23

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 1.6%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 1.6% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2016 年 1 月 29 日，上年度可比区间无比较数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月29日（基金合同生效日）至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	255,334.06

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 2016 年 1 月 29 日，上年度可比区间无比较数据。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2016年1月29日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	6,272,847.97	362,022.36

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 2016 年 1 月 29 日，上年度可比区间无比较数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
601966	玲珑股份	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	1,643	21,326.14	21,326.14	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
300508	维宏股份	2016-04-12	2017-04-19	网下中签	20.08	254.50	10,383	208,490.64	2,642,473.50	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000401	冀东水泥	2016-04-06	重大资产重组	10.90	2016-07-14	11.32	56,263	599,189.84	613,266.70	-
000511	*ST 烯碳	2016-04-26	重大事项	8.92	-	-	100,000	874,974.00	892,000.00	-
000608	阳光股份	2016-03-08	重大资产重组	5.30	2016-07-14	51.20	2,431	12,145.02	12,884.30	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.29	-	-	47,800	379,042.00	396,262.00	-
002347	泰尔重工	2016-04-04	重大事项	19.45	2016-07-18	21.40	13,604	252,253.79	264,597.80	-
002355	兴民钢圈	2016-05-12	重大资产重组	19.35	-	-	10,000	206,911.78	193,500.00	-
002591	恒大高新	2016-04-15	重大资产重组	17.78	-	-	33,600	460,552.00	597,408.00	-
300125	易世达	2016-03-28	重大资产重组	24.81	2016-08-08	24.22	18,552	456,505.96	460,275.12	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大资产重组	27.47	-	-	50,000	1,271,842.00	1,373,500.00	-
300173	智慧松德	2016-04-11	重大资产重组	16.25	2016-08-24	17.88	40,485	588,608.18	657,881.25	-
300176	鸿特精密	2016-04-27	重大资产重组	30.20	-	-	17,631	486,796.99	532,456.20	-
300223	北京君正	2016-06-03	重大资产重组	44.00	-	-	20,000	546,406.64	880,000.00	-
300353	东土科技	2016-06-23	重大事项	22.09	-	-	7,800	128,565.00	172,302.00	-
600511	国药股份	2016-02-17	重大资产重组	27.42	2016-08-04	30.16	10,400	286,217.00	285,168.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	股票交易异常	20.92	2016-07-01	23.01	5,848	20,292.56	122,340.16	-

注：本基金截至 2016 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	144,379,729.17	69.50
	其中：股票	144,379,729.17	69.50
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	47,180,851.21	22.71
7	其他各项资产	16,183,867.61	7.79
8	合计	207,744,447.99	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,358,830.00	0.66
B	采矿业	2,499,891.00	1.22
C	制造业	98,797,614.63	48.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,331,100.00	0.65
E	建筑业	1,531,356.16	0.75
F	批发和零售业	2,958,368.00	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,193,759.00	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,641,785.61	12.04
J	金融业	4,233,594.60	2.07
K	房地产业	2,085,422.05	1.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	460,275.12	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	807,673.00	0.39
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	2,480,060.00	1.21
S	综合	-	-
	合计	144,379,729.17	70.52

7.3 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	300113	顺网科技	97,617	3,705,541.32	1.81

2	300033	同花顺	40,000	3,258,000.00	1.59
3	002108	沧州明珠	120,000	3,108,000.00	1.52
4	300017	网宿科技	45,000	3,024,000.00	1.48
5	600887	伊利股份	180,000	3,000,600.00	1.47
6	300375	鹏翎股份	110,000	2,973,300.00	1.45
7	002311	海大集团	180,000	2,838,600.00	1.39
8	603111	康尼机电	210,067	2,819,099.14	1.38
9	603308	应流股份	110,000	2,765,400.00	1.35
10	300367	东方网力	110,000	2,731,300.00	1.33

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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	002468	艾迪西	7,512,273.88	3.67
2	000932	华菱钢铁	7,328,512.00	3.58
3	600386	北巴传媒	6,901,884.21	3.37
4	300065	海兰信	6,016,392.46	2.94
5	601901	方正证券	5,955,621.00	2.91
6	002108	沧州明珠	5,753,790.00	2.81
7	600172	黄河旋风	5,749,772.88	2.81
8	600232	金鹰股份	5,656,566.90	2.76
9	600271	航天信息	5,535,670.00	2.70
10	600058	五矿发展	5,441,565.00	2.66

11	600958	东方证券	4,920,754.00	2.40
12	300231	银信科技	4,885,836.00	2.39
13	601689	拓普集团	4,864,969.00	2.38
14	300431	暴风集团	4,826,704.00	2.36
15	300367	东方网力	4,511,761.67	2.20
16	300033	同花顺	4,192,009.81	2.05
17	600109	国金证券	4,084,563.80	1.99
18	002094	青岛金王	4,039,478.24	1.97
19	300114	中航电测	3,972,630.08	1.94
20	300017	网宿科技	3,967,125.00	1.94

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	000932	华菱钢铁	6,624,694.80	3.24
2	002468	艾迪西	6,064,043.75	2.96
3	601901	方正证券	5,936,287.51	2.90
4	600058	五矿发展	5,290,405.04	2.58
5	600386	北巴传媒	4,815,864.11	2.35
6	600958	东方证券	4,740,321.00	2.32
7	300065	海兰信	4,567,177.95	2.23
8	300431	暴风集团	4,363,227.77	2.13
9	600109	国金证券	4,156,116.00	2.03
10	600172	黄河旋风	4,127,298.50	2.02

11	300048	合康变频	4,076,874.47	1.99
12	002245	澳洋顺昌	4,041,119.29	1.97
13	002273	水晶光电	3,662,634.00	1.79
14	601689	拓普集团	3,637,800.00	1.78
15	002606	大连电瓷	3,591,866.18	1.75
16	600271	航天信息	3,498,629.94	1.71
17	300206	理邦仪器	3,333,335.44	1.63
18	300114	中航电测	3,283,076.30	1.60
19	600232	金鹰股份	3,248,365.00	1.59
20	002094	青岛金王	3,208,568.44	1.57

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	794,540,117.40
卖出股票的收入（成交）总额	657,623,522.20

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的同花顺（300033）于 2015 年 8 月 19 日公告称，公司于 8 月 18 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》，因涉嫌违反证券期货法律法规被立案调查。公司于 2015 年 9 月 7 日及 9 月 11 日公告称，公司及相关人员因前述事宜收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》。公司于 2015 年 12 月 18 日公告称，公司因前述事宜存在被实施暂停上市风险。

对该股票的投资决策程序的说明：中长期来看，公司作为行业内坚持采用平台战略的金融信息服务提供商，同时拥有海量的 C 端用户和大量的 B 端投资机构，在我国居民财富管理刚起步、金融行业大发展的大背景下，依然具备很大的市场空间。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的鹏翎股份（300375）于 2015 年 12 月 28 日公告称，公司因未按规定披露关联交易的关联方，且未审议并披露关联交易及其发生额，违反了《上市公司信息披露管理办法》的相关规定，收到天津证监局出具的行政处罚决定书。

对该股票的投资决策程序的说明：管理人认为，公司是一家专注汽车胶管的优秀企业。在“新客户+新产品”双重驱动下，主业稳健向上。胶管加快新能源汽车应用，外延并购可期。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的康尼机电（603111）于 2015 年 11 月 5 日公告称，公司因披露预测性信息不审慎，缺乏客观依据；且未能积极配合监管，按要求及时补充披露相关文件，导致公司股票未能按期复牌，影响了投资者的交易权利，上海证券交易所对南京康尼机电股份有限公司和时任南京康尼机电股份有限公司董事会秘书徐庆予以监管关注。公司于 2016 年 3 月 23 日公告称，因公司对标的资产的尽职调查不审慎且关于重大资产重组的信息披露不准确，也未揭示重组可能失败的风险，上海证券交易所对南京康尼机电股份有限公司及时任南京康尼机电股份有限公司董事长金元贵、董事会秘书徐庆予以监管关注。

对该股票的投资决策程序的说明：管理人认为，未来 5 年是我国城市轨道交通建设的高峰，地铁车辆交付将大幅增加，公司有望受益于产业链零部件需求强劲增长极国产化替代加快，同时公司还将积极拓展新能源汽车零部件以及智能制造产业。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合

其余七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	272,556.67
2	应收证券清算款	15,867,813.53
3	应收股利	-
4	应收利息	29,021.36
5	应收申购款	14,476.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,183,867.61

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换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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
1,980	100,185.52	-	-	198,367,335.70	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	140,347.92	0.0708%

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	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月29日）基金份 额总额	326,320,977.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	3,297,081.44
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	131,250,723.09

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	198,367,335.70

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

本报告期，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。

本报告期，经海富通基金管理有限公司 2016 年第一次临时股东大会审议通过，选举张文伟、刘颂(Patrick LIU)、黄正红、陶乐斯(Ligia Torres)、黄金源(Alex NG Kim Guan)、郑国汉(Leonard K.Cheng)、巴约特(Marc Bayot)、杨国平、张馨担任公司第五届董事会董事，其中郑国汉(Leonard K.Cheng)、巴约特(Marc Bayot)、杨国平、张馨为独立董事。

本报告期内，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

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
方正证券	1	642,763,555.23	44.29%	585,752.72	45.20%	-
中泰证券(原齐鲁)	2	482,858,999.79	33.27%	422,214.52	32.58%	-
东方证券	1	132,712,433.21	9.14%	123,593.24	9.54%	-
东兴证券	1	112,969,106.12	7.78%	105,208.58	8.12%	-
中金公司	2	29,950,673.26	2.06%	27,556.38	2.13%	-
申万宏源	2	29,774,623.23	2.05%	12,841.62	0.99%	-
华泰证券	1	20,173,101.73	1.39%	18,786.90	1.45%	-
兴业证券	2	-	0.00%	-	-	-
国金证券	1	-	0.00%	-	-	-
中信建投	1	-	0.00%	-	-	-
财通证券	1	-	0.00%	-	-	-
民族证券	2	-	0.00%	-	-	-
东北证券	1	-	0.00%	-	-	-

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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		交总额 的比例		额的比例		额的比例
方正证券	-	-	-	0.00%	-	-
中泰证券(原 齐鲁)	-	-	160,000, 000.00	30.83%	-	-
东方证券	-	-	300,000, 000.00	57.80%	-	-
东兴证券	-	-	59,000,0 00.00	11.37%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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 34 只公募基金。截至 2016 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 407 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 2016 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业超过 360 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 2016 年 6 月 30 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 110 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 2016 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 95 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。

2016 年 3 月，国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通基金管理有限公司“中国基金业金牛基金管理公司”大奖。

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
二〇一六年八月二十六日