

海富通大中华精选混合型证券投资基金
2016 年半年度报告
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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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
§5 托管人报告	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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
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
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	36
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	40
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	41
7.7 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.....	41
7.8 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.....	41
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金融衍生品投资明细.....	41
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	42

7.11 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通大中华精选混合型证券投资基金
基金简称	海富通大中华混合（QDII）
基金主代码	519602
交易代码	519602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 27 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	81,157,285.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于在海外证券市场交易的大中华公司的优质股票,追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对全球宏观经济和大中华地区区域经济的基本面分析,采用自上而下的策略对资产进行有效资产配置;对股票的选择采用自下而上的“三站式”精选策略,挖掘定价合理,具备竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	MSCI 金龙净总收益指数
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,属于中高风险水平的投资品种。同时,本基金投资的目标市场是海外市场,除了需要承担市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	奚万荣	王永民

负责人	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张文伟	田国立

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 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	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

2.6 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-10,618,066.74
本期利润	-4,822,049.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0602
本期加权平均净值利润率	-7.95%
本期基金份额净值增长率	-6.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-17,155,369.74
期末可供分配基金份额利润	-0.2114
期末基金资产净值	64,001,915.44
期末基金份额净值	0.789
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-21.10%

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	-0.75%	1.37%	2.78%	1.20%	-3.53%	0.17%

过去三个月	1.68%	1.15%	3.15%	1.02%	-1.47%	0.13%
过去六个月	-6.63%	1.61%	1.90%	1.21%	-8.53%	0.40%
过去一年	-17.81%	2.42%	-11.22%	1.38%	-6.59%	1.04%
过去三年	4.09%	1.69%	21.31%	1.05%	-17.22%	0.64%
自基金合同生效起至今	-21.10%	1.53%	4.66%	1.13%	-25.76%	0.40%

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

海富通大中华精选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
 (2011 年 1 月 27 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：1、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，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围、（九）投资限制中规定的各项比例；

2、本基金按照全球投资表现标准（GIPS）计算和表述投资业绩。

§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		
张炳炜	本基金的基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通中国海外混合(QDII)基金经理	2016-02-04	-	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

					<p>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。</p> <p>2016 年 2 月起兼任海富通大中华混合（QDII）和海富通中国海外混合（QDII）基金经理。</p>
杨铭	<p>本基金的基金经理；海富通中国海外混合（QDII）基金经理；海富通资产管理（香港）有限公司大中华股票投资负责人</p>	2011-01-27	2016-02-04	18 年	<p>中国籍，特许金融分析师（CFA），经济学学士，持有基金从业人员资格证书。先后任职于香港东亚银行上海分行、上海瀚蓝投资顾问有限公司，2004 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，任股票分析</p>

					<p>师，2008年6月至2010年1月任海富通中国海外股票(QDII)基金经理助理，2010年1月至2016年2月任海富通中国海外混合(QDII)基金经理，2011年1月至2016年2月任海富通大中华混合(QDII)基金经理，2014年1月起兼任海富通资产管理(香港)有限公司大中华股票投资负责人。</p>
--	--	--	--	--	--

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。

3、本公司于2016年8月17日发布公告，自2016年8月16日起，聘任卜正伦先生担任本基金基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 上半年大中华地区股市随著全球市场波动，除了美国加息、脱欧等因素的影响外，区内也不乏制度改革以及新政的预期，造成市场走势跌宕起伏。1 月初中国 A 股市场重挫探底，大中华市场也都受到影响录得巨额跌幅。不过由于全球市场经过一段时间整理，因日本银行持续负利率、欧洲央行推动宽松政策，搭配政府继续降息和降准，2、3 月市场逐渐恢复动力。二季度初期延续向好气氛，但随后由于政府重新思考海外中国股票回归 A 股市场问题，部分涨幅较大的板块开始出现整理。不过 6 月后随著 MSCI 未纳入 A 股、脱欧等利空陆续释放后，市场原本观望的资金也逐渐回归市场，推动市场缓步回温。

上半年全球新兴市场指数表现要优于成熟市场，但大中华市场股票相对弱于新兴市场股票。大中华股票中，则以台湾市场表现最佳，香港次之，海外中国股票仍相对较弱。报告期内，本基金调整部分不如预期的中小盘软件股，增持业绩平稳的电信及互联网龙头。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 -6.63%，同期业绩比较基准收益率 1.90%，基金净值跑输业绩比较基准 8.53 个百分点。基金净值跑输业绩比较基准的主要原因是在于超配的国内新兴软件、互联网科技公司增长期投入成本高于预期影响股价，以及低配的台湾股市相对较为强劲。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 下半年，虽然英国脱欧提高不确定性，造成全球市场动荡，不过也因此美联储中期加息的机会不大，美国货币供给的步伐趋向稳健，而欧洲和日本偏向宽松的货币政策时间也预期将会拉长。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。

预期下半年市场仍将处在区间调整，我们仍会将焦点放在国内外宏观经济形势和政策的变化，以适时调整持仓结构，目前投资目标仍以受益于中国供给侧改革和民生政策扶持、新技术开发投资、内需拉动、以及两岸三地经济加速融合的行业和中小型成长股等方面，特别着重个股的基本面研究以期获取超额收益。

4.7 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。

本基金采用彭博（bloomberg）咨询系统提供的价格估值。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对海富通大中华精选混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：海富通大中华精选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	上年度末
----	-----	-----	------

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
资产:		-	-
银行存款	6.4.7.1	16,335,737.92	5,273,802.61
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	49,142,733.83	65,558,260.23
其中: 股票投资		49,142,733.83	65,558,260.23
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	3,718.50	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	408.33	71.09
应收股利		663,581.61	-
应收申购款		1,041,703.53	11,739.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		67,187,883.72	70,843,873.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 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		2,519,165.54	-
应付赎回款		331,100.59	312,258.93
应付管理人报酬		92,668.91	107,514.69
应付托管费		15,444.80	17,919.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	227,588.44	281,174.55
负债合计		3,185,968.28	718,867.28
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	81,157,285.18	83,026,692.45
未分配利润	6.4.7.10	-17,155,369.74	-12,901,686.63
所有者权益合计		64,001,915.44	70,125,005.82
负债和所有者权益总计		67,187,883.72	70,843,873.10

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.789 元，基金份额总额 81,157,285.18 份。

6.2 利润表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 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 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-3,985,334.07	-11,961,482.62
1.利息收入		4,119.14	37,581.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,119.14	37,581.06
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,946,315.06	1,005,244.95
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-10,877,835.80	-754,747.68
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		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-

股利收益	6.4.7.15	931,520.74	1,759,992.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,796,017.70	-12,384,685.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		154,252.19	-890,503.05
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,591.96	270,880.25
减：二、费用		836,714.97	2,681,483.03
1. 管理人报酬		542,292.40	1,101,584.47
2. 托管费		90,382.02	183,597.43
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	42,105.01	1,191,370.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	161,935.54	204,931.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,822,049.04	-14,642,965.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,822,049.04	-14,642,965.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 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）	83,026,692.45	-12,901,686.63	70,125,005.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,822,049.04	-4,822,049.04
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）	-1,869,407.27	568,365.93	-1,301,041.34
其中：1.基金申购款	5,567,173.57	-1,256,303.37	4,310,870.20

2.基金赎回款	-7,436,580.84	1,824,669.30	-5,611,911.54
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)	81,157,285.18	-17,155,369.74	64,001,915.44
项目	上年度可比期间 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)	85,787,674.19	-5,142,606.45	80,645,067.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,642,965.65	-14,642,965.65
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)	21,258,553.84	15,472,215.83	36,730,769.67
其中：1.基金申购款	251,805,135.58	22,665,603.04	274,470,738.62
2.基金赎回款	-230,546,581.74	-7,193,387.21	-237,739,968.95
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)	107,046,228.03	-4,313,356.27	102,732,871.76

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

海富通大中华精选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证监许可[2010]1760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《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式，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 821,474,865.11 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(2011)第 15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 821,766,293.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 291,428.86 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司，无境外投资顾问。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金(ETF)等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以全球除内地股票市场以外的具有“大中华概念”上市公司为主要投资对象。“大中华概念”的股票需满足以下三个条件之一：1)上市公司注册在大中华区域(中国内地、香港、台湾、澳门)；2)上市公司中最少百分之三十股权(占总股本)由大中华区域的股东持有；3)公司最近一个会计年度至少百分之五十之营业额来自大中华区域。本基金的投资比例为：股票及其他权益类证券占基金资产的 60%~95%，现金、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%~40%，其中基金保留的现金的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

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》、《海富通大中华精选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 年上半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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度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

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。

6.4.5 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[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税，对金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	16,335,737.92
定期存款	-
其他存款	-
合计	16,335,737.92

注：于 2016 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为：港币活期存款 16,609,857.47（折合人民币 14,195,946.88 元）；台币活期存款 0.00（折合人民币 0.00 元）；美金活期存款 6.14（折合人民币 40.71 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		58,360,480.18	49,142,733.83	-9,217,746.35
贵金属投资-金交所黄金合约				
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		58,360,480.18	49,142,733.83	-9,217,746.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	3,718.50	-	-
兴业太阳能技术控股有限公司配股权证	-	3,718.50	-	获赠权证
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	3,718.50	-	-

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
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	408.33
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
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	-
合计	408.33

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

本基金本报告期末应付交易费用无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	977.90
预提费用	226,610.54
合计	227,588.44

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,026,692.45	83,026,692.45
本期申购	5,567,173.57	5,567,173.57

本期赎回（以“-”号填列）	-7,436,580.84	-7,436,580.84
本期末	81,157,285.18	81,157,285.18

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	-4,929,292.98	-7,972,393.65	-12,901,686.63
本期利润	-10,618,066.74	5,796,017.70	-4,822,049.04
本期基金份额交易产生的变动数	92,153.75	476,212.18	568,365.93
其中：基金申购款	-793,597.12	-462,706.25	-1,256,303.37
基金赎回款	885,750.87	938,918.43	1,824,669.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,455,205.97	-1,700,163.77	-17,155,369.74

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,118.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	1.08
合计	4,119.14

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	15,095,008.58
减：卖出股票成本总额	25,972,844.38
买卖股票差价收入	-10,877,835.80

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 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	931,520.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	931,520.74

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	5,792,299.20
——股票投资	5,792,299.20
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	3,718.50
——权证投资	3,718.50
3.其他	-
合计	5,796,017.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	6,591.96

合计	6,591.96
----	----------

注：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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	42,105.01
银行间市场交易费用	-
合计	42,105.01

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	32,323.20
信息披露费	129,287.34
银行汇划费	325.00
合计	161,935.54

6.4.7.20 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。

6.4.8 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外资产托管人
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
海通国际证券集团有限公司(“海通国际证券”)	海通证券间接控股子公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通国际证券	-	-	17,510,747.62	3.59%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月30日	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	542,292.40	1,101,584.47
其中：支付销售机构的客户维护费	192,556.42	266,905.95

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 1.8% 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 1.8% / 当年天数。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 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	90,382.02	183,597.43

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 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 0.30% / 当年天数。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
报告期初持有的基金份额	17,299,884.66	17,299,884.66
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,299,884.66	17,299,884.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	21.32%	16.16%

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

本基金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。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,140,022.45	4,118.06	1,878,837.80	26,687.08
中银香港	14,195,708.91	-	11,216,912.90	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，其中由中国银行保管的银行存款按适用利率计息，由中银香港保管的银行存款不计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2016 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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

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

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金（ETF）等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行以及境外次托管行中银香港，因而与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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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设定流动性比例要求，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的投资品种比例等。本基金投资于同一机构发行的证券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同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此均能以合理价格适时变现。

于 2016 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

本基金持有及承担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等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,140,022.45	-	-	14,195,715.47	16,335,737.92
交易性金融资产	-	-	-	49,142,733.83	49,142,733.83
衍生金融资产	-	-	-	3,718.50	3,718.50
应收利息	-	-	-	408.33	408.33
应收股利	-	-	-	663,581.61	663,581.61
应收申购款	109.34	-	-	1,041,594.19	1,041,703.53
资产总计	2,140,131.79			65,047,751.93	67,187,883.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,519,165.54	2,519,165.54
应付赎回款	-	-	-	331,100.59	331,100.59
应付管理人报酬	-	-	-	92,668.91	92,668.91
应付托管费	-	-	-	15,444.80	15,444.80
其他负债	-	-	-	227,588.44	227,588.44
负债总计				3,185,968.28	3,185,968.28
利率敏感度缺口	2,140,131.79			61,861,783.65	64,001,915.44
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,273,802.61	-	-	-	5,273,802.61
交易性金融资产	-	-	-	65,558,260.23	65,558,260.23
应收申购款	9.94	-	-	11,729.23	11,739.17
应收利息	-	-	-	71.09	71.09
资产总计	5,273,812.55			65,570,060.55	70,843,873.10
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	107,514.69	107,514.69
应付托管费	-	-	-	17,919.11	17,919.11

应付赎回款	-	-	-	312,258.93	312,258.93
其他负债	-	-	-	281,174.55	281,174.55
负债总计	-	-	-	718,867.28	718,867.28
利率敏感度缺口	5,273,812.55	-	-	64,851,193.27	70,125,005.82

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	40.71	14,195,946.88	14,195,987.59
交易性金融资产	-	49,142,733.83	49,142,733.83
衍生金融资产	-	3,718.50	3,718.50
应收股利	-	412,631.01	412,631.01
资产合计	40.71	63,755,030.22	63,755,070.93
以外币计价的负债			
应付证券清	-	2,519,165.54	2,519,165.54

算款			
负债合计	-	2,519,165.54	2,519,165.54
资产负债表 外汇风险敞 口净额	40.71	61,235,864.68	61,235,905.39
项目	上年度末 2015年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	39.87	5,086,975.56	5,087,015.43
交易性金融资产	-	65,558,260.23	65,558,260.23
资产合计	39.87	70,645,235.79	70,645,275.66
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	39.87	70,645,235.79	70,645,275.66

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值5%	减少约 366	增加约 353
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	增加约 366	减少约 353

注：金额为约数,精确到万元。

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

市的股票，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占基金资产的 60%-95%，银行存款及现金等高流动性资产占基金资产的 5%-40%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	49,142,733.83	76.78	65,558,260.23	93.49
交易性金融资产—基金 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金 属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投 资	3,718.50	0.01	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,146,452.33	76.79	65,558,260.23	93.49

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(6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 531	增加约 393
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 531	减少约 393

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	49,142,733.83	73.14
	其中：普通股	49,142,733.83	73.14
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	3,718.50	0.01
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	3,718.50	0.01
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,335,737.92	24.31
8	其他各项资产	1,705,693.47	2.54
9	合计	67,187,883.72	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	49,142,733.83	76.78
合计	49,142,733.83	76.78

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	14,788,765.17	23.11
金融	13,351,678.67	20.86
非日常生活消费品	6,738,081.53	10.53
原材料	4,483,783.42	7.01
工业	4,463,574.25	6.97
电信业务	3,788,324.78	5.92
医疗保健	958,187.63	1.50
日常消费品	570,338.38	0.89
合计	49,142,733.83	76.78

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	29,800	4,485,120.13	7.01
2	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	4,378,047.08	6.84
3	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	香港交易及结算所有限公司	388 HK	香港证券交易所	中国香港	24,900	3,992,368.69	6.24
4	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	广州汽车集团股份有限公司	2238 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	3,952,848.75	6.18
5	Sinosoft Technology Group Limited	中国擎天软件科技集团有限公司	1297 HK	香港证券交易所	中国香港	1,058,000	3,951,532.56	6.17
6	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	3,788,324.78	5.92
7	Guangshen Railway Company Limited	广深铁路股份有限公司	525 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	3,145,185.60	4.91
8	Kingdee International	金蝶国际软件集团	268 HK	香港证券交易所	中国香港	1,289,000	2,632,990.42	4.11

	onal Softwar e Group Compan y Limited	有限公司		所				
9	Bank Of Communi cation s Co.,Ltd.	交通银行 股份有限 公司	3328 HK	香港证 券交易 所	中国香港	600,000	2,507,601.78	3.92
10	Citic Securitie s Compan y Limited	中信证券 股份有限 公司	6030 HK	香港证 券交易 所	中国香港	170,000	2,469,996.30	3.86
11	Chinaso ft Internati onal Ltd.	中软国际 有限公司	354 HK	香港证 券交易 所	中国香港	950,000	2,452,048.23	3.83
12	Sinopec Shangha i Petroche mical Compan y Limited	中国石化 上海石油 化工股份 有限公司	338 HK	香港证 券交易 所	中国香港	745,000	2,254,021.19	3.52
13	BBMG Corporat ion	北京金隅 股份有限 公司	2009 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,000,000	1,974,287.70	3.08
14	Geely Automob ile Holdings Limited	吉利汽车 控股有限 公司	175 HK	香港证 券交易 所	中国香港	500,000	1,790,533.65	2.80
15	Shenzhe n Internati onal Holdings	深圳国际 控股有限 公司	152 HK	香港证 券交易 所	中国香港	132,742	1,270,646.78	1.99

	Limited							
16	Goldpac Group Limited	金邦达宝嘉控股有限公司	3315 HK	香港证券交易所	中国香港	550,590	1,021,142.88	1.60
17	Shandong Xinhua Pharmaceutical Company Limited	山东新华制药股份有限公司	719 HK	香港证券交易所	中国香港	228,800	958,187.63	1.50
18	Shanghai Jin Jiang International Hotels (Group) Company Limited	上海锦江国际酒店(集团)股份有限公司	2006 HK	香港证券交易所	中国香港	336,000	726,537.87	1.14
19	Vinda International Holdings Limited	维达国际控股有限公司	3331 HK	香港证券交易所	中国香港	49,800	570,338.38	0.89
20	Baoxin Auto Group Limited	宝信汽车集团有限公司	1293 HK	香港证券交易所	中国香港	74,000	268,161.26	0.42
21	China National Materials Company Limited	中国中材股份有限公司	1893 HK	香港证券交易所	中国香港	178,800	255,201.04	0.40
22	Shanghai Fudan Microelectronics Group Company	上海复旦微电子集团股份有限公司	1385 HK	香港证券交易所	中国香港	45,530	245,930.95	0.38

	y Limited							
23	China Singyes Solar Technol ogies Holdings Limited	中国兴业 太阳能技 术控股有 限公司	750 HK	香港证 券交易 所	中国香港	21,000	47,741.87	0.07
24	Colour Life Services Group Co., Limited	彩生活服 务集团有 限公司	1778 HK	香港证 券交易 所	中国香港	800	3,664.82	0.01
25	Fosun Internati onal Limited	复星国际 有限公司	656 HK	香港证 券交易 所	中国香港	32	273.49	0.00

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	CHINA MOBILE LTD	941 HK	3,769,201.53	5.37

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代 码	本期累计卖 出金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	696 HK	2,531,868.33	3.61
2	SHENZHEN INVESTMENT LTD	604 HK	2,271,384.58	3.24
3	COWELL E HOLDINGS INC	1415 HK	2,175,039.77	3.10
4	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	6881 HK	2,053,931.92	2.93
5	DONGJIANG ENVIRONMEN	895 HK	1,490,710.76	2.13

6	GUANGZHOU SHIPYARD INTL CO-H	317 HK	1,437,888.35	2.05
7	FUFENG GROUP LTD	546 HK	741,669.19	1.06
8	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	718,820.20	1.03
9	FOSUN INTERNATIONAL LTD	656 HK	336,193.87	0.48
10	ZTE CORP-H	763 HK	322,225.36	0.46
11	CHINA SINGYES SOLAR TECH	750 HK	288,920.64	0.41
12	GOLDPAC GROUP LTD	3315 HK	278,416.89	0.40
13	CHANJET INFORMATION TECH-H	1588 HK	233,808.59	0.33
14	COLOUR LIFE SERVICES GROUP	1778 HK	214,130.13	0.31

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	3,769,201.53
卖出收入（成交）总额	15,095,008.58

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	权证	兴业太阳能技术控股有限公司配股权证	3,718.50	0.01

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	663,581.61
4	应收利息	408.33
5	应收申购款	1,041,703.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,705,693.47

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
1,939	41,855.23	17,299,884.66	21.32%	63,857,400.52	78.68%

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	825,262.01	1.0169%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式 基金	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月27日）基金 份额总额	821,766,293.97
本报告期期初基金份额总额	83,026,692.45
本报告期基金总申购份额	5,567,173.57
减：本报告期基金总赎回份额	7,436,580.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	81,157,285.18

§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	
ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	6,879,481.19	36.47%	6,879.47	31.59%	-
CITIC	-	2,946,704.79	15.62%	3,536.05	16.24%	-

Securities International Company Limited						
Essence International Securities Ltd	-	2,531,868.32	13.42%	3,797.80	17.44%	-
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	-	2,281,590.22	12.09%	2,403.17	11.04%	-
China Merchants Sec(HK) Limited	-	2,175,039.76	11.53%	2,175.04	9.99%	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	975,477.78	5.17%	1,463.21	6.72%	-
BOCOM International Securities Limited	-	513,930.69	2.72%	770.90	3.54%	-
CCB International Securities Limited	-	379,137.52	2.01%	568.70	2.61%	-
UBS Securities Asia Limited	-	180,979.79	0.96%	180.98	0.83%	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-
ShenYin WanGuo (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-
MasterLink	-	-	-	-	-	-

Securities Corp.						
YUANTA SECURITIES (HONG KONG) COMPANY LIMITED	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY CO. INTERNATIONAL PLC	-	-	-	-	-	-
The Bank of New York Company Inc.	-	-	-	-	-	-
BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
CICC HK SEC. LTD.	-	-	-	-	-	-
Fubon Bank (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities(H K) Limited	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-

J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金新租用券商大华继显(香港)有限公司 UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited 的交易单元。

2、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。

3、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。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
ICB C INT ERN ATI ON	-	-	-	-	-	-	-	-

AL SEC URI TIE S LIM ITE D								
CITI C Secu rities Inter natio nal Com pany Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
Esse nce Inter natio nal Secu rities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UO B Kay Hian (Hon g Kon g) Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Mer chan ts Sec(HK) Limi	-	-	-	-	-	-	-	-

ted								
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

Shen Yin Wan Guo (H.K .)Li mite d	-	-	-	-	-	-	-	-
Hait ong Inter natio nal Secu rities Grou p Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
Mast erLi nk Secu rities Corp .	-	-	-	-	-	-	-	-
YU ANT A SEC URI TIE S (HO NG KO NG) CO MPA NY LIM ITE D	-	-	-	-	-	-	-	-
Deut sche	-	-	-	-	-	-	-	-

Securities Asia Limited								
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY CO. INTERNATIONAL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
The Bank of New York Company Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-

se (Hon g Kon g) Ltd								
CIC C HK SEC. LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubo n Ban k (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Pari bas Secu rities (Asi a) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Ever brig ht Secu rities (HK) Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-
Guo du Secu rities (Hon g Kon g)	-	-	-	-	-	-	-	-

Limited								
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

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	海富通中国海外精选混合型证券投资基金及海富通大中华精选混合型证券投资基金 2015 年度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》	2016-01-05
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽投资顾问（北京）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》	2016-01-13
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在宜信普泽投资顾问（北京）有限公司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》	2016-01-13
4	海富通基金管理有限公司基金行业高级	《中国证券报》、《上海	2016-01-20

	管理人员变更公告	证券报》和《证券时报》	
5	海富通基金管理有限公司关于参加上海凯石财富基金销售有限公司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》	2016-01-28
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售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》	2016-01-28
7	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-02-01
8	海富通大中华精选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》	2016-02-05
9	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-02-24
10	海富通基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司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》	2016-03-03
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国都证券股份有限公司网上交易、手机炒股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》	2016-03-05
12	海富通基金管理有限公司关于参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司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》	2016-03-09
13	海富通基金管理有限公司关于参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司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》	2016-03-11
14	海富通基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司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》	2016-03-11
15	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-22
16	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-30
17	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》	2016-03-31
18	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》	2016-04-16
19	海富通基金管理有限公司关于从业人员	《中国证券报》、《上海	2016-04-19

	在子公司兼职情况变更的公告	证券报》和《证券时报》	
20	海富通基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-28
21	海富通基金管理有限公司关于参加深圳富济财富管理有限公司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》	2016-04-30
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳富济财富管理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》	2016-04-30
23	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰金融服务（深圳）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》	2016-05-07
24	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行基金通优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-05-12
25	海富通基金管理有限公司关于官方淘宝店和网上直销支付宝渠道暂停办理基金开户、申购等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-05-17
26	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信期货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》	2016-05-28
27	海富通基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司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》	2016-06-16
28	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华金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》	2016-06-21
29	海富通基金管理有限公司关于参加浙江金观诚财富管理有限公司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》	2016-06-23
30	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理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》	2016-06-23
31	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-28
32	海富通基金管理有限公司关于旗下部分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》	2016-06-28
33	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机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》	2016-06-30

§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。

§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大中华精选混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通大中华精选混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通大中华精选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) 报告期内海富通大中华精选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
二〇一六年八月二十六日