

**海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 年 12 月 31 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	海富通东财大数据混合
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	64,150,534.67 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	郭明
	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>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和 指标	2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	6,775,773.25
本期利润	5,655,258.73
加权平均基金份额 本期利润	0.0327
本期基金份额净值 增长率	3.60%
3.1.2 期末数据和 指标	2016 年末
期末可供分配基金 份额利润	0.0362
期末基金资产净值	66,473,693.90
期末基金份额净值	1.036

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）。

4、本基金合同生效日为 2016 年 1 月 29 日。合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

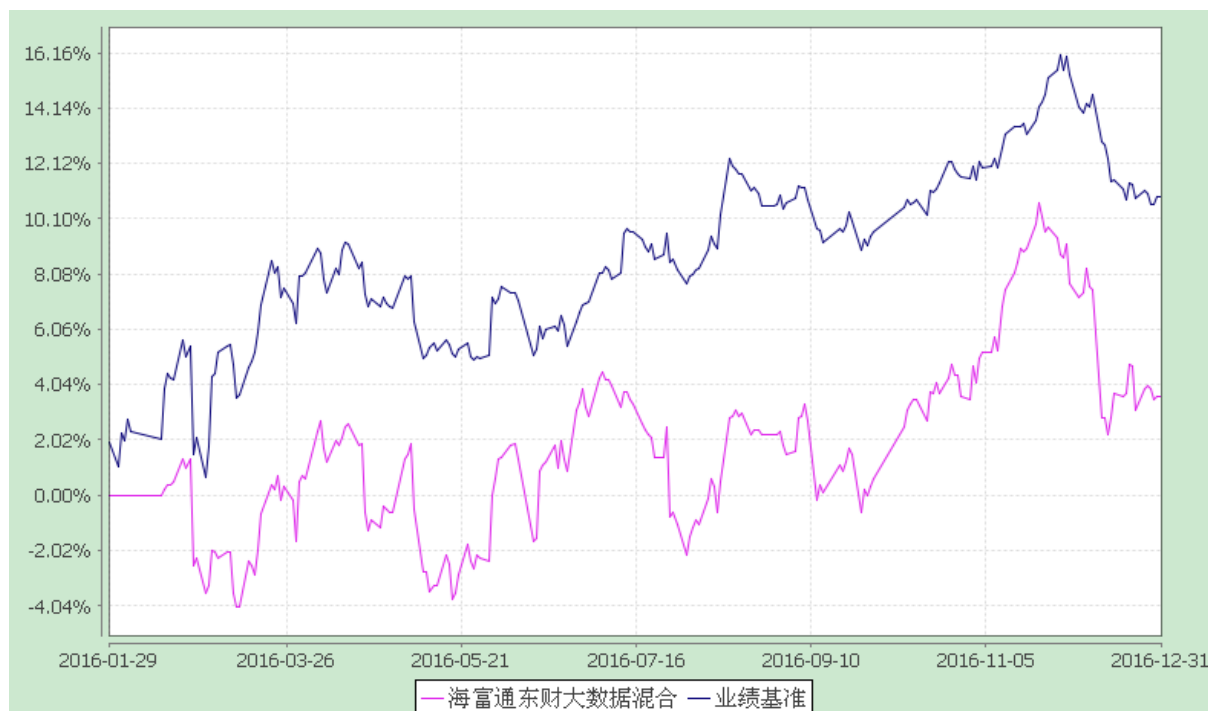
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.98%	0.86%	1.16%	0.43%	1.82%	0.43%
过去六个月	0.39%	0.85%	3.62%	0.46%	-3.23%	0.39%
自基金合同生效起至今	3.60%	0.92%	10.89%	0.66%	-7.29%	0.26%

#### 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的历史走势对比图  
 (2016 年 1 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日)

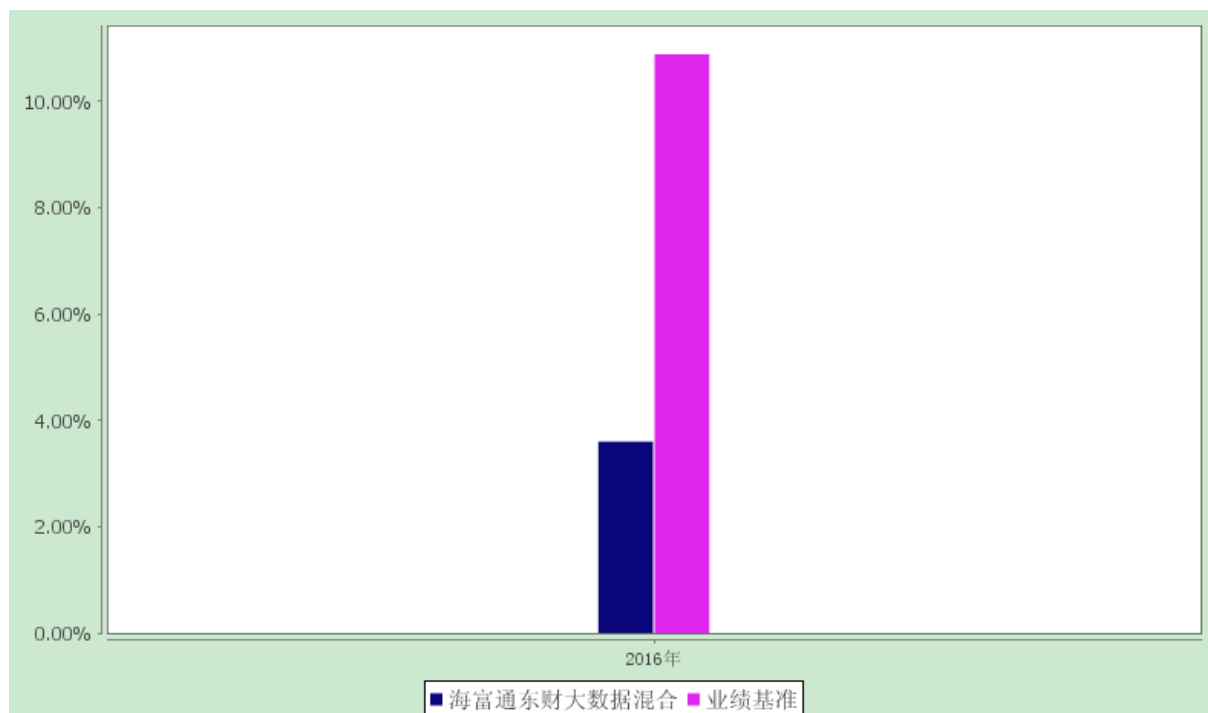


注：1、本基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金  
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：图中列示的 2016 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 1 月 29 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去一年未发生利润分配的情况。

## § 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 12 月 31 日，本基金管理人

共管理 42 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、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞益债券型证券投资基金、海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金 (LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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理；海富通养老收益混合基金经理；海富通欣益混合基金经	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，海富通基金管理有限公司量



	理；量化投资部总监				<p>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。</p> <p>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。</p> <p>2016 年 1 月起兼任海富通东财大数据混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合基金经理。</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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风

险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证公平交易制度的执行和实现。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易，未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年的股市，可谓是惊心动魄，跌宕起伏，整体处于震荡市。2016 年全年上证综指下跌 12.31%，收 3103.64 点，深圳成指跌 19.64%，报 10177.14 点，中小板、创业板指分别下跌 22.89% 和 27.71%。而一级市场可谓热火朝天，IPO 和增发金额不断创新高。

2016 年的市场经历了许多重要事件的冲击，全球政治环境的变化扰动着经济和资本市场。年初美元走强、人民币兑美元汇率承压；年中英国“脱欧”，全球市场悲观情绪骤升；11 月，特朗普赢得美国大选，再现“黑天鹅”事件；年末美联储如期加息并透露明年信号，全球范围内经济复苏、物价上涨。

就国内而言，2016 开年 A 股市场暴跌，沪指跌至年内最低点 2638.30 点。二季度呈现先扬后抑，随后震荡上行的行情。三季度沪指一路震荡上行，重回 3000 点，随后因监管趋严受到冲击，“史上最严借壳标准”令花样借壳走向穷途末路，沪指 3000 点得而复失，盘面维持窄幅震荡，投资情绪持续低迷，多个交易日振幅创新低。四季度市场一改低迷走势，沪指一度突破 3200 点，但年末债市经历了较大的调整，加之保监会出台了限制险资入主上市公司的措施，炒作资金降温，股市受到一定影响，12 月最终

沪指下跌 4.50%，收于 3103.64 点，深圳成指跌 7.58%，收于 10177.14 点，中小板下跌 6.23%，创业板下跌 10.12%。

板块方面，在 29 个中信一级行业中，2016 全年只有食品饮料（7.56%）、家电（1.78%）、银行（0.69%）、煤炭（0.36%）获得正收益，传媒（-37.71%）、计算机（-36.12%）、旅游餐饮（-27.81%）、交通运输（-23.99%）、国防军工（-22.69%）跌幅逾 20%。

2016 年上半年的 A 股市场先跌后震荡，证券市场感受到了明显的市场凉意，市场的交易量和活跃度受到明显的压制，股票指数反复在一个较小的箱体震荡，市场运行体系变化较大。本基金在三季度及时调整大数据等量化选股模型，更多结合多因子选股模型，在 8 月到 11 月的阶段中提高和改善了部分组合业绩，但是仍然需要改善择时模型，更好的控制净值回撤。

#### 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 3.60%，同期业绩比较基准收益率为 10.89%，基金净值跑输业绩比较基准 7.29 个百分点。主要原因是本基金二季度建仓期有限度的参与了市场底部反弹行情，而 7 月份的股票配置行业过于集中在二季度涨幅较高的行业，以及四季度虽然抓住了一波小盘股上涨行情，但是在年末的下跌中没有及时调整，导致了净值回撤。

#### 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 2017 年，预计中国经济的特征是经济增速下行叠加通胀压力加剧。经济增速下行方面，2017 年房地产投资下滑将会给经济带来较大的下行压力。2016 年房地产市场表现出过热的特征，销售面积和销售金额分别比上年增长 22.5%和 34.8%，推动全年房地产投资增速由上年的 1.0%回升至 6.9%，对 2016 年的经济企稳贡献不小。2016 年“十一”期间 20 个城市的限购、限贷政策出台之后，房地产销售面积增速已经开始下滑，我们认为该下滑趋势将持续一至两年时间，未来会给房地产投资增速带来较大的下行压力，预计 2017 年 2 季度将是该压力开始体现的时间节点。通胀压力加剧方面，房地产销售火热带来的需求好转叠加库存低位等因素，推动整个 2016 年大宗商品表现良好，从而导致 2016 年下半年 PPI 回升屡屡超出预期，这一趋势在 2017 年尤其是上半年仍然有望持续，预计 PPI 同比增速在 2-3 月份达到高点，可能在 7-8%左右，全年 PPI 可能在 4%以上。CPI 走势来看，2017 年全年也有一定的上行压力，主要是油价及相关产业链的价格上涨对于 CPI 构成中食品的运输成本以及交通中的燃料成本等都有推升作用。预计 CPI 上半年 1-2 月份是高点，而下半年至年末将再次有上行压力。基于通胀的压力，货币政策在 2017 年大概率会中性偏紧，主要源自于人民币贬值压力和国内防控金融风险及资产泡沫的政策导向。财政政策方面，我们预计 2017 年会继续维持“积极的财政政策”的基调，房地产投资下滑带来的经济增长压力需要基建投资来对冲。海外方面，特朗普正式就职之后其国内财政刺激政策以及对华政策对中国资本市场的机遇和

冲击也需要持续关注。

证券市场表现方面，2016 年大盘股显著跑赢小盘股，整个市场的风格主要是关注行业基本面和公司业绩，我们预计 2017 年上半年这一风格大概率仍会持续。目前从上市公司估值水平来看，整体估值偏低，但是分化严重，多数行业仍高于历史均值水平。在国内经济面临下行压力、货币政策预期中性偏紧的情况下，我们需要更多关注企业的盈利改善和确定性。2017 年上半年我们仍看好大盘股和价值型品种，后周期的行业经过过去几年的产能去化库存都处于低位，补库存的需求可能推升产品价格，从而带动盈利上涨。出口行业受益于人民币贬值，预计 2017 年或有一定改善。2017 年下半年，我们认为成长型品种可能有一定的超跌反弹的机会，但需要观察到货币政策不再边际收紧，同时行业基本面也需要看到一些转好的趋势。

每一年 A 股的春季行情都非常值得期待，上证指数很有可能出现震荡上行的格局，而创业板综指等在 2016 年超跌的指数很有可能会出现大幅度反弹行情，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，努力抓住市场变化的因子特征，提高反弹相关因子的权重，积极寻找低估值并有稳定业绩增长的股票，争取为持有人提供相对的稳定收益。

#### 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

本报告期内，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，海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：海富通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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	
银行存款	8,505,112.22
结算备付金	893,395.20
存出保证金	146,868.97
交易性金融资产	58,058,364.97
其中：股票投资	58,058,364.97
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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	64,330.11
应收利息	2,308.97
应收股利	-
应收申购款	2,960.56
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	67,673,341.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-

卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	274,806.42
应付管理人报酬	94,319.65
应付托管费	14,737.44
应付销售服务费	-
应付交易费用	464,812.71
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	350,970.88
负债合计	1,199,647.10
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	64,150,534.67
未分配利润	2,323,159.23
所有者权益合计	66,473,693.90
负债和所有者权益总计	67,673,341.00

注：1.报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.036 元，基金份额总额 64,150,534.67 份。

2.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 12 月 31 日止期间。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、收入	<b>13,067,101.24</b>
1.利息收入	842,174.47

其中：存款利息收入	724,041.65
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）	12,626,332.84
其中：股票投资收益	12,425,308.59
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-349,120.00
股利收益	550,144.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,120,514.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	719,108.45
<b>减：二、费用</b>	<b>7,411,842.51</b>
1. 管理人报酬	2,609,178.55
2. 托管费	407,684.21
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	4,034,981.75
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	359,998.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>5,655,258.73</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>5,655,258.73</b>

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



### 7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	5,655,258.73	5,655,258.73
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）	-262,170,442.68	-3,332,099.50	-265,502,542.18
其中：1.基金申购款	18,621,417.08	1,308,822.45	19,930,239.53
2.基金赎回款	-280,791,859.76	-4,640,921.95	-285,432,781.71
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）	64,150,534.67	2,323,159.23	66,473,693.90

注：本基金合同成立于 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 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张文伟，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

海富通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[2015]3083 号《关于准予海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通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(特殊普通合伙)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,基金托管人为中国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、货币市场工具、权证、资产支持证券、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)。本基金的投资组合比例为:基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%~95%,权证投资占基金资产净值的 0%~3%。在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为:本基金业绩比较基准:沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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 2017 年 3 月 24 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 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其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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和债券，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、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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。

(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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
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
法国巴黎投资管理 BE 控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.8.1.1 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。

##### 7.4.8.1.2 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。

##### 7.4.8.1.3 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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月29日（基金合同生效日）至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,609,178.55
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,764,588.47

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.60%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 1.60% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.2 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 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	407,684.21

注：支付基金托管人中国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。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本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。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期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。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末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。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月29日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	8,505,112.22	442,237.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无通过关联方购买其承销的证券。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

## 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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
300508	维宏股份	2016-04-12	2017-04-19	首发原股东限	20.08	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-

				售股份						
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股未上市	9.30	9.30	992	9,225.60	9,225.60	-

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。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300223	北京君正	2016-12-19	重大事项	48.40	-	-	20,000	546,406.64	968,000.00	-
002282	博深工具	2016-10-10	重大资产重组	13.80	-	-	41,700	548,125.77	575,460.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	47,800	379,042.00	395,306.00	-
000042	中洲控股	2016-10-27	重大资产重组	20.24	-	-	17,700	339,794.00	358,248.00	-
002809	红墙股份	2016-12-22	重大事项未公告	74.08	2017-02-15	68.02	4,400	339,178.00	325,952.00	-
300513	恒泰实达	2016-10-31	重大资产重组	95.36	2017-02-27	82.00	3,300	328,792.78	314,688.00	-
300150	世纪瑞尔	2016-11-08	重大资产重组	9.97	2017-03-21	10.97	27,100	270,914.79	270,187.00	-
000682	东方电子	2016-10-10	重大资产重组	5.20	-	-	44,400	240,168.00	230,880.00	-
300189	神农基因	2016-12-12	重大资产重组	5.25	2017-02-28	5.34	40,000	205,262.84	210,000.00	-
002396	星网锐捷	2016-09-12	重大事项未公告	19.70	2017-02-21	18.35	10,600	206,162.88	208,820.00	-
600859	王府井	2016-09-27	重大资产重组	16.28	-	-	12,200	205,570.00	198,616.00	-
002440	闰土股份	2016-10-21	重大资产重组	16.34	2017-01-12	15.22	9,000	140,493.00	147,060.00	-
300479	神思电	2016-12-	重大事项	25.57	-	-	5,500	161,788.00	140,635.00	-

	子	13								
300065	海兰信	2016-12-08	重大资产重组	38.52	-	-	3,600	133,749.00	138,672.00	-
600242	中昌数据	2016-10-11	重大资产重组	16.97	2017-03-13	16.80	5,600	82,488.00	95,032.00	-
000540	中天城投	2016-11-28	重大资产重组	6.93	2017-01-03	7.00	13,700	93,023.00	94,941.00	-
000560	昆百大A	2016-09-02	重大资产重组	10.40	-	-	8,000	80,080.00	83,200.00	-
600552	凯盛科技	2016-09-08	重大资产重组	18.43	2017-02-13	17.51	4,300	78,132.92	79,249.00	-
300535	达威股份	2016-12-12	重大资产重组	90.29	-	-	800	81,094.00	72,232.00	-
300518	盛讯达	2016-12-13	重大资产重组	113.46	-	-	600	83,315.00	68,076.00	-
002798	帝王洁具	2016-11-02	重大资产重组	67.00	2017-01-17	60.34	900	56,518.00	60,300.00	-
300537	广信材料	2016-10-12	重大资产重组	48.79	2017-01-13	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-
603009	北特科技	2016-12-28	重大事项未公告	47.89	2017-01-04	52.68	800	31,764.00	38,312.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 51,641,579.08 元，属于第二层次的余额为 6,416,785.89 元，无属于第三层次的余额。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	58,058,364.97	85.79
	其中：股票	58,058,364.97	85.79
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	9,398,507.42	13.89
7	其他各项资产	216,468.61	0.32
8	合计	67,673,341.00	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,048,956.00	1.58
B	采矿业	860,962.00	1.30
C	制造业	35,579,433.81	53.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,836,177.00	4.27
E	建筑业	1,331,291.00	2.00
F	批发和零售业	2,716,472.00	4.09
G	交通运输、仓储和邮政业	2,146,067.00	3.23
H	住宿和餐饮业	68,580.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,379,422.50	8.09
J	金融业	613,012.00	0.92
K	房地产业	1,780,230.00	2.68
L	租赁和商务服务业	279,954.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	1,269,366.00	1.91
N	水利、环境和公共设施管理业	1,876,680.66	2.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	105,273.00	0.16
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	166,488.00	0.25
	合计	58,058,364.97	87.34

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300508	维宏股份	12,050	1,463,954.50	2.20
2	300223	北京君正	20,000	968,000.00	1.46
3	000430	张家界	47,500	579,975.00	0.87
4	002282	博深工具	41,700	575,460.00	0.87
5	002046	轴研科技	45,800	538,150.00	0.81
6	300404	博济医药	16,600	538,006.00	0.81
7	300486	东杰智能	20,300	527,800.00	0.79
8	300395	菲利华	22,600	523,642.00	0.79
9	000858	五粮液	14,900	513,752.00	0.77
10	300139	晓程科技	36,000	487,800.00	0.73

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 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002468	申通快递	7,512,273.88	11.30
2	000932	华菱钢铁	7,328,512.00	11.02
3	600386	北巴传媒	7,260,857.47	10.92
4	600172	黄河旋风	6,941,669.88	10.44
5	300065	海兰信	6,922,327.46	10.41
6	601689	拓普集团	6,906,922.00	10.39
7	600232	金鹰股份	6,891,868.90	10.37
8	601901	方正证券	6,827,266.00	10.27
9	601998	中信银行	6,633,381.00	9.98

10	601788	光大证券	5,808,372.55	8.74
11	600585	海螺水泥	5,776,178.00	8.69
12	002108	沧州明珠	5,753,790.00	8.66
13	600271	航天信息	5,535,670.00	8.33
14	300033	同花顺	5,510,981.31	8.29
15	600058	五矿发展	5,441,565.00	8.19
16	300114	中航电测	5,292,849.94	7.96
17	300231	银信科技	5,272,319.00	7.93
18	600999	招商证券	5,008,178.00	7.53
19	000858	五粮液	5,004,959.00	7.53
20	600155	宝硕股份	4,984,820.37	7.50
21	000786	北新建材	4,935,575.00	7.42
22	600958	东方证券	4,920,754.00	7.40
23	300431	暴风集团	4,826,704.00	7.26
24	603308	应流股份	4,696,743.60	7.07
25	002078	太阳纸业	4,550,350.50	6.85
26	601555	东吴证券	4,543,357.00	6.83
27	300367	东方网力	4,511,761.67	6.79
28	002056	横店东磁	4,473,895.09	6.73
29	300274	阳光电源	4,396,142.33	6.61
30	002673	西部证券	4,373,321.00	6.58
31	600109	国金证券	4,301,043.80	6.47
32	300017	网宿科技	4,298,625.00	6.47
33	002390	信邦制药	4,228,769.00	6.36
34	300207	欣旺达	4,199,799.88	6.32
35	300048	合康新能	4,184,041.86	6.29
36	002245	澳洋顺昌	4,182,631.00	6.29
37	300113	顺网科技	4,179,405.00	6.29
38	300187	永清环保	4,164,265.00	6.26
39	601198	东兴证券	4,057,708.50	6.10
40	002094	青岛金王	4,039,478.24	6.08
41	600547	山东黄金	3,967,421.00	5.97
42	002304	洋河股份	3,963,102.11	5.96
43	300206	理邦仪器	3,936,545.84	5.92
44	002606	大连电瓷	3,908,522.60	5.88
45	600887	伊利股份	3,853,954.00	5.80
46	300166	东方国信	3,834,593.54	5.77
47	002643	万润股份	3,825,613.13	5.76
48	000983	西山煤电	3,765,744.49	5.67
49	000776	广发证券	3,763,397.00	5.66
50	300446	乐凯新材	3,741,013.00	5.63
51	300258	精锻科技	3,589,435.25	5.40
52	300373	扬杰科技	3,571,005.14	5.37
53	002635	安洁科技	3,513,574.00	5.29

54	002142	宁波银行	3,473,926.00	5.23
55	600869	智慧能源	3,443,771.00	5.18
56	601021	春秋航空	3,439,385.00	5.17
57	002299	圣农发展	3,428,352.19	5.16
58	300182	捷成股份	3,402,302.71	5.12
59	601318	中国平安	3,373,503.00	5.07
60	600117	西宁特钢	3,339,186.10	5.02
61	002311	海大集团	3,334,596.60	5.02
62	603798	康普顿	3,320,307.83	4.99
63	002273	水晶光电	3,284,890.00	4.94
64	002517	恺英网络	3,234,638.52	4.87
65	600563	法拉电子	3,171,966.62	4.77
66	600395	盘江股份	3,171,477.85	4.77
67	002279	久其软件	3,148,467.00	4.74
68	600060	海信电器	3,129,688.16	4.71
69	002008	大族激光	3,121,319.54	4.70
70	000709	河钢股份	3,105,345.00	4.67
71	002322	理工环科	3,080,121.00	4.63
72	002518	科士达	3,062,115.00	4.61
73	300009	安科生物	3,051,365.00	4.59
74	603111	康尼机电	3,035,262.98	4.57
75	300232	洲明科技	3,024,546.89	4.55
76	002657	中科金财	3,018,637.76	4.54
77	600651	飞乐音响	3,016,360.80	4.54
78	600236	桂冠电力	3,015,292.54	4.54
79	300286	安科瑞	2,981,269.00	4.48
80	300375	鹏翎股份	2,980,368.00	4.48
81	300369	绿盟科技	2,973,310.57	4.47
82	002440	闰土股份	2,967,005.00	4.46
83	300053	欧比特	2,945,857.00	4.43
84	000402	金融街	2,917,101.00	4.39
85	300267	尔康制药	2,798,430.00	4.21
86	600425	青松建化	2,794,649.00	4.20
87	600459	贵研铂业	2,785,281.00	4.19
88	002343	慈文传媒	2,774,995.01	4.17
89	002341	新纶科技	2,736,969.41	4.12
90	300302	同有科技	2,694,093.00	4.05
91	603726	朗迪集团	2,684,980.53	4.04
92	300091	金通灵	2,684,392.00	4.04
93	600352	浙江龙盛	2,656,215.75	4.00
94	002466	天齐锂业	2,653,729.20	3.99
95	000712	锦龙股份	2,631,503.01	3.96
96	300223	北京君正	2,625,530.06	3.95
97	000783	长江证券	2,607,239.00	3.92



98	300081	恒信移动	2,602,348.00	3.91
99	300345	红宇新材	2,600,782.80	3.91
100	300270	中威电子	2,581,465.25	3.88
101	300354	东华测试	2,559,580.84	3.85
102	601628	中国人寿	2,556,292.00	3.85
103	000959	首钢股份	2,554,602.91	3.84
104	601992	金隅股份	2,553,534.98	3.84
105	000333	美的集团	2,538,747.15	3.82
106	002699	美盛文化	2,526,608.71	3.80
107	002149	西部材料	2,522,896.72	3.80
108	000898	鞍钢股份	2,519,736.00	3.79
109	300211	亿通科技	2,510,231.00	3.78
110	300448	浩云科技	2,504,431.50	3.77
111	300085	银之杰	2,503,799.00	3.77
112	300389	艾比森	2,493,080.17	3.75
113	300007	汉威电子	2,480,280.16	3.73
114	300095	华伍股份	2,471,714.58	3.72
115	300101	振芯科技	2,464,382.11	3.71
116	000768	中航飞机	2,420,019.00	3.64
117	002081	金螳螂	2,413,951.95	3.63
118	300133	华策影视	2,398,796.40	3.61
119	300398	飞凯材料	2,398,300.15	3.61
120	300439	美康生物	2,368,287.90	3.56
121	002454	松芝股份	2,365,919.78	3.56
122	002138	顺络电子	2,354,149.00	3.54
123	600801	华新水泥	2,353,077.78	3.54
124	002234	民和股份	2,343,700.00	3.53
125	300353	东土科技	2,337,075.51	3.52
126	600392	盛和资源	2,329,791.00	3.50
127	300015	爱尔眼科	2,322,014.00	3.49
128	300159	新研股份	2,282,724.00	3.43
129	002355	兴民智通	2,276,029.53	3.42
130	002624	完美世界	2,271,379.00	3.42
131	000670	*ST 盈方	2,259,015.00	3.40
132	300250	初灵信息	2,252,134.00	3.39
133	300011	鼎汉技术	2,244,571.00	3.38
134	002548	金新农	2,233,322.00	3.36
135	000001	平安银行	2,204,872.00	3.32
136	601939	建设银行	2,168,975.00	3.26
137	601169	北京银行	2,158,463.80	3.25
138	600531	豫光金铅	2,144,911.00	3.23
139	300327	中颖电子	2,139,123.90	3.22
140	002357	富临运业	2,116,113.00	3.18
141	601339	百隆东方	2,101,453.57	3.16

142	002086	东方海洋	2,097,875.00	3.16
143	300458	全志科技	2,089,079.00	3.14
144	300404	博济医药	2,082,000.00	3.13
145	600259	广晟有色	2,078,074.00	3.13
146	000919	金陵药业	2,065,782.00	3.11
147	002477	雏鹰农牧	2,039,186.00	3.07
148	600990	四创电子	2,027,472.00	3.05
149	002184	海得控制	2,027,028.55	3.05
150	002117	东港股份	2,007,172.00	3.02
151	300098	高新兴	1,999,505.42	3.01
152	300203	聚光科技	1,991,423.58	3.00
153	601699	潞安环能	1,980,138.00	2.98
154	002458	益生股份	1,969,598.76	2.96
155	002713	东易日盛	1,966,808.00	2.96
156	300213	佳讯飞鸿	1,958,053.00	2.95
157	000801	四川九洲	1,948,933.78	2.93
158	002631	德尔未来	1,945,327.00	2.93
159	002323	雅百特	1,936,967.00	2.91
160	300107	建新股份	1,933,096.00	2.91
161	002797	第一创业	1,925,062.00	2.90
162	300246	宝莱特	1,918,665.82	2.89
163	002177	御银股份	1,916,769.00	2.88
164	002362	汉王科技	1,910,480.00	2.87
165	300325	德威新材	1,888,826.00	2.84
166	600584	长电科技	1,880,053.00	2.83
167	002530	丰东股份	1,866,776.94	2.81
168	300513	恒泰实达	1,865,422.00	2.81
169	600362	江西铜业	1,862,622.00	2.80
170	002510	天汽模	1,860,834.53	2.80
171	300440	运达科技	1,857,859.00	2.79
172	300418	昆仑万维	1,852,776.00	2.79
173	000568	泸州老窖	1,847,668.26	2.78
174	300018	中元股份	1,841,851.50	2.77
175	002281	光迅科技	1,835,815.00	2.76
176	002382	蓝帆医疗	1,828,219.00	2.75
177	002128	露天煤业	1,817,690.80	2.73
178	002282	博深工具	1,815,968.18	2.73
179	002043	兔宝宝	1,810,946.00	2.72
180	300275	梅安森	1,808,297.00	2.72
181	300318	博晖创新	1,799,623.75	2.71
182	300083	劲胜精密	1,774,475.11	2.67
183	000687	华讯方舟	1,773,199.29	2.67
184	002476	宝莫股份	1,759,664.98	2.65
185	002501	利源精制	1,755,109.00	2.64

186	300075	数字政通	1,748,158.00	2.63
187	002463	沪电股份	1,744,928.25	2.62
188	300445	康斯特	1,737,837.16	2.61
189	601336	新华保险	1,733,619.00	2.61
190	002591	恒大高新	1,712,770.27	2.58
191	300226	上海钢联	1,710,993.00	2.57
192	300084	海默科技	1,701,233.67	2.56
193	300449	汉邦高科	1,699,049.00	2.56
194	002474	榕基软件	1,693,957.21	2.55
195	002367	康力电梯	1,691,149.65	2.54
196	000825	太钢不锈	1,687,926.00	2.54
197	300079	数码视讯	1,682,900.82	2.53
198	000498	山东路桥	1,674,850.00	2.52
199	600369	西南证券	1,674,338.00	2.52
200	002523	天桥起重	1,673,988.47	2.52
201	002214	大立科技	1,671,709.20	2.51
202	600782	新钢股份	1,663,414.00	2.50
203	300447	全信股份	1,662,258.00	2.50
204	603456	九洲药业	1,662,101.00	2.50
205	000889	茂业通信	1,661,445.00	2.50
206	002296	辉煌科技	1,654,905.00	2.49
207	000970	中科三环	1,651,600.00	2.48
208	601099	太平洋	1,649,576.00	2.48
209	300348	长亮科技	1,645,059.00	2.47
210	300145	中金环境	1,642,525.00	2.47
211	600525	长园集团	1,640,308.00	2.47
212	300394	天孚通信	1,637,670.99	2.46
213	002307	北新路桥	1,632,213.00	2.46
214	002649	博彦科技	1,629,549.00	2.45
215	300196	长海股份	1,626,319.20	2.45
216	603885	吉祥航空	1,624,222.00	2.44
217	300487	蓝晓科技	1,624,073.51	2.44
218	002236	大华股份	1,617,923.00	2.43
219	002001	新 和 成	1,610,992.00	2.42
220	000650	仁和药业	1,607,520.00	2.42
221	300305	裕兴股份	1,603,051.00	2.41
222	002780	三夫户外	1,599,206.00	2.41
223	600306	*ST 商城	1,591,196.00	2.39
224	002520	日发精机	1,584,912.84	2.38
225	300218	安利股份	1,580,232.00	2.38
226	300096	易联众	1,578,719.00	2.37
227	300200	高盟新材	1,569,730.75	2.36
228	603528	多伦科技	1,568,995.65	2.36
229	603029	天鹅股份	1,568,952.02	2.36

230	002178	延华智能	1,560,122.00	2.35
231	002553	南方轴承	1,552,301.66	2.34
232	002659	中泰桥梁	1,550,743.94	2.33
233	600879	航天电子	1,548,894.00	2.33
234	300093	金刚玻璃	1,540,643.17	2.32
235	300401	花园生物	1,539,893.22	2.32
236	000895	双汇发展	1,537,940.20	2.31
237	002644	佛慈制药	1,536,365.84	2.31
238	300315	掌趣科技	1,531,800.00	2.30
239	002046	轴研科技	1,527,846.50	2.30
240	300214	日科化学	1,527,668.00	2.30
241	601113	华鼎股份	1,525,287.65	2.29
242	300036	超图软件	1,524,406.78	2.29
243	300357	我武生物	1,522,887.72	2.29
244	600834	申通地铁	1,519,148.00	2.29
245	002159	三特索道	1,516,591.47	2.28
246	002016	世荣兆业	1,513,990.00	2.28
247	300002	神州泰岳	1,502,707.94	2.26
248	600720	祁连山	1,502,324.00	2.26
249	000708	大冶特钢	1,501,543.50	2.26
250	000861	海印股份	1,497,148.00	2.25
251	300301	长方集团	1,493,359.48	2.25
252	002432	九安医疗	1,492,902.00	2.25
253	002071	长城影视	1,490,355.26	2.24
254	300177	中海达	1,483,688.52	2.23
255	300328	宜安科技	1,464,489.00	2.20
256	600698	湖南天雁	1,461,244.00	2.20
257	600808	马钢股份	1,454,874.30	2.19
258	002292	奥飞娱乐	1,451,300.00	2.18
259	300303	聚飞光电	1,448,459.13	2.18
260	002642	荣之联	1,445,788.96	2.17
261	300386	飞天诚信	1,442,198.00	2.17
262	600022	山东钢铁	1,438,957.05	2.16
263	002206	海利得	1,436,652.22	2.16
264	002110	三钢闽光	1,432,984.00	2.16
265	002532	新界泵业	1,432,089.93	2.15
266	300378	鼎捷软件	1,430,428.00	2.15
267	000401	冀东水泥	1,429,736.00	2.15
268	300217	东方电热	1,424,068.00	2.14
269	603788	宁波高发	1,422,270.00	2.14
270	603822	嘉澳环保	1,422,197.00	2.14
271	300350	华鹏飞	1,419,228.00	2.14
272	300379	东方通	1,414,959.14	2.13
273	601766	中国中车	1,405,000.00	2.11

274	000423	东阿阿胶	1,402,913.00	2.11
275	002191	劲嘉股份	1,393,943.00	2.10
276	300263	隆华节能	1,387,949.99	2.09
277	002295	精艺股份	1,387,241.31	2.09
278	002297	博云新材	1,386,867.49	2.09
279	600858	银座股份	1,386,127.31	2.09
280	300154	瑞凌股份	1,385,605.50	2.08
281	300259	新天科技	1,377,639.21	2.07
282	002324	普利特	1,377,483.01	2.07
283	300329	海伦钢琴	1,369,499.00	2.06
284	600507	方大特钢	1,366,628.00	2.06
285	002013	中航机电	1,359,935.60	2.05
286	300500	苏州设计	1,358,749.08	2.04
287	300508	维宏股份	1,352,297.45	2.03
288	002185	华天科技	1,346,904.00	2.03
289	300210	森远股份	1,338,901.10	2.01
290	300140	启源装备	1,337,152.14	2.01
291	300241	瑞丰光电	1,331,410.36	2.00

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600386	北巴传媒	7,349,144.98	11.06
2	600172	黄河旋风	7,210,016.50	10.85
3	300065	海兰信	7,176,942.37	10.80
4	002468	申通快递	7,148,843.75	10.75
5	601689	拓普集团	7,116,167.00	10.71
6	601901	方正证券	6,814,697.51	10.25
7	601998	中信银行	6,778,239.00	10.20
8	600232	金鹰股份	6,653,991.90	10.01
9	000932	华菱钢铁	6,624,694.80	9.97
10	002108	沧州明珠	5,990,986.71	9.01
11	600585	海螺水泥	5,930,555.21	8.92
12	601788	光大证券	5,822,905.00	8.76
13	600271	航天信息	5,491,181.94	8.26
14	600155	宝硕股份	5,387,389.99	8.10
15	300231	银信科技	5,347,315.26	8.04

16	300033	同花顺	5,325,232.00	8.01
17	600058	五矿发展	5,290,405.04	7.96
18	300114	中航电测	5,141,637.29	7.73
19	600999	招商证券	5,066,924.26	7.62
20	000858	五粮液	4,932,534.57	7.42
21	000786	北新建材	4,879,719.39	7.34
22	600958	东方证券	4,740,321.00	7.13
23	002078	太阳纸业	4,704,220.89	7.08
24	002056	横店东磁	4,670,571.11	7.03
25	300274	阳光电源	4,632,727.75	6.97
26	601555	东吴证券	4,553,347.85	6.85
27	002245	澳洋顺昌	4,493,253.05	6.76
28	002673	西部证券	4,415,900.00	6.64
29	300048	合康新能	4,401,708.47	6.62
30	600109	国金证券	4,369,161.23	6.57
31	300431	暴风集团	4,363,227.77	6.56
32	300017	网宿科技	4,328,036.66	6.51
33	300113	顺网科技	4,296,574.36	6.46
34	603308	应流股份	4,287,381.31	6.45
35	300207	欣旺达	4,285,312.60	6.45
36	002094	青岛金王	4,228,445.42	6.36
37	300206	理邦仪器	4,200,505.98	6.32
38	300367	东方网力	4,168,878.51	6.27
39	002390	信邦制药	4,079,896.32	6.14
40	601198	东兴证券	4,034,521.18	6.07
41	300166	东方国信	3,968,207.47	5.97
42	300187	永清环保	3,942,105.73	5.93
43	600887	伊利股份	3,939,867.15	5.93
44	300373	扬杰科技	3,930,694.91	5.91
45	002304	洋河股份	3,899,050.61	5.87
46	002606	大连电瓷	3,858,113.18	5.80
47	000983	西山煤电	3,848,311.30	5.79
48	002643	万润股份	3,844,669.69	5.78
49	600547	山东黄金	3,785,751.04	5.70
50	300446	乐凯新材	3,710,787.38	5.58
51	002635	安洁科技	3,686,056.48	5.55
52	300258	精锻科技	3,677,604.12	5.53
53	002273	水晶光电	3,662,634.00	5.51
54	000776	广发证券	3,611,687.38	5.43
55	601021	春秋航空	3,467,918.20	5.22
56	002299	圣农发展	3,431,296.00	5.16
57	600117	西宁特钢	3,420,063.67	5.14
58	300182	捷成股份	3,404,602.81	5.12
59	002142	宁波银行	3,367,855.00	5.07

60	600869	智慧能源	3,338,577.80	5.02
61	601318	中国平安	3,288,161.17	4.95
62	000402	金融街	3,277,124.00	4.93
63	300009	安科生物	3,269,779.81	4.92
64	603798	康普顿	3,262,296.49	4.91
65	600236	桂冠电力	3,242,137.30	4.88
66	300232	洲明科技	3,216,649.38	4.84
67	002279	久其软件	3,200,213.00	4.81
68	002008	大族激光	3,163,891.25	4.76
69	300375	鹏翎股份	3,158,153.42	4.75
70	603111	康尼机电	3,096,418.03	4.66
71	600563	法拉电子	3,087,759.34	4.65
72	600060	海信电器	3,075,442.75	4.63
73	600651	飞乐音响	3,056,550.44	4.60
74	002311	海大集团	3,041,052.76	4.57
75	600395	盘江股份	3,040,474.00	4.57
76	300053	欧比特	3,022,474.76	4.55
77	002322	理工环科	2,993,496.08	4.50
78	600425	青松建化	2,982,802.95	4.49
79	002518	科士达	2,982,092.50	4.49
80	300369	绿盟科技	2,980,280.57	4.48
81	002657	中科金财	2,966,840.00	4.46
82	002341	新纶科技	2,957,524.93	4.45
83	300286	安科瑞	2,901,326.75	4.36
84	002517	恺英网络	2,778,720.46	4.18
85	300302	同有科技	2,750,476.82	4.14
86	300267	尔康制药	2,727,486.67	4.10
87	000712	锦龙股份	2,691,312.00	4.05
88	002466	天齐锂业	2,677,462.35	4.03
89	601992	金隅股份	2,636,358.04	3.97
90	000709	河钢股份	2,626,139.79	3.95
91	300389	艾比森	2,622,811.40	3.95
92	000768	中航飞机	2,601,511.34	3.91
93	300211	亿通科技	2,600,561.30	3.91
94	300398	飞凯材料	2,597,273.04	3.91
95	002343	慈文传媒	2,583,326.28	3.89
96	300095	华伍股份	2,565,067.40	3.86
97	603726	朗迪集团	2,553,129.41	3.84
98	601628	中国人寿	2,550,263.89	3.84
99	300448	浩云科技	2,545,176.34	3.83
100	300085	银之杰	2,537,075.97	3.82
101	002081	金螳螂	2,526,599.50	3.80
102	002548	金新农	2,515,252.59	3.78
103	000333	美的集团	2,514,654.00	3.78

104	300270	中威电子	2,514,306.49	3.78
105	000783	长江证券	2,510,963.08	3.78
106	300091	金通灵	2,499,507.20	3.76
107	000898	鞍钢股份	2,495,986.77	3.75
108	300007	汉威电子	2,491,746.03	3.75
109	002699	美盛文化	2,488,025.82	3.74
110	600801	华新水泥	2,481,125.55	3.73
111	300159	新研股份	2,474,092.95	3.72
112	300354	东华测试	2,460,184.85	3.70
113	600459	贵研铂业	2,455,616.00	3.69
114	002149	西部材料	2,454,903.24	3.69
115	300133	华策影视	2,425,386.28	3.65
116	600352	浙江龙盛	2,415,808.22	3.63
117	300101	振芯科技	2,412,725.57	3.63
118	002440	闰土股份	2,366,464.84	3.56
119	002234	民和股份	2,362,500.00	3.55
120	300439	美康生物	2,357,561.51	3.55
121	000959	首钢股份	2,354,877.13	3.54
122	002454	松芝股份	2,346,437.40	3.53
123	300250	初灵信息	2,336,752.75	3.52
124	300015	爱尔眼科	2,320,114.82	3.49
125	002357	富临运业	2,293,025.00	3.45
126	002624	完美世界	2,292,918.02	3.45
127	300345	红宇新材	2,280,110.56	3.43
128	300327	中颖电子	2,255,016.30	3.39
129	002138	顺络电子	2,254,618.00	3.39
130	601169	北京银行	2,224,726.06	3.35
131	002713	东易日盛	2,194,887.18	3.30
132	000001	平安银行	2,191,216.00	3.30
133	300223	北京君正	2,188,872.36	3.29
134	300353	东土科技	2,177,338.66	3.28
135	300203	聚光科技	2,140,890.00	3.22
136	002117	东港股份	2,109,668.00	3.17
137	002355	兴民智通	2,098,921.84	3.16
138	600259	广晟有色	2,095,263.26	3.15
139	600990	四创电子	2,087,363.00	3.14
140	300081	恒信移动	2,080,039.18	3.13
141	002477	雏鹰农牧	2,072,965.00	3.12
142	600531	豫光金铅	2,064,598.13	3.11
143	601939	建设银行	2,048,000.00	3.08
144	002086	东方海洋	2,030,880.93	3.06
145	601339	百隆东方	2,029,966.01	3.05
146	600392	盛和资源	2,028,997.45	3.05
147	300011	鼎汉技术	2,020,258.88	3.04



148	300213	佳讯飞鸿	2,011,620.02	3.03
149	002797	第一创业	2,005,408.00	3.02
150	002323	雅百特	1,997,284.70	3.00
151	000670	*ST 盈方	1,995,513.86	3.00
152	601699	潞安环能	1,991,197.00	3.00
153	002458	益生股份	1,990,331.00	2.99
154	300107	建新股份	1,973,338.17	2.97
155	300246	宝莱特	1,970,228.96	2.96
156	002177	御银股份	1,966,318.54	2.96
157	300098	高新兴	1,965,470.28	2.96
158	300440	运达科技	1,965,313.47	2.96
159	002530	丰东股份	1,964,549.04	2.96
160	300458	全志科技	1,954,753.70	2.94
161	002362	汉王科技	1,948,314.30	2.93
162	002043	兔 宝 宝	1,939,212.00	2.92
163	000919	金陵药业	1,910,027.96	2.87
164	300325	德威新材	1,896,416.05	2.85
165	300075	数字政通	1,892,603.74	2.85
166	002128	露天煤业	1,878,308.00	2.83
167	002184	海得控制	1,878,104.75	2.83
168	000568	泸州老窖	1,872,413.01	2.82
169	300348	长亮科技	1,833,846.97	2.76
170	000801	四川九洲	1,831,500.00	2.76
171	603528	多伦科技	1,826,393.05	2.75
172	002631	德尔未来	1,821,414.00	2.74
173	300018	中元股份	1,820,024.28	2.74
174	300318	博晖创新	1,815,819.79	2.73
175	002501	利源精制	1,812,873.00	2.73
176	002382	蓝帆医疗	1,810,749.01	2.72
177	601336	新华保险	1,804,277.00	2.71
178	300275	梅安森	1,801,670.25	2.71
179	000970	中科三环	1,796,130.00	2.70
180	002476	宝莫股份	1,791,129.06	2.69
181	300226	上海钢联	1,790,789.44	2.69
182	300079	数码视讯	1,760,689.64	2.65
183	002281	光迅科技	1,759,280.00	2.65
184	300083	劲胜精密	1,757,331.17	2.64
185	000825	太钢不锈	1,747,581.00	2.63
186	002474	榕基软件	1,745,655.29	2.63
187	300145	中金环境	1,742,443.53	2.62
188	000498	山东路桥	1,719,257.00	2.59
189	002510	天汽模	1,716,542.44	2.58
190	300196	长海股份	1,706,968.51	2.57
191	002463	沪电股份	1,705,681.73	2.57

192	601099	太平洋	1,683,910.70	2.53
193	600584	长电科技	1,679,200.00	2.53
194	600369	西南证券	1,676,000.00	2.52
195	002523	天桥起重	1,662,653.52	2.50
196	002214	大立科技	1,659,201.40	2.50
197	002591	恒大高新	1,659,110.53	2.50
198	600362	江西铜业	1,657,812.00	2.49
199	300036	超图软件	1,656,985.84	2.49
200	002236	大华股份	1,649,867.85	2.48
201	300449	汉邦高科	1,648,697.61	2.48
202	000889	茂业通信	1,648,447.52	2.48
203	000687	华讯方舟	1,644,529.00	2.47
204	300394	天孚通信	1,639,079.17	2.47
205	603029	天鹅股份	1,628,166.84	2.45
206	300096	易联众	1,627,000.19	2.45
207	002367	康力电梯	1,613,483.98	2.43
208	300447	全信股份	1,612,674.17	2.43
209	002649	博彦科技	1,603,723.00	2.41
210	002296	辉煌科技	1,595,955.75	2.40
211	603456	九洲药业	1,595,110.00	2.40
212	300401	花园生物	1,590,090.40	2.39
213	300357	我武生物	1,586,775.88	2.39
214	002780	三夫户外	1,584,752.00	2.38
215	300200	高盟新材	1,584,000.78	2.38
216	600525	长园集团	1,573,415.40	2.37
217	600879	航天电子	1,572,700.00	2.37
218	002159	三特索道	1,566,774.42	2.36
219	300445	康斯特	1,564,856.38	2.35
220	002307	北新路桥	1,559,378.64	2.35
221	300002	神州泰岳	1,548,567.60	2.33
222	002642	荣之联	1,541,511.24	2.32
223	600782	新钢股份	1,537,712.00	2.31
224	300301	长方集团	1,534,935.60	2.31
225	600834	申通地铁	1,534,662.72	2.31
226	300093	金刚玻璃	1,532,383.57	2.31
227	600306	*ST 商城	1,531,705.72	2.30
228	300177	中海达	1,530,913.03	2.30
229	601113	华鼎股份	1,524,733.41	2.29
230	300214	日科化学	1,523,982.11	2.29
231	300418	昆仑万维	1,519,327.67	2.29
232	300487	蓝晓科技	1,511,278.62	2.27
233	300217	东方电热	1,497,828.71	2.25
234	000708	大冶特钢	1,496,859.75	2.25
235	002659	中泰桥梁	1,491,316.00	2.24

236	300305	裕兴股份	1,489,318.25	2.24
237	300241	瑞丰光电	1,485,949.46	2.24
238	002001	新 和 成	1,484,346.21	2.23
239	300173	智慧松德	1,484,315.92	2.23
240	002520	日发精机	1,473,136.13	2.22
241	300328	宜安科技	1,468,274.54	2.21
242	002292	奥飞娱乐	1,467,404.68	2.21
243	002644	佛慈制药	1,463,301.08	2.20
244	300303	聚飞光电	1,460,562.80	2.20
245	300386	飞天诚信	1,452,343.34	2.18
246	000650	仁和药业	1,449,973.70	2.18
247	603885	吉祥航空	1,446,549.96	2.18
248	600858	银座股份	1,445,296.48	2.17
249	002110	三钢闽光	1,434,621.00	2.16
250	002206	海 利 得	1,429,531.53	2.15
251	300379	东方通	1,421,982.31	2.14
252	300419	浩丰科技	1,420,790.26	2.14
253	300404	博济医药	1,420,446.84	2.14
254	000423	东阿阿胶	1,417,499.64	2.13
255	300084	海默科技	1,416,518.43	2.13
256	002071	长城影视	1,414,456.07	2.13
257	300341	麦迪电气	1,411,953.17	2.12
258	601766	中国中车	1,410,000.00	2.12
259	002178	延华智能	1,402,129.84	2.11
260	300350	华鹏飞	1,402,102.25	2.11
261	002016	世荣兆业	1,399,376.93	2.11
262	300074	华平股份	1,390,469.77	2.09
263	300210	森远股份	1,388,494.95	2.09
264	603788	宁波高发	1,381,857.00	2.08
265	000861	海印股份	1,375,898.62	2.07
266	300263	隆华节能	1,375,054.98	2.07
267	000401	冀东水泥	1,373,073.32	2.07
268	300218	安利股份	1,372,940.61	2.07
269	600698	湖南天雁	1,371,897.37	2.06
270	600507	方大特钢	1,367,500.00	2.06
271	002532	新界泵业	1,367,421.36	2.06
272	002609	捷顺科技	1,363,148.04	2.05
273	002432	九安医疗	1,357,566.70	2.04
274	603005	晶方科技	1,351,872.84	2.03
275	300266	兴源环境	1,350,307.15	2.03
276	600720	祁连山	1,348,281.88	2.03
277	300315	掌趣科技	1,345,450.46	2.02
278	300061	康耐特	1,336,082.22	2.01
279	002324	普利特	1,333,694.19	2.01

280	300050	世纪鼎利	1,332,937.74	2.01
281	300378	鼎捷软件	1,331,662.60	2.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,393,723,571.16
卖出股票的收入（成交）总额	1,346,970,000.26

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### 8.10.2 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同，本组合暂不投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 报告期内本基金投资的东杰智能（300486）于 2016 年 12 月 30 日公告称，公司 2015 年 8 月 6 日召开第五届董事会第十二次会议，审议变更“年产 100 台/套工业自动化智能物流装备扩建项目”（下称该项目）募投项目实施地点。事实上公司挪用募集资金 60.83%用于购置位于上海的商业用房产，导致该项目的服务对象和投资重点均发生变更，且公司未及时进行充分信息披露，被山西证监局予以责令改正。

对该证券的投资决策程序的说明：公司在汽车智能物流装备市场处于领先地位，但受汽车行业固定资产投资增速放缓影响，自 2013 年开始智能物流输送系统业务收入下滑，经 3 年调整期后，该业务未来有望保持平稳。另外，凭借在汽车智能物流装备积累的优势，公司正大力开拓智能物流仓储系统及立体停车库市场，智能物流仓储系统已成功进入医药、食品和电商等行业市场，预计该业务受益制造业装备升级及电商发展，将迎来快速成长期。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。

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。

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	146,868.97
2	应收证券清算款	64,330.11
3	应收股利	-
4	应收利息	2,308.97
5	应收申购款	2,960.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	216,468.61
---	----	------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300223	北京君正	968,000.00	1.46	重大资产重组
2	002282	博深工具	575,460.00	0.87	重大事项

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,625	39,477.25	10,968,007.31	17.10%	53,182,527.36	82.90%

#### 9.2 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	111,691.75	0.1741%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和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
-----------------	------

## § 10 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	18,621,417.08
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	280,791,859.76
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	64,150,534.67

注：总申购份额含转换入份额（如有），总赎回份额含转换出份额（如有）。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2、2016年度，因第四届董事会任期届满，经公司临时股东大会审议通过，同意张文伟、刘颂(Patrick LIU)、杨明、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。

3、2016年11月5日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第五届董事会第七次会议审议通过，同意阎小庆先生辞去公司副总裁的职务。

4、2017年2月4日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第五届董事会第十次临时会议审议通过，同意刘颂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，代为履行总经理职务的期限不超过90日。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 60,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 1 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民族证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	963,811,605.75	35.20%	878,324.88	35.93%	-
中泰证券(原齐鲁)	2	766,771,583.50	28.00%	677,178.99	27.70%	-
东兴证券	3	503,134,090.87	18.37%	444,250.07	18.17%	-
中金公司	2	186,031,562.84	6.79%	169,792.87	6.95%	-
东方证券	1	151,393,429.18	5.53%	140,990.80	5.77%	-
华泰证券	1	104,026,042.51	3.80%	96,879.07	3.96%	-
东吴证券	2	33,529,668.62	1.22%	24,520.41	1.00%	-
申万宏源	2	29,774,623.23	1.09%	12,841.62	0.53%	-

注：1、本基金本报告期新增财通证券、国金证券、中信建投、方正证券、东方证券、华泰证券各一个交易单元，新增民族证券、兴业证券、中泰证券(原齐鲁)、中金公司、



东吴证券、申万宏源各两个交易单元，新增东兴证券三个交易单元。

## 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,并报公司总裁办公会议核准。

<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议核准。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
民族证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	-	-	160,000,000.00	30.83%	-	-
东兴证券	-	-	59,000,000.00	11.37%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	300,000,000.00	57.80%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 43 只公募基金。截至 2016 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 443 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 12 月 31 日，海富通为近 80 家企业超过 370 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 12 月 31 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 221 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。2016 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首批基本养老保险基金投资管理人。

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 12 月 31 日，投资咨询及海外业务规模超过 63 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

二〇一七年三月二十八日