

**海富通精选证券投资基金**  
**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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	海富通精选混合
基金主代码	519011
交易代码	519011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 8 月 22 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,435,909,792.50 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行资产配置的投资策略，实施全程风险管理，在保证资产良好流动性的前提下，在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金的投资策略分两个层次：第一层次为适度主动的资产配置，以控制或规避市场系统性风险；第二层次为积极主动的精选证券，以分散或规避个券风险。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。
业绩比较基准	MSCI China A 指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险程度适中的品种。本基金力争通过适度主动的资产配置和积极主动的精选证券，识别和控制风险，实现风险限度内的超额回报。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	陆志俊
	联系电话	021-38650891	95559
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559

传真	021-33830166	021-62701216
----	--------------	--------------

## 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办公场所

## § 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	2015 年	2014 年
本期已实现收益	124,351,033.46	953,604,084.72	-27,310,213.31
本期利润	-30,816,116.68	863,876,806.88	84,928,452.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0081	0.2128	0.0110
本期基金份额净值增长率	-2.89%	26.97%	4.02%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0980	0.2113	0.0196
期末基金资产净值	2,685,181,126.01	2,024,334,194.74	3,078,415,684.09
期末基金份额净值	0.4940	0.6461	0.5168

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)。

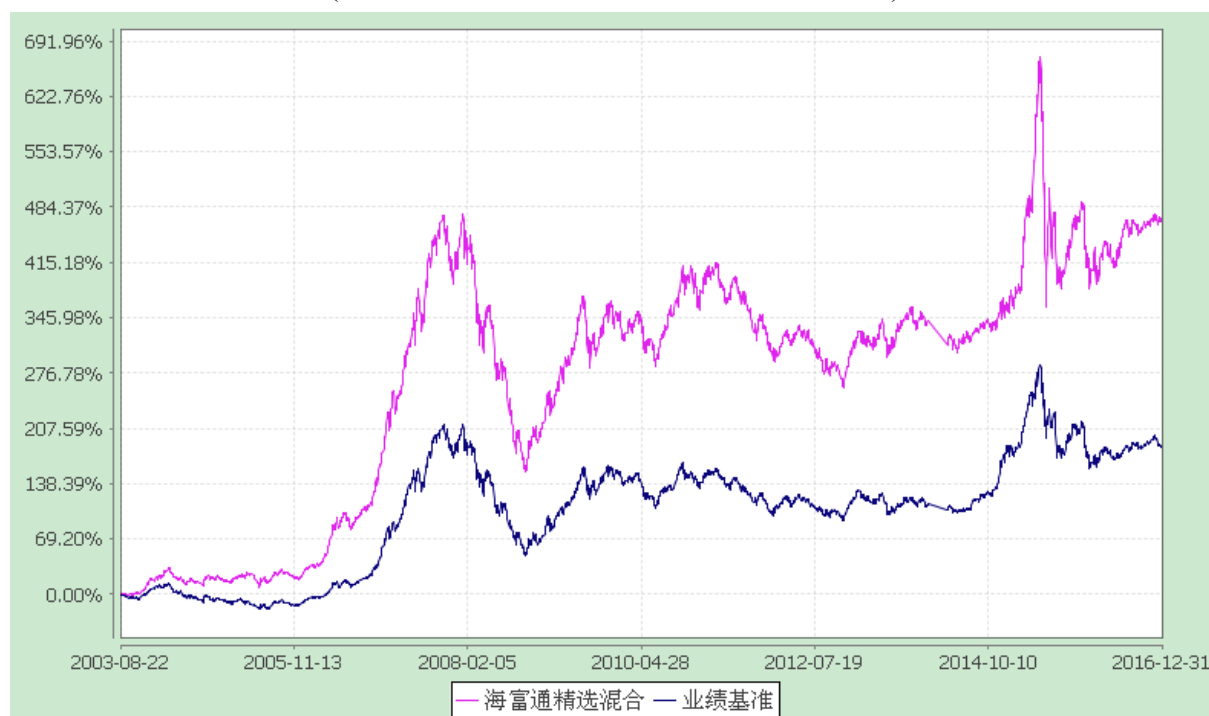
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	1.64%	0.55%	0.48%	0.46%	1.16%	0.09%
过去六个月	3.52%	0.64%	2.81%	0.50%	0.71%	0.14%
过去一年	-2.89%	1.13%	-7.74%	0.98%	4.85%	0.15%
过去三年	28.25%	1.45%	33.71%	1.17%	-5.46%	0.28%
过去五年	40.27%	1.26%	40.31%	1.06%	-0.04%	0.20%
自基金合同生效起至今	467.86%	1.29%	185.11%	1.15%	282.75%	0.14%

#### 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

海富通精选证券投资基金  
 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  
 (2003年8月22日至2016年12月31日)



注：1、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。本基金自2007年6月28日至2007年9月29日,为持续营销后建仓期。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十八条(三)、(六)规定的比例限制及本基金投资组合的比例

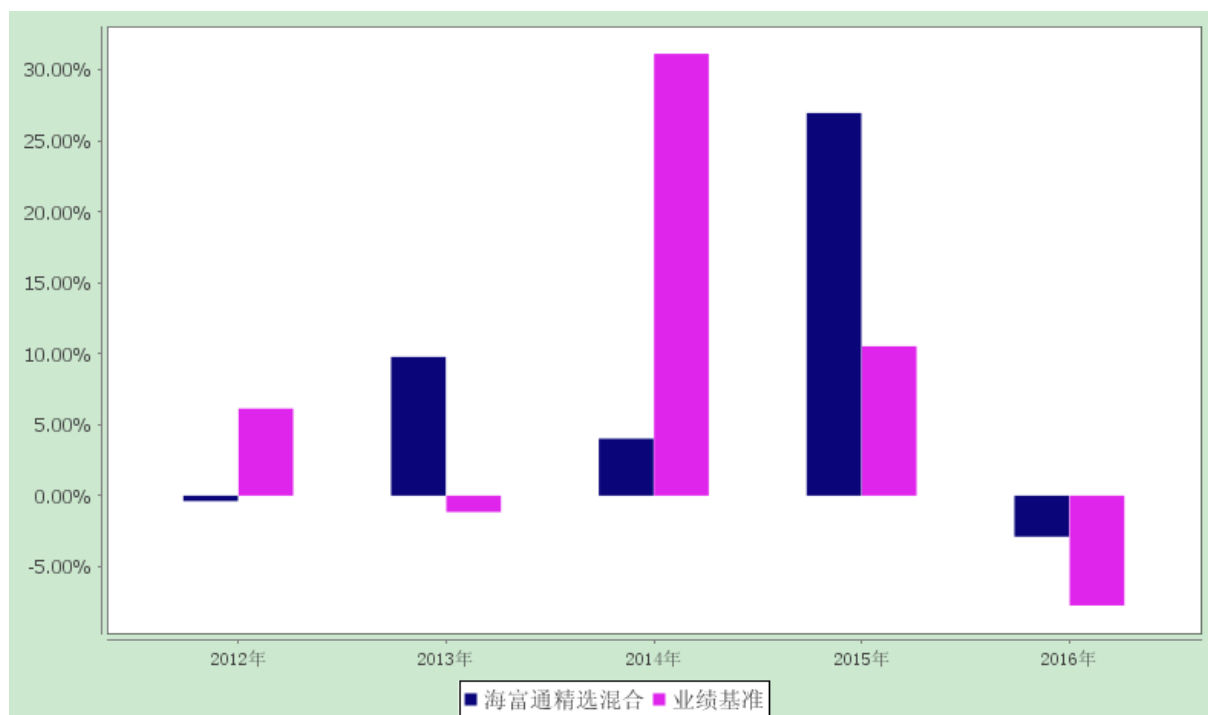
范围。

2、为了能更公允地体现基金投资业绩,海富通基金管理有限公司自 2007 年 1 月 1 日起调整海富通精选基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为 MSCI China A 指数,相应的基准权重不变。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通精选证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016 年	1.330	508,934,477.86	194,566,738.28	703,501,216.14	-
2015 年	0.100	25,677,692.04	22,757,891.42	48,435,583.46	-
2014 年	0.100	44,827,646.96	38,130,195.84	82,957,842.80	-
合计	1.530	579,439,816.86	255,454,825.54	834,894,642.40	-

## § 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		
丁俊	本基金的基金经理；海	2014-01-17	2016-08-12	14 年	硕士。持有基金从业人员资格证

	富通精选贰号混合基金经理；海富通收益增长混合基金经理；研究部总监				<p>书。历任平安资产管理公司权益投资部研究主管，海富通基金管理有限公司基金经理助理、基金经理、研究总监、投资副总监，现任海富通基金管理有限公司研究部总监。</p> <p>2007年8月至2012年1月任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。</p> <p>2014年4月至2015年6月兼任海富通股票混合基金经理。</p> <p>2014年1月至2016年8月兼任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2014年4月至2016年8月兼任海富通收益增长混合基金经理。</p>
王智慧	本基金的基金经理；海富通精选贰号混合基金经理；海富通沪港深混合基金经理；总经理助理	2016-04-11	-	14年	<p>管理学博士。持有基金从业人员资格证书。曾在华宝兴业基金管理有限公司、中国国际金融有限公司、上海申银万国证券研究所、浙江龙盛集团股份有限公司、国元证券有限责任公司从事投资研究及管理工作。</p> <p>2012年1月至2015年11月任</p>



					<p>华宝大盘精选混合基金经理，2012年2月至2015年11月任华宝医药生物混合型基金经理，2013年2月至2015年11月任华宝兴业多策略股票基金经理。2015年11月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2016年4月起兼任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2016年11月起兼任海富通沪港深混合基金经理。</p>
李志	<p>本基金的基金经理助理；海富通收益增长混合基金经理助理；海富通股票混合基金经理助理；海富通强化回报混合基金经理助理；海富通风格优势混合基金经理助理；海富通精选贰号混合基金经理助理；海富通领先成长混合基金经理助理；海富通中小盘混合基金经理助理；</p>	2016-07-14	-	4年	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。历任上海申银万国证券研究所有限公司助理分析师，汇丰晋信基金管理有限公司研究员，2015年12月加入海富通基金管理有限公司，任股票相对收益组合部分析师。现任海富通精选混合、海富通收益增长混合、海富通股票混合、海富通强化回报混合、海富通风格优势混合、海富通精选贰号混合、海富通领先成长混合、海富通中</p>

	海富通国策 导向混合基 金经理助理； 海富通内需 热点混合基 金经理助理； 海富通改革 驱动混合基 金经理助理				小盘混合、海富 通国策导向混合、 海富通内需热点 混合和海富通改 革驱动混合的基 金经理助理。
--	---	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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%。

本基金年初采用较低仓位, 在年初市场大幅度下跌过程中受到的冲击略小于同行平均水平, 一季度积极参与了景气改善的养殖行业和受益价格上涨的大宗商品。二季度适当提高了股票仓位并参与了食品饮料、新能源汽车、智能汽车、家电等行业, 取得了一定的超额收益。三季度是我们坚守了价值龙头和优质成长股, 及时减持了食品

饮料等调整幅度较大的板块，避开了市场调整的结构风险，净值回撤幅度较小。四季度较好地把握了石化产业链、基础化工、汽车等板块的机会，同时回避了创业板等估值较高板块的下跌风险。分季度综合起来看，二季度和四季度通过结构偏离创造了较好的超额收益，一季度和三季度分别通过低仓位和持有低估值价值股较好地控制了净值回撤幅度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为-2.89%，同期基金业绩比较基准收益率为-7.74%，基金净值跑赢业绩比较基准 4.85 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

本基金认为 2017 年风险与机会并存，风格转换的可能性不小。一方面，经历 2016 年房地产高增长之后的中国经济增长压力加大，去杠杆、防风险导致货币政策取向适度中性甚至略微偏紧的可能性不小；另一方面，供给侧结构性改革和“一带一路”政策助推部分中上游行业景气度显著改善。同时，经历 2016 年的调整后，2017 年下半年可能会涌现出一批估值和增速较为匹配的优质成长股，如果届时经济增长出现较大下行压力，从而导致中上游行业景气下行，则市场可能出现投资风格转向成长股。

本基金将围绕行业景气持续改善、国企混合所有制改革、“一带一路”等方向寻找结构性机会，同时密切关注经济走势和市场风格转换，在二季度逐步布局一些优质成长股。

#### 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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成。

本基金报告期内进行过两次利润分配。第一次以截止 2015 年 12 月 31 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2016 年 04 月 15 日完成权益登记，单位分红金额为 0.01 元，合计利润分配金额 31,020,879.11 元。第二次以截止 2016 年 11 月 18 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2016 年 12 月 06 日完成权益登记，单位分红金额为 0.123 元，合计利润分配金额 672,480,337.03 元。两次分红均符合基金合同规定。

#### 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 年度，基金托管人在海富通精选证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

2016 年度，海富通基金管理有限公司在海富通精选证券投资基金投资运作、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，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 2 次收益分配，分配金额为 703,501,216.14 元，符合基金合同的规定。

#### 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

2016 年度，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通精选证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：海富通精选证券投资基金

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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	233,304.25	200,670,332.81
结算备付金	132,481,771.06	190,573.13
存出保证金	1,359,468.60	1,098,493.00
交易性金融资产	2,469,399,252.43	1,849,957,837.65
其中：股票投资	1,910,790,352.43	1,215,891,675.25
基金投资	-	-
债券投资	558,608,900.00	634,066,162.40
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	100,000,000.00	-
应收证券清算款	1,611,886.55	-
应收利息	18,096,663.98	18,635,949.01
应收股利	-	-
应收申购款	29,599.03	109,535.80
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,723,211,945.90	2,070,662,721.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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	26,782,425.68	39,593,717.71
应付赎回款	862,106.83	2,555,087.49
应付管理人报酬	3,538,703.54	2,568,992.93
应付托管费	589,783.93	428,165.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,857,556.34	781,644.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	400,243.57	400,918.94
负债合计	38,030,819.89	46,328,526.66
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,649,537,393.85	950,742,256.62
未分配利润	1,035,643,732.16	1,073,591,938.12
所有者权益合计	2,685,181,126.01	2,024,334,194.74
负债和所有者权益总计	2,723,211,945.90	2,070,662,721.40

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4940 元，基金份额总额 5,435,909,792.50 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通精选证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	28,474,136.85	941,660,915.87



1.利息收入	18,601,404.82	27,903,909.73
其中：存款利息收入	1,644,509.68	1,648,392.83
债券利息收入	16,815,697.13	26,215,401.56
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	141,198.01	40,115.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	164,474,333.38	1,003,355,269.13
其中：股票投资收益	157,042,580.78	996,262,575.44
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,709,838.89	1,082,860.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	10,141,591.49	6,009,833.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-155,167,150.14	-89,727,277.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	565,548.79	129,014.85
<b>减：二、费用</b>	<b>59,290,253.53</b>	<b>77,784,108.99</b>
1. 管理人报酬	33,108,585.13	37,212,986.75
2. 托管费	5,518,097.50	6,202,164.42
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	20,209,908.62	33,902,829.53
5. 利息支出	7,539.50	9,292.38
其中：卖出回购金融资产支出	7,539.50	9,292.38
6. 其他费用	446,122.78	456,835.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-30,816,116.68</b>	<b>863,876,806.88</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-30,816,116.68</b>	<b>863,876,806.88</b>

**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：海富通精选证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 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）	950,742,256.62	1,073,591,938.12	2,024,334,194.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-30,816,116.68	-30,816,116.68
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）	698,795,137.23	696,369,126.86	1,395,164,264.09
其中：1.基金申购款	1,121,672,734.77	1,070,640,600.53	2,192,313,335.30
2.基金赎回款	-422,877,597.54	-374,271,473.67	-797,149,071.21
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）	-	-703,501,216.14	-703,501,216.14
五、期末所有者权益（基金净值）	1,649,537,393.85	1,035,643,732.16	2,685,181,126.01
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,807,748,168.11	1,270,667,515.98	3,078,415,684.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	863,876,806.88	863,876,806.88
三、本期基金份额交易产生的基金净	-857,005,911.49	-1,012,516,801.28	-1,869,522,712.77

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	109,747,046.48	134,043,223.18	243,790,269.66
2.基金赎回款	-966,752,957.97	-1,146,560,024.46	-2,113,312,982.43
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）	-	-48,435,583.46	-48,435,583.46
五、期末所有者权益（基金净值）	950,742,256.62	1,073,591,938.12	2,024,334,194.74

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

海富通精选证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 85 号《关于同意海富通精选证券投资基金设立的批复》核准，由海富通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《海富通精选证券投资基金基金契约》(后更名为《海富通精选证券投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 8 月 22 日募集成立。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 3,698,432,268.39 元，已经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 110 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通精选证券投资基金招募说明书》和《关于对海富通精选基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 7 月 4 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 3.295543296，并于 2007 年 7 月 5 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通精选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，包括国内依法上市股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金

资产净值的 20%。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 50%-80%，债券投资 20%-50%，权证投资 0%-3%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：MSCI China A 指数 X 65%+上证国债指数 X 35%。

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》、《海富通精选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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎投资管理 BE 控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31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
海通证券	6,098,787,736.84	44.86%	8,252,622,110.50	37.53%

## 7.4.8.1.2 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。

## 7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
海通证券	6,326,030.10	22.57%	-	-

## 7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	5,616,599.40	44.90%	3,565,497.27	60.88%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余 额	占期末应付 佣金总额的 比例
海通证券	7,368,216.29	37.56%	183,097.53	23.42%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 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1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	33,108,585.13	37,212,986.75
其中：支付销售机构的客户维护 费	6,233,718.27	8,637,678.87

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,518,097.50	6,202,164.42

注：支付基金托管人交通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

本基金本报告期末及上年度末未通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交

易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
报告期初持有的基金份额	30,195,269.25		30,195,269.25	
报告期间申购/买入总份额	-		-	
报告期间因拆分变动份额	-		-	
减：报告期间赎回/卖出总份额	-		-	
报告期末持有的基金份额	30,195,269.25		30,195,269.25	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.56%		0.96%	

注：1、期间申购/买入总份额含转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人于 2007 年 8 月 13 日运用自有资金申购本基金 3000 万元，申购费为 1000 元。

##### 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。

##### 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	233,304.25	767,857.23	200,670,332.81	1,188,876.01

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。



### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 7.4.9 期末（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
002400	省广股份	2016-09-21	2017-09-22	非公开发行	13.58	13.64	5,344,330	72,576,001.40	72,896,661.20	-
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	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

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。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

### 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	股票	停牌	停牌	期末估值	复牌	复牌开	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	------	----	-----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	单价	日期	盘单价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
000887	中鼎股份	2016-11-18	重大资产重组	25.94	2017-02-15	23.99	3,394,007	80,459,550.48	88,040,541.58	-
000903	云内动力	2016-12-22	重大事项	8.76	2017-03-23	9.64	7,286,588	64,101,390.07	63,830,510.88	-
600735	新华锦	2016-12-19	重大资产重组	20.74	-	-	1,400,000	24,983,319.32	29,036,000.00	-
600797	浙大网新	2016-10-27	重大资产重组	18.00	2017-01-06	17.95	3,168,541	57,487,734.25	57,033,738.00	-

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

本基金本报告期末以及上年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

本基金本报告期末以及上年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 1,599,671,770.61 元，属于第二层次的余额为 869,727,481.82 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 1,006,884,631.59 元，属于第二层次的余额为 843,073,206.06 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(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,910,790,352.43	70.17
	其中：股票	1,910,790,352.43	70.17
2	固定收益投资	558,608,900.00	20.51
	其中：债券	558,608,900.00	20.51
	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	100,000,000.00	3.67
	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	132,715,075.31	4.87

	合计		
7	其他各项资产	21,097,618.16	0.77
8	合计	2,723,211,945.90	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	14,632,347.60	0.54
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,415,302,377.63	52.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,875,121.96	0.89
E	建筑业	46,794,649.27	1.74
F	批发和零售业	67,498,917.90	2.51
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,033,738.00	2.12
J	金融业	212,756,538.87	7.92
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	72,896,661.20	2.71
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,910,790,352.43	71.16

### 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	601233	桐昆股份	7,914,257	113,648,730.52	4.23
2	000887	中鼎股份	3,394,007	88,040,541.58	3.28
3	601997	贵阳银行	5,111,600	80,661,048.00	3.00
4	002400	省广股份	5,344,330	72,896,661.20	2.71
5	002304	洋河股份	932,635	65,844,031.00	2.45
6	600691	阳煤化工	17,059,010	65,506,598.40	2.44
7	000903	云内动力	7,286,588	63,830,510.88	2.38
8	002353	杰瑞股份	3,072,077	62,363,163.10	2.32
9	601600	中国铝业	14,004,390	59,098,525.80	2.20
10	600742	一汽富维	3,566,241	57,523,467.33	2.14

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	600104	上汽集团	192,294,155.66	9.50
2	601186	中国铁建	139,690,570.09	6.90
3	300017	网宿科技	110,497,366.35	5.46
4	601233	桐昆股份	103,980,040.90	5.14
5	601169	北京银行	94,924,952.38	4.69
6	601668	中国建筑	92,311,902.00	4.56
7	002304	洋河股份	90,081,387.46	4.45
8	601818	光大银行	89,617,051.49	4.43
9	600068	葛洲坝	88,586,329.45	4.38
10	601997	贵阳银行	87,236,678.88	4.31
11	600742	一汽富维	86,447,577.90	4.27
12	000887	中鼎股份	80,459,550.48	3.97
13	600155	宝硕股份	75,580,548.99	3.73

14	600797	浙大网新	74,741,220.37	3.69
15	300011	鼎汉技术	72,971,852.52	3.60
16	002400	省广股份	72,576,001.40	3.59
17	600566	济川药业	65,388,069.87	3.23
18	000903	云内动力	64,101,390.07	3.17
19	603008	喜临门	63,792,139.83	3.15
20	000069	华侨城 A	63,406,999.19	3.13
21	600158	中体产业	61,654,455.15	3.05
22	002501	利源精制	60,888,681.29	3.01
23	601333	广深铁路	60,522,907.20	2.99
24	601989	中国重工	60,263,834.30	2.98
25	000800	一汽轿车	59,641,835.82	2.95
26	600166	福田汽车	59,518,018.13	2.94
27	601600	中国铝业	59,304,526.76	2.93
28	600686	金龙汽车	58,270,775.88	2.88
29	002332	仙琚制药	57,923,171.99	2.86
30	600691	阳煤化工	57,922,244.56	2.86
31	002353	杰瑞股份	57,909,324.22	2.86
32	002568	百润股份	57,109,358.20	2.82
33	002760	凤形股份	56,204,350.00	2.78
34	603658	安图生物	56,085,197.28	2.77
35	002589	瑞康医药	55,172,566.89	2.73
36	300322	硕贝德	53,836,015.31	2.66
37	600519	贵州茅台	53,436,794.48	2.64
38	002341	新纶科技	52,760,126.76	2.61
39	002050	三花智控	52,376,265.59	2.59
40	000902	新洋丰	52,115,965.63	2.57
41	300408	三环集团	51,263,833.08	2.53
42	002564	天沃科技	51,103,890.12	2.52
43	300185	通裕重工	48,868,856.00	2.41
44	000333	美的集团	47,935,165.73	2.37
45	600887	伊利股份	47,295,904.31	2.34
46	000402	金融街	47,051,161.37	2.32
47	002690	美亚光电	46,759,577.51	2.31
48	002048	宁波华翔	46,309,721.71	2.29
49	600060	海信电器	46,291,586.08	2.29
50	000625	长安汽车	46,029,923.56	2.27
51	002087	新野纺织	45,366,801.64	2.24
52	002479	富春环保	44,288,488.88	2.19
53	601618	中国中冶	43,798,417.00	2.16
54	002073	软控股份	43,601,876.25	2.15
55	002271	东方雨虹	42,956,827.93	2.12
56	300025	华星创业	41,893,012.51	2.07
57	000661	长春高新	41,621,959.91	2.06

58	002262	恩华药业	41,445,890.85	2.05
59	601689	拓普集团	40,990,543.23	2.02

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600104	上汽集团	212,656,592.18	10.51
2	601186	中国铁建	150,581,746.60	7.44
3	300017	网宿科技	144,262,607.26	7.13
4	600276	恒瑞医药	142,956,178.05	7.06
5	601668	中国建筑	105,164,041.19	5.19
6	601169	北京银行	99,983,767.56	4.94
7	600566	济川药业	89,385,496.04	4.42
8	000002	万 科 A	82,738,517.88	4.09
9	600068	葛洲坝	77,061,237.01	3.81
10	600158	中体产业	76,724,548.03	3.79
11	601166	兴业银行	73,928,856.19	3.65
12	600166	福田汽车	69,728,605.45	3.44
13	601989	中国重工	65,402,877.98	3.23
14	002271	东方雨虹	62,629,356.99	3.09
15	002501	利源精制	62,231,513.41	3.07
16	601333	广深铁路	59,957,219.15	2.96
17	000402	金 融 街	59,829,991.70	2.96
18	600686	金龙汽车	59,271,962.52	2.93
19	000069	华侨城 A	58,851,405.34	2.91
20	002050	三花智控	58,802,448.75	2.90
21	002341	新纶科技	58,660,854.39	2.90
22	300185	通裕重工	58,297,476.26	2.88
23	300136	信维通信	56,490,256.09	2.79
24	300100	双林股份	56,314,545.05	2.78
25	002583	海能达	55,345,802.27	2.73
26	002568	百润股份	54,997,335.81	2.72
27	603008	喜临门	53,912,596.37	2.66
28	000661	长春高新	53,326,546.69	2.63
29	000333	美的集团	51,715,178.11	2.55
30	002087	新野纺织	50,693,741.91	2.50
31	300408	三环集团	50,488,467.36	2.49
32	002760	凤形股份	49,826,952.95	2.46

33	600887	伊利股份	48,266,195.79	2.38
34	002048	宁波华翔	46,670,338.00	2.31
35	300025	华星创业	46,605,808.37	2.30
36	000625	长安汽车	45,839,739.31	2.26
37	600060	海信电器	45,528,500.69	2.25
38	002127	南极电商	44,268,681.35	2.19
39	002479	富春环保	42,652,360.67	2.11
40	600208	新湖中宝	42,469,922.30	2.10
41	002299	圣农发展	42,296,558.46	2.09
42	000848	承德露露	42,167,120.55	2.08
43	600885	宏发股份	41,572,751.81	2.05
44	000959	首钢股份	41,124,664.77	2.03

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	7,179,161,614.66
卖出股票的收入（成交）总额	6,491,009,910.85

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,990,900.00	0.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	551,618,000.00	20.54
	其中：政策性金融债	551,618,000.00	20.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	558,608,900.00	20.80



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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	150207	15 国开 07	1,400,000	141,274,000.00	5.26
2	140201	14 国开 01	1,000,000	100,110,000.00	3.73
3	160401	16 农发 01	1,000,000	100,000,000.00	3.72
4	150201	15 国开 01	700,000	70,322,000.00	2.62
5	160204	16 国开 04	500,000	49,985,000.00	1.86

**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投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 报告期内本基金投资的阳煤化工（600691）于 2016 年 1 月 6 日公告公司下属控股子公司深州化肥碳化车间发生一起管道爆炸事故，被当地政府立案调查。

对该证券的投资决策程序的说明：公司吨尿素市值最低，受益于尿素价格上涨，未来业绩有望大幅增长。乙二醇项目进入试生产阶段，近期港口库存低位，下游需求旺盛，短期仍有上涨空间。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。

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	1,359,468.60
2	应收证券清算款	1,611,886.55
3	应收股利	-
4	应收利息	18,096,663.98
5	应收申购款	29,599.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,097,618.16

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-----------	----------

				(%)	
1	002400	省广股份	72,896,661.20	2.71	非公开发行
2	000887	中鼎股份	88,040,541.58	3.28	重大事项
3	000903	云内动力	63,830,510.88	2.38	重大资产重组

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
120,868	44,973.94	2,245,666,680. 67	41.31%	3,190,243,111.8 3	58.69%

### 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	213,540.36	0.0039%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003 年 8 月 22 日)基金份额总额	3,698,432,268.39
本报告期期初基金份额总额	3,133,050,135.79
本报告期基金总申购份额	3,696,416,111.66
减：本报告期基金总赎回份额	1,393,556,454.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,435,909,792.50

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 100,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 14 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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	6,098,787,736.84	44.86%	5,616,599.40	44.90%	-
长江证券	1	2,802,947,669.98	20.62%	2,610,387.52	20.87%	-
国泰君安	2	1,246,101,465.69	9.17%	1,136,585.79	9.09%	-
招商证券	1	1,208,818,244.30	8.89%	1,101,598.99	8.81%	-
华创证券	1	1,071,649,679.29	7.88%	976,595.92	7.81%	-
国金证券	1	279,967,155.29	2.06%	255,134.21	2.04%	-
中信建投	1	266,712,714.09	1.96%	248,389.58	1.99%	-
国元证券	2	156,729,748.10	1.15%	145,965.45	1.17%	-
兴业证券	2	129,793,717.50	0.95%	120,876.44	0.97%	-
光大证券	1	128,795,652.26	0.95%	117,372.04	0.94%	-
平安证券	1	84,460,672.23	0.62%	78,658.44	0.63%	-
川财证券	1	66,762,083.24	0.49%	48,822.95	0.39%	-
华泰证券	1	54,677,669.59	0.40%	50,921.68	0.41%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内退租德邦证券、中信证券两个券商交易单元。

## 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核准。

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

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	6,326,030.10	22.57%	-	-	-	-
长江证券	19,305,300.00	68.88%	60,600,000.00	23.25%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	100,000,000.00	38.37%	-	-
国元证券	2,396,398.50	8.55%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	100,000,000.00	38.37%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 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，中国证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