

海富通领先成长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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	海富通领先成长混合
基金主代码	519025
交易代码	519025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 30 日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	109,085,336.05 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	从具有领先发展的行业中，精选出具有高度成长性的股票，在控制风险并保持资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金运用已经得到市场检验和认可的国际先进投资理念，通过上市公司基本面的分析和研究，坚持寻找价值“洼地”和长线投资，来获得超额收益。在投资组合构建和管理的过程中，本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的方法，在具有领先发展的行业中，精选出具有高度成长性的股票。
业绩比较基准	MSCI China A 指数×80%+上证国债指数×20%
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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	田青
	联系电话	021-38650891	010-67595096
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	40088-40099	010-67595096
传真	021-33830166	010-66275853

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	http://www.hftfund.com
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	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-12,855,331.55	73,092,958.13	68,813,409.45
本期利润	-19,684,335.81	4,424,373.69	130,573,539.24
加权平均基金份额本期利润	-0.1728	0.0272	0.3054
本期基金份额净值增长率	-12.55%	5.73%	33.96%
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	0.1781	0.3191	0.0838
期末基金资产净值	128,514,230.05	158,154,866.33	490,851,484.08
期末基金份额净值	1.178	1.347	1.274

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	-2.00%	0.52%	0.55%	0.56%	-2.55%	-0.04%
过去六个月	-1.51%	0.66%	3.11%	0.62%	-4.62%	0.04%
过去一年	-12.55%	1.58%	-10.66%	1.21%	-1.89%	0.37%
过去三年	23.87%	2.01%	36.40%	1.44%	-12.53%	0.57%
过去五年	30.74%	1.75%	41.77%	1.30%	-11.03%	0.45%
自基金合同生效起至今	33.98%	1.66%	36.31%	1.29%	-2.33%	0.37%

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

海富通领先成长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
 (2009年4月30日至2016年12月31日)

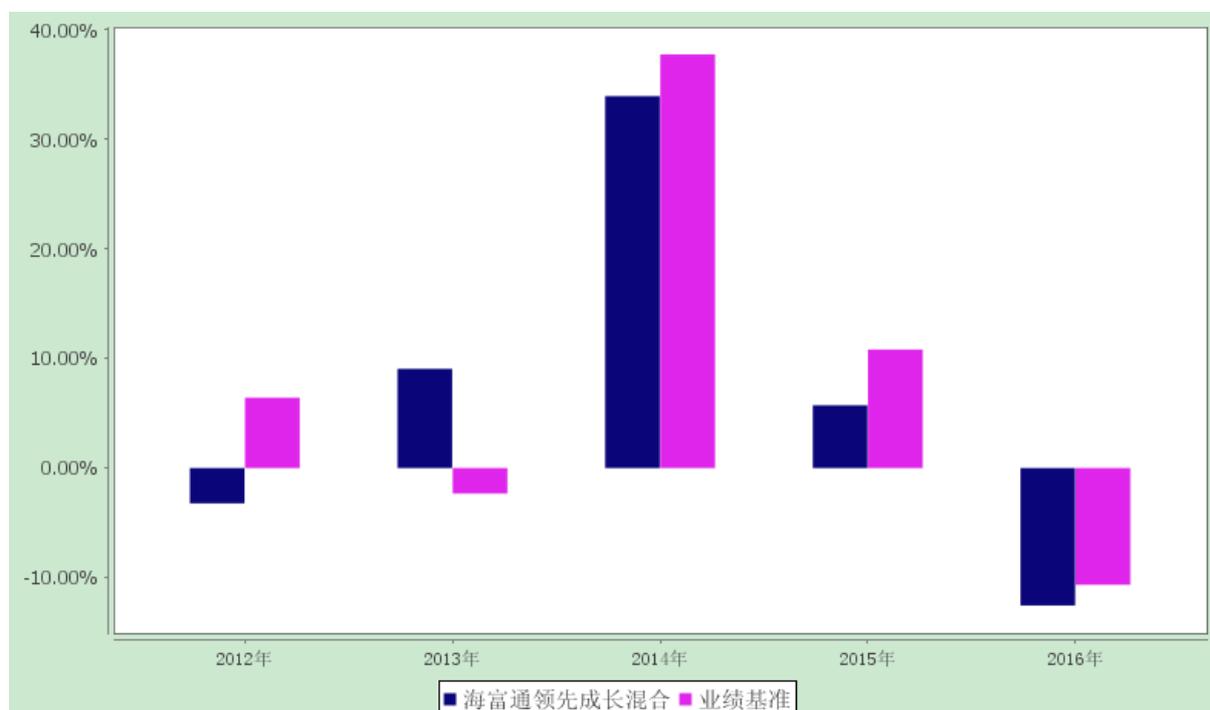


注：按照基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，即 2009 年 4 月 30 日至 2009 年 10 月 29 日。建仓期结束时本基金投资组合均达到本基金合同第十二条

(二)、(七)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

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

海富通领先成长混合型证券投资基金
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	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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		
黄峰	本基金的基金经理；海富通内需热点混合基金经理；海富通股票混合	2014-12-17	-	6 年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任大公国际资信评估公司信用分析部分析师，深圳九富投

	基金经理： 海富通中小 盘混合基金 经理				资顾问有限公司 项目部员工，大 连獐子岛渔业集 团股份有限公司 证券部负责人、 证券事务代表， 华创证券有限责 任公司研究所高 级研究员， 2011 年 5 月加 入海富通基金管 理有限公司，历 任股票分析师、 基金经理助理。 2014 年 12 月起 担任海富通股票 混合、海富通中 小盘混合、海富 通内需热点混合 和海富通领先成 长混合的基金经 理。
张金涛	本基金的基 金经理	2015-10-26	-	6 年	硕士。持有基金 从业人员资格证 书。2010 年 7 月至 2011 年 6 月任华泰联合 证券有限责任公 司研究员， 2011 年 6 月至 2013 年 8 月任 农银汇理基金管 理有限公司研究 员，2013 年 8 月加入海富通 基金管理有限公 司，担任股票分 析师。2015 年 10 月起任海富 通领先成长混合 的基金经理。
李志	本基金的基 金经理助理； 海富通精选 混合基金经	2016-07-14	-	4 年	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

	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；海富通中小盘混合基金经理助理；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			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%。

回顾本基金 2016 年度的操作，年初采取了低仓位、偏向钢铁、煤炭等行业的配置策略，二季度，本基金积极调整持仓结构，适时配置了新能源车相关行业，三季度基于宏观判断，配置上倾向以创业板为主；四季度，基于经济复苏的逻辑，本基金积极调整行业配置，配置方向逐渐向石油化工、基础化工等周期类资产倾斜。

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-12.55%，同期业绩比较基准收益率为-10.66%，基金净值跑输业绩比较基准 1.89 个百分点。净值跑输业绩基准的主要原因是三季度对宏观经济解读偏差，组合配置偏重的创业板跌幅较大所致。

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 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。

2017 年在不确定中寻找确定性，本基金将继续沿着经济复苏和货币政策变动方向寻找投资机会，力求为份额持有人获得较好的投资回报。

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,基金收益可进行分配;本基金收益每年最多分配 6 次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。

本基金报告期内未进行过利润分配,但符合基金合同规定。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：海富通领先成长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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	43,643,337.31	34,150,797.18
结算备付金	1,242,726.17	1,683,023.63
存出保证金	102,919.02	360,415.20
交易性金融资产	87,228,129.03	117,814,832.78
其中：股票投资	87,228,129.03	117,814,832.78
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	-	6,128,704.53
应收利息	10,061.33	9,064.65
应收股利	-	-
应收申购款	6,816.60	16,212.43
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	132,233,989.46	160,163,050.40
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,513,595.55	83,517.75
应付赎回款	68,929.30	516,051.80

应付管理人报酬	165,928.15	201,837.87
应付托管费	27,654.69	33,639.65
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	573,565.16	802,196.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	370,086.56	370,940.90
负债合计	3,719,759.41	2,008,184.07
所有者权益：		
实收基金	109,085,336.05	117,408,870.10
未分配利润	19,428,894.00	40,745,996.23
所有者权益合计	128,514,230.05	158,154,866.33
负债和所有者权益总计	132,233,989.46	160,163,050.40

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.178 元，基金份额总额 109,085,336.05 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通领先成长混合型证券投资基金

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	-12,458,245.90	17,161,730.27
1.利息收入	261,488.15	313,913.89
其中：存款利息收入	261,488.15	313,913.89
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）	-5,901,675.95	84,634,644.12
其中：股票投资收益	-6,310,554.65	83,708,280.73
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	-	-
股利收益	408,878.70	926,363.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-6,829,004.26	-68,668,584.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	10,946.16	881,756.70
减：二、费用	7,226,089.91	12,737,356.58
1. 管理人报酬	1,997,978.25	3,658,773.71
2. 托管费	332,996.45	609,795.62
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,498,972.67	8,065,552.42
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	396,142.54	403,234.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-19,684,335.81	4,424,373.69
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-19,684,335.81	4,424,373.69

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通领先成长混合型证券投资基金

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）	117,408,870.10	40,745,996.23	158,154,866.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-19,684,335.81	-19,684,335.81
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）	-8,323,534.05	-1,632,766.42	-9,956,300.47
其中：1.基金申购款	5,609,870.24	847,733.64	6,457,603.88
2.基金赎回款	-13,933,404.29	-2,480,500.06	-16,413,904.35
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）	109,085,336.05	19,428,894.00	128,514,230.05
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）	385,256,973.40	105,594,510.68	490,851,484.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,424,373.69	4,424,373.69
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）	-267,848,103.30	-69,272,888.14	-337,120,991.44
其中：1.基金申购款	340,340,798.26	307,331,147.39	647,671,945.65
2.基金赎回款	-608,188,901.56	-376,604,035.53	-984,792,937.09

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）	117,408,870.10	40,745,996.23	158,154,866.33

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

海富通领先成长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[2008]第 1296 号《关于核准海富通领先成长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通领先成长股票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 2,664,517,207.18 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(2009)第 081 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通领先成长股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 4 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,665,319,248.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 802,040.92 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，海富通领先成长股票型证券投资基金于 2015 年 08 月 07 日公告后更名为海富通领先成长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通领先成长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，包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合中股票资产占基金资产的 65%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，现金、债券、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%-35%，其中，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%。

本基金的业绩比较基准为：MSCIChinaA 指数×80%+上证国债指数×20%。

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》、《海富通领先成长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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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	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	
	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	413,941,176.93	13.76%	781,790,680.43	14.74%

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 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	377,224.90	13.88%	40,652.54	7.09%
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	700,128.65	14.94%	93,314.72	11.63%

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	1,997,978.25	3,658,773.71
其中：支付销售机构的客户维护费	537,360.12	928,156.05

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	332,996.45	609,795.62

注：支付基金托管人中国建设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

本基金本报告期及上年度可比期间未与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固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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
中国建设银行	43,643,337.31	237,977.61	34,150,797.18	271,470.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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
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	1,006	9,355.80	9,355.80	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	10.44	10.44	1,103	11,515.32	11,515.32	-

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
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大资产重组	21.77	2017-01-06	19.60	58,600	1,345,348.00	1,275,722.00	-
002635	安洁科技	2016-11-08	重大资产重组	33.74	2017-02-08	33.50	36,900	1,333,696.00	1,245,006.00	-
300223	北京君正	2016-12-19	重大事项	48.40	-	-	20,100	641,478.00	972,840.00	-
600406	国电南瑞	2016-12-29	重大资产重组	16.63	-	-	80,700	1,298,251.00	1,342,041.00	-

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 82,349,346.25 元，属于第二层次的余额为 4,878,782.78 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 93,860,647.76 元，第二层次 23,954,185.02 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	87,228,129.03	65.96
	其中：股票	87,228,129.03	65.96
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	44,886,063.48	33.94
7	其他各项资产	119,796.95	0.09
8	合计	132,233,989.46	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	2,616,014.00	2.04

B	采矿业	-	-
C	制造业	53,110,284.61	41.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,274,340.00	0.99
E	建筑业	7,163,941.13	5.57
F	批发和零售业	1,226,668.00	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	3,714,671.00	2.89
H	住宿和餐饮业	1,282,446.00	1.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,342,041.00	1.04
J	金融业	9,024,079.07	7.02
K	房地产业	2,557,674.00	1.99
L	租赁和商务服务业	-	-
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	3,915,970.22	3.05
S	综合	-	-
	合计	87,228,129.03	67.87

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	000018	神州长城	427,567	4,574,966.90	3.56
2	002200	云投生态	111,700	2,616,014.00	2.04
3	600016	民生银行	284,300	2,581,444.00	2.01
4	600565	迪马股份	344,700	2,557,674.00	1.99
5	600742	一汽富维	158,000	2,548,540.00	1.98

6	601333	广深铁路	494,500	2,507,115.00	1.95
7	601928	凤凰传媒	238,245	2,494,425.15	1.94
8	002570	贝因美	166,000	2,177,920.00	1.69
9	000639	西王食品	88,655	2,151,656.85	1.67
10	002262	恩华药业	101,000	2,110,900.00	1.64

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 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	300033	同花顺	16,187,869.50	10.24
2	000709	河钢股份	13,797,892.00	8.72
3	600188	兖州煤业	12,627,209.80	7.98
4	002758	华通医药	12,132,479.60	7.67
5	300271	华宇软件	11,789,834.33	7.45
6	600019	宝钢股份	11,693,268.74	7.39
7	600782	新钢股份	11,486,139.60	7.26
8	002102	冠福股份	10,803,443.21	6.83
9	000858	五粮液	10,476,609.48	6.62
10	002323	雅百特	10,287,646.00	6.50
11	002589	瑞康医药	9,751,558.86	6.17
12	600519	贵州茅台	9,177,562.37	5.80
13	600688	上海石化	9,173,898.00	5.80
14	000937	冀中能源	9,106,685.59	5.76
15	002245	澳洋顺昌	8,619,998.00	5.45
16	600028	中国石化	8,568,579.00	5.42
17	300083	劲胜精密	8,514,383.60	5.38
18	002247	帝龙文化	8,466,860.00	5.35
19	000932	华菱钢铁	8,339,990.98	5.27
20	000018	神州长城	8,334,180.00	5.27
21	002670	国盛金控	8,178,873.41	5.17
22	300017	网宿科技	8,173,303.22	5.17
23	000983	西山煤电	7,978,786.00	5.04
24	002456	欧菲光	7,962,103.10	5.03
25	600395	盘江股份	7,919,942.81	5.01
26	600155	宝硕股份	7,905,304.51	5.00
27	300148	天舟文化	7,889,347.60	4.99

28	002452	长高集团	7,780,417.20	4.92
29	600054	黄山旅游	7,527,246.73	4.76
30	000581	威孚高科	7,523,444.79	4.76
31	300014	亿纬锂能	7,401,707.00	4.68
32	600801	华新水泥	7,333,449.96	4.64
33	600362	江西铜业	7,272,389.18	4.60
34	300207	欣旺达	7,243,266.89	4.58
35	002094	青岛金王	7,022,889.50	4.44
36	601336	新华保险	6,820,350.00	4.31
37	002271	东方雨虹	6,775,551.21	4.28
38	002224	三力士	6,679,728.92	4.22
39	600109	国金证券	6,589,333.10	4.17
40	300498	温氏股份	6,422,156.41	4.06
41	000059	华锦股份	6,341,582.00	4.01
42	000915	山大华特	6,249,654.70	3.95
43	300011	鼎汉技术	6,156,900.13	3.89
44	002643	万润股份	6,096,629.74	3.85
45	000060	中金岭南	6,033,677.00	3.82
46	600598	北大荒	5,967,404.37	3.77
47	600570	恒生电子	5,932,504.71	3.75
48	600585	海螺水泥	5,605,988.10	3.54
49	600559	老白干酒	5,514,056.84	3.49
50	300497	富祥股份	5,415,176.00	3.42
51	600068	葛洲坝	5,406,711.00	3.42
52	601668	中国建筑	5,397,707.00	3.41
53	600808	马钢股份	5,377,637.00	3.40
54	601186	中国铁建	5,335,290.00	3.37
55	600418	江淮汽车	5,333,044.13	3.37
56	600887	伊利股份	5,322,971.00	3.37
57	601028	玉龙股份	5,316,657.70	3.36
58	601886	江河集团	5,276,134.00	3.34
59	600276	恒瑞医药	5,269,148.56	3.33
60	600201	生物股份	5,211,990.50	3.30
61	002780	三夫户外	5,190,451.43	3.28
62	300269	联建光电	5,156,017.11	3.26
63	601818	光大银行	5,091,620.00	3.22
64	002510	天汽模	5,070,387.00	3.21
65	300342	天银机电	5,056,012.00	3.20
66	000498	山东路桥	4,991,913.24	3.16
67	002026	山东威达	4,878,093.57	3.08
68	300031	宝通科技	4,790,902.76	3.03
69	300115	长盈精密	4,731,606.27	2.99
70	601800	中国交建	4,688,065.91	2.96
71	300310	宜通世纪	4,590,322.00	2.90

72	600622	嘉宝集团	4,502,215.22	2.85
73	601611	中国核建	4,301,034.00	2.72
74	000898	鞍钢股份	4,217,054.00	2.67
75	300159	新研股份	4,127,329.00	2.61
76	000957	中通客车	4,122,655.10	2.61
77	600079	人福医药	4,107,425.05	2.60
78	002092	中泰化学	4,105,571.17	2.60
79	002267	陕天然气	4,098,540.21	2.59
80	002042	华孚色纺	4,095,874.00	2.59
81	600617	国新能源	4,079,138.06	2.58
82	000910	大亚圣象	4,071,918.30	2.57
83	002138	顺络电子	4,061,199.14	2.57
84	600477	杭萧钢构	4,058,703.60	2.57
85	002475	立讯精密	4,051,112.57	2.56
86	300296	利亚德	4,049,435.82	2.56
87	600826	兰生股份	4,041,206.00	2.56
88	000639	西王食品	4,024,161.00	2.54
89	600976	健民集团	4,015,542.00	2.54
90	600050	中国联通	4,015,380.42	2.54
91	002234	民和股份	4,000,511.00	2.53
92	002662	京威股份	3,978,003.60	2.52
93	002554	惠博普	3,972,566.00	2.51
94	300232	洲明科技	3,970,837.08	2.51
95	600219	南山铝业	3,968,057.00	2.51
96	002673	西部证券	3,952,660.04	2.50
97	601021	春秋航空	3,952,481.20	2.50
98	300494	盛天网络	3,924,991.00	2.48
99	300136	信维通信	3,922,492.55	2.48
100	600562	国睿科技	3,911,239.77	2.47
101	601689	拓普集团	3,910,637.42	2.47
102	002500	山西证券	3,896,949.00	2.46
103	002600	江粉磁材	3,892,596.00	2.46
104	600565	迪马股份	3,890,215.00	2.46
105	600141	兴发集团	3,890,173.00	2.46
106	000078	海王生物	3,879,346.00	2.45
107	000028	国药一致	3,873,654.08	2.45
108	000655	金岭矿业	3,873,351.00	2.45
109	002123	梦网荣信	3,871,365.00	2.45
110	002466	天齐锂业	3,855,732.00	2.44
111	001979	招商蛇口	3,845,930.50	2.43
112	601012	隆基股份	3,835,092.00	2.42
113	600869	智慧能源	3,814,707.95	2.41
114	600547	山东黄金	3,808,576.40	2.41
115	002368	太极股份	3,807,697.00	2.41

116	601225	陕西煤业	3,797,480.26	2.40
117	300294	博雅生物	3,786,411.00	2.39
118	300160	秀强股份	3,739,430.00	2.36
119	600343	航天动力	3,715,923.24	2.35
120	600548	深高速	3,700,665.03	2.34
121	600325	华发股份	3,642,607.31	2.30
122	000703	恒逸石化	3,621,534.48	2.29
123	600048	保利地产	3,574,917.22	2.26
124	600855	航天长峰	3,557,855.12	2.25
125	600029	南方航空	3,465,636.00	2.19
126	300408	三环集团	3,453,331.48	2.18
127	601929	吉视传媒	3,447,361.00	2.18
128	300203	聚光科技	3,437,170.36	2.17
129	601998	中信银行	3,426,557.00	2.17
130	600820	隧道股份	3,418,650.00	2.16
131	002501	利源精制	3,410,271.00	2.16
132	300436	广生堂	3,385,714.50	2.14
133	002583	海能达	3,380,252.78	2.14
134	000688	建新矿业	3,377,344.00	2.14
135	600432	*ST 吉恩	3,348,117.00	2.12
136	002367	康力电梯	3,346,435.48	2.12
137	300367	东方网力	3,239,022.00	2.05
138	300037	新宙邦	3,224,214.00	2.04
139	300381	溢多利	3,183,075.00	2.01
140	600136	当代明诚	3,167,024.34	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	300033	同花顺	15,715,301.34	9.94
2	000709	河钢股份	12,949,541.38	8.19
3	600188	兖州煤业	12,927,799.06	8.17
4	002323	雅百特	12,509,333.20	7.91
5	002758	华通医药	12,154,198.10	7.68
6	300271	华宇软件	12,006,662.31	7.59
7	600782	新钢股份	11,948,532.83	7.55
8	300083	劲胜精密	11,540,745.50	7.30
9	600019	宝钢股份	11,355,874.77	7.18

10	002102	冠福股份	10,814,141.28	6.84
11	002245	澳洋顺昌	9,912,097.77	6.27
12	300342	天银机电	9,684,731.35	6.12
13	000858	五 粮 液	9,571,287.67	6.05
14	002589	瑞康医药	9,502,207.90	6.01
15	002026	山东威达	9,440,531.15	5.97
16	600688	上海石化	9,196,643.02	5.81
17	600519	贵州茅台	9,150,304.71	5.79
18	002456	欧菲光	8,891,541.97	5.62
19	000937	冀中能源	8,804,783.70	5.57
20	000932	华菱钢铁	8,508,392.70	5.38
21	002247	帝龙文化	8,474,668.61	5.36
22	600028	中国石化	8,388,720.38	5.30
23	300017	网宿科技	8,253,045.42	5.22
24	000983	西山煤电	8,010,810.00	5.07
25	600395	盘江股份	7,991,402.66	5.05
26	600801	华新水泥	7,900,852.44	5.00
27	002094	青岛金王	7,853,937.49	4.97
28	002670	国盛金控	7,716,002.97	4.88
29	002452	长高集团	7,652,462.22	4.84
30	300148	天舟文化	7,618,569.79	4.82
31	600054	黄山旅游	7,429,102.87	4.70
32	300014	亿纬锂能	7,371,149.05	4.66
33	000581	威孚高科	7,357,003.42	4.65
34	600990	四创电子	7,249,770.32	4.58
35	600362	江西铜业	7,153,293.56	4.52
36	300031	宝通科技	7,070,884.96	4.47
37	000059	华锦股份	7,044,579.98	4.45
38	600155	宝硕股份	6,998,488.98	4.43
39	002271	东方雨虹	6,877,876.41	4.35
40	002224	三 力 士	6,709,664.16	4.24
41	300159	新研股份	6,639,496.41	4.20
42	600547	山东黄金	6,594,418.65	4.17
43	601336	新华保险	6,572,809.04	4.16
44	002368	太极股份	6,455,283.58	4.08
45	600562	国睿科技	6,438,773.14	4.07
46	002544	杰赛科技	6,382,624.92	4.04
47	300498	温氏股份	6,358,950.30	4.02
48	000915	山大华特	6,195,026.07	3.92
49	300497	富祥股份	6,186,930.09	3.91
50	600598	北大荒	6,020,015.24	3.81
51	600570	恒生电子	5,946,285.17	3.76
52	600585	海螺水泥	5,878,044.05	3.72
53	000060	中金岭南	5,815,622.23	3.68

54	002643	万润股份	5,793,303.04	3.66
55	300011	鼎汉技术	5,788,834.72	3.66
56	300207	欣旺达	5,735,543.21	3.63
57	002425	凯撒文化	5,726,894.34	3.62
58	600559	老白干酒	5,427,119.06	3.43
59	300025	华星创业	5,308,506.00	3.36
60	600276	恒瑞医药	5,287,150.42	3.34
61	002780	三夫户外	5,274,964.50	3.34
62	600109	国金证券	5,273,824.47	3.33
63	600201	生物股份	5,250,278.10	3.32
64	601668	中国建筑	5,233,722.00	3.31
65	600068	葛洲坝	5,197,894.09	3.29
66	600887	伊利股份	5,188,084.00	3.28
67	601028	玉龙股份	5,183,530.69	3.28
68	600418	江淮汽车	5,131,979.85	3.24
69	300310	宜通世纪	5,126,872.75	3.24
70	002510	天汽模	5,024,820.76	3.18
71	000498	山东路桥	5,019,633.32	3.17
72	601800	中国交建	4,922,303.91	3.11
73	300269	联建光电	4,845,017.67	3.06
74	300115	长盈精密	4,728,222.14	2.99
75	000957	中通客车	4,721,119.43	2.99
76	601886	江河集团	4,634,317.37	2.93
77	600622	嘉宝集团	4,502,354.00	2.85
78	601611	中国核建	4,494,515.03	2.84
79	600808	马钢股份	4,465,738.78	2.82
80	300136	信维通信	4,443,591.76	2.81
81	603368	柳州医药	4,351,538.21	2.75
82	601186	中国铁建	4,348,001.00	2.75
83	300299	富春通信	4,280,620.45	2.71
84	300401	花园生物	4,251,820.87	2.69
85	600869	智慧能源	4,225,113.53	2.67
86	300296	利亚德	4,187,180.24	2.65
87	300160	秀强股份	4,184,388.80	2.65
88	600976	健民集团	4,150,370.84	2.62
89	600343	航天动力	4,096,792.31	2.59
90	000028	国药一致	4,080,034.74	2.58
91	000898	鞍钢股份	4,070,160.00	2.57
92	601012	隆基股份	4,063,945.00	2.57
93	601225	陕西煤业	4,047,706.47	2.56
94	300294	博雅生物	4,031,014.73	2.55
95	002042	华孚色纺	4,027,441.00	2.55
96	002234	民和股份	4,014,956.22	2.54
97	002138	顺络电子	3,995,023.92	2.53

98	002707	众信旅游	3,981,085.20	2.52
99	002092	中泰化学	3,974,730.43	2.51
100	600477	杭萧钢构	3,974,043.30	2.51
101	600050	中国联通	3,952,379.80	2.50
102	002123	梦网荣信	3,939,657.71	2.49
103	002673	西部证券	3,927,739.90	2.48
104	002554	惠博普	3,927,582.97	2.48
105	002475	立讯精密	3,922,620.12	2.48
106	000655	金岭矿业	3,884,692.13	2.46
107	600079	人福医药	3,884,641.63	2.46
108	002466	天齐锂业	3,876,869.00	2.45
109	000018	神州长城	3,863,796.95	2.44
110	000078	海王生物	3,852,874.84	2.44
111	002267	陕天然气	3,850,432.64	2.43
112	600048	保利地产	3,834,894.10	2.42
113	601818	光大银行	3,830,625.57	2.42
114	002600	江粉磁材	3,825,501.02	2.42
115	300203	聚光科技	3,825,296.60	2.42
116	600219	南山铝业	3,821,987.95	2.42
117	002500	山西证券	3,819,360.00	2.41
118	600617	国新能源	3,777,365.00	2.39
119	600325	华发股份	3,745,953.61	2.37
120	600136	当代明诚	3,731,280.67	2.36
121	002662	京威股份	3,720,923.62	2.35
122	600548	深高速	3,602,508.10	2.28
123	000703	恒逸石化	3,592,937.08	2.27
124	002367	康力电梯	3,591,960.50	2.27
125	600487	亨通光电	3,591,526.60	2.27
126	300494	盛天网络	3,587,548.56	2.27
127	601998	中信银行	3,586,865.58	2.27
128	300381	溢多利	3,582,337.16	2.27
129	601021	春秋航空	3,551,002.12	2.25
130	000402	金融街	3,544,655.23	2.24
131	001979	招商蛇口	3,528,428.46	2.23
132	600432	*ST 吉恩	3,507,579.49	2.22
133	300367	东方网力	3,461,883.00	2.19
134	300037	新宙邦	3,451,194.71	2.18
135	600029	南方航空	3,375,050.80	2.13
136	300408	三环集团	3,371,660.95	2.13
137	002501	利源精制	3,322,332.66	2.10
138	600141	兴发集团	3,316,377.09	2.10
139	300436	广生堂	3,256,800.76	2.06
140	300232	洲明科技	3,250,865.47	2.06
141	000911	南宁糖业	3,203,298.06	2.03

142	600855	航天长峰	3,198,170.42	2.02
-----	--------	------	--------------	------

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	1,496,120,056.49
卖出股票的收入（成交）总额	1,513,567,201.33

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。

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。

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	102,919.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,061.33
5	应收申购款	6,816.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,796.95

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
7,928	13,759.50	1,990,609.75	1.82%	107,094,726.30	98.18%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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(2009年4月30日)基金份额总额	2,665,319,248.10
本报告期期初基金份额总额	117,408,870.10
本报告期基金总申购份额	5,609,870.24
减：本报告期基金总赎回份额	13,933,404.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	109,085,336.05

注：总申购份额含转换入份额，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 70,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的年限是 8 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	佣金	占当期佣金总	

			交总额 的比例		量的比 例	
广发证券	1	591,218,615.00	19.65%	550,601.06	20.25%	-
华泰证券	1	421,968,290.53	14.03%	384,540.02	14.15%	-
海通证券	2	413,941,176.93	13.76%	377,224.90	13.88%	-
招商证券	1	370,597,316.39	12.32%	337,725.75	12.42%	-
银河证券	1	234,252,048.23	7.79%	166,623.72	6.13%	-
财富证券	1	201,232,931.34	6.69%	187,408.53	6.89%	-
东北证券	1	197,045,710.14	6.55%	179,568.12	6.61%	-
民生证券	1	161,478,775.74	5.37%	150,385.11	5.53%	-
国泰君安	1	109,697,714.43	3.65%	102,160.07	3.76%	-
德邦证券	1	88,776,247.79	2.95%	80,902.24	2.98%	-
中银国际	2	81,775,297.09	2.72%	74,521.74	2.74%	-
中泰证券 (原齐鲁)	1	55,086,886.72	1.83%	51,302.67	1.89%	-
中投证券	1	31,564,861.24	1.05%	29,396.38	1.08%	-
安信证券	2	28,532,474.44	0.95%	26,569.50	0.98%	-
瑞银证券	1	21,058,221.60	0.70%	19,611.40	0.72%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期退租东兴证券、招商证券各一个交易单元，退租中信证券两个交易单元。

(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
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券 (原齐鲁)	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-

§ 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