海富通养老收益混合型证券投资基金
2016 年年度报告
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 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 12
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 16
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 17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 22
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 22
§5 托管人报告 22
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 22
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 22
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 22
§6 审计报告 23
§7 年度财务报表 24
7.1 资产负债表 24
7.2 利润表 25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 27
7.4 报表附注 28
§8 投资组合报告 52
8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
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 59
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 60
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 60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 60

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 60
8.12 投资组合报告附注 61
§9 基金份额持有人信息 61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62
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 62
§10 开放式基金份额变动 62
§11 重大事件揭示 63
11.1 基金份额持有人大会决议 63
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 63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 63
11.4 基金投资策略的改变 63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 63
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 64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 64
11.8 其他重大事件 65
§12 影响投资者决策的其他重要信息 70
§13 备查文件目录 71
13.1 备查文件目录 71
13.2 存放地点 71
13.3 查阅方式 71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通养老收益混合型证券投资基金	
基金简称	海富通养老收益混合	
基金主代码	519050	
交易代码	519050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 29 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	336,171,006.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C
下属分级基金的交易代码	519050	002339
报告期末下属分级基金的份额总额	320,079,795.77 份	16,091,211.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。
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，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。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。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+2%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66 号东亚银行金融大厦36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张文伟	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、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	
	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C
本期已实现收益	12,598,395.99	-61,789.36	206,533,458.04	-	5,731,830.29	-
本期利润	9,456,443.08	-80,664.12	209,712,951.45	-	8,188,324.47	-
加权平均基金份额本期利润	0.0148	-0.0753	0.0903	-	0.0483	-
本期加权平均净值利润率	1.09%	-5.76%	6.83%	-	4.90%	-
本期基金份额净值增长率	2.39%	3.82%	11.20%	-	21.28%	-
3.1.2 期末数据和指标	**2016 年末**		**2015 年末**		**2014 年末**	
	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C
期末可供分配利润	72,607,982.11	3,786,689.05	661,614,502.62	-	5,758,977.76	-
期末可供分配基金份额利润	0.2268	0.2353	0.3458	-	0.2139	-
期末基金资产净值	393,461,671.56	19,918,431.35	2,583,968,940.86	-	32,677,531.98	-
期末基金份额净值	1.229	1.238	1.350	-	1.214	-
3.1.3 累计期末	**2016 年末**		**2015 年末**		**2014 年末**	

指标	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C
基金份额累计净值增长率	38.22%	3.82%	35.00%	-	21.40%	-

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、本基金自 2016 年 1 月 8 日起，根据收费模式的不同，将基金分为海富通养老收益混合 A 和海富通养老收益混合 C 两类份额。

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

1．海富通养老收益混合 A：

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	0.38%	0.12%	1.18%	0.02%	-0.80%	0.10%
过去六个月	0.97%	0.13%	2.37%	0.01%	-1.40%	0.12%
过去一年	2.39%	0.11%	4.76%	0.01%	-2.37%	0.10%
过去三年	38.09%	0.52%	17.25%	0.02%	20.84%	0.50%
自基金合同生效起至今	38.22%	0.51%	21.56%	0.02%	16.66%	0.49%

2．海富通养老收益混合 C：

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	①－③	②－④

				④		
过去三个月	0.53%	0.11%	1.18%	0.02%	-0.65%	0.09%
过去六个月	1.48%	0.13%	2.37%	0.01%	-0.89%	0.12%
自基金合同生效起至今	3.82%	0.11%	4.67%	0.01%	-0.85%	0.10%

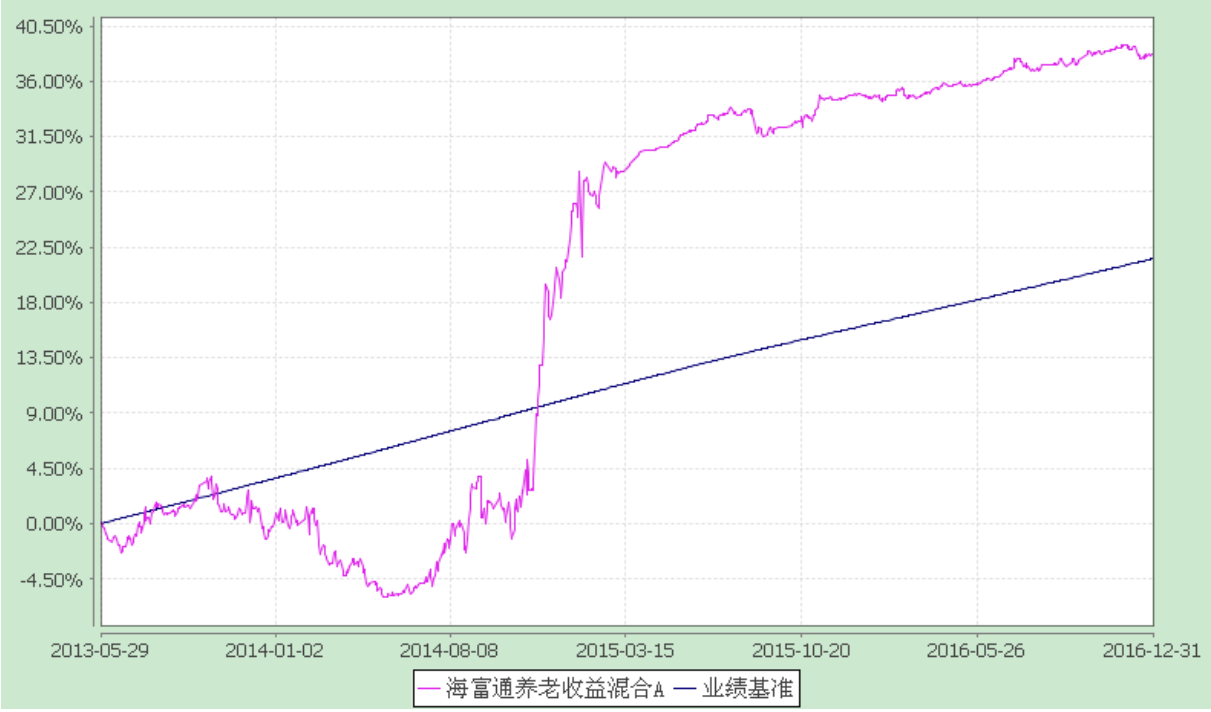
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通养老收益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

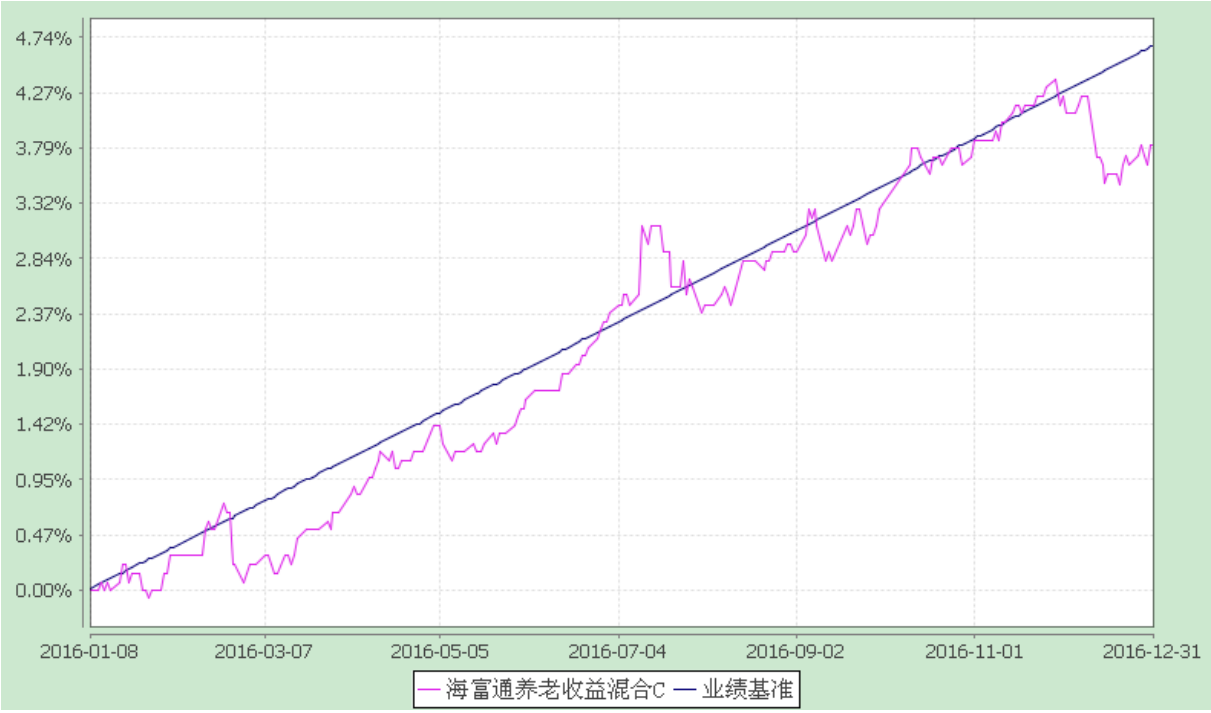
1．海富通养老收益混合 A

(2013 年 5 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日)



2．海富通养老收益混合 C

(2016 年 1 月 8 日至 2016 年 12 月 31 日)



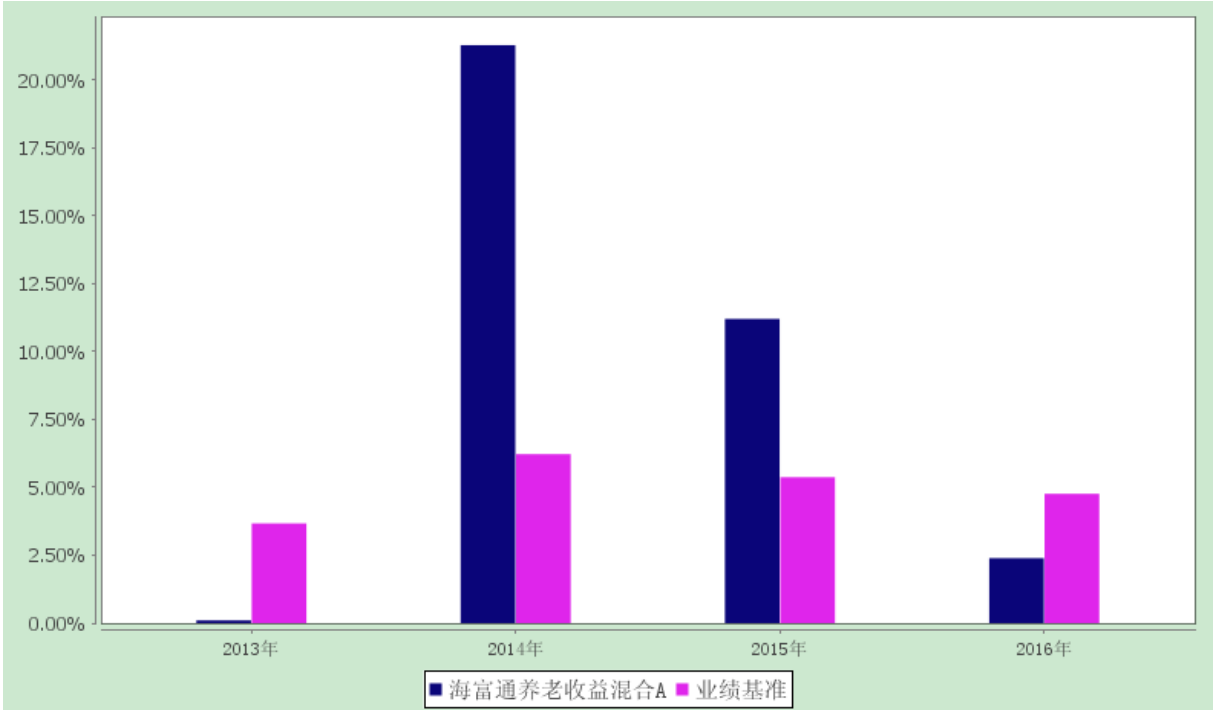
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（五）投资限制中规定的各项比例。

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

海富通养老收益混合型证券投资基金

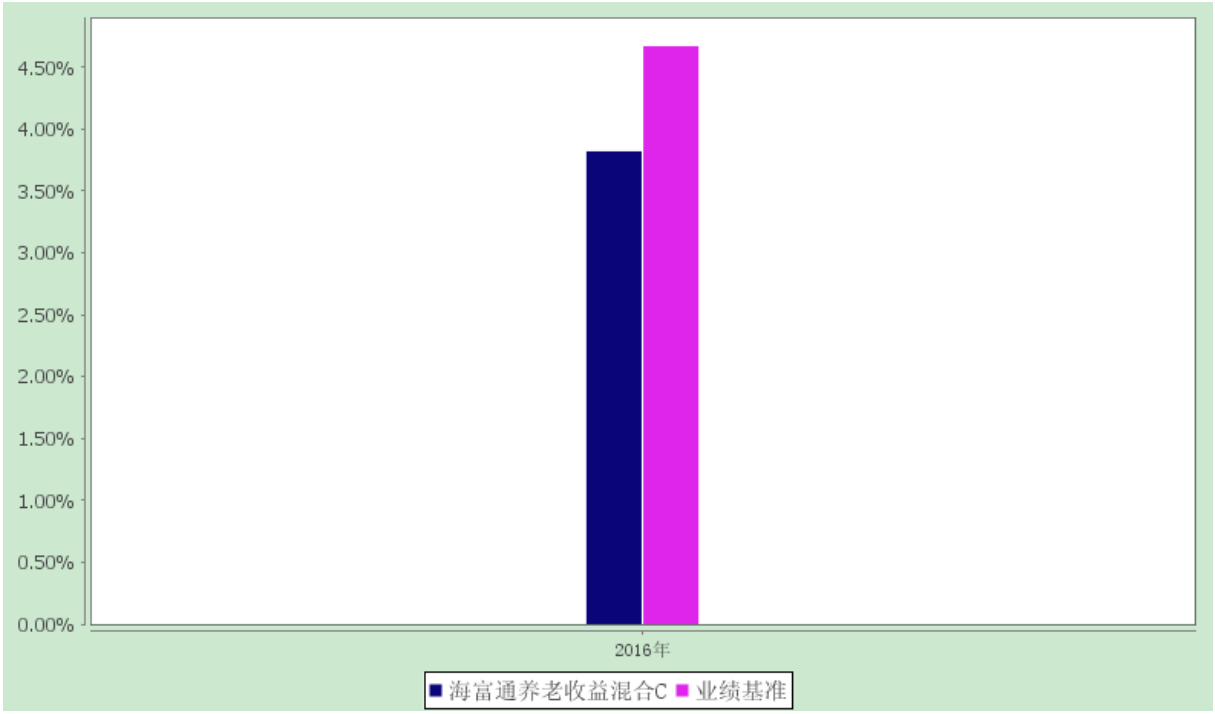
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1．海富通养老收益混合 A



注：图中列示的 2013 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 5 月 29 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

2．海富通养老收益混合 C



注：本基金自 2016 年 1 月 8 日起增加 C 类份额，图中列示的 2016 年度基金净值增长率自 1 月 8 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

1、海富通养老收益混合 A：

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	1.530	48,803,604.01	168,942.01	48,972,546.02	-
2015 年	-	-	-	-	-
2014 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通养老收益混合 C：

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	1.590	12.77	2,266,458.30	2,266,471.07	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自 2016 年 1 月 8 日起增加 C 类份额。

§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		
赵恒毅	本基金的基金经理；海富通双利债券基金经理；海富通双福分级债券基金经理；海富通一年定开债券基金经理；海富通纯债债券基金经理	2013-12-30	2016-04-29	10 年	金融学硕士。持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2008 年 3 月任通用技术集团投资管理有限公司研究员，2008 年 4 月至 2011 年 5 月任富国基金管理有限公司研究员，2011 年 5 月至 2013 年 7 月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理，2012 年 5 月至 2013 年 7 月任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理，2012 年 6 月至 2013 年 7 月任富国可转换债券证券投资基金基金经理，2013 年 11 月加入海富通基金管理有限公司。2013 年 12 月至 2016 年 4 月任海富通养老收益混合和海富通双利债券基金经理。2014 年 5 月至 2016 年 4 月兼任海富通双福分级债券基金经

					理。2015 年 12 月至 2016 年 4 月兼任海富通一年定开债券和海富通纯债债券基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理；海富通季季增利理财债券基金经理；海富通稳健添利债券基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通货币基金经理；海富通双福分级债券基金经理；海富通双利债券基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通聚利债券基金经理；海富通欣荣混合基金	2016-04-22	-	11 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理 、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月起兼任海富通纯债债券、海富通双福分级债券、海富通双利债券及海富通养老收益混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通强化回报混合基金经理。

	经理				
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；海富通东财大数据混合基金经理；海富通欣益混合基金经理；量化投资部总监	2015-04-29	2016-06-22	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化分析师、投资经理、量化投资部副总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2014 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2015 年 4 月至 2016 年 6 月兼任海富通养老收益混合和海富通新内需混合基金经理。2016 年 1 月起兼任海富通东财大数据混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣益混合基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通欣荣混合基金经理；多资产策略投资部总监	2016-06-22	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、量化投资部总监，现任海富通基金管理有限公司多资产策略投资部总监。2016 年 6 月起兼任海富通新内需混合和海富通养老收益混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。
夏妍妍	本基金的基金经理助理；海富	2016-01-04	-	2 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有

	通纯债债券基金经理助理；海富通双利债券基金经理助理；海富通一年定开债券基金经理助理；海富通双福分级债券基金经理助理				限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，任固定收益分析师。2016 年 1 月起任海富通双利债券、海富通双福分级债券、海富通养老收益混合、海富通一年定开债券、海富通纯债债券的基金经理助理。

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 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%。

本年度，基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

从债市看，经历了 2014、2015 两年的牛市，2016 年的债券市场表现可谓一波三折，收益率先下后上，总体震荡收跌。从 10 年期国债的收益率走势看可以将 2016 年的债券市场分为三个阶段：1-5 月区间窄幅震荡，6-10 月收益率突破下行并创下历史新低，11-12 月则出现恐慌式的大幅调整。每一阶段背后都有其对应的市场环境和逻辑，而其中政策因素是贯穿全年的主导因素。具体分阶段来看，年初政府稳增长意愿强烈，信贷投放加大，地产政策放松，央行降低准备金率，经济出现短暂回升。这一阶段债券收益率区间震荡，只是 4 月中旬受违约风险扩散影响，信用债出现了一波调整。5 月政策风向出现转变，权威人士讲话后政策重心从需求侧刺激转为供给侧改革，工业产出、房地产投资以及出口纷纷出现回落，信贷和社融也开始下滑。货币政策则维持稳健偏宽松，虽然央行并未采取降准降息等手段，但是灵活运用公开市场操作、MLF、SLF、SLO 等工具进行货币投放，资金面依旧宽松。这时的经济政策环境开始对债市变得有利，而 6 月下旬英国脱欧公投则成为了债市的助燃剂，避险情绪和对货币进一步宽松的预期推动了债市出现快速上涨。与此同时，随着利率的走低，银行资产出表化、委外投资迅猛扩大，整个金融体系的杠杆与资产价格正反馈强化，“资产荒”成为市场主旋律。无论是超长期利率债还是低评级信用债，只要收益率相对较高，都成为市场博取收益的对象，期限利差、信用利差被持续压缩。这一情况于 8 月中旬到达极致，10 年期国债一度达到 2.65%的历史新低，信用利差也来到了近乎历史最低的分位水平。进入四季度，供给侧改革取得初步成效，PPI 由负转正，企业盈利改善，经济企稳回升。鉴于美国加息预期渐近人民币贬值压力加大和国内日益增长的地产泡沫，管理层政策重心转向“防风险”和“挤泡沫”，一方面严格实施地产调控，另一方面货币政策边际收紧。央行通过持续公开市场“锁短放长”操作，不断抬升资金成本，并加强理财监管考核。起初市场不以为意，认为地产调控会加剧资产荒和对经济的悲观预期，10 年期国债收益率于 10 月中下旬再次逼近 8 月份的低点。然而进入 11 月，负债端的剧烈波动使得原本就脆弱的市场开始急转直下，尤其在 11 月底资金面紧张加剧，货基遭遇赎回，国海证券“代持违约”事件更是雪上加霜，大量杠杆盘被迫抛出，10 年期国开债收益率相对年内低点一度上行 100bps 左右。信用债也难以幸免，收益率以及信用利差大幅上升，二级市场亦成交寥寥，债市流动性受到重创。这一波市场调整持续了三周，直至 12 月下旬才在央行的维稳下出现缓解，虽然时间不算长但调整幅度之大不亚于去年的股灾，沉重的打击了一直处于牛市惯性思维中的债券市场。纵观全年表现，1 年期国债收益率上行 35BP，10 年期国债收益率上行 19BP，3 年期 AA+中短期票据收益率上行约 68BP，债市没有延续前两年的牛市步伐。可转债方面，16 年的转债市场更是表现不佳，中证转债指数或受正股拖累或受流动性冲击，于年初、年中、年末三次探底，全年跌 11.76%。

本基金债券部分全年维持短久期高信用的策略，尽量规避风险，追求稳定收益和流

动性管理，并尽量提高组合整体配置收益。全年来看，债券部分收益稳定，规避了信用风险和利率风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通养老收益混合 A 净值增长率为 2.39%，同期业绩比较基准收益率为 4.76%，基金净值跑输业绩比较基准 2.37 个百分点。海富通养老收益混合 C 净值增长率为 3.82%，同期业绩比较基准收益率为 4.67%，基金净值跑输业绩比较基准 0.85 个百分点。基金跑输业绩基准的主要原因是本年度由于股债双杀，基金虽然取得绝对收益，但低于业绩基准的水平。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从股市看，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 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 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。

本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，波段操作以获取回撤可控的绝对收益。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力获取绝对收益。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

从债市看，2017 年经济可能继续维持弱势平稳。虽然近期工业增长、固定资产投资阶段性回升，一季度经济增速仍能维持在较高水平，但中期看补库存推动是否能发展为需求推动仍存在较大不确定性，尤其是经历严厉调控后的地产投资情况、财政对基建的支持力度、PPP 的落地情况等都还有待观察。如果需求无法恢复，下半年经济依然面临回落压力。通胀方面，2017 年通胀中枢上移是大概率事件。PPI 回升对 CPI 的传导、重要资源品价格上涨带来可能的输入性通胀都使得通胀预期抬升，但目前看还不具备全面通胀的条件。货币政策方面，2016 年下半年以来货币政策面临汇率贬值、金融去杠杆、地产去泡沫的多重压力，货币政策边际收紧，这一状态可能仍会持续较长一段时间。但是，货币政策仍是服务于国内经济，随着贬值压力的逐步释放，货币政策可能获得更多的独立性，届时将视国内经济和通胀水平来选择政策偏紧或是偏松。总体看，2017 的债市环境可能与今年类似，趋势性不强、预期变化快，主要原因还是在于管理层政策重心的摇摆。17 年下半年迎来“十九大”，届时可能确立未来的政策重心，但在此之前市场可能仍延续区间波动的特征。另外全球经济政治的不稳定加剧、不确定因素增多也是重要的扰动因素，尤其是美国换届后的经济和货币政策直接影响了全球风险偏好和资金的流向，对我国经济和资本市场也有重要影响。在此环境下，我们对 2017 年债市保持中性看法，风险和机会共存，经济和政策的预期差或是投资机会的所在。从品种上看，结构性机会下利率债依旧是性价比较好的波段品种，可择机参与。信用债信用利差过窄的局面已有所改善，但保护依然不足，可能有进一步走扩的风险，需更多关注配置时点。可转债整体估值有所压缩，价格处于历史底部，可考虑积极布局。

下一年度，本基金债券部分仍将维持低久期高信用等级的债券配置策略，积极配置存款、短期债券等流动性管理工具，提高组合收益率。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过现场检查、系统监控、人员询问、重点抽查等一系列方式开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事长和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作的重点包括以下几个方面：

一、持续完善公司的规章制度，健全内部控制体系，落实内控责任。

监察稽核部组织各部门结合新业务和新法规的要求，对内部制度和流程进行更新，为公司业务开展提供有效的制度保障，并及时更新合规注意事项卡，以强化岗位职责，满足业务发展和相关法规要求，为基金持有人谋求最大利益提供有力的保障。

二、加强对公司和基金日常运作的合规审核

本报告期内，监察稽核部坚持以法律法规和公司管理制度为依据，对公司和基金日常运作的各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，确保了基金运作的诚信和合法合规性。本报告期内，公司监察稽核的范围涉及投资、销售、客服、IT、基金运营等各个方面。通过事前、事中、事后的全方位合规审核，公司对投资交易、客户服务体系、信息安全控制、基金运营控制、分支机构管理等方面的内部规章制度和各项业务流程予以了完善；同时强化了现有规章制度的执行力度，并很好的落实了相关建议。

三、加强对各业务部门审计和检查的力度

本报告期内，监察稽核部根据证监会的要求和公司年初制定的年度审计计划和日常业务检查安排，对公司各部门的业务有选择有重点的开展专项审计、定期审计及日常检查工作，严格控制各部门的主要风险，加强并完善公司的内部控制状况。

四、有效推进反洗钱工作

本报告期内，监察稽核部结合反洗钱法规及公司业务特点，根据新法规要求建立客户洗钱风险评估指标体系，对客户进行洗钱风险等级划分。同时还按照法规规定，定期登陆反洗钱系统，对系统筛选的可疑交易进行人工识别和复核，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。

五、加强投资者教育，培养投资者风险意识和投资理念

本报告期内，监察稽核部会同相关部门鼓励投资者进行长期投资，持续不断和投资者进行沟通，通过多种渠道、多种媒介积极推进投资者教育工作，培养广大投资者的风险意识和投资理念、切实加强保护了广大基金持有人的合法权益。

六、强化法规学习，开展内控培训，培养员工的风险防范意识。

本报告期内，监察稽核部及时将新颁布的各项法律法规进行解读，并提供给全体员工学习，同时定期对全体员工进行内控培训，剖析风险案例。通过培训，员工的合规意识有所增强，主动控制业务风险的积极性也得到了提高。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有 3 年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司业务管理委员会批准后实施。

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。

4.8 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2016 年 12 月 6 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2016 年 12 月 20 日完成权益登记，海富通养老收益混合 A 单位分红金额为 1.53 元，海富通养老收益混合 C 单位分红金额为 1.59 元，合计利润分配金额 51,239,017.90 元。符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 22016 号

海富通养老收益混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的海富通养老收益混合型证券投资基金(以下简称“ 海富通养老收益基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、 2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是海富通养老收益基金的基金管理人海富通基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述海富通养老收益基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了海富通养老收益基金 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)　　中国注册会计师　陈玲　傅琛慧

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2017-03-24

§7　年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通养老收益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	附注号	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	7.4.7.1	85,712,383.43	189,675,252.83
结算备付金		12,337,279.65	2,203,681,985.33
存出保证金		2,645,086.97	527,915.48
交易性金融资产	7.4.7.2	314,098,248.23	185,392,381.33
其中：股票投资		84,519,248.23	54,453,357.53
基金投资		-	-
债券投资		229,579,000.00	130,939,023.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,543,662.97
应收利息	7.4.7.5	2,093,280.00	7,032,760.68
应收股利		-	-
应收申购款		1,304.93	92,102.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		416,887,583.21	2,587,946,061.24
负债和所有者权益	**附注号**	**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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,346,205.19	-
应付赎回款		45,644.36	623,904.11
应付管理人报酬		379,536.07	2,207,018.34
应付托管费		94,884.01	551,754.58
应付销售服务费		1,244.81	-
应付交易费用	7.4.7.7	239,907.42	177,426.04
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	400,058.44	417,017.31
负债合计		3,507,480.30	3,977,120.38
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	336,171,006.93	1,913,385,382.50
未分配利润	7.4.7.10	77,209,095.98	670,583,558.36
所有者权益合计		413,380,102.91	2,583,968,940.86
负债和所有者权益总计		416,887,583.21	2,587,946,061.24

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，海富通养老收益基金 A 类基金份额净值 1.229 元，基金份额总额 320,079,795.77 份；海富通养老收益基金 C 类基金份额净值 1.238 元，基金份额总额 16,091,211.16 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通养老收益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	附注号	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
一、收入		**22,553,181.29**	**261,348,677.73**
1.利息收入		17,801,648.90	57,906,206.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,145,176.29	19,182,842.56
债券利息收入		3,906,684.77	25,760,626.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		749,787.84	12,962,737.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,245,198.88	186,496,051.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,148,308.50	202,052,855.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	801,370.43	-16,052,927.61
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-665,520.00	-
股利收益	7.4.7.16	961,039.95	496,123.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,160,827.67	3,179,493.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,667,161.18	13,766,926.01
减：二、费用		**13,177,402.33**	**51,635,726.28**
1．管理人报酬		8,812,860.63	42,256,700.22
2．托管费		2,203,215.21	7,405,858.06
3．销售服务费		1,244.81	-
4．交易费用	7.4.7.19	1,698,689.12	1,457,480.01
5．利息支出		-	12,502.15
其中：卖出回购金融资产支出		-	12,502.15
6．其他费用	7.4.7.20	461,392.56	503,185.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**9,375,778.96**	**209,712,951.45**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**9,375,778.96**	**209,712,951.45**

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通养老收益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）	1,913,385,382.50	670,583,558.36	2,583,968,940.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,375,778.96	9,375,778.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”填列）	-1,577,214,375.57	-551,511,224.25	-2,128,725,599.82
其中：1.基金申购款	18,427,761.40	6,996,078.77	25,423,840.17
2.基金赎回款	-1,595,642,136.97	-558,507,303.02	-2,154,149,439.99
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）	-	-51,239,017.09	-51,239,017.09
五、期末所有者权益（基金净值）	336,171,006.93	77,209,095.98	413,380,102.91
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）	26,918,554.22	5,758,977.76	32,677,531.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	209,712,951.45	209,712,951.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变	1,886,466,828.28	455,111,629.15	2,341,578,457.43

动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	10,170,120,186.54	3,199,748,178.91	13,369,868,365.45
2.基金赎回款	-8,283,653,358.26	-2,744,636,549.76	-11,028,289,908.02
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）	1,913,385,382.50	670,583,558.36	2,583,968,940.86

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

海富通养老收益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[2013] 299 号文核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通养老收益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 850,131,326.99 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(2013)第 328 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通养老收益混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 850,399,612.86 份基金份额,其中认购资金利息折合 268,285.87 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2016 年 1 月 6 日《关于海富通养老收益混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2016 年 1 月 8 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额，并对 C 级份额收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通养老收益混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转换债券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、资产支持证券以及经

法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%~95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%~3%，债券、银行存款、货币市场工具、现金及其它资产合计占基金资产的比例为 5%~100%，其中每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率(税后)+ 2%。

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》、《海富通养老收益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 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。

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(主要为股指期货投资)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卖出回购金融资产款和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和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大

变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	5,712,383.43	189,675,252.83
定期存款	80,000,000.00	-
其中：存款期限 1-3 个月	50,000,000.00	-
存款期限 3 个月-1 年	30,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计	85,712,383.43	189,675,252.83

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		82,860,627.52	84,519,248.23	1,658,620.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	230,312,612.87	229,579,000.00	-733,612.87
	合计	230,312,612.87	229,579,000.00	-733,612.87
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		313,173,240.39	314,098,248.23	925,007.84
项目		上年度末		

		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		49,562,493.38	54,453,357.53	4,890,864.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	101,789,792.44	100,900,023.80	-889,768.64
	银行间市场	29,967,660.00	30,039,000.00	71,340.00
	合计	131,757,452.44	130,939,023.80	-818,428.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		181,319,945.82	185,392,381.33	4,072,435.51

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
——股指期货	-12,893,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-12,893,680.00	-	-	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
——股指期货	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0 元。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,343.16	141,587.72
应收定期存款利息	194,097.30	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	7,299.60	723,703.23
应收债券利息	1,887,511.24	6,167,227.90
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	4.23
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	28.70	237.60
合计	2,093,280.00	7,032,760.68

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	238,932.42	172,251.16

银行间市场应付交易费用	975.00	5,174.88
合计	239,907.42	177,426.04

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	58.44	2,017.31
预提费用	400,000.00	415,000.00
合计	400,058.44	417,017.31

7.4.7.9 实收基金

海富通养老收益混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,913,385,382.50	1,913,385,382.50
本期申购	2,336,528.72	2,336,528.72
本期赎回（以“-”号填列）	-1,595,642,115.45	-1,595,642,115.45
本期末	320,079,795.77	320,079,795.77

海富通养老收益混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	16,091,232.68	16,091,232.68
本期赎回（以“-”号填列）	-21.52	-21.52
本期末	16,091,211.16	16,091,211.16

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2016 年 1 月 6 日《关于海富通养老收益混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金

托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2016 年 1 月 8 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额，并对 C 级份额收取销售服务费。

7.4.7.10 未分配利润

海富通养老收益混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	661,614,502.62	8,969,055.74	670,583,558.36
本期利润	12,598,395.99	-3,141,952.91	9,456,443.08
本期基金份额交易产生的变动数	-552,632,370.48	-5,053,209.15	-557,685,579.63
其中：基金申购款	807,118.59	14,596.55	821,715.14
基金赎回款	-553,439,489.07	-5,067,805.70	-558,507,294.77
本期已分配利润	-48,972,546.02	-	-48,972,546.02
本期末	72,607,982.11	773,893.68	73,381,875.79

海富通养老收益混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-61,789.36	-18,874.76	-80,664.12
本期基金份额交易产生的变动数	6,114,949.48	59,405.90	6,174,355.38
其中：基金申购款	6,114,957.54	59,406.09	6,174,363.63
基金赎回款	-8.06	-0.19	-8.25
本期已分配利润	-2,266,471.07	-	-2,266,471.07
本期末	3,786,689.05	40,531.14	3,827,220.19

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	498,602.54	9,582,792.30

定期存款利息收入	952,430.63	5,516,666.67
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	11,692,020.75	3,621,323.57
其他	2,122.37	462,060.02
合计	13,145,176.29	19,182,842.56

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	710,334,962.39	668,462,831.81
减：卖出股票成本总额	706,186,653.89	466,409,976.12
买卖股票差价收入	4,148,308.50	202,052,855.69

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	601,170,045.67	3,673,480,790.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	590,334,610.02	3,607,665,512.16
减：应收利息总额	10,034,065.22	81,868,205.69
买卖债券差价收入	801,370.43	-16,052,927.61

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

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

股指期货投资收益	-665,520.00	-
其他	-	-
合计	-665,520.00	-

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	961,039.95	496,123.74
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	961,039.95	496,123.74

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-3,147,427.67	3,179,493.41
——股票投资	-3,232,243.44	3,997,922.05
——债券投资	84,815.77	-818,428.64
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	-13,400.00	-
——权证投资	-	-
——股指期货	-13,400.00	-
3.其他	-	-
合计	-3,160,827.67	3,179,493.41

7.4.7.18 其他收入

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

基金赎回费收入	2,401,309.50	13,685,993.18
基金转换费收入	265,851.68	80,932.83
合计	2,667,161.18	13,766,926.01

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	1,691,689.12	1,437,030.01
银行间市场交易费用	7,000.00	20,450.00
合计	1,698,689.12	1,457,480.01

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	100,000.00	115,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,450.00
其他	1,400.00	200.00
银行划款手续费	23,992.56	51,535.84
合计	461,392.56	503,185.84

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增

值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金托管人、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
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	8,812,860.63	42,256,700.22

其中：支付销售机构的客户维护费	64,372.34	132,899.42

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1.0%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 1.0% / 当年天数。

7.4.10.2.2 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	2,203,215.21	7,405,858.06

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 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
中国银行	5,712,383.43	498,602.54	189,675,252.83	9,582,792.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 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其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

海富通养老收益混合 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016-12-20	2016-12-20	2016-12-20	1.530	48,803,604.01	168,942.01	48,972,546.02	-
合计				1.530	48,803,604.01	168,942.01	48,972,546.02	-

海富通养老收益混合 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016-12-20	2016-12-20	2016-12-20	1.590	12.77	2,266,458.30	2,266,471.07	-

合计			1.590	12.77	2,266,458.30	2,266,471.07	-

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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	-
300508	维宏股份	2016-04-12	2017-04-19	首发原股东限售股份	20.08	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-
300586	美联新财	2016-12-26	2017-01-04	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
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	-

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。

7.4.12.2 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	
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	13.79	-	-	12,675	181,597.63	174,788.25	-
002492	恒基达鑫	2016-02-24	重大资产重组	12.66	-	-	22,900	263,220.00	289,914.00	-
600406	国电南瑞	2016-12-29	重大资产重组	16.63	-	-	24,850	411,470.50	413,255.50	-
600551	时代出版	2016-11-28	重大资产重组	20.32	-	-	30,575	629,624.68	621,284.00	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的四层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行；定期存款存放在具有基金托管资格的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	219,315,000.00	30,039,000.00
合计	219,315,000.00	30,039,000.00

注：未评级部分为政策性金融债和短期融资债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	10,264,000.00	652,000.00
未评级	-	100,248,023.80

合计	10,264,000.00	100,900,023.80

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持的大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营

活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	85,712,383.43	-	-	-	85,712,383.43
结算备付金	12,337,279.65	-	-	0.00	12,337,279.65
存出保证金	2,645,086.97	-	-	0.00	2,645,086.97
交易性金融资产	229,579,000.00	-	-	84,519,248.23	314,098,248.23
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	0.00	-	-	0.00	0.00
应收利息	0.00	-	-	2,093,280.00	2,093,280.00
应收申购款	9.99	-	-	1,294.94	1,304.93
资产总计	330,273,760.04	-	-	86,613,823.17	416,887,583.21
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,346,205.19	2,346,205.19
应付赎回款	-	-	-	45,644.36	45,644.36
应付管理人报酬	-	-	-	379,536.07	379,536.07
应付托管费	-	-	-	94,884.01	94,884.01
应付销售服务费	-	-	-	1,244.81	1,244.81
应付交易费用	-	-	-	239,907.42	239,907.42
其他负债	-	-	-	400,058.44	400,058.44
负债总计	-	-	-	3,507,480.30	3,507,480.30
利率敏感度缺口	330,273,760.04	-	-	83,106,342.87	413,380,102.91
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	189,675,252.83	-	-	-	189,675,252.83
结算备付金	2,203,681,985.33	-	-	-	2,203,681,985.33
存出保证金	527,915.48	-	-	-	527,915.48
交易性金融资产	130,287,023.80	-	652,000.00	54,453,357.53	185,392,381.33
应收证券清算款	-	-	-	1,543,662.97	1,543,662.97
应收申购款	39.76	-	-	92,062.86	92,102.62
应收利息	-	-	-	7,032,760.68	7,032,760.68
资产总计	2,524,172,217.20	-	652,000.00	63,121,844.04	2,587,946,061.24

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,207,018.34	2,207,018.34
应付托管费	-	-	-	551,754.58	551,754.58
应付交易费用	-	-	-	177,426.04	177,426.04
应付赎回款	-	-	-	623,904.11	623,904.11
其他负债	-	-	-	417,017.31	417,017.31
负债总计	-	-	-	3,977,120.38	3,977,120.38
利率敏感度缺口	2,524,172,217.20	-	652,000.00	59,144,723.66	2,583,968,940.86

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 24	减少约 5
	市场利率下降 25 个基点	增加约 24	增加约 5

注：影响金额为约数，精确到万元。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资

0%~95%，权证投资 0%~3%，债券、银行存款、货币市场工具、现金及其它资产 5%~100%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	84,519,248.23	20.45	54,453,357.53	2.11
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
合计	84,519,248.23	20.45	54,453,357.53	2.11

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 107	增加约 224
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 107	减少约 224

注：影响金额为约数，精确到万元。

7.4.14 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 81,595,958.31 元，属于第二层次的余额为 232,502,289.92 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 53,139,878.01 元，第二层次 132,252,503.32，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	84,519,248.23	20.27
	其中：股票	84,519,248.23	20.27
2	固定收益投资	229,579,000.00	55.07
	其中：债券	229,579,000.00	55.07
	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	98,049,663.08	23.52
7	其他各项资产	4,739,671.90	1.14
8	合计	416,887,583.21	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	1,263,213.80	0.31
B	采矿业	1,661,205.00	0.40
C	制造业	55,561,909.70	13.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	258,750.00	0.06
E	建筑业	4,057,134.15	0.98
F	批发和零售业	4,206,533.09	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,160,754.00	0.28
H	住宿和餐饮业	608,076.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,789,022.17	0.67
J	金融业	7,982,745.07	1.93
K	房地产业	1,189,993.00	0.29
L	租赁和商务服务业	954,083.25	0.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	438,000.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	582,815.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,805,014.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	84,519,248.23	20.45

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投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002415	海康威视	195,550	4,656,045.50	1.13
2	600519	贵州茅台	8,300	2,773,445.00	0.67
3	601939	建设银行	382,100	2,078,624.00	0.50
4	601009	南京银行	188,000	2,037,920.00	0.49
5	000018	神州长城	169,800	1,816,860.00	0.44
6	600172	黄河旋风	101,300	1,811,244.00	0.44
7	002640	跨境通	96,800	1,771,440.00	0.43
8	600409	三友化工	185,900	1,745,601.00	0.42
9	600887	伊利股份	94,830	1,669,008.00	0.40
10	600547	山东黄金	45,500	1,661,205.00	0.40
11	600643	爱建集团	125,990	1,563,535.90	0.38
12	600691	阳煤化工	397,800	1,527,552.00	0.37
13	002475	立讯精密	67,800	1,406,850.00	0.34
14	000963	华东医药	18,387	1,325,151.09	0.32
15	300232	洲明科技	85,800	1,280,136.00	0.31
16	300508	维宏股份	10,383	1,261,430.67	0.31
17	600068	葛洲坝	136,800	1,257,192.00	0.30
18	300136	信维通信	33,500	954,750.00	0.23
19	601006	大秦铁路	123,000	870,840.00	0.21
20	600688	上海石化	126,700	815,948.00	0.20
21	002450	康得新	42,100	804,531.00	0.19
22	603589	口子窖	25,000	803,250.00	0.19
23	601328	交通银行	138,600	799,722.00	0.19
24	300199	翰宇药业	44,300	796,514.00	0.19
25	000895	双汇发展	38,000	795,340.00	0.19
26	000596	古井贡酒	17,400	791,700.00	0.19
27	000001	平安银行	85,800	780,780.00	0.19
28	600079	人福医药	38,300	764,085.00	0.18
29	002304	洋河股份	10,800	762,480.00	0.18
30	002394	联发股份	42,350	748,748.00	0.18
31	300138	晨光生物	39,500	720,085.00	0.17
32	600426	华鲁恒升	54,200	718,150.00	0.17
33	600183	生益科技	64,800	712,800.00	0.17

34	300498	温氏股份	20,140	709,330.80	0.17
35	002241	歌尔股份	26,600	705,432.00	0.17
36	002035	华帝股份	27,000	700,650.00	0.17
37	601233	桐昆股份	48,600	697,896.00	0.17
38	600567	山鹰纸业	181,000	655,220.00	0.16
39	300207	欣旺达	46,800	650,520.00	0.16
40	600703	三安光电	47,800	640,042.00	0.15
41	300031	宝通科技	30,300	638,724.00	0.15
42	600073	上海梅林	54,407	622,960.15	0.15
43	600309	万华化学	28,900	622,217.00	0.15
44	600551	时代出版	30,575	621,284.00	0.15
45	000786	北新建材	60,125	618,686.25	0.15
46	601689	拓普集团	21,000	617,820.00	0.15
47	601818	光大银行	157,387	615,383.17	0.15
48	002032	苏泊尔	17,599	614,557.08	0.15
49	600258	首旅酒店	26,600	608,076.00	0.15
50	002343	慈文传媒	13,400	605,278.00	0.15
51	300156	神雾环保	24,100	602,741.00	0.15
52	002092	中泰化学	49,500	598,950.00	0.14
53	600873	梅花生物	91,700	597,884.00	0.14
54	600138	中青旅	28,500	597,645.00	0.14
55	000965	天保基建	89,600	597,632.00	0.14
56	600498	烽火通信	23,700	597,477.00	0.14
57	600419	天润乳业	10,474	597,122.74	0.14
58	000550	江铃汽车	22,100	596,700.00	0.14
59	002310	东方园林	42,100	595,715.00	0.14
60	603658	安图生物	10,700	594,813.00	0.14
61	600007	中国国贸	34,300	592,361.00	0.14
62	601222	林洋能源	73,400	592,338.00	0.14
63	600569	安阳钢铁	197,300	589,927.00	0.14
64	601607	上海医药	30,000	586,800.00	0.14
65	600661	新南洋	20,500	582,815.00	0.14
66	002074	国轩高科	18,800	582,612.00	0.14
67	002690	美亚光电	27,500	581,900.00	0.14
68	601595	上海电影	14,600	578,452.00	0.14
69	002456	欧菲光	16,800	575,904.00	0.14
70	002200	云投生态	23,650	553,883.00	0.13
71	600276	恒瑞医药	12,040	547,820.00	0.13
72	000858	五粮液	15,050	518,924.00	0.13
73	600882	广泽股份	46,611	500,602.14	0.12
74	002262	恩华药业	23,175	484,357.50	0.12
75	600104	上汽集团	20,500	480,725.00	0.12
76	600351	亚宝药业	48,600	480,168.00	0.12
77	002501	利源精制	38,680	474,603.60	0.11

78	600518	康美药业	25,100	448,035.00	0.11
79	300070	碧水源	25,000	438,000.00	0.11
80	600406	国电南瑞	24,850	413,255.50	0.10
81	000639	西王食品	16,250	394,387.50	0.10
82	002511	中顺洁柔	19,700	392,030.00	0.09
83	002332	仙琚制药	30,350	390,604.50	0.09
84	000915	山大华特	9,125	384,436.25	0.09
85	000661	长春高新	3,368	376,710.80	0.09
86	600572	康恩贝	50,000	365,500.00	0.09
87	300115	长盈精密	13,900	362,234.00	0.09
88	600566	济川药业	11,239	351,331.14	0.08
89	002078	太阳纸业	50,300	336,004.00	0.08
90	002221	东华能源	27,000	334,530.00	0.08
91	002433	太安堂	30,000	325,200.00	0.08
92	000726	鲁泰 A	24,800	317,688.00	0.08
93	300142	沃森生物	28,100	306,290.00	0.07
94	002019	亿帆医药	19,055	291,350.95	0.07
95	002492	恒基达鑫	22,900	289,914.00	0.07
96	600166	福田汽车	90,350	279,181.50	0.07
97	002108	沧州明珠	13,475	274,485.75	0.07
98	600856	中天能源	18,750	258,750.00	0.06
99	002236	大华股份	17,500	239,400.00	0.06
100	300417	南华仪器	4,300	235,898.00	0.06
101	002323	雅百特	15,000	227,100.00	0.05
102	000333	美的集团	7,700	216,909.00	0.05
103	300210	森远股份	9,200	200,836.00	0.05
104	300154	瑞凌股份	19,100	196,348.00	0.05
105	600241	时代万恒	12,200	188,612.00	0.05
106	300354	东华测试	7,600	185,440.00	0.04
107	300270	中威电子	12,200	185,318.00	0.04
108	002508	老板电器	5,000	184,000.00	0.04
109	600415	小商品城	21,000	181,650.00	0.04
110	300437	清水源	7,600	180,196.00	0.04
111	300448	浩云科技	6,000	179,280.00	0.04
112	601599	鹿港文化	19,250	176,330.00	0.04
113	002400	省广股份	12,675	174,788.25	0.04
114	600690	青岛海尔	16,243	160,480.84	0.04
115	300439	美康生物	5,100	153,969.00	0.04
116	300452	山河药辅	3,500	153,090.00	0.04
117	300394	天孚通信	4,700	152,139.00	0.04
118	300358	楚天科技	8,800	151,712.00	0.04
119	300455	康拓红外	7,800	151,710.00	0.04
120	300444	双杰电气	6,300	151,200.00	0.04
121	603599	广信股份	8,900	150,944.00	0.04

122	002593	日上集团	20,500	150,880.00	0.04
123	300370	安控科技	16,300	150,612.00	0.04
124	300390	天华超净	12,000	150,240.00	0.04
125	300360	炬华科技	7,800	150,072.00	0.04
126	002747	埃斯顿	4,600	150,052.00	0.04
127	603566	普莱柯	6,200	149,916.00	0.04
128	300389	艾比森	6,900	149,730.00	0.04
129	603015	弘讯科技	12,100	149,435.00	0.04
130	603023	威帝股份	10,200	149,226.00	0.04
131	300312	邦讯技术	10,400	148,408.00	0.04
132	002771	真视通	2,100	147,924.00	0.04
133	000498	山东路桥	18,244	144,674.92	0.03
134	002036	联创电子	7,500	143,700.00	0.03
135	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.03
136	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.02
137	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.02
138	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
139	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.01
140	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.01
141	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
142	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
143	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
144	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
145	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
146	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
147	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
148	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

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	601818	光大银行	37,220,331.38	1.44
2	601398	工商银行	36,850,600.00	1.43
3	600028	中国石化	25,032,000.00	0.97
4	601328	交通银行	24,281,537.00	0.94
5	601939	建设银行	19,287,362.00	0.75
6	601318	中国平安	18,169,606.00	0.70
7	601857	中国石油	14,913,000.00	0.58
8	601288	农业银行	13,911,914.16	0.54

9	600050	中国联通	10,822,236.79	0.42
10	600690	青岛海尔	10,720,922.33	0.41
11	600048	保利地产	9,268,041.01	0.36
12	000963	华东医药	7,619,000.00	0.29
13	600074	保千里	7,537,872.00	0.29
14	600036	招商银行	7,487,886.75	0.29
15	600180	瑞茂通	7,123,293.11	0.28
16	000858	五 粮 液	5,801,689.00	0.22
17	000915	山大华特	5,649,286.00	0.22
18	002311	海大集团	5,581,581.28	0.22
19	600873	梅花生物	5,525,706.00	0.21
20	600104	上汽集团	5,495,879.00	0.21

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	601398	工商银行	36,595,800.00	1.42
2	601818	光大银行	35,904,669.47	1.39
3	600028	中国石化	24,716,416.05	0.96
4	601328	交通银行	23,062,842.00	0.89
5	601318	中国平安	17,869,332.46	0.69
6	601939	建设银行	17,052,357.92	0.66
7	601857	中国石油	14,907,997.20	0.58
8	601288	农业银行	13,979,801.74	0.54
9	600690	青岛海尔	11,224,970.33	0.43
10	600050	中国联通	10,891,824.32	0.42
11	600048	保利地产	8,950,772.00	0.35
12	600036	招商银行	7,199,006.98	0.28
13	600074	保千里	7,114,941.41	0.28
14	600180	瑞茂通	6,996,846.70	0.27
15	000963	华东医药	6,304,002.79	0.24
16	000858	五 粮 液	5,810,331.14	0.22
17	002311	海大集团	5,664,626.12	0.22
18	000333	美的集团	5,439,814.56	0.21
19	600104	上汽集团	5,399,715.55	0.21
20	000915	山大华特	5,285,978.42	0.20

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	739,484,788.03
卖出股票的收入（成交）总额	710,334,962.39

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,955,000.00	7.25
	其中：政策性金融债	29,955,000.00	7.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	189,360,000.00	45.81
6	中期票据	10,264,000.00	2.48
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	229,579,000.00	55.54

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	160304	16 进出 04	300,000	29,955,000.00	7.25
2	011698520	16 天士力 SCP004	300,000	29,874,000.00	7.23
3	011698494	16 华能新能 SCP004	300,000	29,874,000.00	7.23
4	011698522	16 华电 SCP017	300,000	29,874,000.00	7.23
5	011698934	16 首钢	300,000	29,868,000.00	7.23

		SCP005			

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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名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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1703	IC1703	-5.00	-6,080,400.00	-23,360.00	-
IF1703	IF1703	-7.00	-6,826,680.00	9,960.00	-
公允价值变动总额合计					-13,400.00
股指期货投资本期收益					-665,520.00
股指期货投资本期公允价值变动					-13,400.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值，符合既定投资政策及投资目标。

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	2,645,086.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,093,280.00
5	应收申购款	1,304.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,739,671.90

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

本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§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

份额级别	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
海富通养老收益混合 A	1,729	185,124.23	310,953,598.46	97.15%	9,126,197.31	2.85%
海富通养老收	3	5,363,737.0	16,091,130.83	100.00	80.33	0.00%

益混合 C		5		%		
合计	1,732	194,094.11	327,044,729.29	97.29%	9,126,277.64	2.71%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	海富通养老收益混合 A	77,900.10	0.0243%
	海富通养老收益混合 C	-	-
	合计	77,900.10	0.0232%

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	份额级别	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	海富通养老收益混合 A	0
	海富通养老收益混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通养老收益混合 A	0
	海富通养老收益混合 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通养老收益混合 A	海富通养老收益混合 C
基金合同生效日（2013 年 5 月 29 日）基金份额总额	850,399,612.86	-
本报告期期初基金份额总额	1,913,385,382.50	-
本报告期基金总申购份额	2,336,528.72	16,091,232.68
减：本报告期基金总赎回份额	1,595,642,115.45	21.52

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	320,079,795.77	16,091,211.16

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。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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 4 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	
国金证券	1	575,288,037.50	39.82%	305,649.05	35.92%	-
华创证券	1	256,573,209.67	17.76%	105,531.93	12.40%	-
天风证券	2	191,912,973.79	13.28%	138,267.69	16.25%	-
中信证券	2	153,081,081.89	10.60%	142,561.16	16.75%	-
银河证券	1	121,396,379.70	8.40%	62,070.05	7.29%	-
长江证券	1	91,734,070.72	6.35%	56,077.18	6.59%	-
中金公司	2	34,326,972.26	2.38%	31,968.11	3.76%	-
申万宏源	2	20,400,693.50	1.41%	8,799.08	1.03%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增渤海证券 1 个交易单元，天风证券 2 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
国金证券	-	-	353,000,000.00	16.85%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	30,000,000.00	1.43%	-	-
中信证券	-	-	160,000,000.00	7.64%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	740,672.00	6.87%	-	-	-	-
中金公司	9,176,553.60	85.17%	1,497,300,000.00	71.46%	-	-
申万宏源	856,672.50	7.95%	55,000,000.00	2.62%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司旗下基金 2015 年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-04
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-04
4	海富通基金管理有限公司关于因交易所发生指数熔断至收市调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-04
5	关于海富通养老收益混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-06
6	海富通基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券	2016-01-06

	的提示性公告	时报》	
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-06
8	海富通基金管理有限公司关于因交易所发生指数熔断至收市调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-08
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-13
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在宜信普泽投资顾问（北京）有限公司开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-13
11	海富通基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-20
12	海富通基金管理有限公司关于参加上海凯石财富基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-28
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-01-28
14	海富通基金管理有限公司关于参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-02
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-02
16	海富通基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-03
17	海富通基金管理有限公司关于参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-09
18	海富通基金管理有限公司关于参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-11
19	海富通基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-11
20	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京展恒基金销售股份有限公司为销售机构并实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-03-31

21	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-16
22	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-19
23	海富通养老收益混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-26
24	海富通基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-28
25	海富通养老收益混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-30
26	海富通基金管理有限公司关于参加深圳富济财富管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-30
27	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳富济财富管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-04-30
28	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-05-07
29	海富通基金管理有限公司关于官方淘宝店和网上直销支付宝渠道暂停办理基金开户、申购等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-05-17
30	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信期货有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-05-28
31	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在公司直销中心开展赎回费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-06
32	海富通基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-16
33	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华金证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-21
34	海富通养老收益混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-23
35	海富通基金管理有限公司关于参加浙江金观诚财富管理有限公司申购费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券	2016-06-23

	活动的公告	时报》	
36	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-23
37	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在官方京东店开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-28
38	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-06-30
39	海富通基金管理有限公司旗下基金 2016 年半年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-07-01
40	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销平台通联支付招商银行渠道申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-07-01
41	海富通基金管理有限公司关于参加上海大智慧财富管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-07-05
42	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧财富管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-07-05
43	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京广源达信投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-08-02
44	海富通基金管理有限公司关于参加北京广源达信投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-08-02
45	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-08-16
46	海富通基金管理有限公司关于参加北京汇成基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-08-16
47	海富通基金管理有限公司关于对网上直销平台海富通货币市场证券投资基金（金账户）转换为其他基金实行费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-08-30
48	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天风证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-09-02
49	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宏信证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-09-07

50	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-09-20
51	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金暂停在北京恒天明泽基金销售有限公司开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-10-18
52	海富通基金管理有限公司关于参加北京钱景财富投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-10-19
53	海富通基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-11-05
54	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-11-05
55	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-11-29
56	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增厦门市鑫鼎盛控股有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-11-30
57	海富通基金管理有限公司关于参加厦门市鑫鼎盛控股有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-11-30
58	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-12-05
59	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-12-07
60	海富通基金管理有限公司关于参加北京新浪仓石基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-12-07
61	海富通养老收益混合型证券投资基金第一次分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-12-15
62	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大同证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-12-21
63	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-12-22

64	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-12-27

§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。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准设立海富通养老收益混合型证券投资基金的文件

（二）海富通养老收益混合型证券投资基金基金合同

（三）海富通养老收益混合型证券投资基金招募说明书

（四）海富通养老收益混合型证券投资基金托管协议

（五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

（六）报告期内海富通养老收益混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36－37 层本基金管理人办公地址。

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日