

海富通欣益灵活配置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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

§ 1 重要提示及目录

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。

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

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

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

本报告期自 2016 年 9 月 7 日（基金合同生效日）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.....	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	20
§6 审计报告	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56

8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12	投资组合报告附注	56
§9	基金份额持有人信息	57
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§10	开放式基金份额变动	58
§11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4	基金投资策略的改变	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8	其他重大事件	61
§12	影响投资者决策的其他重要信息	62
§13	备查文件目录	63
13.1	备查文件目录	63
13.2	存放地点	63
13.3	查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣益混合	
基金主代码	519221	
交易代码	519221	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 7 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	499,220,253.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
下属分级基金的交易代码	519222	519221
报告期末下属分级基金的份 额总额	449,206,082.84 份	50,014,170.58 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,积极把握证券市场的投资机会,追求资产的保值增值。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心,首先按照投资时钟理论,根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段,作出权益类资产的初步配置,并根据投资时钟判断大致的行业配置;其次结合证券市场趋势指标,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。债券投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,在市场创新和变化中寻找投资机会,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式,确定和构造

	合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times 30\%$ + 中证全债指数收益率 $\times 70\%$
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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	陆志俊
	联系电话	021-38650891	95559
	电子邮箱	wrxj@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
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	上海市浦东新区银城中路188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	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		张文伟	牛锡明

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	上海市湖滨路 202 号普华永道

	(特殊普通合伙)	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 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日	
	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
本期已实现收益	5,190,103.48	640,031.27
本期利润	-1,125,043.44	-59,104.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0030	-0.0012
本期加权平均净值利润率	-0.29%	-0.12%
本期基金份额净值增长率	-0.10%	-0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
期末可供分配利润	-233,091.54	-59,174.42
期末可供分配基金份额利润	-0.0005	-0.0012
期末基金资产净值	448,972,991.30	49,954,996.16
期末基金份额净值	0.999	0.999
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	
	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
基金份额累计净值增长率	-0.10%	-0.10%

注：1、本基金合同生效日为 2016 年 9 月 7 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

2、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。

3、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。

4、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

1. 海富通欣益混合 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	-0.10%	0.12%	-0.73%	0.27%	0.63%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.11%	-1.18%	0.26%	1.08%	-0.15%

2. 海富通欣益混合 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④	①-③	②-④
过去三个月	-0.10%	0.13%	-0.73%	0.27%	0.63%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.12%	-1.18%	0.26%	1.08%	-0.14%

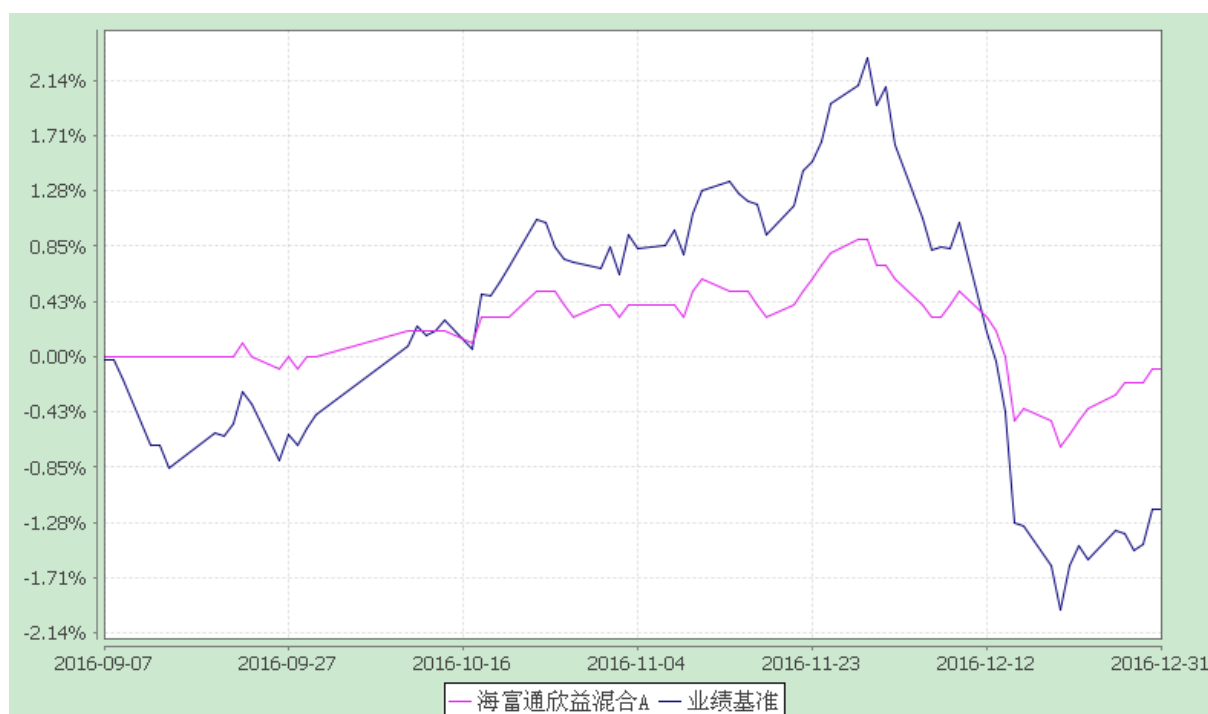
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

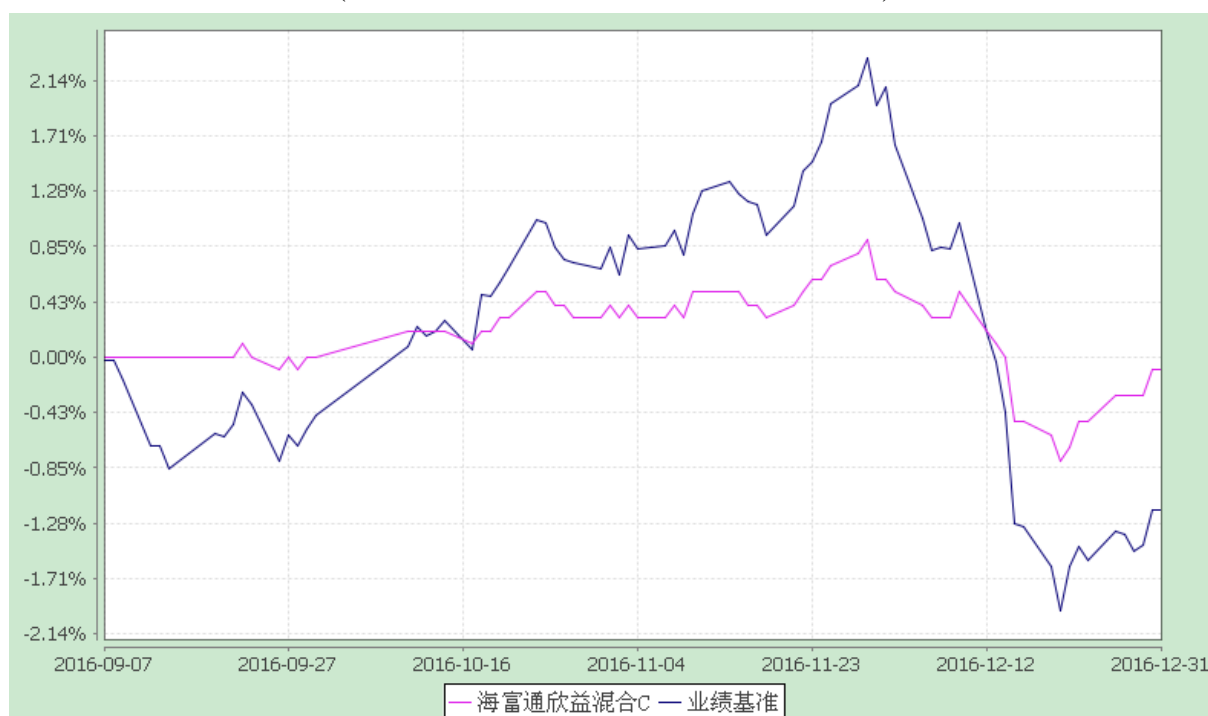
1. 海富通欣益混合 A

(2016 年 9 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日)



2. 海富通欣益混合 C

(2016 年 9 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日)



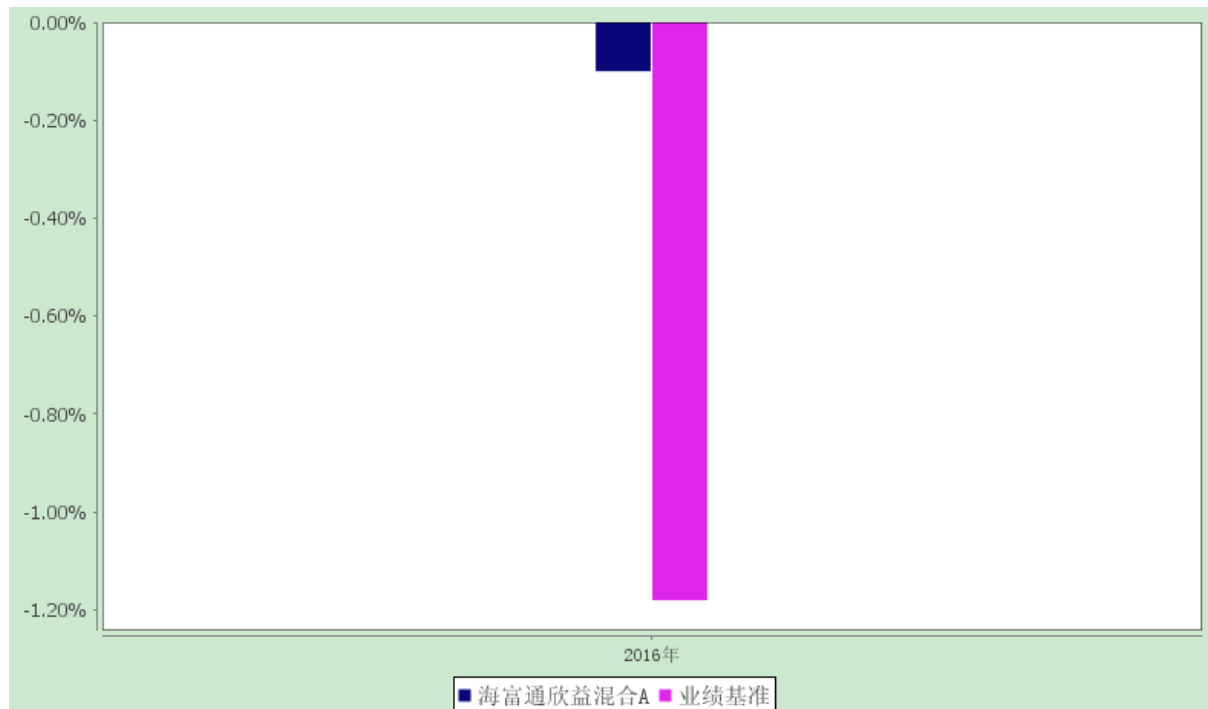
注：1、本基金合同于 2016 年 9 月 7 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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

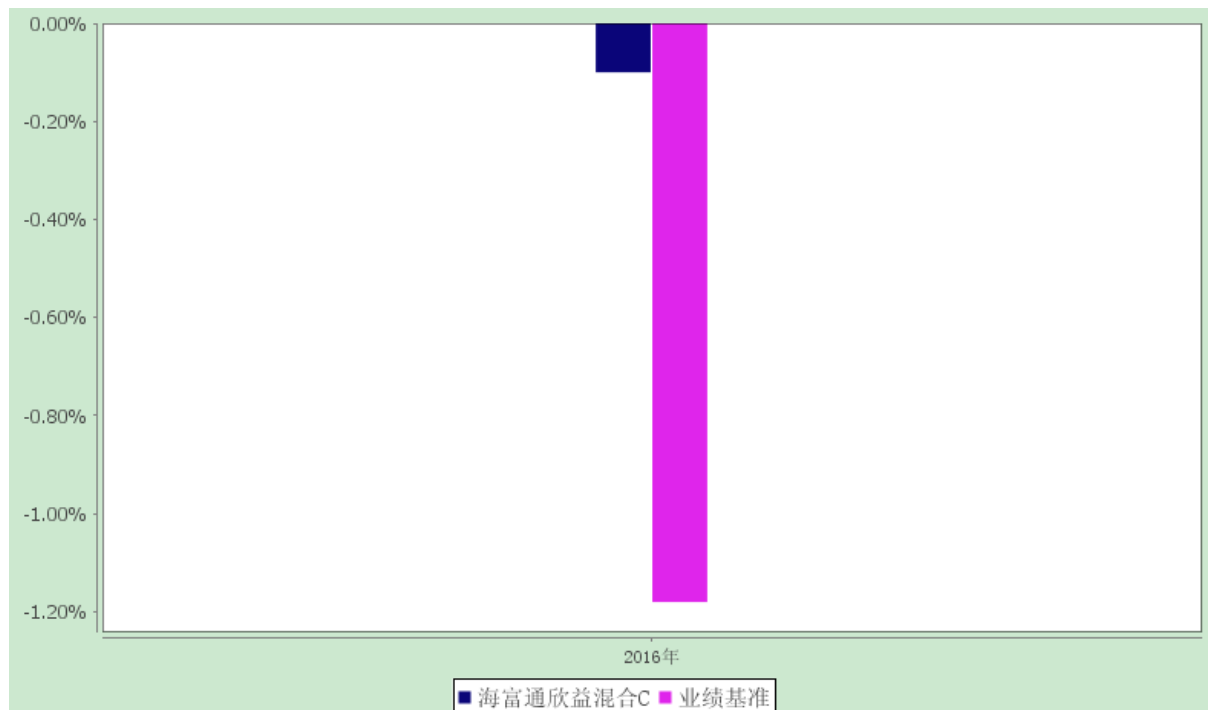
海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金

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. 海富通欣益混合 A



2. 海富通欣益混合 C



注：图中列示的 2016 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 9 月 7 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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

注：本基金合同于 2016 年 9 月 7 日生效，未实施利润分配。

§ 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		
陈甄璞	本基金的基金经理；海富通养老收益混合基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通东财大数据混合基金经理；量化投资部总监	2016-09-07	-	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工程师，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。
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；	2016-09-07	-	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

	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；海富通养老收益混合基金经理；海富通纯债债券基金经理；海富通聚利债券；海富通新内需混合基金经理；海富通欣荣混合基金经理				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。
--	--	--	--	--	--

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、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

就国内而言，2016 开年 A 股市场暴跌，沪指跌至年内最低点 2638.30 点。二季度呈现先扬后抑，随后震荡上行的行情。三季度沪指一路震荡上行，重回 3000 点，随后因监管趋严受到冲击，“史上最严借壳标准”令花样借壳走向穷途末路，沪指 3000 点得而复失，盘面维持窄幅震荡，投资情绪持续低迷，多个交易日振幅创新低。四季度市场一改低迷走势，沪指一度突破 3200 点，但年末债市经历了较大的调整，加之保监会出台了限制险资入主上市公司的措施，炒作资金降温，股市受到一定影响，12 月最终沪指下跌 4.50%，收于 3103.64 点，深圳成指跌 7.58%，收于 10177.14 点，中小板下跌 6.23%，创业板下跌 10.12%。

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

本基金在三季度末成立，四季度的 A 股市场继续维持震荡，大盘股先扬后抑，本基金及时抓住机会，精选大市值、低波动、高股息的股票，以提升股票组合业绩。

从债券市场看，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%。

本基金在三季度末成立，尽管债券部分建仓时已经采取了短久期、低仓位的策略，但还是在四季度的调整中受到损失。我们在债市调整中增加了部分仓位，总体依然保持短久期，低杠杆。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-0.10%，同期业绩比较基准收益率为-1.18%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.08 个百分点。本基金 C 类份额净值增长率为-0.10%，同期业绩比较基准收益率为-1.18%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.08 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

证券市场表现方面，2016 年大盘股显著跑赢小盘股，整个市场的风格主要是关注行

业基本面和公司业绩，我们预计 2017 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。

展望 2017 年，上证指数很有可能会继续维持震荡幅度，只要每次回调不突破下行平台，市场走势依然稳健，本基金将积极利用大盘股量化模型，结合情绪择时指标体系，努力抓住股票的结构性的上涨波段，合理控制股票债券配置比例，同时参与新股申购，努力为持有人提供稳定收益。

从债券市场看，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。

在 2017 年度，本基金会择机增加债券部分配置，以短久期为主，控制信用风险，适度提高杠杆，争取提高组合的配置收益，关注利率债的交易性机会，并配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、本基金本报告期内无应分配的收益。

二、已实施的利润分配:无。

三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016 年度,基金托管人在海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016 年度,海富通基金管理有限公司在海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 21996 号

海富通欣益灵活配置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欣益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“海富通欣益混合基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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欣益混合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，上述海富通欣益混合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，公允反映了海富通欣益混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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：海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	5,050,139.05
结算备付金		2,038,657.96
存出保证金		39,148.89
交易性金融资产	7.4.7.2	516,683,998.14
其中：股票投资		88,489,816.94
基金投资		-
债券投资		428,194,181.20
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		4,980,738.95
应收利息	7.4.7.5	5,857,112.79
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		534,649,795.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 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		35,000,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		118.46
应付管理人报酬		253,708.36
应付托管费		63,427.11
应付销售服务费		8,468.16
应付交易费用	7.4.7.7	225,195.58
应交税费		-
应付利息		890.36
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	170,000.29
负债合计		35,721,808.32
所有者权益:		-
实收基金	7.4.7.9	499,220,253.42
未分配利润	7.4.7.10	-292,265.96
所有者权益合计		498,927,987.46
负债和所有者权益总计		534,649,795.78

注：1.报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 499,220,253.42 份，其中海富通欣益混合基金 A 类份额 449,206,082.84 份，海富通欣益混合基金 C 类份额 50,014,170.58 份。A 类份额净值 0.999 元，C 类份额净值 0.999 元。

2.本基金合同成立于 2016 年 9 月 7 日，上年度可比期间无比较数据。

7.2 利润表

会计主体：海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		540,165.45
1.利息收入		3,817,620.29
其中：存款利息收入	7.4.7.11	289,184.78
债券利息收入		2,657,127.48
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		871,308.03
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,736,820.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,690,916.36
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
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	-
股利收益	7.4.7.16	45,904.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-7,014,282.49
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	7.29
减：二、费用		1,724,313.19
1. 管理人报酬		807,775.02
2. 托管费		201,943.82
3. 销售服务费		31,485.17
4. 交易费用	7.4.7.19	414,340.36
5. 利息支出		97,543.77

其中：卖出回购金融资产支出		97,543.77
6. 其他费用	7.4.7.20	171,225.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,184,147.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,184,147.74

注：本基金合同成立于 2016 年 9 月 7 日，上年度可比期间无比较数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	400,125,466.20	-	400,125,466.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,184,147.74	-1,184,147.74
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）	99,094,787.22	891,881.78	99,986,669.00
其中：1.基金申购款	99,107,076.35	891,963.62	99,999,039.97
2.基金赎回款	-12,289.13	-81.84	-12,370.97
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）	499,220,253.42	-292,265.96	498,927,987.46

注：本基金合同成立于 2016 年 9 月 7 日，上年度可比期间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 939 号《关于准予海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 400,035,458.76 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 400,125,466.20 份，其中认购资金利息折合 90,007.44 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是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)、权证、股指期货等权益类品种，债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等)，国债期货，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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基

准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。

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》、《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券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。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的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

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

数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。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

本基金每一类别的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)对于在锁定期内的非公开发行股票，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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(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。

(4)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。

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
活期存款	5,050,139.05
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	5,050,139.05

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	88,944,754.40	88,489,816.94	-454,937.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	55,905,530.79	54,866,181.20	-1,039,349.59
	银行间市场	378,847,995.44	373,328,000.00	-5,519,995.44
	合计	434,753,526.23	428,194,181.20	-6,559,345.03
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	523,698,280.63	516,683,998.14	-7,014,282.49	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产 / 负债。

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
应收活期存款利息	1,978.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	917.40
应收债券利息	5,854,199.62
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	17.60
合计	5,857,112.79

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

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
交易所市场应付交易费用	221,443.08
银行间市场应付交易费用	3,752.50
合计	225,195.58

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.29
预提费用	170,000.00
合计	170,000.29

7.4.7.9 实收基金

海富通欣益混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	350,101,283.31	350,101,283.31
本期申购	99,107,066.41	99,107,066.41
本期赎回（以“-”号填列）	-2,266.88	-2,266.88
本期末	449,206,082.84	449,206,082.84

海富通欣益混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	50,024,182.89	50,024,182.89
本期申购	9.94	9.94
本期赎回（以“-”号填列）	-10,022.25	-10,022.25
本期末	50,014,170.58	50,014,170.58

注：1. 本基金自 2016 年 8 月 29 日至 2016 年 9 月 1 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 400,035,458.76 元。根据《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 90,007.44 元在本基金成立后，折算为 90,007.44 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2016 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2016 年 11 月 17 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回业务自 2016 年 11 月 18 日起开始办理。

3. 申购含转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

7.4.7.10 未分配利润

海富通欣益混合 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
本期利润	5,190,103.48	-6,315,146.92	-1,125,043.44
本期基金份额交易产生的变动数	859,334.48	32,617.42	891,951.90
其中：基金申购款	859,356.49	32,607.07	891,963.56
基金赎回款	-22.01	10.35	-11.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,049,437.96	-6,282,529.50	-233,091.54

海富通欣益混合 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	640,031.27	-699,135.57	-59,104.30
本期基金份额交易产生的变动数	-75.69	5.57	-70.12
其中：基金申购款	0.08	-0.02	0.06
基金赎回款	-75.77	5.59	-70.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	639,955.58	-699,130.00	-59,174.42

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日
活期存款利息收入	84,688.00
定期存款利息收入	172,083.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30,314.22
其他	2,099.23

合计	289,184.78
----	------------

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日
卖出股票成交总额	107,978,389.92
减：卖出股票成本总额	104,287,473.56
买卖股票差价收入	3,690,916.36

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	45,904.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	45,904.00

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9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日
1.交易性金融资产	-7,014,282.49
——股票投资	-454,937.46
——债券投资	-6,559,345.03
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-7,014,282.49

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日
基金赎回费收入	7.29
合计	7.29

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日
交易所市场交易费用	411,315.36
银行间市场交易费用	3,025.00
合计	414,340.36

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	110,000.00
其他	400.00
银行划款手续费	825.05
合计	171,225.05

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	80,602,696.67	26.84%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易,上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
海通证券	51,919,930.79	92.87%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
海通证券	1,363,700,000.00	50.13%

7.4.10.1.5 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9月7日（基金合同生效日）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	74,781.65	27.03%	36,751.48	16.60%

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。

7.4.10.2 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9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	807,775.02

其中：支付销售机构的客户维护费	31.12
-----------------	-------

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月 31日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C	合计
交通银行	-	6.40	6.40
海富通基金	-	31,478.77	31,478.77
合计	-	31,485.17	31,485.17

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额对应的资产净值} \times 0.2\% \div \text{当年天数}。$$

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

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本报告期末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9月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,050,139.05	84,688.00

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末通过关联方购买其承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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
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
000042	中洲控股	2016-10-27	重大资产重组	20.24	-	-	1,700	33,303.00	34,408.00	-
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项	6.25	2017-01-26	6.29	70,000	455,272.22	437,500.00	-
000411	英特集团	2016-12-27	重大事项	22.10	2017-01-11	24.31	3,800	80,811.00	83,980.00	-
000540	中天城投	2016-11-28	重大资产重组	6.93	2017-01-03	7.00	90,800	596,302.00	629,244.00	-
002151	北斗星通	2016-11-16	重大资产重组	31.90	2017-01-12	31.00	1,000	31,629.00	31,900.00	-
300100	双林股份	2016-11-07	重大资产重组	34.00	2017-01-25	30.60	900	30,856.00	30,600.00	-
300513	恒泰实达	2016-10-31	重大资产重组	95.36	2017-02-24	86.18	300	28,200.00	28,608.00	-
600173	卧龙地产	2016-12-22	重大事项未公告	11.48	-	-	4,100	34,317.00	47,068.00	-
600855	航天长峰	2016-11-08	重大资产重组	28.89	-	-	1,000	28,910.00	28,890.00	-

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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 35,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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交通银行，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。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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
A-1	9,902,000.00
A-1 以下	-
未评级	184,010,181.20
合计	193,912,181.20

注：未评级部分为国债、金融债、短期融资券。

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
AAA	109,649,000.00
AAA 以下	124,633,000.00
未评级	-
合计	234,282,000.00

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的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持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，其余金融资产

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同约定到期日均为一个半月以内且不计息，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、卖出回购金融资产等。

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	5,050,139.05	-	-	-	5,050,139.05
结算备付金	2,038,657.96	-	-	-	2,038,657.96
存出保证金	39,148.89	-	-	-	39,148.89
交易性金融资产	193,912,181.20	234,282,000.00	-	88,489,816.94	516,683,998.14
应收证券清算款	-	-	-	4,980,738.95	4,980,738.95
应收利息	-	-	-	5,857,112.79	5,857,112.79
资产总计	201,040,127.10	234,282,000.00	-	99,327,668.68	534,649,795.78
负债					
卖出回购金融资产款	35,000,000.00	-	-	-	35,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	118.46	118.46

应付管理人报酬	-	-	-	253,708.36	253,708.36
应付托管费	-	-	-	63,427.11	63,427.11
应付销售服务费	-	-	-	8,468.16	8,468.16
应付交易费用	-	-	-	225,195.58	225,195.58
应付利息	-	-	-	890.36	890.36
其他负债	-	-	-	170,000.29	170,000.29
负债总计	35,000,000.00	-	-	721,808.32	35,721,808.32
利率敏感度缺口	166,040,127.10	234,282,000.00	-	98,605,860.36	498,927,987.46

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 -
	市场利率上升 25 个基点	减少约 143	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 144	-

注：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比例为基金总资产的 0%-95%，权证投资 0%-3%。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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	88,489,816.94	17.74
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	88,489,816.94	17.74

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 17.74%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 87,006,659.90 元，属于第二层次的余额为 429,677,338.24 元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃

日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额
无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	88,489,816.94	16.55
	其中：股票	88,489,816.94	16.55
2	固定收益投资	428,194,181.20	80.09
	其中：债券	428,194,181.20	80.09
	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	7,088,797.01	1.33
7	其他各项资产	10,877,000.63	2.03
8	合计	534,649,795.78	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	106,610.00	0.02
B	采矿业	1,408,334.00	0.28
C	制造业	29,382,395.19	5.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,324,507.00	1.27
E	建筑业	957,437.23	0.19
F	批发和零售业	3,473,602.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	4,549,927.00	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,352,245.32	0.47
J	金融业	27,579,720.60	5.53
K	房地产业	8,852,370.60	1.77
L	租赁和商务服务业	382,249.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	928,196.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	2,140,013.00	0.43
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	52,210.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	88,489,816.94	17.74

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	601398	工商银行	1,010,000	4,454,100.00	0.89
2	601939	建设银行	630,000	3,427,200.00	0.69
3	600036	招商银行	135,300	2,381,280.00	0.48
4	601318	中国平安	63,800	2,260,434.00	0.45

5	601607	上海医药	97,600	1,909,056.00	0.38
6	600643	爱建集团	129,960	1,612,803.60	0.32
7	600048	保利地产	151,800	1,385,934.00	0.28
8	000001	平安银行	150,000	1,365,000.00	0.27
9	601336	新华保险	31,000	1,357,180.00	0.27
10	000651	格力电器	50,000	1,231,000.00	0.25
11	000333	美的集团	40,000	1,126,800.00	0.23
12	000895	双汇发展	51,600	1,079,988.00	0.22
13	002304	洋河股份	15,000	1,059,000.00	0.21
14	600155	宝硕股份	70,000	1,047,900.00	0.21
15	600377	宁沪高速	120,000	1,026,000.00	0.21
16	002594	比亚迪	20,000	993,600.00	0.20
17	601166	兴业银行	60,000	968,400.00	0.19
18	600019	宝钢股份	150,000	952,500.00	0.19
19	601818	光大银行	240,000	938,400.00	0.19
20	601288	农业银行	300,000	930,000.00	0.19
21	601988	中国银行	270,000	928,800.00	0.19
22	600221	海南航空	249,400	813,044.00	0.16
23	600023	浙能电力	149,300	810,699.00	0.16
24	300017	网宿科技	15,000	804,150.00	0.16
25	601998	中信银行	120,000	769,200.00	0.15
26	000625	长安汽车	50,000	747,000.00	0.15
27	000709	河钢股份	200,000	668,000.00	0.13
28	000540	中天城投	90,800	629,244.00	0.13
29	600297	广汇汽车	68,100	582,936.00	0.12
30	000541	佛山照明	57,700	567,768.00	0.11
31	000999	华润三九	22,000	544,060.00	0.11
32	000539	粤电力 A	100,000	532,000.00	0.11
33	000550	江铃汽车	19,600	529,200.00	0.11
34	000926	福星股份	40,100	510,874.00	0.10
35	000002	万科 A	24,700	507,585.00	0.10
36	601088	中国神华	30,900	499,962.00	0.10
37	000863	三湘印象	58,700	498,363.00	0.10
38	600736	苏州高新	55,100	497,553.00	0.10
39	600688	上海石化	76,500	492,660.00	0.10
40	000656	金科股份	93,600	490,464.00	0.10
41	600708	光明地产	54,800	489,364.00	0.10
42	601898	中煤能源	84,200	489,202.00	0.10
43	601601	中国太保	17,600	488,752.00	0.10
44	601006	大秦铁路	69,000	488,520.00	0.10
45	600795	国电电力	153,600	486,912.00	0.10
46	600089	特变电工	53,300	486,629.00	0.10
47	000729	燕京啤酒	70,000	486,500.00	0.10
48	600325	华发股份	38,000	486,400.00	0.10

49	600077	宋都股份	89,000	485,940.00	0.10
50	601788	光大证券	30,300	484,497.00	0.10
51	600886	国投电力	72,600	484,242.00	0.10
52	601628	中国人寿	20,100	484,209.00	0.10
53	600578	京能电力	115,200	483,840.00	0.10
54	600022	山东钢铁	193,500	483,750.00	0.10
55	600642	申能股份	82,400	483,688.00	0.10
56	600011	华能国际	68,600	483,630.00	0.10
57	000667	美好置业	130,800	482,652.00	0.10
58	600027	华电国际	97,500	482,625.00	0.10
59	600016	民生银行	53,100	482,148.00	0.10
60	600030	中信证券	30,000	481,800.00	0.10
61	600376	首开股份	40,700	480,667.00	0.10
62	600808	马钢股份	169,800	480,534.00	0.10
63	000776	广发证券	28,500	480,510.00	0.10
64	601991	大唐发电	125,700	480,174.00	0.10
65	600029	南方航空	68,400	480,168.00	0.10
66	000089	深圳机场	60,000	480,000.00	0.10
67	002758	华通医药	16,100	477,204.00	0.10
68	600170	上海建工	100,700	476,311.00	0.10
69	002736	国信证券	30,600	475,830.00	0.10
70	600606	绿地控股	54,300	472,953.00	0.09
71	601618	中国中冶	99,900	465,534.00	0.09
72	601155	新城控股	39,600	465,300.00	0.09
73	000402	金融街	45,000	463,500.00	0.09
74	000883	湖北能源	100,000	458,000.00	0.09
75	601211	国泰君安	24,500	455,455.00	0.09
76	600674	川投能源	51,800	450,660.00	0.09
77	300405	科隆精化	9,700	449,692.00	0.09
78	600000	浦发银行	27,600	447,396.00	0.09
79	300141	和顺电气	19,000	444,410.00	0.09
80	300354	东华测试	18,000	439,200.00	0.09
81	600637	东方明珠	18,800	438,040.00	0.09
82	000166	申万宏源	70,000	437,500.00	0.09
83	000423	东阿阿胶	8,000	430,960.00	0.09
84	600593	大连圣亚	10,700	424,576.00	0.09
85	601899	紫金矿业	125,500	419,170.00	0.08
86	300389	艾比森	19,300	418,810.00	0.08
87	002015	霞客环保	46,800	412,308.00	0.08
88	601567	三星医疗	35,800	410,984.00	0.08
89	002693	双成药业	37,800	407,484.00	0.08
90	002553	南方轴承	33,100	407,130.00	0.08
91	600505	西昌电力	40,100	407,015.00	0.08
92	000880	潍柴重机	28,900	404,889.00	0.08

93	300422	博世科	9,900	403,227.00	0.08
94	300067	安诺其	46,100	396,460.00	0.08
95	300442	普丽盛	9,000	388,080.00	0.08
96	300023	宝德股份	20,300	382,249.00	0.08
97	600727	鲁北化工	35,800	380,554.00	0.08
98	300489	中飞股份	10,000	380,100.00	0.08
99	300321	同大股份	9,800	378,280.00	0.08
100	600561	江西长运	27,200	377,536.00	0.08
101	300394	天孚通信	11,600	375,492.00	0.08
102	603002	宏昌电子	56,400	374,496.00	0.08
103	300455	康拓红外	19,200	373,440.00	0.07
104	300239	东宝生物	46,100	372,488.00	0.07
105	300358	楚天科技	21,600	372,384.00	0.07
106	000502	绿景控股	17,398	368,837.60	0.07
107	002337	赛象科技	48,500	368,115.00	0.07
108	603223	恒通股份	10,900	367,657.00	0.07
109	300270	中威电子	24,100	366,079.00	0.07
110	000590	启迪古汉	18,500	363,525.00	0.07
111	300013	新宁物流	27,400	354,282.00	0.07
112	000069	华侨城 A	50,000	347,500.00	0.07
113	300259	新天科技	33,200	343,952.00	0.07
114	300437	清水源	14,200	336,682.00	0.07
115	300416	苏试试验	9,700	333,195.00	0.07
116	300396	迪瑞医疗	8,800	332,904.00	0.07
117	603311	金海环境	14,200	331,002.00	0.07
118	300390	天华超净	26,400	330,528.00	0.07
119	300445	康斯特	11,500	328,900.00	0.07
120	002757	南兴装备	8,000	328,240.00	0.07
121	300345	红宇新材	29,900	328,003.00	0.07
122	300464	星徽精密	18,000	326,340.00	0.07
123	300435	中泰股份	17,500	324,450.00	0.07
124	000978	桂林旅游	28,400	322,908.00	0.06
125	300419	浩丰科技	11,300	321,598.00	0.06
126	000430	张家界	26,300	321,123.00	0.06
127	603199	九华旅游	8,100	320,679.00	0.06
128	300492	山鼎设计	6,100	320,372.00	0.06
129	600858	银座股份	34,100	319,176.00	0.06
130	002776	柏堡龙	11,100	318,570.00	0.06
131	002771	真视通	4,503	317,191.32	0.06
132	600816	安信信托	13,300	314,146.00	0.06
133	300289	利德曼	24,800	308,760.00	0.06
134	600080	金花股份	24,500	307,720.00	0.06
135	600984	建设机械	34,600	302,404.00	0.06
136	601579	会稽山	20,600	294,168.00	0.06

137	002454	松芝股份	21,400	291,682.00	0.06
138	603606	东方电缆	18,900	290,682.00	0.06
139	002398	建研集团	21,300	289,254.00	0.06
140	600810	神马股份	28,000	288,120.00	0.06
141	601111	中国国航	22,600	162,720.00	0.03
142	000779	三毛派神	8,300	159,858.00	0.03
143	000421	南京公用	17,000	151,130.00	0.03
144	300444	双杰电气	4,900	117,600.00	0.02
145	603601	再升科技	7,200	115,848.00	0.02
146	002759	天际股份	4,500	112,185.00	0.02
147	300428	四通新材	4,500	111,465.00	0.02
148	300429	强力新材	3,400	108,800.00	0.02
149	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.02
150	002780	三夫户外	1,500	101,250.00	0.02
151	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.02
152	000411	英特集团	3,800	83,980.00	0.02
153	002766	索菱股份	2,200	82,478.00	0.02
154	002115	三维通信	7,800	82,134.00	0.02
155	300468	四方精创	1,400	77,798.00	0.02
156	000605	渤海股份	3,600	75,708.00	0.02
157	300440	运达科技	2,600	74,854.00	0.02
158	300218	安利股份	4,600	74,612.00	0.01
159	300481	濮阳惠成	2,200	73,260.00	0.01
160	002200	云投生态	3,100	72,602.00	0.01
161	300392	腾信股份	4,200	71,358.00	0.01
162	300398	飞凯材料	1,200	69,888.00	0.01
163	603936	博敏电子	2,200	69,674.00	0.01
164	300494	盛天网络	2,200	69,366.00	0.01
165	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
166	002421	达实智能	8,700	57,246.00	0.01
167	600419	天润乳业	1,000	57,010.00	0.01
168	601222	林洋能源	6,900	55,683.00	0.01
169	600007	中国国贸	3,200	55,264.00	0.01
170	300201	海伦哲	6,800	55,012.00	0.01
171	002303	美盈森	5,300	54,484.00	0.01
172	600452	涪陵电力	1,300	54,184.00	0.01
173	002410	广联达	3,700	54,020.00	0.01
174	300068	南都电源	2,800	53,956.00	0.01
175	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
176	002374	丽鹏股份	6,800	53,448.00	0.01
177	000070	特发信息	2,100	53,109.00	0.01
178	300133	华策影视	4,600	52,210.00	0.01
179	002471	中超控股	8,500	51,510.00	0.01
180	002036	联创电子	2,600	49,816.00	0.01

181	600173	卧龙地产	4,100	47,068.00	0.01
182	300210	森远股份	1,900	41,477.00	0.01
183	002246	北化股份	3,400	40,596.00	0.01
184	300306	远方光电	1,700	40,205.00	0.01
185	002507	涪陵榨菜	3,000	40,140.00	0.01
186	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.01
187	300061	康耐特	1,700	39,151.00	0.01
188	002593	日上集团	5,300	39,008.00	0.01
189	603699	纽威股份	2,300	38,732.00	0.01
190	300399	京天利	1,200	38,016.00	0.01
191	300119	瑞普生物	2,200	37,818.00	0.01
192	002225	濮耐股份	5,600	37,632.00	0.01
193	600889	南京化纤	2,700	35,505.00	0.01
194	002760	凤形股份	900	35,271.00	0.01
195	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
196	000042	中洲控股	1,700	34,408.00	0.01
197	600793	宜宾纸业	1,100	34,364.00	0.01
198	600965	福成股份	2,600	34,008.00	0.01
199	300161	华中数控	1,300	33,800.00	0.01
200	002151	北斗星通	1,000	31,900.00	0.01
201	300100	双林股份	900	30,600.00	0.01
202	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
203	600855	航天长峰	1,000	28,890.00	0.01
204	300513	恒泰实达	300	28,608.00	0.01
205	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
206	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
207	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	10,191,930.00	2.04
2	601939	建设银行	6,142,268.00	1.23
3	600036	招商银行	4,155,412.00	0.83
4	600048	保利地产	3,578,918.00	0.72
5	601318	中国平安	3,039,182.80	0.61
6	601336	新华保险	2,594,160.00	0.52
7	000776	广发证券	2,576,889.00	0.52
8	600030	中信证券	2,504,295.00	0.50

9	600377	宁沪高速	2,126,103.00	0.43
10	601688	华泰证券	2,064,425.87	0.41
11	000001	平安银行	2,046,000.00	0.41
12	000858	五 粮 液	2,016,235.00	0.40
13	600900	长江电力	2,011,500.00	0.40
14	000333	美的集团	2,009,103.00	0.40
15	600585	海螺水泥	2,005,700.00	0.40
16	000651	格力电器	1,980,000.00	0.40
17	600028	中国石化	1,968,000.00	0.39
18	601607	上海医药	1,936,065.00	0.39
19	600643	爱建集团	1,611,518.43	0.32
20	000895	双汇发展	1,180,866.20	0.24

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	5,531,720.00	1.11
2	601939	建设银行	3,031,000.00	0.61
3	600048	保利地产	2,335,488.00	0.47
4	000776	广发证券	2,310,514.43	0.46
5	600585	海螺水泥	2,220,626.00	0.45
6	600028	中国石化	2,146,000.00	0.43
7	000858	五 粮 液	2,105,520.00	0.42
8	600030	中信证券	2,007,756.94	0.40
9	601688	华泰证券	1,961,300.00	0.39
10	600900	长江电力	1,871,255.00	0.38
11	600036	招商银行	1,651,126.00	0.33
12	601336	新华保险	1,370,729.92	0.27
13	600887	伊利股份	1,190,858.00	0.24
14	600104	上汽集团	1,166,058.44	0.23
15	000600	建投能源	1,151,292.28	0.23
16	000338	潍柴动力	1,145,343.00	0.23
17	600208	新湖中宝	1,139,578.43	0.23
18	000661	长春高新	1,127,400.00	0.23
19	600377	宁沪高速	1,101,050.56	0.22
20	000963	华东医药	1,093,287.54	0.22

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	193,232,227.96
卖出股票的收入（成交）总额	107,978,389.92

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	4,470,181.20	0.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,966,000.00	4.00
	其中：政策性金融债	19,966,000.00	4.00
4	企业债券	50,396,000.00	10.10
5	企业短期融资券	169,476,000.00	33.97
6	中期票据	183,886,000.00	36.86
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	428,194,181.20	85.82

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	011698539	16 紫江 SCP005	400,000	39,892,000.00	8.00
2	101476001	14 贵州久联 MTN001	300,000	31,746,000.00	6.36
3	101458028	14 海宁资产 MTN001	300,000	31,389,000.00	6.29

4	101662022	16 三安 MTN001	300,000	30,519,000.00	6.12
5	122390	15 龙湖 01	300,000	30,378,000.00	6.09

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。

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

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

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

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

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内,本基金投资的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证券中，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	39,148.89
2	应收证券清算款	4,980,738.95
3	应收股利	-
4	应收利息	5,857,112.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,877,000.63

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

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
海富通欣益混合 A	191	2,351,864.31	449,184,786.67	100.00%	21,296.17	0.00%
海富通欣益混合 C	28	1,786,220.38	50,011,250.00	99.99%	2,920.58	0.01%
合计	219	2,279,544.54	499,196,036.67	100.00%	24,216.75	0.00%

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

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	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	海富通欣益混合 A	0
	海富通欣益混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣益混合 A	0
	海富通欣益混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 7 日）基金份额总额	350,101,283.31	50,024,182.89
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	99,107,066.41	9.94
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	2,266.88	10,022.25
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	449,206,082.84	50,014,170.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额（如有），总赎回份额含转换出份额（如有）。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2、2016 年度，因第四届董事会任期届满，经公司临时股东大会审议通过，同意张文伟、刘颂(Patrick LIU)、杨明、黄正红、陶乐斯(Ligia Torres)、黄金源(Alex NG Kim Guan)、郑国汉(Leonard K.Cheng)、巴约特(Marc Bayot)、杨国平、张馨担任公司第五届董事会董事，其中郑国汉(Leonard K.Cheng)、巴约特(Marc Bayot)、杨国平、张馨为独立董事。

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

4、2017 年 2 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第五届董事会第十次临时会议审议通过，同意刘颂先生辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长张文伟先生代为履行总经理职务，代为履行总经理职务的期限不超过 90 日。

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

本报告期内,本基金聘用普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 60,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	137,294,940.84	45.72%	125,117.18	45.23%	-
海通证券	2	80,602,696.67	26.84%	74,781.65	27.03%	-
兴业证券	2	75,041,749.86	24.99%	69,886.45	25.26%	-
长江证券	1	7,360,892.94	2.45%	6,855.26	2.48%	-

注：1、本基金本报告期新增江海证券、中金公司、长江证券、招商证券、华创证券、国金证券、中信建投、光大证券、平安证券、川财证券、华泰证券各一个交易单元,申万宏源、海通证券、东方证券、国泰君安、国元证券、兴业证券各两个交易单元。

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

公司业总裁办公会核准。

<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
招商证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	51,919,930.79	92.87%	1,363,700,000.00	50.13%	-	-
兴业证券	3,985,600.00	7.13%	391,600,000.00	14.40%	-	-
长江证券	-	-	965,000,000.00	35.47%	-	-

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	海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-08-24
2	海富通基金管理有限公司关于海富通欣	《中国证券报》、《上	2016-09-01

	益灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	海证券报》和《证券时报》	
3	海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-09-08
4	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
5	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
6	海富通欣益灵活配置混合证券投资基金暂停大额申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-11-15
7	海富通欣益灵活配置混合证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2016-11-15
8	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
9	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
10	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欣益灵活配置混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通欣益灵活配置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）报告期内海富通欣益灵活配置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