海富通大中华精选混合型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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:二〇一五年八月二十八日

1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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2015年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及有关规定,经基金管理人与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,本基金从2015年8月7日起由“海富通大中华精选股票型证券投资基金”更名为“海富通大中华精选混合型证券投资基金”。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	海富通大中华混合(QDII)
基金主代码	519602
交易代码	519602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月27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	107,046,228.03份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于在海外证券市场交易的大中华公司的优质股票,追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对全球宏观经济和大中华地区区域经济的基本面分析,采用自上而下的策略对资产进行有效资产配置;对股票的选择采用自下而上的“三站式”精选策略,挖掘定价合理,具备竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	MSCI金龙净总收益指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高风险水平的投资品种。同时,本基金投资的目标市场是海外市场,除了需要承担市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行(香港)有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	-2,258,279.82
本期利润	-14,642,965.65
加权平均基金份额本期利润	-0.1209
本期基金份额净值增长率	2.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0403
期末基金资产净值	102,732,871.76
期末基金份额净值	0.960

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-14.29%	2.76%	-4.33%	1.17%	-9.96%	1.59%
过去三个月	-0.52%	2.29%	4.54%	1.19%	-5.06%	1.10%
过去六个月	2.13%	1.77%	11.20%	0.97%	-9.07%	0.80%
过去一年	2.67%	1.39%	15.12%	0.89%	-12.45%	0.50%
过去三年	30.79%	1.10%	45.89%	0.87%	-15.10%	0.23%
自基金合同生效起至今	-4.00%	1.25%	17.88%	1.07%	-21.88%	0.18%

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

海富通大中华精选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历史走势对比图
(2011年1月27日至2015年6月30日)

注:1.按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(三)投资范围、(九)投资限制中规定的各项比例;
2.本基金按照全球投资表现标准(GIPS)计算和表述投资业绩。

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2015年6月30日,本基金管理人共管理32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、海富通精选或弓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、海富通风格灵活配置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、海富通现金管理货币市场基金、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、海富通双利分级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。

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		
杨铭	本基金的基金经理;海富通中国海外混合(QDII)基金经理;海富通资产管理(香港)有限公司大中华股票投资负责人	2011-01-27	-	17年	中国籍,特许金融分析师(CFA),经济学学士,持有基金从业人员资格证书。先后任职于海通证券证券经纪人上海分行、上海海监投资顾问有限公司,2004年4月加入海富通基金管理有限公司,任股票分析师,2008年6月至2010年1月任海富通中国海外混合(QDII)基金经理助理,2010年1月起任海富通中国海外混合(QDII)基金经理,2011年1月起任海富通大中华混合(QDII)基金经理,2014年1月起兼任海富通资产管理(香港)有限公司大中华股票投资负责人。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1公平交易制度的执行情况

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。

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。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、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)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,检验结果表明,在T日、T+3日和T+5日不同循环期内,不管是买入或是卖出,公司各组合间买卖价差不显著,表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待,不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.4.2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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

二零一五年上半年,全球经济增长减速,大宗商品价格低位波动,欧洲和日本的QE使美元汇率大涨后回落,美元利率走势的不确定性上升。中国政府继续以包括降准降息和地方债发行置换存内的宽松货币政策来应对疲慢下行的宏观经济,定义了经济“新常态”,同时提出了“互联网+”和“大众创业、万众创新”、地产政策的放松,亚投行和博鳌亚洲论坛推升“一带一路”,沪港通和深港通的预期等利好,令市场情绪上升,大小盘指数出现背离。进入6月份由于中国A股回调,希腊债务危机恶化,MERS威胁,半导体电子业前景转差,美元加息不确定性上升各个因素的综合作用,大中华股票大跌。上半年,新兴市场股市表现略好于发达市场股市,大中华股票表现好于新兴市场股市,其中的中国大陆股票表现最强,台湾股票最弱。

报告期内,本基金增加了股票仓位,主要增持了信息技术、工业和非日常生活消费品行业的配置,减持了金融、电信和能源行业的配置。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为2.13%,同期业绩比较基准收益率11.20%,基金净值跑输业绩比较基准9.07个百分点。跑输基准主要是因为四、五月表现好的信息技术和工业行业等重仓股票受到六月起大幅回调的负面影响。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二零一五年下半年,我们认为美元加息预期将明朗化,欧洲和日本宽松的货币政策依然。中国政府有望继续延续既有的货币政策和财政政策,宏观经济转触底企稳,无风险利率有望继续下行。我们关注的重大事件包括美联储加息时点的不确定性,国企改革顶层设计的出台,深港通和资本项目的开放进程,证券法的修订进度,以及国内A股的企稳、中国政府坚定改革和转型是最大的背景,将进一步增强市场的长期信心,市场对于政策改革和结合改革的预期会越来越高。沪港通和深港通开通后估值相对A股非常便宜的海外中国股票将提供很多投资机会。就市场而言,公司业绩增速企稳,大中华股票的整体估值仍处于偏低水平。因此,下半年市场将会处于一个震荡盘升格局,且结构性机会很多。

对于二零一五年下半年的市场判断,我们持谨慎乐观的态度。我们将继续密切关注国内外宏观经济形势和政策的变化,在投资上我们将灵活应对经济形势和市场的变化,灵活调整仓位和持仓结构,结合沪港通和深港通的进展,坚持深入挖掘估值合理且业绩增长较为确定的中小型成长股以期获取超额收益,对受益于中国改革和民生政策扶持、新技术的投资和消费、内需拉动和经济转型两岸三地经济加速融合的行业和公司,加深个股的基本面研究。

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,估值工作小组经分析取相关部门的建议,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。

本基金采用彭博(bloomberg)咨询系统提供的价格估值。

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

本报告期内,本基金自2015年1月20日至2015年4月9日,连续54个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

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”)在对海富通大中华精选混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守了《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 托管人对本半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半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:海富通大中华精选混合型证券投资基金
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	13,095,756.75	27,164,438.31
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	89,502,074.48	50,009,755.35
其中:股票投资		89,502,074.48	50,009,755.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资			
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		399,728.02	-
应收利息	6.4.7.5	5,387.04	3,654.43
应收股利		1,224,739.15	29,904.57
应收申购款		1,207,182.37	10,020,848.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		105,434,867.81	87,228,601.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,902,725.06
应付赎回款		2,179,776.17	296,330.41
应付管理人报酬		252,104.56	84,267.33
应付托管费		42,017.43	14,044.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	228,097.89	286,166.13
负债合计		2,701,996.05	6,583,533.47
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	107,046,228.03	85,787,674.19
未分配利润	6.4.7.10	-4,313,356.27	-5,142,606.45
所有者权益合计		102,732,871.76	80,645,067.74
负债和所有者权益总计		105,434,867.81	87,228,601.21

注:1.报告截止日2015年6月30日,基金份额净值0.960元,基金份额总额107,046,228.03份。
2.本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体:海富通大中华精选混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		-11,961,482.62	2,054,883.70
1.利息收入		37,581.06	3,490.81
其中:存款利息收入	6.4.7.11	37,581.06	3,490.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,005,244.95	4,903,397.82
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-754,747.68	4,411,643.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益			
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,759,992.63	491,754.30
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-12,384,685.83	-2,890,933.14
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-890,503.05	37,324.11
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	270,880.25	1,604.10
减:二、费用		2,681,483.03	912,263.13
1. 管理人报酬		1,101,584.47	466,786.15
2. 托管费		183,597.43	77,797.70
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,191,370.12	178,280.68
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	204,931.01	189,398.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-14,642,965.65	1,142,620.57
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-14,642,965.65	1,142,620.57

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通大中华精选混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30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)	85,787,674.19	-5,142,606.45	80,645,067.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,642,965.65	-14,642,965.65
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)	21,258,553.84	15,472,215.83	36,730,769.67
其中:1.基金申购款	251,805,135.58	22,665,603.04	274,470,738.62
2.基金赎回款	-230,546,581.74	-7,193,387.21	-237,739,968.95
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)	107,046,228.03	-4,313,356.27	102,732,871.76
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	69,156,237.47	-5,629,750.68	63,526,486.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,142,620.57	1,142,620.57
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)	-18,785,081.74	1,220,353.96	-17,564,727.78
其中:1.基金申购款	1,105,065.00	-73,062.19	1,032,002.81
2.基金赎回款	-19,890,146.74	1,293,416.15	-18,596,730.59
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)	50,371,155.73	-3,266,776.15	47,104,379.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:刘颖,主管会计工作负责人:陶网雄,会计机构负责人:胡正万

6.4 报表附注

6.4.1基金基本情况

海富通大中华精选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证监许可[2010]1760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《海富通大中华精选混合型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币821,474,865.11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(2011)第15号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》于2011年1月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为821,766,293.97份基金份额,其中认购资金利息折合291,428.86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。境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司,境外投资顾问。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金(ETF)等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以全球除内地股票市场以外的具有“大中华概念”上市公司为主要投资对象。“大中华概念”的股票需满足以下三个条件之一:1)上市公司注册在大中华区域(中国内地、香港、台湾、澳门);2)上市公司中最少百分之三十股权(占总股本)由大中华区域的股东持有;3)公司最近一个会计年度至少百分之五十之营业额来自大中华区域。本基金的投资比例为:股票及其他权益类证券占基金资产的60%-95%,现金、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,其中基金保留的现金的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:MSCI金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

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2015年8月27日批准报出。

6.4.2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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年上半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2015年6月30日的财务状况以及2015年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5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。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税应税范围,不征收营业税。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外资产托管人
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
海通国际证券集团有限公司(“海通国际证券”)	海通证券间接控股子公司

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通国际证券	17,510,747.62	3.59%	-	-

6.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,101,584.47	466,786.15
其中:支付销售机构的客户维护费	266,905.95	232,223.60

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1.8%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 1.8% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	183,597.43	77,797.70

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0.30%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 0.30% / 当年天数。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
报告期初持有的基金份额	17,299,884.66	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,299,884.66	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.16%	-

注:基金管理人海富通基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托海富通直销机构办理,适用费率为人民币1,000元/笔。

6.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	1,878,837.80	26,687.08	592,490.12	3,488.63
中银香港	11,216,912.90	-	2,885,262.89	-

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管,其中由中国银行保管的银行存款按适用利率计息,由中银香港保管的银行存款不计息。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2期末持有的暂时性停牌等流通受限股票

本基金本期末持有暂时停牌等流通受限证券。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7投资组合报告

7.1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	89,502,074.48	84.89
	其中:普通股	89,502,074.48	84.89
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,095,756.75	12.42
8	其他各项资产	2,837,036.58	2.69
9	合计	105,434,867.81	100.00

7.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	89,502,074.48	87.12
合计	89,502,074.48	87.12

注:国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定;ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	30,778,916.39	29.96
工业	21,779,493.99	21.20
金融	15,765,197.14	15.35
非日常生活消费品	9,377,464.04	9.13
原材料	7,775,666.99	7.57
医疗保健	3,141,531.24	3.06
日常消费品	637,789.91	0.62
公共事业	246,014.78	0.24
合计	89,502,074.48	87.12

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Cowell e Holdings Inc.	高伟电子控股有限公司	1415 HK	香港交易所	中国香港	1,245,000	7,020,009.07	6.83
2	Kingdee International Software Group Company Limited	金蝶国际软件集团有限公司	268 HK	香港交易所	中国香港	1,639,000	5,971,496.87	5.81
3	Wisdom Holdings Group	智美控股集团	1661 HK	香港交易所	中国香港	1,120,500	5,381,352.41	5.24
4	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	香港交易及结算所有限公司	388 HK	香港交易所	中国香港	24,900	5,372,516.03	5.23
5	China High Speed Transmission Equipment Group Co., Ltd.	中国高速传动设备集团有限公司	658 HK	香港交易所	中国香港	996,000	5,286,115.92	5.15
6	Sinosoft Technology Group Limited	中国擎天软件科技集