海富通中小盘混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一六年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中小盘混合
基金主代码	519026
交易代码	519026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
报告期末基金份额总额	193,212,822.57份
投资目标	本基金通过投资于具有高成长潜力和良好基本面的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等，对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控，在投资范围内确定相应大类资产配置比例；其次通过对行业及个股进行定量与定性相结合的分析，精选具有良好基本面和成长潜力的中小盘上市公司进行投资。
业绩比较基准	基金业绩比较基准＝中证700指数×80%＋上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2015年10月1日-2015年12月31日）
1.本期已实现收益	21,621,420.75
2.本期利润	50,473,805.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.2543
4.期末基金资产净值	239,366,592.59
5.期末基金份额净值	1.239

注：（1）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；（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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

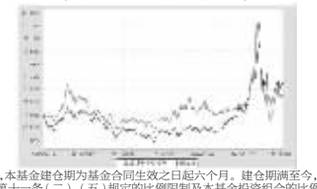
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	25.03%	2.58%	18.19%	1.63%	6.84%	0.95%

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

海富通中小盘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

（2010年4月14日至2015年12月31日）



注：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。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十一条（二）、（五）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄峰	本基金的基金经理；海富通内需热点混合基金经理；海富通股票混合基金经理；海富通领先成长混合基金经理	2014-12-17	-	5年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任大公国际资信评估公司信用分析师，深圳九届投资顾问有限公司项目部负工，大连碧才岛渔业集团股份有限公司证券部负责人，证券事务代表，华创证券有限责任公司研究所高级研究员，2011年5月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师，基金经理助理，2014年12月起担任海富通股票混合、海富通中小盘混合、海富通内需热点混合和海富通领先成长混合的基金经理。

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为：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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年是后三个月，市场总算给投资者一个安慰。

在A股历史中，2015年注定是不平凡的一年，一、二季度，股指单边向上，直冲5178.19高点；三季度在去杠杆压力下，市场恐怖下跌，千股涨停后又现千股跌停，创下全年2850.71低点；四季度，市场热点密集轮动，政策扶植不断，三个月上证综指上涨15.93%，深证成指上涨26.80%。

虽然，2015年整个市场形势严峻，投资者被“过山车”式的上涨下跌“颠”的晕眩，但第四季度，次新股、传感器、芯片国产化、虚拟现实、智能穿戴、大数据等热点概念涨幅居前，对市场人气恢复起到了极大作用。

央行6次降息降准，市场流动性宽裕，再加上“资产荒”，使得全年股票市场仍有不俗表现。全年来看，上证综指上涨9.41%，报收3539.18点，深证成指上涨14.98%，报收12664.89点。而被认为是中国未来经济转型方向的中小创表现良好，中小板指全年上涨63.70%，报收8393.83点。创业板指全年上涨84.41%，报收2714.5点。就中信证券行业指数来看，传媒、计算机、轻工制造、通信、机械、电子元器件等涨幅都翻了一番。而传统行业，诸如银行、非银行金融、煤炭等涨幅殿后，不足10%。

四季度，季度初期本基金进一步加仓至高位水平，相比三季度更为乐观，大幅降低的御类资产的配置比例，增加创新转型类、改革类等高弹性资产的配置，并尝试加大精选力度、提高持股集中度。12月下旬开始迅速降低仓位至偏低水平。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为25.03%，同期业绩比较基准收益率为18.19%，基金净值跑赢业绩比较基准6.84个百分点。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济预计短期不会有太大的波动。在汽车、房地产政策的拉动下，在货币政策持续宽松的滞后影响下，预计宏观经济仍可在缓弱中保持相对平稳。展望2016年，供给侧改革、人民币汇率将成为关注的焦点，货币政策在保持宽松的同时进一步宽松的空间有限，这使得宏观经济依然处于挑战与机遇并存的调整震荡期。

2015年成长、转型股表现突出，这与2014年大盘蓝筹股的独领风骚形成了鲜明对比。但综合来看，过去几年股市的总收益还是相当惊人的，这给2016年的操作带来了不小的难度。面临新一年宏观经济、汇率、货币政策、注册制等一系列不确定因素，在相对偏高的估值水平下，预计新的一年股市预期收益不会太高，降低收益目标、注意节奏把握、注意结构分化将是操作的重点。

2016年一季度，本基金将伺机适度提高仓位，重点关注改革类产的投资机会，重点关注创新型资产中商业模式真正落地带来的投资机会。关注阶段性超跌资产的修复性机会，并适度增加交易性操作。另外，市场风格方面，2016年是否会发生大的变化，是一季度需要重点关注的课题。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	176,567,559.62	70.38
	其中：股票	176,567,559.62	70.38
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	70,408,669.38	28.06
7	其他资产	3,904,605.88	1.56
8	合计	250,880,834.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	217,689.55	0.09
C	制造业	113,261,000.02	47.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,412,163.71	24.82
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,391,979.52	1.42
L	租赁和商务服务业	284,726.82	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	176,567,559.62	73.76

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600562	国睿科技	370,578	23,046,245.82	9.63
2	002657	中科金财	244,022	19,519,319.78	8.15
3	002544	杰赛科技	304,137	12,597,354.54	5.26
4	600990	四创电子	118,807	9,817,022.41	4.10
5	300078	思创医惠	190,800	9,311,040.00	3.89
6	600855	航天长峰	202,000	8,015,360.00	3.35
7	002026	山东威达	440,600	7,763,372.00	3.24
8	002368	太极股份	107,400	7,206,540.00	3.01
9	300359	全通教育	78,080	6,724,249.60	2.81
10	600343	航天动力	237,890	6,082,847.30	2.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的四创电子（600990）于2015年12月23日因公司办理股票停牌及延期复牌事项不审慎、停牌期间的信息披露不充分，上海证券交易所予以公司及董事会秘书通报批评的处分。2015年12月25日，公司董事长因同样原因被上海证券交易所予以监管关注。

对该股票的投资决策程序的说明：公司通过市场快速扩张助推销售及业绩增长，并持续保持在雷达电子领域的领先优势。同时，得益于科研院所改制，公司作为大股东中电38所旗下唯一上市公司，未来存在资产注入预期，且大股东营收规模为公司6倍，资产优质，注入后有望极大增厚公司业绩。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	656,393.68
2	应收证券清算款	2,980,239.98
3	应收股利	-
4	应收利息	9,579.79
5	应收申购款	258,392.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,904,605.88

5.11.4报告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。

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002544	杰赛科技	12,597,354.54	5.26	重大资产重组
2	600990	四创电子	9,817,022.41	4.10	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	201,084,228.93
本报告期基金总申购份额	17,493,800.14
减：本报告期基金总赎回份额	25,365,206.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	193,212,822.57

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8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32只公募基金。截至2015年12月31日，海富通管理的公募基金资产规模超过469亿元人民币。

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2015年12月31日，海富通为近80家企业超过349亿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2015年12月31日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过103亿元。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有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。

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2015年12月31日，投资咨询及海外业务规模超过111亿元人民币。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，能够在香港募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。

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。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

（一）中国证监会批准设立海富通中小盘混合型证券投资基金的文件

（二）海富通中小盘混合型证券投资基金基金合同

（三）海富通中小盘混合型证券投资基金招募说明书

（四）海富通中小盘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）报告期内海富通中小盘混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2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。

9.3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

二〇一六年一月二十一日

海富通中证100 指数证券投资基金（LOF）

【2015】第四季度报告

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：二〇一六年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中证100 指数（LOF）
场内简称	海富100
基金主代码	162307
交易代码	162307
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月30日
报告期末基金份额总额	148,383,172.02份
投资目标	采用指数化投资方式，通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段，控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度，实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证100指数×95%＋活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2015年10月1日-2015年12月31日）
1.本期已实现收益	3,778,849.30
2.本期利润	20,548,947.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.1311
4.期末基金资产净值	160,203,857.90
5.期末基金份额净值	1.080

注：（1）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。（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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

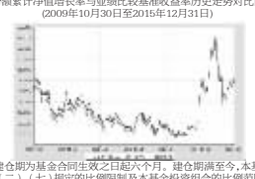
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.56%	1.48%	13.54%	1.51%	0.02%	-0.03%

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

海富通中证100 指数证券投资基金（LOF）

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

（2009年10月30日至2015年12月31日）



注：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。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十五条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘璎	本基金的基金经理；海富通上证周期ETF基金经理；海富通上证周期ETF联接基金经理；海富通上证非周期ETF联接基金经理；海富通上证非周期ETF基金经理；海富通中证内地低碳指数基金经理；指数投资部指数投资负责人	2012-01-20	-	14年	管理学硕士，持有基金从业人员资格证书。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司，曾任华安上证180ETF基金经理助理；2007年3月至2010年2月担任华安上证180ETF基金经理助理；2007年3月至2010年6月担任华安中证A股300指数基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司，2010年11月起任海富通上证非周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理。2012年1月起兼任海富通中证100指数（LOF）基金经理。2012年5月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。2013年10月起任指数投资部指数投资负责人。

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 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 公平交易专项说明

4.3.1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。

4.3.2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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年是后三个月，市场总算给投资者一个安慰。

在A股历史中，2015年注定是不平凡的一年，一、二季度，股指单边向上，直冲5178.19高点；三季度在去杠杆压力下，市场恐怖下跌，千股涨停后又现千股跌停，创下全年2850.71低点；四季度，市场热点密集轮动，政策扶植不断，三个月上证综指上涨15.93%，深证成指上涨26.80%。

虽然，2015年整个市场形势严峻，投资者被“过山车”式的上涨下跌“颠”的晕眩，但第四季度，次新股、传感器、芯片国产化、虚拟现实、智能穿戴、大数据等热点概念涨幅居前，对市场人气恢复起到了极大作用。

央行6次降息降准，市场流动性宽裕，再加上“资产荒”，使得全年股票市场仍有不俗表现。全年来看，上证综指上涨9.41%，报收3539.18点，深证成指上涨14.98%，报收12664.89点。而被认为是中国未来经济转型方向的中小创表现良好，中小板指全年上涨63.70%，报收8393.83点。创业板指全年上涨84.41%，报收2714.5点。就中信证券行业指数来看，传媒、计算机、轻工制造、通信、机械、电子元器件等涨幅都翻了一番。而传统行业，诸如银行、非银行金融、煤炭等涨幅殿后，不足10%。

报告期间，本基金完成了年末的指数成份股调整。作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为13.56%，同期业绩比较基准收益率为13.54%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济预计短期不会有太大的波动。在汽车、房地产政策的拉动下，在货币政策持续宽松的滞后影响下，预计宏观经济仍可在缓弱中保持相对平稳。展望2016年，供给侧改革、人民币汇率将成为关注的焦点，货币政策在保持宽松的同时进一步宽松的空间有限，这使得宏观经济依然处于挑战与机遇并存的调整震荡期。

2015年成长、转型股表现突出，这与2014年大盘蓝筹股的独领风骚形成了鲜明对比。但综合来看，过去几年股市的总收益还是相当惊人的，这给2016年的操作带来了不小的难度。面临新一年宏观经济、汇率、货币政策、注册制等一系列不确定因素，在相对偏高的估值水平下，预计新的一年股市预期收益不会太高，降低收益目标、注意节奏把握、注意结构分化将是操作的重点。

2016年一季度，本基金将伺机适度提高仓位，重点关注改革类产的投资机会，重点关注创新型资产中商业模式真正落地带来的投资机会。关注阶段性超跌资产的修复性机会，并适度增加交易性操作。另外，市场风格方面，2016年是否会发生大的变化，是一季度需要重点关注的课题。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	150,288,346.44	93.40
	其中：股票	150,288,346.44	93.40
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,677,279.04	6.01
7	其他资产	950,143.60	0.59
8	合计	160,915,769.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	4,676,152.74	2.92
C	制造业	38,986,234.56	24.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,888,955.80	3.68
E	建筑业	6,755,315.53	4.22
F	批发和零售业	1,478,787.15	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	3,781,491.51	2.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,977,736.55	3.11
J	金融业	75,369,018.78	47.05
K	房地产业	7,215,530.62	4.50
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	777,163.20	0.49
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	381,960.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	150,288,346.44	93.81

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	257,709	9,277,524.00	5.79
2	600016	民生银行	742,007	7,152,947.48	4.46
3	601166	兴业银行	363,612	6,206,856.84	3.87
4	000002	万 科A	196,114	4,791,065.02	2.99
5	600036	招商银行	255,263	4,592,181.37	2.87
6	600000	浦发银行	242,970	4,439,061.90	2.77
7	600030	中信证券	199,994	3,869,883.90	2.42
8	601328	交通银行	582,633	3,752,156.52	2.34
9	601288	农业银行	958,344	3,095,451.12	1.93
10	601766	中国中车	229,571	2,949,987.35	1.84

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的上海电气（601727）的公司董事长黄迪南于2015年3月13日因信息披露违规被上交所公告予以监管关注。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金系指数型基金，对该股票的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	136,008.22
2	应收证券清算款	797,967.83
3	应收股利	-
4	应收利息	2,256.78
5	应收申购款	13,910.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	950,143.60

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况的说明

5.11.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	160,655,947.03
本报告期基金总申购份额	2,279,189.08
减：本报告期基金总赎回份额	14,551,964.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	148,383,172.02

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8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32只公募基金。截至2015年12月31日，海富通管理的公募基金资产规模超过469亿元人民币。

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2015年12月31日，海富通为近80家企业超过349亿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2015年12月31日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过103亿元。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有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。

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2015年12月31日，投资咨询及海外业务规模超过111亿元人民币。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