

## 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

\$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、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。  
基金托管人和报告编制机构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。  
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，但不保证本基金一定盈利。  
本基金过往业绩并不代表其未来表现。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。  
本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

\$2 基金产品概况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A 农林、牧、渔业		568,662.00	0.15
B 制造业		3,601,808.00	0.93
C 制造业		33,604,076.24	8.67
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		2,162,512.00	0.56
E 建筑业		5,270,201.77	1.36
F 批发和零售业		1,030,500.00	0.27
G 交通运输、仓储和邮政业		1,813,328.00	0.47
H 餐饮和住宿业		-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业		2,224,166.80	0.57
J 金融业		38,854,753.00	10.02
K 房地产业		3,982,766.86	1.03
L 机器设备、文具及汽车修理业		469,794.00	0.12
M 科学研究、技术服务业		-	-
N 水利、环境和公共设施管理业		1,398,421.00	0.36
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		194,190.00	0.05
S 综合		-	-
合计		95,175,179.67	24.54

6.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名股票投资明细

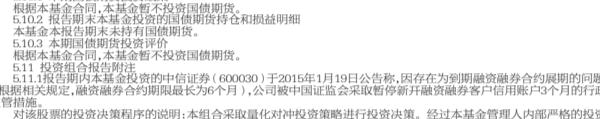
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	100,000	8,194,000.00	2.11
2	600016	民生银行	500,000	4,970,000.00	1.28
3	600030	中信证券	151,200	4,068,792.00	1.05
4	600048	保利地产	332,033	3,791,816.86	0.98
5	600066	招商银行	200,000	3,744,000.00	0.97
6	601166	兴业银行	215,400	3,715,650.00	0.96
7	600000	浦发银行	206,100	3,529,376.00	0.91
8	600887	伊利股份	173,710	3,283,119.00	0.85
9	601666	中国太保	176,632	3,241,127.52	0.84
10	601328	交通银行	363,503	2,995,240.00	0.77

6.3.1 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	100,000	8,194,000.00	2.11
2	600016	民生银行	500,000	4,970,000.00	1.28
3	600030	中信证券	151,200	4,068,792.00	1.05
4	600048	保利地产	332,033	3,791,816.86	0.98
5	600066	招商银行	200,000	3,744,000.00	0.97
6	601166	兴业银行	215,400	3,715,650.00	0.96
7	600000	浦发银行	206,100	3,529,376.00	0.91
8	600887	伊利股份	173,710	3,283,119.00	0.85
9	601666	中国太保	176,632	3,241,127.52	0.84
10	601328	交通银行	363,503	2,995,240.00	0.77

6.3.2 自基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年11月20日至2015年6月30日)



注:1)本基金业绩比较基准不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期收入扣减期间费用后的余额,扣减相关费用后的余额。

本期利润为本期收入加上本期已实现收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内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(%) 净值增长 率标准差 (%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 10.69% 0.75% 9.89% 0.01% 9.80% 0.74%

3.2.2 自基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年11月20日至2015年6月30日)



注:1)本基金于2014年11月20日生效,截至报告期末本基金尚未满一年,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条(二)之投资限制。(四)投资限制中规定的各项比例。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理)简介

姓名 职务 任本基金的基金 经理期限 离任日期 说明

陈晓祺 本基金的基金 经理,海富通阿尔 法对冲混合型发起式证 券投资基金的基金经理 2014-11-20 - 7年

注:1)本基金的原基金经理,其任期自2014年11月20日起至2015年6月30日止,离任日期即公司做出决定之日起;非首任基金经理,其任期即原基金经理离任之日起至新任基金经理到任之日止。

2)承认对基金的申报材料、书面声明文件等的真实性、准确性和完整性承担责任。

3)报告期内本基金运作符合法律法规的规定。

4)管理人根据法律法规及基金合同的规定,本着谨慎原则勤勉尽责地管理和运用基金资产,不发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对宏观经济的分析

报告期末,本基金管理人对宏观经济的分析请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.3 公司内部管理情况

报告期末,本公司根据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上公平交易制度和风险管理流程,并按照《关于发布证券期货经营机构管理人员公平交易行为规范的通知》的要求,对公司的投资交易行为进行控制,确保公平交易制度的执行和规范运行。

4.4 报告期内基金的投资策略

报告期末,本公司根据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上公平交易制度和风险管理流程,并按照《关于发布证券期货经营机构管理人员公平交易行为规范的通知》的要求,对公司的投资交易行为进行控制,确保公平交易制度的执行和规范运行。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期末,本基金净值增长率为10.69%,同期业绩比较基准收益率为9.80%。百分点。

4.6 报告期内基金的估值政策

本基金的估值政策遵循《证券投资基金会计核算办法》的规定,在估值方法方面,本基金采用成本法估值,即在估值时以买入成本扣除相关费用后的金额作为买入成本,卖出时以卖出金额扣除相关费用后的金额作为卖出金额。

4.7 报告期内基金的费用计提、摊销及分配情况

本基金的费用计提、摊销及分配情况请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.8 报告期内基金的税收

本基金的税收政策请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.9 报告期内基金的关联交易

本基金的关联交易请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.10 报告期内信息披露费的列支情况

本基金的信息披露费列支情况请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.11 报告期内会计师费的列支情况

本基金的会计师费列支情况请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.12 报告期内因投资组合变化而调整的基金费用

本基金的因投资组合变化而调整的基金费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.13 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.14 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.15 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.16 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.17 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.18 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.19 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.20 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.21 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.22 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.23 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.24 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.25 其他费用

本基金的其他费用请见《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金2015年第2季度报告》。

4.26 其他费用