

海富通养老收益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

1.1 重要提示
本基金的投资目标及资产配置与本报告所披露内容不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人海富通基金管理有限公司承诺：本基金管理人已于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等内容，保证基金资产不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金托管人中国工商银行股份有限公司承诺：基金托管人已复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，保证基金资产不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金的投资业绩并不预示其未来业绩表现，投资者应仔细阅读本报告并认真阅读本基金的风险揭示书。
本报告所载数据截至2015年10月31日或至2015年12月31日止。

基金概况	
基金名称	海富通养老收益混合型
基金代码	519091
交易代码	519090
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2013年04月29日
报告期末基金份额总额	1,913,385,382.03份
投资目标	本基金坚持采用资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，积极把握股票市场的投资机会，谋求资产长期增值，实现基金资产的保值增值目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金的投资策略以基金的投资目标为中心，在实现预期的投资目标的前提下，力求实现风险最小化。在资产配置策略方面，根据对宏观经济形势的判断，确定大类资产配置比例，并在此基础上进行股票、债券、货币市场工具等资产的配置，并在此基础上进行股票、债券、货币市场工具等资产的配置，并在此基础上进行股票、债券、货币市场工具等资产的配置。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和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。
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

3.1 主要财务指标和基金净值表现

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	10,590,803.41
2.本期利润	14,734,514.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0121
4.期末基金资产净值	2,983,989,940.98
5.期末基金份额净值	1.560

注:1.本期已实现收益指基金本期实现的收益，计入本期损益中归属于基金资产净值中份额。
2.本期利润指基金本期实现的收益，计入本期损益中归属于基金资产净值中份额。
3.加权平均基金份额本期利润指基金本期实现的收益，计入本期损益中归属于基金资产净值中份额。
4.期末基金资产净值指基金本期实现的收益，计入本期损益中归属于基金资产净值中份额。
5.期末基金份额净值指基金本期实现的收益，计入本期损益中归属于基金资产净值中份额。

阶段	净增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	2.04%	0.15%	1.10%	0.02%	0.94%	0.13%

注:1.本基金业绩比较基准采用与业绩比较基准比较基准收益率的比较。
2.本基金业绩比较基准采用与业绩比较基准比较基准收益率的比较。
3.本基金业绩比较基准采用与业绩比较基准比较基准收益率的比较。
4.本基金业绩比较基准采用与业绩比较基准比较基准收益率的比较。
5.本基金业绩比较基准采用与业绩比较基准比较基准收益率的比较。

阶段	净增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	2.04%	0.15%	1.10%	0.02%	0.94%	0.13%

注:本基金合同约定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,截至报告期末本基金的各项投资比例已符合基金合同第十二条(二)投资组合比例限制。(四)投资组合比例限制。
1. 投资组合比例限制

姓名	职务	担任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
陈皓	基金经理	2013-12-30	10年	金融学硕士，持有基金从业资格，曾任海富通基金管理有限公司基金经理，2013年12月加入海富通基金管理有限公司，担任海富通养老收益混合型证券投资基金基金经理，2015年12月加入海富通基金管理有限公司，担任海富通养老收益混合型证券投资基金基金经理。
陈皓	基金经理	2015-04-29	7年	金融学硕士，持有基金从业资格，曾任海富通基金管理有限公司基金经理，2015年4月加入海富通基金管理有限公司，担任海富通养老收益混合型证券投资基金基金经理，2015年12月加入海富通基金管理有限公司，担任海富通养老收益混合型证券投资基金基金经理。

注:1.对基金的投资决策,其任职日期自基金合同生效之日起,离任日期自公告作出之日起,非担任基金经理,其任职日期自离任日期起。
2.基金经理的任职日期自基金合同生效之日起,离任日期自公告作出之日起,非担任基金经理,其任职日期自离任日期起。
3.基金经理的任职日期自基金合同生效之日起,离任日期自公告作出之日起,非担任基金经理,其任职日期自离任日期起。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

注:1.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
2.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
3.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
4.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。
5.本基金资产净值指基金资产净值,即基金资产减去负债后的余额。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	527,935.48
2	应收证券清算款	1,543,462.07
3	应收股利	-
4	应收利息	7,032,760.68
5	其他应收款	82,102.62
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,106,441.76

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	54,453,367.53	2.10
2	固定收益投资	130,287,023.00	5.00
3	其中:债券	130,287,023.00	5.00
4	货币市场工具	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	2,263,367,238.16	92.48
10	其他资产	9,106,441.76	0.36
11	负债	2,587,146,061.28	100.00

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	826,983.00	0.03
B	采矿业	258,470.00	0.01
C	制造业	31,468,890.10	1.22
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应	743,230.00	0.03
E	建筑业	1,323,296.00	0.05
F	批发和零售业	2,109,854.44	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	1,004,404.00	0.04
H	住宿和餐饮业	600,816.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,509,542.70	0.14
J	金融业		
K	房地产业	3,620,244.00	0.14
L	租赁和商务服务业	1,912,467.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	634,730.21	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,026,066.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作	486,780.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合	4,827,991.13	0.19
	合计	54,463,367.63	2.11