海富通风格优势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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	海富通风格优势混
基金主代码	519013
交易代码	519013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月19日
报告期末基金份额总额	759,122,741.11份
投资目标	在适度控制风险并保持资产良好流动性的前提下,通过积极选择不同风格优势的股票,力争为投资者提供长期稳定的超额回报。
投资策略	本基金将在适度的大类资产配置的基础上,运用"风格优选,积极轮换,精选个股"策略,把握不同风格优势策略在不同阶段的变动趋势和投资机会,并在策略内自下而上精选个股,实现基金资产的超额收益。本基金的投资策略主要包括资产配置策略、风格轮换策略和精选证券策略。
业绩比较基准	75%×MSCI China A+25%×上证国债
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	中国建设银行股份有限公司

§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	35,860,767.23
2.本期利润	152,420,330.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.1946
4.期末基金资产净值	672,994,784.61
5.期末基金份额净值	0.887

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

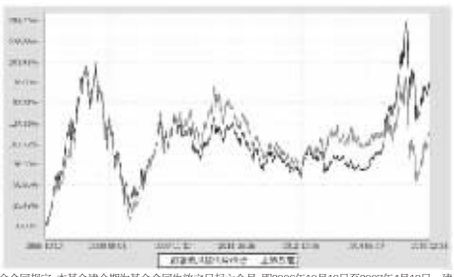
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	27.81%	1.87%	13.66%	1.28%	14.15%	0.59%

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

海富通风格优势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

(2006年10月19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,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束时本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(二)、(六)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		
顾晓飞	本基金的基金经理;海富通新内需混合基金经理;海富通国策导向混合基金经理	2014-12-12	-	7年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2008年5月至2010年6月任天华投资咨询管理有限公司研究员,2010年6月至2011年7月任天合基金管理有限公司研究员,2011年8月至2011年10月任东吴基金管理有限公司研究员,2011年10月至2014年7月任国泰基金管理有限公司研究员,2014年8月加入海富通基金管理有限公司。2014年8月起任海富通国策导向混合基金经理,2014年12月起兼任海富通新内需混合和海富通风格优势混合基金经理。
施敏佳	本基金的基金经理	2015-10-26	-	4年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2006年8月至2009年5月任普华永道中天会计师事务所有限公司高级审计员,2009年5月至2011年1月任展讯通信(上海)有限公司内审主管,2011年1月至2013年6月任东方证券股份有限公司分析师,2013年6月加入海富通基金管理有限公司,担任股票分析师。2015年10月起任海富通风格优势混合基金经理。

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为:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对投资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

报告期内,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年最后三个月,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53.70%,报收8393.83点。创业板指全年上涨84.41%,报收27145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、煤炭等涨幅最后,不足10%。

回顾四季度的操作,本基金较及时地增加了权益的配置比例,同时在结构上主要倾向于TMT、智能制造等板块,获得了一定的超额收益。

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27.81%,同期基金业绩比较基准收益率为13.66%,基金净值跑赢业绩比较基准14.15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疲弱中保持相对平稳。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率不会太高,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,适度增加改革类资产的配置,重点关注低估值蓝筹资产的修复性机会,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	599,193,423.07	87.05
	其中:股票	599,193,423.07	87.05
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	68,802,196.35	10.00
7	其他资产	20,320,215.61	2.95
8	合计	688,315,835.03	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	-	-
C	制造业	460,063,240.87	68.36
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	13,705,685.00	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	10,145,177.74	1.51
H	住宿和餐饮业	23,846,083.60	3.54
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,034,622.00	5.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	19,292,779.66	2.87
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	38,105,834.20	5.66
S	综合	-	-
	合计	599,193,423.07	89.03

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	300083	劲胜精密	836,835	39,599,032.20	5.88
2	002171	楚江新材	1,440,521	34,543,693.58	5.13
3	300115	长盈精密	788,306	26,463,432.42	3.93
4	002699	美盛文化	497,922	25,443,814.20	3.78
5	300242	明家科技	482,230	24,092,210.80	3.58
6	002149	西部材料	851,425	23,848,414.25	3.54
7	002560	通达股份	515,155	22,409,242.50	3.33
8	603006	联明股份	351,600	22,129,704.00	3.29
9	300097	智云股份	469,064	21,788,022.80	3.24
10	300073	当升科技	555,600	21,573,948.00	3.21

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。

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	565,147.58
2	应收证券清算款	19,538,833.46
3	应收股利	-
4	应收利息	18,973.92
5	应收申购款	197,260.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,320,215.61

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报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300242	明家科技	24,092,210.80	3.58	重大事项

§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	816,618,279.62
本报告期基金总申购份额	8,756,380.47
减:本报告期基金总赎回份额	66,251,918.98
本报告期基金分拆变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	759,122,741.11

§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ROFII(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ROFII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风格优势混合型证券投资基金的文件

(二)海富通风格优势混合型证券投资基金基金合同

(三)海富通风格优势混合型证券投资基金招募说明书

(四)海富通风格优势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)报告期内海富通风格优势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

海富通股票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	海富通股票混合
基金主代码	519005
交易代码	519005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年7月29日
报告期末基金份额总额	1,742,539,149.16份
投资目标	精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合,分享中国经济高速成长的成果,谋求基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采用双层次的投资策略:第一层次主要通过对股票市场的系统性风险进行分析,确定股票和现金资产的配置比例;第二层次主要是通过对行业景气循环和个股的研究,精选适合本投资组合风险收益特征的股票。
业绩比较基准	80%×MSCI China A+20%×上证国债
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	-39,401,133.69
2.本期利润	197,087,371.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.1115
4.期末基金资产净值	1,519,533,460.97
5.期末基金份额净值	0.872

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

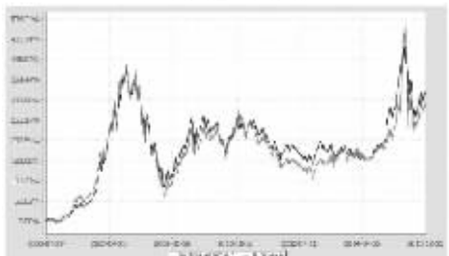
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.44%	2.04%	14.46%	1.36%	-0.02%	0.68%

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

海富通股票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

(2005年7月29日至2015年12月31日)



注: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。本基金自2007年8月22日至2007年11月23日为持续营销后建仓期。建仓期满至今本基金的各项投资比例已达到基金合同有关投资范围的规定,即股票资产70%-95%,一年期以内的国家债券和现金的比例不低于5%。同时满足第14章(七)有关投资组合限制的各项比例要求。

§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;海富通中小盘混合基金经理;海富通国策导向混合基金经理;海富通新内需热点混合基金经理;海富通风格优势混合基金经理	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部分析师,深圳九富投资顾问有限公司项目部员工,大连獐子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:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对投资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

报告期内,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年最后三个月,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53.70%,报收8393.83点。创业板指全年上涨84.41%,报收27145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、煤炭等涨幅最后,不足10%。

四季度,本基金整体保持了较低的仓位水平,结构上以价值蓝筹为基础性配置,并适度进行了少量波段操作及主题性投资。

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14.44%,同期业绩比较基准收益率为14.46%,基金净值跑输业绩比较基准0.02个百分点。基金净值跑输业绩基准的主要原因是四季度初期仓位水平偏低。

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疲弱中保持相对平稳。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率不会太高,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,适度增加改革类资产的配置,重点关注低估值蓝筹资产的修复性机会,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	1,117,898,340.72	71.40
	其中:股票	1,117,898,340.72	71.40
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	439,996,549.73	28.10
7	其他资产	7,894,774.63	0.50
8	合计	1,565,789,665.08	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	-	-
C	制造业	779,799,350.83	51.32
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	15,094,789.46	0.99
I	信息传输、软件和信息技术服务业	286,353,182.19	18.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	36,651,018.24	2.41
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	-	-
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	1,117,898,340.72	73.57

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	2,141,478	133,178,516.82	8.76
2	002657	中科金财	1,434,240	114,724,857.60	7.55
3	300078	思创医惠	1,202,845	58,698,836.00	3.86
4	002026	山东威达	2,797,225	49,287,104.50	3.24
5	600855	航天长峰	1,234,181	48,972,302.08	3.22
6	002368	太极股份	681,700	45,742,070.00	3.01
7	300359	全通教育	458,968	39,526,324.16	2.60
8	600343	航天动力	1,503,239	38,437,821.23	2.53
9	600340	华夏幸福	1,193,067	36,651,018.24	2.41
10	002530	丰东股份	2,265,404	33,958,405.96	2.23

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。

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	1,131,667.70
2	应收证券清算款	6,660,402.78
3	应收股利	-
4	应收利息	62,093.11
5	应收申购款	40,611.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,894,774.63

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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002530	丰东股份	33,958,405.96	2.23	重大事项

§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	1,791,121,017.33
本报告期基金总申购份额	11,103,371.30
减:本报告期基金总赎回份额	59,685,239.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,742,539,149.16

§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ROFII(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ROFII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股票混合型证券投资基金的文件

(二)海富通股票混合型证券投资基金基金合