海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通新内需混合
基金主代码	519130
交易代码	519130
基金运作方式	契约型,开放式
基金合同生效日	2014年11月27日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,031,366,502.99份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	海富通新内需混合A / 海富通新内需混合C
下属分级基金的交易代码	519130 / 002172
报告期末下属分级基金的份额总额	1,031,365,865.57份 / 637.42份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将从受益于国家扩大内需促进经济发展政策的热点行业中,精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极投资,同时利用灵活的资产配置,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心,首先按照投资时钟理论,根据宏观预测环境判断经济周期所处的阶段,作出权益类资产的初步配置;并根据投资时钟判断大致的行业配置;其次结合证券市场趋势指标,判断证券市场指数的大致风险收益比;从而做出权益类资产的具体仓位选择。在债券组合的具体构造和调整上,本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数×50%+上证国债指数×50%
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,属于中等风险水平的投资品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	洪渊
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wxx@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年		2014年11月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
	海富通新内需混合A	海富通新内需混合C	海富通新内需混合A	海富通新内需混合C
本期已实现收益	162,362,178.22	0.83	84,294,883.75	-
本期利润	114,043,789.12	1.02	135,929,683.93	-
加权平均基金份额本期利润	0.0596	0.0088	0.2238	-
本期基金份额净值增长率	13.75%	0.14%	22.20%	-
3.1.2期末数据和指标	2015年末		2014年末	
	海富通新内需混合A	海富通新内需混合C	海富通新内需混合A	海富通新内需混合C
期末可供分配基金份额利润	0.3899	0.3896	0.1376	-
期末基金资产净值	1,433,472,873.49	885.75	748,429,358.93	-
期末基金份额净值	1.390	1.390	1.222	-

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)。

4.本基金自2015年12月17日起,根据收费模式的不同,将基金分为A类和C类。

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

1. 海富通新内需混合A:

3.1.1期间数据和指标	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
过去三个月	0.87%	0.09%	9.68%	0.87%	-8.81%	-0.78%
过去六个月	1.46%	0.09%	-6.60%	1.32%	8.06%	-1.23%
过去一年	13.75%	1.03%	9.96%	1.23%	3.79%	-0.20%
自基金合同生效起至今	39.00%	1.43%	23.18%	1.22%	15.82%	0.21%

2. 海富通新内需混合C:

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
自基金合同生效起至今	0.14%	0.03%	2.65%	1.04%	-2.51%	-1.01%

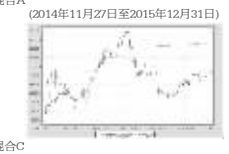
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

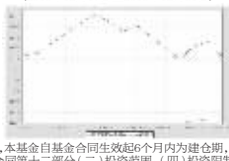
1. 海富通新内需混合A

(2014年11月27日至2015年12月31日)



2. 海富通新内需混合C

(2015年12月17日至2015年12月31日)



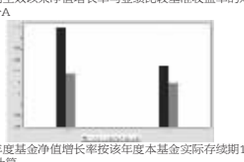
注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)投资范围、(四)投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

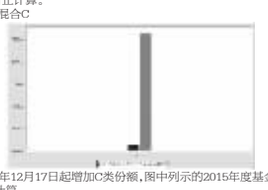
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通新内需混合A



注:图中列示的2014年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期11月27日(基金合同生效日)起至12月31日止计算。

2. 海富通新内需混合C



注:本基金自2015年12月17日起增加C类份额,图中列示的2015年度基金净值增长率自12月17日起至12月31日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通新内需混合A:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通新内需混合C:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金过去二年未发生利润分配的情况。

§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12月31日,本基金管理人共管理31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、海富通精选或号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、海富通趋进增利债券型证券投资基金(LOF)、海富通国策导向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、上证可质押抵投综合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		
顾晓飞	本基金的基金经理;海富通风格优势混合基金经理;海富通国策导向混合基金经理	2014-11-27	-	7年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2008年5月至2010年6月任天弗投资咨询管理有限公司研究员,2010年6月至2011年7月任天弁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月任闽泰基金管理有限公司研究员及基金经理助理,2014年8月加入海富通基金管理有限公司。2014年8月至2016年2月任海富通国策导向混合基金经理,2014年12月至2016年2月兼任海富通新内需混合和海富通风格优势混合基金经理。
陈振隼	本基金的基金经理;海富通阿尔法对冲混合基金经理;海富通养老收益混合基金经理	2015-04-29	-	7年	硕士,持有基金从业人员资格证书。1999年6月至2001年3月任职于复旦金仕达计算机有限公司,2001年3月至2004年3月任职于东方证券股份有限公司,2004年3月至2007年1月任职于复旦金仕达计算机有限公司,2007年1月至2008年8月任职于HM中国有限公司,2008年8月加入海富通基金管理有限公司,历任量化分析师、投资经理。2014年11月起任海富通阿尔法对冲混合基金基金经理,2015年4月起兼任海富通养老收益混合和海富通新内需混合基金经理,2016年1月起兼任海富通东财大数据混合基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理;海富通季季增利债券基金经理;海富通趋稳债券基金经理;海富通现金管理货币基金经理	2015-04-29	-	10年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2006年4月至2014年6月就职于华宝兴业基金管理有限公司,曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理。2014年6月加入海富通基金管理有限公司,2014年8月至2016年10月任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利债券基金经理。2015年11月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2016年1月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016年2月起兼任海富通货币基金经理。
刘石开	本基金的基金经理助理;海富通养老收益混合基金经理助理;海富通纯债债券基金经理助理;海富通领先成长混合基金经理助理;海富通阿尔法对冲混合基金经理助理	2015-05-11	2015-12-18	6年	硕士,持有基金从业人员资格证书,历任银联商务有限公司业务管理规数据分析员,长江证券股份有限公司金融衍生产品部金融工程师,2011年6月加入海富通基金管理有限公司,任权益投资部数量分析研究员。2014年12月至2015年12月任海富通领先成长混合、海富通阿尔法对冲混合基金经理助理。2015年3月至2015年12月兼任海富通养老收益混合基金经理助理。2015年8月至2015年12月兼任海富通新内需混合基金经理助理。2016年1月起兼任海富通货币基金经理助理。

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的日;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。

3、本公司于2016年2月26日发布公告,自2016年2月26日起,顾晓飞先生不再担任本基金基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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各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。同时,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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、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)公司管理的不同投资组合同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明,报告期内公司对旗下各投资组合公平对待,不存在利益输送的行为。

4.3.3 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,未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年A股年线犹如一把正挂的利剑,刺痛了每一个投资者的心。

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,三个月上证综指上涨15.93%,深证成指上涨26.80%。

虽然,2015年全年市场形势严峻,投资者被"过山车"式的上涨下跌"颠"的晕眩。但2015年投资者只要自始至终坚持,还是能收获不错的收益。央行6次降息降准,市场流动性宽裕,再加上"资产荒",使得2015全年股票市场有不俗表现。

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%。互联网营销、虚拟现实、智能电视等概念涨幅在两倍以上,次新股、网络游戏、网络安全、大数据、工业4.0等概念涨幅在一倍以上。

2015年上半年股市有一波显著的上涨行情,本基金积极参与上涨机会,同时注重防范波动风险,重点投资金融与建筑等大盘股。5月底考虑到市场风险较大,本基金以参与IPO新股申购为主要投资策略,同时兼顾一定的流动性,并在严格控制较低股票仓位的前提下,积极抓住较稳定的股票投资机会。

从债市看,2015年经济基本面总体疲弱,在三期叠加的大背景下经济增速出现放缓,工业、投资等多项经济数据屡屡创下近年来的新低。而随着全球通缩风险蔓延、大宗商品下跌,2015全年的通胀率一直处于一个较低的水平。在这种情况下政府一方面促转型调结构,提出了供给侧改革的思路,加快经济出清,另一方面也依旧呈现出较强的稳增长意愿。首先,货币政策持续宽松,全年央行共实施了五次降准和五次降息,并持续通过SLF、MLF等定向手段向市场注入流动性。具体来看2015年存款准备金率共下调了300BP,一年期贷款利率从去年底的6%下调至目前的4.75%,一年期存款利率从2.75%下调至目前的1.5%,同时打开浮动区间,形式上完成了利率市场化。其次,财政政策也积极发力,2015年赤字率目标由14年的21%提升至23%,并推出万亿地方债置换以及万亿专项金融债,希望拉动投资回升。宽货币和宽财政起到了一定的托底效果,但也受到一定制约,比如资金向实体传导不畅、地方财政和杠杆约束等问题,经济企稳仍需时日。

在此背景下,15年债券市场延续了牛市行情,一方面资金利率得益于货币政策总体保持低位平稳,下半年7天回购利率始终平稳维持25%左右水平,另一方面6月份以后股市断崖式回落,市场风险偏好急剧下降,大量资金涌入债市,带动利率债、信用债收益率大幅下行,期限利差和信用利差均迅速收窄。总体看全年1年期国债收益率下行96BP,10年国债收益率下行80BP,突破了自08年以来的历史低位,期限利差先扩后窄。而信用债在钱多缺资产的格局下表现更为出色,各评级、各期限品种全年都有100BP以上的下行幅度,尤其是在经济下行信用风险加大的情况下中短久期、中高评级信用债成为市场追捧对象,信用利差被压缩至历史低位,城投债也因为地方债置换安全度提高而投资情绪回暖。转债方面,一至五月转债受股市推动大幅上涨,众多个券纷纷触发赎回退市,转债稀缺性进一步推升估值,然而六月股市剧烈震荡,转债在正股和估值双重压力下急剧下跌,归还了年初以来累积的回报,虽然四季度股市虽有反弹,但转债受制于高估值弹性严重不足,全年中证转债指数跌26.5%。

本基金一季度未参与债券方面的投资,二季度本基金债券部分主要根据新股申购的节奏管理组合流动性,非打新期间操作以存款和配置短期短融为主。三季度IPO暂停后,本基金大部分资金仅作流动性管理,逐步配置一定比例的存款和短期债券,在维持流动性的同时尽量提高收益。12月底IPO重启后,本基金继续积极参与打新。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通新内需混合A基金净值增长率为13.75%,同期业绩比较基准收益率为9.96%,基金净值跑赢业绩比较基准3.79个百分点。海富通新内需混合C基金净值增长率为0.14%,同期业绩比较基准收益率为2.65%,基金净值跑输业绩比较基准2.51个百分点。基金净值跑输业绩比较基准的主要原因在于本基金以参与新股申购为主要投资策略,绝大部分的资金都用于新股申购,股票仓位非常低。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年,我国宏观经济将面临与前几年截然不同的、复杂多变的国际国内环境。站在国际视角,2016年是国际金融危机后发达国家开始走出危机,美国进入加息周期的第一年,不同经济体的经济周期存在差异,国际资本流动预计将出现显著变化。从国内经济发展看,2016年是我国全面建成小康社会决胜阶段的开局之年,也是推进结构性改革的攻坚之年;供给侧改革作为新一年的政策重点,有望重塑中国经济竞争力。同时,短期也可能带来意外的阵痛和风险,比如债务违约率可能在局部快速提升、淘汰落后产能导致失业率上升等问题。在全新形势下,我们对中国经济的长期走势充满信心,也对短期内风险可能局部爆发带来的经济波动存在一丝担忧。

从证券市场来看,目前A股市场整体估值不贵,但是结构性差异较大,低估值与高估值并存。同时,A股市场本身制度环境的变化也给市场走势增添变数,注册制的推出、大股东减持规则的变化、上海证券交易所战略新兴板的设立等很有可能导致A股市场中长期估值中枢的改变。考虑到当前国内经济所面临的困难局面、国际市场的复杂格局以及中国资本市场自身的不断演变,我们认为2016年A股投资操作将面临较大的难度,应调低基金投资的预期收益。新的一年,我们将根据形势变化适当调整投资研究的重心,提升对宏观经济与全球市场的关注,并注意跳出前几年一直沿用的盈利模式和惯性思维框架,积极关注新形势、新机遇和新风险。在认清困难形势的同时,我们认为还应积极寻找结构性机会。一方面,供给侧改革将改善产能过剩行业的竞争格局,龙头公司有望从中受益从而提升投资价值;另一方面,在市场波动中顺应中国经济转型方向的成长股也会有被错杀的机会,在合适的价格上买入优质成长股也将是我们的主要策略之一。

展望2016A股将迎来新IPO改革下的首批新股发行,同时会对注册制的具体实施办法细则给予明确。本基金的投资思路将以保本投资为主,同时继续积极参与新股申购,努力抓住股票的结构性上涨波段,严格控制股票仓位,尽可能增强债券收益,争取为持有人提供稳定收益。

从债市看,当前经济仍未出现明显的见底信号,总需求不振,而供给端改革的作用短期难以体现,明年上半年可能出现工业增长、工业产能以及固定资产投资的进一步下行。但是,明年传统的稳增长政策无疑是积极财政政策可能会有所加码,下半年经济或许能逐步企稳,需待观察。

货币政策方面,目前利率市场化几近收官,降息政策边际效应递减,央行开始逐步构建一个适应新经济和金融环境的货币政策框架:从数量型调控转为价格型调控、从存贷款基准利率调控转变为利率走廊调控,在利率、汇率、金融稳定等多目标管理下明年货币政策难以出现大幅放水但也难以转向,总体仍会维持平稳和适度宽松,降准的空间会大于降息。

在这种环境下,我们对明年债市保持谨慎乐观,基本面和资金面因素对债市仍相对有利,限制收益率出现大幅上行的可能,但明年财政发力带来的挤出效应、宽货币转向宽信用可能性加大,也会制约收益率下行的速度和空间,因此明年债市可能呈现区间波动的特性。此外,股市和汇市的变化仍是最大的不确定因素,两者影响了国内和国际的资金的分配和流向,对债市形成阶段性扰动,尤其是目前贬值压力加大,需要保持密切关注。

下一年度,本基金债券部分主要是根据新股申购的节奏管理组合流动性。积极配置存款、短期债券等流动性管理工具,提高组合收益率。

4.6 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。估值工作小组充分听取相关部门的建议,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。

4.7 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。

4.8 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

本基金本报告期无需要说明的情形。

§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

2015年,本基金托管人在对海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内海富通基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

姓名	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	67,086,952.00	79,045,501.73
结算备付金	796,123,587.66	0.00
存出保证金	232,861.61	0.00
交易性金融资产	80,553,076.75	670,601,062.94
其中:股票投资	53,770,398.75	670,601,062.94
基金投资	-	-
债券投资	26,782,678.00	0.00
资产支持证券投资	-	0.00
贵金属投资	-	0.00
衍生金融资产	-	0.00
买入返售金融资产	489,481,734.22	0.00
应收证券清算款	569,424.80	1,736,879.68
应收利息	2,149,441.53	16,437.78
应收股利	-	0.00
应收申购款	-	0.00
递延所得税资产	-	0.00
其他资产	-	-
资产总计	1,436,197,078.57	751,399,882.13
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	0.00
交易性金融负债	-	0.00
衍生金融负债	-	0.00
卖出回购金融资产款	-	0.00
应付证券清算款	-	0.00
应付赎回款	-	0.00
应付管理人报酬	1,561,651.87	978,312.32
应付托管费	325,344.12	163,052.07
应付销售服务费	-	0.00
应付交易费用	421,323.34	1,793,296.31
应交税费	-	0.00
应付利息	-	0.00
应付利润	-	0.00
递延所得税负债	-	0.00
其他负债	415,000.00	35,862.50
负债合计	2,723,319.33	2,970,523.20
所有者权益:		
实收基金	1,031,366,502.99	612,499,675.00
未分配利润	402,107,256.25	135,929,683.93
所有者权益合计	1,433,473,759.24	748,429,358.93
负债和所有者权益总计	1,436,197,078.57	751,399,882.13

注:1. 报告截止日2015年12月31日,基金份额总额1,031,366,502.99份,其中A类基金份额总额1,031,365,865.57份,基金份额净值1.390元;C类基金份额总额637.42份,基金份额净值1.390元。于2014年12月31日,基金份额总额612,499,675.00份,基金份额净值1.222元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2015年度和2014年11月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	162,351,335.86	139,884,783.31
1.利息收入	37,315,227.06	177,657.20
其中:存款利息收入	27,442,113.27	111,279.30
债券利息收入	2,782,888.66	0.00
资产支持证券利息收入	-	0.00
买入返售金融资产收入	7,090,225.13	66,378.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	136,909,496.45	88,072,325.83
其中:股票投资收益	136,328,167.90	88,072,325.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	149,030.43	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	0.00
股利收益	432,298.12	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-48,318,388.91	51,634,800.18
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	36,445,001.26	-
减:二、费用	48,307,545.72	3,955,099.38
1. 管理人报酬	36,564,382.00	978,312.32
2. 托管费	6,376,932.13	163,052.07
3. 销售服务费	-	0.00
4. 交易费用	4,939,479.05	2,777,466.49
5. 利息支出	266.23	0.00
其中:卖出回购金融资产支出	266.23	0.00
6. 其他费用	426,486.31	36,268.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	114,043,790.14	135,929,683.93
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	114,043,790.14	135,929,683.93

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	612,499,675.00	135,929,683.93	748,429,358.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	114,043,790.14	114,043,790.14
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)	418,866,827.99	152,133,782.18	571,000,610.17
其中:1.基金申购款	7,792,900,273.04	2,764,341,328.78	10,557,241,601.82
2.基金赎回款	-7,374,033,445.05	-2,612,207,546.60	-9,986,240,991.65
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)	1,031,366,502.99	402,107,256.25	1,433,473,759.24

项目	上年度可比期间 2014年11月27日(基金合同生效日)至2014年12月31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)	612,499,675.00	-	612,499,675.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	135,929,683.93	135,929,683.93
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	612,499,675.00	135,929,683.93	748,429,358.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通新内需灵活配置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(以下简称"中国证监会")证监许可[2014]479号《关于核准海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金募集申请的批复》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《海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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612,311,169.88元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第713号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年11月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为612,499,675.00份基金份额,其中认购资金利息折合188,505.12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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》,自2015年12月17日起,本基金根据赎回费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人赎回时收取较高赎回费用的称为A类基金份额;在投资人赎回时收取较低赎回费用并从本类别基金资产中计提销售服务费的称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:基金投资组合中股票资产占基金资产的0%~95%,现金、债券、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%~100%,其中,持有的全部权证市值占基金资产净值的0%~3%,在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金将80%以上的非现金基金资产投资于受益内需增长的公司发行的股票和债券。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:MSCIChinaA指数×50%+上证国债指数×50%。

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2016年3月24日批准报出。

7.4.2 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>》、中国证券投资基金协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015