海富通中小盘股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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：二〇一三年八月二十四日

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。本半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2013年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	海富通中小盘股票
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
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	808,296,593.09份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

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	本基金是股票型基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。其预期收益、预期风险高于货币型基金和债券型基金。

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	赵会军
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@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

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

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	60,728,281.27
本期利润	70,614,442.24
加权平均基金份额本期利润	0.0788
本期基金份额净值增长率	8.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2274
期末基金资产净值	784,076,365.70
期末基金份额净值	0.970

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）。

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

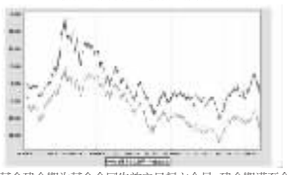
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.09%	1.93%	-12.33%	1.52%	5.24%	0.41%
过去三个月	2.86%	1.66%	-5.63%	1.19%	8.49%	0.47%
过去六个月	8.02%	1.56%	-2.39%	1.17%	10.41%	0.39%
过去一年	5.66%	1.39%	-4.80%	1.14%	10.46%	0.25%
过去三年	4.30%	1.41%	-6.66%	1.22%	10.96%	0.19%
自基金合同生效起至今	-3.00%	1.38%	-26.26%	1.26%	23.26%	0.12%

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

海富通中小盘股票型证券投资基金

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2013年6月30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“兴证国投基金管理有限公司”）于2003年4月1日共同发起设立。本海富通中小盘股票型证券投资基金是基金管理人管理的第十二只公募基金；除本基金外，基金管理人目前还管理着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、海富通风格优势股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金（LOF）、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、海富通大中华精选股票型证券投资基金、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、海富通稳健增利分级债券型证券投资基金、海富通国策导向股票型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通现金管理货币市场基金、海富通养老收益混合型证券投资基金二十二只公募基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程宗	本基金的基金经理，海富通养老收益混合基金经理	2010-04-14	-	10年	中国国籍，硕士，特许金融分析师(CFA)，持有基金从业人员资格证书。历任金信管理研究公司研究所研究员，国金证券研究所研究员，曾当选《新财富》2005年度最佳行业分析师。2006年7月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、非公募股票组合投资经理。2010年4月起任海富通中小盘股票基金经理，2013年5月起兼任海富通养老收益混合基金经理。

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，表明投资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管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年，A股市场受事件影响震荡剧烈，调控房地产“国五条”，理财产品清理“8号文”，IPO何时重启，“钱荒”等对市场造成较大冲击。同时我们看到，宏观经济背景仍不容乐观，传统企业复苏乏力，投资拉动增长模式难以为继，GDP增速预期持续下滑。我们也看到新任领导人对于出台政策“怕大国如烹小鲜”的谨慎态度，打消了以往经济不行靠政策的市场预期。而在传统行业萎靡不振的情况下，以传媒、电子、环保等为代表的新兴行业崛起，今年上半年上证指数虽然表现不佳，但以创业板为代表的成长股却一枝独秀，行业上分化也较为明显，其中信息服务、电子、医药生物等行业涨势喜人，有色、采掘等行业表现疲软。

本基金在第一季度大幅增加了股票资产配置比例，结构上增持了医药、食品等消费类资产以及电子、国防军工和环保等成长类资产，减持了地产化工建材等周期类行业；在第二季度小幅降低了股票资产配置比例，进入6月份后投资策略转向以减仓和防御为主，并根据业绩情况增减了个股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为8.02%，同期基金业绩比较基准收益率为-2.39%，基金净值跑赢业绩比较基准10.41个百分点。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美国方面，随着房地产的复苏和就业的持续好转使得美国家庭资产净值得到提升，居民的消费意愿也随之不断加强促进了消费的增长。随着美国经济复苏的加快，其对于货币政策正常化的讨论会逐步升级，QE退出仍是一个大的趋势。欧洲方面，5月以来欧洲经济景气小幅好转，其在衰退之中出现了企稳的迹象。

国内方面，下半年国内实体经济在去杠杆的背景下可能面临缓慢趋降的风险。虽然政府在“稳增长”与“调结构”并举的情况下，有可能向“稳增长”倾斜，出台一些定向的稳定增长措施，但力度尚不明晰。流动性方面，我们预计下半年社会融资总量余额增速会有所下降，资金价格将高于上半年。市场方面，在经历了前期流动性恐慌大幅调整之后，我们认为短期市场有望企稳。但在经济复苏力度较弱、资金面偏紧、IPO开闸和限售股解禁减持依然处于高峰期的背景下，下半年A股市场趋势性的机会不多。结构上，由于经济的疲软，上游原材料和中间制造业等传统周期行业的投资机会依然不大，机会依然来自于信息、消费和医药等增速快的行业。随着中报的公布，前期中小盘股普涨的行情也或将结束，但有业绩支撑、确定性高的成长股的表现可能依旧强劲。后续我们会关注中美货币政策的新举措、三中全会、社会融资总量增速、资金成本变化情况和IPO启动对股市的影响等。

基于上述判断，本基金下半年维持对A股市场谨慎乐观的判断，关注结构性机会和改革红利机会，聚焦成长股，深挖受益于经济转型的板块和公司，根据半年报情况以及草根调研，捕捉估值合理且成长性相对确定的成长股。

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，并经本公司业务管理委员会批准后实施。

基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资监督外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

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。

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

2013年上半年，本基金托管人在对海富通中小盘股票型证券投资基金的托管过程中，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

2013年上半年，海富通中小盘股票型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通中小盘股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，海富通中小盘股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通中小盘股票型证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：海富通中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	78,555,683.79	60,080,752.08
结算备付金	4,224,278.19	1,282,483.48
存出保证金	851,822.07	1,593,654.49
交易性金融资产	701,798,778.47	761,722,019.55
其中：股票投资	661,794,778.47	721,418,019.55
基金投资	-	-
债券投资	40,004,000.00	40,304,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	70,000,000.00	50,000,000.00
应收证券清算款	-	51,533,404.53
应收利息	1,953,281.85	957,698.67
应收股利	-	-
应收申购款	157,165.02	80,711.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	857,541,009.39	927,250,724.70
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	70,000,000.00	57,550,592.70
应付赎回款	477,717.79	902,644.40
应付管理人报酬	998,639.93	1,027,592.45
应付托管费	166,439.99	171,265.42
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,623,334.91	1,338,158.88
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,511.07	400,428.34
负债合计	73,464,643.69	61,390,682.19
所有者权益：		
实收基金	808,296,593.09	964,715,220.33
未分配利润	-24,220,227.39	-98,855,177.82
所有者权益合计	784,076,365.70	865,860,042.51
负债和所有者权益总计	857,541,009.39	927,250,724.70

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.970元，基金份额总额808,296,593.09份。

6.2利润表

会计主体：海富通中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	85,192,339.31	64,943,770.29
1.利息收入	1,551,967.00	1,461,521.20
其中：存款利息收入	186,550.45	482,003.84
债券利息收入	1,177,010.42	443,979.46
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	188,406.13	535,537.90
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	73,727,911.42	-34,297,044.23
其中：股票投资收益	71,397,427.91	-36,774,656.34
基金投资收益	-	-
债券投资收益	22,146.29	-358,760.83
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,308,337.22	2,836,372.94
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	9,886,160.97	97,461,874.74
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	26,299.92	317,418.58
减：二、费用	14,577,897.07	17,012,650.96
1.管理人报酬	6,418,237.64	7,710,357.19
2.托管费	1,069,706.36	1,285,059.48
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	6,880,767.56	7,806,624.78
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	209,185.51	210,609.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	70,614,442.24	47,931,119.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	70,614,442.24	47,931,119.33

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30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）	964,715,220.33	-98,855,177.82	865,860,042.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,614,442.24	70,614,442.24
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）	-156,418,627.24	4,020,508.19	-152,398,119.05
其中：1.基金申购款	28,796,444.47	-828,940.76	27,967,503.71
2.基金赎回款	-185,215,071.71	4,849,448.95	-180,365,622.76
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）	808,296,593.09	-24,220,227.39	784,076,365.70

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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）	1,320,525,533.97	-161,768,638.17	1,158,756,895.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,931,119.33	47,931,119.33
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）	-309,340,461.30	31,170,531.02	-278,169,930.28
其中：1.基金申购款	37,503,505.25	-3,173,316.37	34,330,188.88
2.基金赎回款	-346,843,966.55	34,343,847.39	-312,500,119.16
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）	1,011,185,072.67	-82,666,987.82	928,518,084.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：田仁灿，主管会计工作负责人：阎小庆，会计机构负责人：高勇前

6.4报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通中小盘股票型证券投资基金（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［2010］第83号《关于核准海富通中小盘股票型证券投资基金募集的批复》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《海富通中小盘股票型证券投资基金募集与认购方案》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1,236,586,870.58元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2010）第080号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通中小盘股票型证券投资基金基金合同》于2010年4月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,236,887,362.60份基金份额，其中认购资金利息折合300,492.02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《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中小盘股票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，包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%，其中将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票，权证投资占基金资产净值的0%-3%，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%-40%，其中，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%。本基金的业绩比较基准为：中证700 指数×80%+上证国债指数×20%。

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2013年8月22日批准报出。

6.4.2 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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告［2010］5号《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》》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通中小盘股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2013年6 月30 日的财务状况以及2013年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5差错更正的说明

本基金报告期内无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税［2002］128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税［2004］78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税［2005］102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税［2005］107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税［2008］1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税［2012］85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

①）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

②）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

③）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税，暂不征收企业所得税。

④）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,418,237.64	7,710,357.19
其中：支付销售机构的客户维护费	2,576,187.96	2,784,047.58

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,069,706.36	1,285,059.48

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	78,555,683.79	145,754.62	31,495,623.33	445,134.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300027	华谊兄弟	2013-06-05	重大事项	28.55	2013-07-24	31.41	894,098	26,220,043.63	25,526,497.90	-
300133	华策影视	2013-05-28	重大资产重组	24.43	2013-07-30	26.87	150,000	3,568,747.32	3,664,500.00	-
300256	星星科技	2013-05-17	重大资产重组	13.01	2013-08-09	14.31	1,350,689	17,917,373.38	17,572,463.89	-
000998	隆平高科	2013-05-03	重大资产重组	18.46	2013-07-08	20.50	1,299,781	26,535,511.00	23,993,957.26	-

注：本基金截至2013年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	661,794,778.47	77.17
	其中：股票	661,794,778.47	77.17
2	固定收益投资	40,004,000.00	4.66
	其中：债券	40,004,000.00	4.66
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	70,000,000.00	8.16
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	82,779,961.98	9.65
6	其他各项资产	2,962,268.94	0.35
7	合计	857,541,009.39	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	23,993,957.26	3.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	483,503,366.19	61.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,616,752.40	3.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	14,303,058.32	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,510,818.88	8.48
J	金融业	12,608,327.52	1.61
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	8,067,500.00	1.03
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	29,190,997.90	3.72
S	综合	-	-
	合计	661,794,778.47	84.40

7.3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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600332	广州药业	2,250,000	77,085,000.00	9.83
2	002241	歌尔声学	1,200,000	43,548,000.00	5.55
3	300090	盛运股份	1,199,964	37,054,888.32	4.73
4	002353	杰瑞股份	500,000	34,500,000.00	4.40
5	600557	康缘药业	1,199,892	31,857,132.60	4.06
6	300027	华谊兄弟	894,098	25,526,497.90	3.26
7	002236	大华股份	650,000	24,849,500.00	3.17
8	000998	隆平高科	1,299,781	23,993,957.26	3.06
9	600187	国中水务	1,830,756	23,616,752.40	3.01
10	600893	航空动力	1,304,185	21,492,968.80	2.74

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.hftfund.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	47,242,077.15	5.46
2	300090	盛运股份	41,554,933.53	4.80
3	002353	杰瑞股份	39,786,499.63	4.60
4	600391	成发科技	39,121,633.71	4.52
5	002241	歌尔声学	38,628,972.73	4.46
6	601169	北京银行	36,474,352.59	4.21
7	000768	中航飞机	36,198,789.86	4.18
8	600332	广州药业	34,339,118.88	3.97
9	000002	万 科A	34,328,975.27	3.96
10	600523	贵航股份	33,424,120.77	3.86
11	300104	乐视网	32,573,325.68	3.76
12	002236	大华股份	32,501,123.84	3.75
13	002570	贝因美	30,972,823.36	3.58
14	300315	掌趣科技	29,675,618.27	3.43
15	000400	许继电气	28,996,334.19	3.35
16	600705	中航投资	27,675,300.56	3.20
17