海富通风格优势股票型证券投资基金

2014 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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年三月三十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月27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2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通风格优势股票
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
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
报告期末基金份额总额	1,684,951,642.71份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	本基金是股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	田青
	联系电话	021-38650891	010-67595096
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		40088-40099	010-67595096
传真		021-33830166	010-66275853

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	254,438,846.20	301,430,303.84	-526,870,489.32
本期利润	233,148,525.40	266,101,968.56	-33,867,798.37
加权平均基金份额本期利润	0.1066	0.0904	-0.0079
本期基金份额净值增长率	14.60%	9.85%	-1.12%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0028	-0.1301	-0.2075
期末基金资产净值	1,680,303,860.50	2,243,462,567.23	3,314,158,603.51
期末基金份额净值	0.997	0.870	0.792

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(为期末累计数,不是当期发生数)。

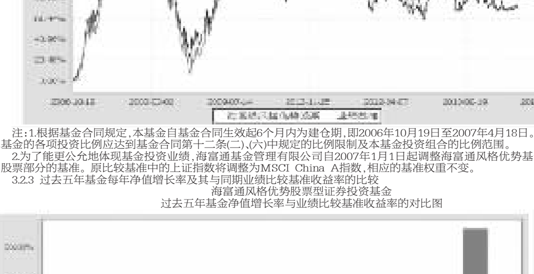
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	10.29%	2.05%	27.36%	1.15%	-17.07%	0.90%
过去六个月	15.39%	1.59%	41.53%	0.94%	-26.14%	0.65%
过去一年	14.60%	1.40%	35.54%	0.87%	-20.94%	0.53%
过去三年	24.47%	1.35%	41.36%	0.96%	-16.89%	0.39%
过去五年	1.17%	1.33%	7.10%	1.01%	-5.93%	0.32%
自基金合同生效起至今	136.90%	1.63%	143.71%	1.39%	-6.81%	0.24%

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的历史走势对比图
(2006年10月19日至2014年12月31日)

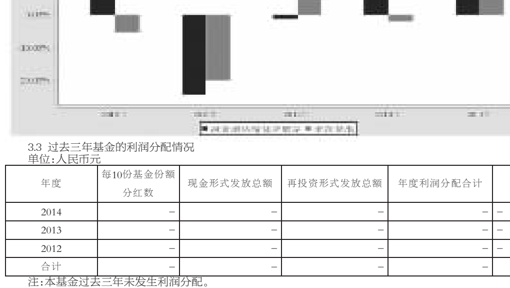


注:1.根据基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期满至今,本基金的各项投资比例应达到基金合同第十二条(二)、(六)中规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

2.为了能更公允地体现基金投资业绩,海富通基金管理有限公司自2007年1月1日起调整海富通风格优势基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为MSCI China A指数,相应的基准权重不变。

3.2.3 过去五年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

海富通风格优势股票型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2014	-	-	-	-	-
2013	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金过去三年未发生利润分配。

§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2014年12月31日,本基金管理人共管理32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、海富通精选贰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)、海富通中小盘股票型证券投资基金、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、海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)、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、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双利分级债券型证券投资基金、海富通内需热点股票型证券投资基金、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、上证可质押城投债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		
陈静	本基金的基金经理;海富通股票基金经理;海富通领先成长股票基金经理	2012-02-17	2014-04-11	10年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任浙江省财政厅副主任科员、上海新理益投资管理有限公司高级经理、国元证券有限责任公司研究员、中国科技产业投资基金管理有限公司投资总监。2008年5月加入海富通基金管理有限公司,任投资经理。2012年2月至2014年4月任海富通股票、海富通风格优势股票基金经理。2012年4月至2014年4月任海富通领先成长股票基金经理。
宋争林	本基金的基金经理;海富通中小盘股票基金经理;海富通内需热点股票基金经理;海富通新内需混合基金经理	2014-04-11	2014-12-17	11年	清华大学物理化学专业博士研究生,持有基金从业人员资格证书,2003年3月起先后任职于中原证券、上海融昌资产管理有限公司、东方证券、国金证券,担任股票分析师,2007年5月加入海富通基金管理有限公司,任股票分析师。2013年11月至2014年12月任海富通中小盘股票基金经理。2014年4月至2014年12月,兼任海富通风格优势股票和海富通内需热点股票基金经理。2014年11月至2014年12月兼任海富通新内需混合基金经理。
顾晓飞	本基金的基金经理;海富通新内需混合基金经理;海富通国策导向股票基金经理	2014-12-12	-	6年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2008年5月至2010年6月任天隼投资咨询管理有限公司研究员,2010年6月至2011年7月任天治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月起任海富通国策导向股票基金经理。2014年12月起兼任海富通新内需混合和海富通风格优势股票基金经理。

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。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

回顾2014年,宏观经济持续表现疲弱,随着政府一系列以经济托底为主线的微刺激政策出台(区域经济建设、铁路建设、小微企业减税、定向降准、地产限购政策松动等),A股市场上半年在经济数据、IPO重启和利好政策的交互影响下艰难前行。进入下半年,在沪港通积极预期,以及一带一路、国企改革、地产松绑、自贸区等相关政策纷纷出台的背景下,蓝筹股再度获得市场青睐。而后,央行在11月21日的全面降息举措,令市场感受到政府缓和实体经济下滑的决心,全面激发了市场热情,融资融券余额在股市的赚钱效应吸引下屡创新高,市场交投活跃。政策面利好及资金面支撑成为下半年大盘估值回升的主要动力,推动大盘在四季度走出量价齐升、投资热点涌动的大涨行情。

指数方面,各主要市场指数在2014年均收涨,大盘指数表现优于中小板和创业板。本年度,上证综指、深证成指、中小板指和创业板指分别上涨52.87%、35.62%、9.67%和12.83%。就中信一级行业指数来看,各行业指数也出现普涨行情。其中,非银行金融、建筑、房地产、银行、交通运输等大盘蓝筹板块表现靓丽,年度涨幅均在70%以上,非银行金融板块以129.76%涨幅居首;电子元器件、医药、传媒、食品饮料等行业表现相对较弱。

由于对市场相对谨慎,因此本基金在上半年降低了股票仓位。本基金持仓较多的传统成长行业,如安防、食品饮料行业表现较差,而重仓持有的化工类等资产表现相对较好。在结构上,增持了新能源行业。第三季度开始保持了较高的股票仓位,结构上保持了新能源行业,增配了农业等行业的股票。四季度继续保持了较高的股票仓位,结构上超配非银、一带一路相关、体育等行业,减持了估值偏高的创业板、中小板相关行业。

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14.60%,同期基金业绩比较基准收益率为35.54%,基金净值跑输业绩比较基准20.94个百分点。基金跑输基准是因为没有及时预判大盘风格变化,调整行业配置。

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2015年,2014年经济增速下滑至7%-8%的区间将成为未来几年的常态,从外部环境来看,美国经济复苏情况良好,但欧洲及日本经济增长压力较大,预计货币政策上会保持持续宽松的态势。大宗商品的价格预计将维持在低位运行。

国内投资方面,2015年国内基建及房地产投资增速将面临继续下行的压力。出口由于人民币升值的压力,将保持弱势。消费受制于较弱的投资增速及反腐影响,2015年可能依旧保持低位平稳。预计进入2015年经济将呈现稳增长和促改革并重的局面,介于目前经济内生增长依然维持弱势,预计政府仍将持续的保持一定程度的刺激,同时通过寻找新的经济增长点来稳定和促进经济增长。

在经过2014年上证指数的大幅上涨之后,预计市场将会继续被流动性及政策变化所主导一段时间,投资机会逐渐增多。延续上期判断,之前处于历史底部的价值蓝筹公司,随着市场对经济大周期系统风险担忧的进一步缓解,在2014年第四季度出现了一波估值修复的行情。作为稳定经济的主要手段之一,铁路核电等投资相关产业在2015年两会之前将会被市场逐步认知并重视。随着政策的逐步落实和订单的逐步确认,将会对相关的价值蓝筹公司进一步带来估值和业绩的双提升。成长类资产以及转型类资产在年报期面临业绩兑现的压力,在经过业绩的检验和筛选之后,代表着未来经济发展大方向,具备真实高成长能力的相关行业和股票将会重新获得市场的青睐。

基于上述判断,在稳定与转型的双重背景下,随着稳定经济的措施的持续推进,优质存量资产的价值将会继续得到体现和重估;而符合经济升级趋势、政策扶持方向等相关资产,如果能得到业绩的支撑,其股价仍将有望震荡上行。

本基金2015年将延续2014年四季度的投资方向,仍将以两个方面为主,其中一方面为受益于政府稳定经济措施的行业,相关优质公司会带来业绩和估值的双提升,另外一方面代表着未来经济发展大方向,具备真实高成长能力的相关行业和股票。

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。

除了投资总监外,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。

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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:海富通风格优势股票型证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日
单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	185,446,902.97	382,011,803.46
结算备付金	1,263,282.70	5,463,764.32
存出保证金	613,626.71	838,226.34
交易性金融资产	1,497,211,801.99	1,863,984,274.99
其中:股票投资	1,497,211,801.99	1,863,984,274.99
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	200,000,000.00
应收证券清算款	14,320,950.89	-
应收利息	43,977.78	89,370.24
应收股利	-	-
应收申购款	3,225,128.37	152,039.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,702,125,671.41	2,452,539,478.36
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	-	200,167,796.07
应付赎回款	13,981,676.65	1,675,390.51
应付管理人报酬	2,095,386.94	2,883,090.20
应付托管费	349,231.14	480,515.07
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,039,175.64	3,469,547.23
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	356,340.54	400,572.05
负债合计	21,821,810.91	209,076,911.13
所有者权益:		
实收基金	1,684,951,642.71	2,578,867,218.29
未分配利润	-4,647,782.21	-335,404,651.06
所有者权益合计	1,680,303,860.50	2,243,462,567.23
负债和所有者权益总计	1,702,125,671.41	2,452,539,478.36

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值0.997元,基金份额总额1,684,951,642.71份。

7.2 利润表

会计主体:海富通风格优势股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	286,568,322.51	334,532,509.59
1.利息收入	2,422,802.83	3,104,114.23
其中:存款利息收入	2,329,600.77	1,680,680.02
债券利息收入	-	1,350,404.80
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	93,202.06	73,029.41
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	305,399,242.89	365,745,529.91
其中:股票投资收益	288,551,321.24	344,752,744.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	653,590.81
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	16,847,921.65	20,339,194.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-21,290,320.80	-35,328,335.28
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	36,597.59	1,011,200.73
减:二、费用	53,419,797.11	68,430,541.03
1.管理人报酬	28,907,740.12	37,608,833.30
2.托管费	4,817,956.65	6,268,138.83
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	19,251,444.20	24,126,622.48
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	442,656.14	426,946.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	233,148,525.40	266,101,968.56
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	233,148,525.40	266,101,968.56

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通风格优势股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日
单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1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)	2,578,867,218.29	-335,404,651.06	2,243,462,567.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	233,148,525.40	233,148,525.40
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)	-893,915,575.58	97,608,343.45	-796,307,232.13
其中:1.基金申购款	59,073,305.41	-4,198,297.60	54,875,007.81
2.基金赎回款	-952,988,880.99	101,806,641.05	-851,182,239.94
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)	1,684,951,642.71	-4,647,782.21	1,680,303,860.50
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	4,182,041,088.80	-867,882,485.29	3,314,158,603.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	266,101,968.56	266,101,968.56
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)	-1,603,173,870.51	266,375,865.67	-1,336,798,004.84
其中:1.基金申购款	170,172,535.81	-32,185,932.38	137,986,603.43
2.基金赎回款	-1,773,346,406.32	298,561,798.05	-1,474,784,608.27
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)	2,578,867,218.29	-335,404,651.06	2,243,462,567.23

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:张文伟,主管会计工作负责人:陶网雄,会计机构负责人:张琦

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通风格优势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")证监基金字[2006]第179号《关于同意海富通风格优势股票型证券投资基金设立的批复》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《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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2,217,258,171.44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(2006)第136号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》于2006年10月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,218,085,859.91份基金份额,其中认购资金利息折合827,688.47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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通风格优势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。在通常市场情况下,基金投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%,权证投资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:MSCIChinaA指数×75%+上证国债指数×25%。

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2015年3月25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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通风格优势股票型证券投资基金 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2014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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司("海富通")	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎投资管理BE控股公司 (BNP Paribas Investment Partners BE Holding)	基金管理人的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	1,979,156,151.58	15.83%	1,607,018,733.27	10.17%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	1,773,620.27	15.82%	839,255.67	16.66%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	1,441,044.20	10.51%	130,212.59	3.75%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	28,907,740.12	37,608,833.30
其中:支付销售机构的客户维护费	5,307,598.20	6,283,490.31

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,817,956.65	6,268,138.83

注:支付基金托管人中国建设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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	185,446,902.97	2,260,245.22	382,011,803.46	1,559,216.38

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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购买其承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600705	中航资本	2014-03-20	2015-03-19	非公开发行	14.54	15.78	3,000,000	43,620,000.00	47,340,000.00	-
600705	中航资本	2014-12-26	2015-03-19	非公开发行-转增	-	15.78	3,000,000	-	47,340,000.00	-

注:基金作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.9.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002157	正邦科技	2014-11-19	重大资产重组	10.03	2015-03-16	11.03	5,182,033	53,339,902.69	51,975,790.99	-

注:本基金截至2014年12月31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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为1,350,556,011.00元,属于第二层次的余额为146,655,790.99元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次1,802,665,286.59元,第二层次61,318,988.40元,无属于第三层次的余额)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,497,211,801.99	87.96
	其中:股票	1,497,211,801.99	87.96
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	186,710,185.67	10.97
7	其他各项资产	18,203,683.75	1.07
8	合计	1,702,125,671.41	100.00

8.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	309,315,790.99	18.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	534,179,011.00	31.79
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	462,595,000.00	27.53
K	房地产业	191,122,000.00	11.37
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	1,497,211,801.99	89.10

8.3 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

代码	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	300162	雷曼光电	2,400,000	134,400,000.00	8.00
2	600109	国金证券	6,000,000	118,740,000.00	7.07
3	600068	葛洲坝	12,000,000	111,960,000.00	6.66
4	601390	中国中铁	12,000,000	111,600,000.00	6.64
5	600048	保利地产	10,000,000	108,200,000.00	6.44
6	601688	华泰证券	4,000,000	97,880,000.00	5.83
7	601186	中国铁建	6,254,850	95,449,011.00	5.68
8	600705	中航资本	6,000,000	94,680,000.00	5.63
9	601668	中国建筑	12,000,000	87,360,000.00	5.20
10	600999	招商证券	2,000,000	56,540,000.00	3.36

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 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601788	光大证券	148,905,651.71	6.64
2	600109	国金证券	147,243,112.47	6.56
3	601688	华泰证券	147,110,346.63	6.56
4	600048	保利地产	128,249,339.51	5.72
5	601318	中国平安	125,203,281.51	5.58
6	300162	雷曼光电	120,909,207.34	5.39
7	600030	中信证券	118,674,452.62	5.29
8	600068	葛洲坝	112,170,508.24	5.00
9	601901	方正证券	102,107,863.44	4.55
10	601668	中国建筑	102,030,637.16	4.55
11	600031	三一重工	100,856,434.33	4.50
12	601390	中国中铁	99,535,904.53	4.44
13	600999	招商证券	97,145,055.61	4.33
14	002415	海康威视	89,283,654.71	3.98
15	601186	中国铁建	84,656,738.24	3.77
16	002292	奥飞动漫	77,502,096.91	3.45
17	002005	德豪润达	75,589,859.11	3.37
18	600406	国电南瑞	73,975,370.99	3.30
19	000728	国元证券	70,032,153.26	3.12
20	601000	唐山港	69,910,778.07	3.12
21	000559	万向钱潮	69,734,001.61	3.11
22	002714	牧原股份	66,146,801.61	2.95
23	600522	中天科技	65,288,946.85	2.91
24	600585	海螺水泥	60,341,820.87	2.69
25	601555	东吴证券	57,624,431.55	2.57
26	600887	伊利股份	57,466,615.46	2.56
27	002104	恒宝股份	54,498,296.87	2.43
28	300168	万达信息	53,466,445.70	2.38
29	002157	正邦科技	53,339,902.69	2.38
30	600108	亚盛集团	52,396,245.56	2.34
31	002673	西部证券	51,471,509.00	2.29
32	002500	山西证券	51,466,263.13	2.29
33	601328	交通银行	51,457,574.01	2.29
34	000783	长江证券	51,437,679.63	2.29
35	300090	盛运股份	51,359,822.18	2.29
36	002048	宁波华翔	50,958,266.02	2.27
37	600158	中体产业	50,834,409.60	2.27
38	002477	雏鹰农牧	50,735,891.01	2.26
39	601118	海南橡胶	50,456,714.82	2.25
40	600210	紫江企业	50,288,915.73	2.24
41	002407	多氟多	50,195,751.60	2.24
42	600036	招商银行	50,131,423.46	2.23
43	000157	中联重科	48,803,207.13	2.18
44	000528	柳 工	48,604,808.77	2.17
45	601669	中国电建	47,190,945.47	2.10
46	002299	圣农发展	46,939,811.74	2.09
47	601800	中国交建	46,726,403.95	2.08
48	300037	新宙邦	45,409,303.75	2.02
49	300070	碧水源	45,261,148.01	2.02
50	000024	招商地产	45,016,202.54	2.01

注:"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600352	浙江龙盛	238,895,063.23	10.65
2	601788	光大证券	155,581,815.90	6.93
3	601901	方正证券	145,982,095.21	6.51
4	600030	中信证券	128,928,824.97	5.75
5	002415	海康威视	127,575,352.61	5.69
6	600703	三安光电	124,318,184.67	5.54
7	002440	闰土股份	113,561,564.85	5.06
8	600887	伊利股份	109,378,362.84	4.88
9	000895	双汇发展	102,500,131.27	4.57
10	300212	易华录	101,994,587.43	4.55
11	600405	动力源	89,694,913.86	4.00
12	601318	中国平安	88,362,227.81	3.94
13	600511	国药股份	86,252,873.63	3.84
14	000728	国元证券	76,681,762.68	3.42
15	000559	万向钱潮	74,843,265.93	3.34
16	002714	牧原股份	72,704,156.77	3.24
17	600585	海螺水泥	71,626,063.52	3.19
18	601000	唐山港	68,647,200.68	3.06
19	601555	东吴证券	67,720,623.40	3.02
20	300168	万达信息	67,697,474.05	3.02
21	600079	人福医药	66,833,807.05	2.98
22	002005	德豪润达	66,111,039.90	2.95
23	002292	奥飞动漫	65,860,296.76	2.94
24	002104	恒宝股份	65,527,593.79	2.92
25	600522	中天科技	64,151,097.55	2.86
26	300323	华灿光电	63,185,240.47	2.82
27	601607	上海医药	61,622,180.17	2.75
28	002236	大华股份	61,428,147.11	2.74
29	600108	亚盛集团	58,952,509.80	2.63
30	600406	国电南瑞	57,650,660.46	2.57
31	000783	长江证券	57,476,278.36	2.56
32	601018	宁波港	56,876,654.14	2.54
33	601186	中国铁建	56,666,661.00	2.53
34	601118	海南橡胶	56,628,270.40	2.52
35	002202	金风科技	56,596,826.46	2.52
36	002375	亚厦股份	56,589,632.55	2.52
37	600210	紫江企业	54,864,555.77	2.45
38	002673	西部证券	54,788,814.05	2.44
39	000963	华东医药	52,048,281.15	2.32
40	601766	中国南车	51,706,298.82	2.30
41	002048	宁波华翔	51,515,992.20	2.30
42	601328	交通银行	49,969,187.18	2.23
43	002299	圣农发展	49,925,213.87	2.23
44	002474	榕基软件	49,658,975.05	2.21
45	600031	三一重工	49,570,215.73	2.21
46	300090	盛运股份	49,389,800.47	2.20
47	600036	招商银行	48,861,926.81	2.18
48	601688	华泰证券	47,985,180.14	2.14
49	002407	多氟多	47,634,596.23	2.12
50	002500	山西证券	46,577,685.09	2.08
51	600372	中航电子	45,888,895.82	2.05
52	002477	雏鹰农牧	45,525,944.92	2.03

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

序号	5,958,042,786.37
卖出股票的收入(成交)总额	6,592,076,259.81

注:"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1报告期内本基金投资的招商证券(600999)于2015年1月16日被中国证监会通报批评称公司存在向不符合条件的客户融资融券问题,并且受过处理仍未改正,中国证监会对公司采取责令限期改正的行政监管措施。

对该股票的投资决策程序的说明:当前行业正处于创新改革的黄金发展时期,公司作为具有雄厚资本实力的券商在创新业务领域具有先发优势和规模优势,公司增发后充裕的资本金将加速公司资本中介业务和投资业务规模化发展,开启业务新空间。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2本报告期内,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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	613,626.71
2	应收证券清算款	14,320,950.89
3	应收股利	-
4	应收利息	43,977.78
5	应收申购款	3,225,128.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,203,683.75

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600705	中航资本	94,680,000.00	5.63	非公开发行

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
66,342	25,397.96	42,258,136.19	2.51%	1,642,693,506.52	97.49%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	18,438.13	0.0011%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2006年10月19日)基金份额总额	2,218,085,859.91
本报告期期初基金份额总额	2,578,867,218.29
本报告期基金总申购份额	59,073,305.41
减:本报告期基金总赎回份额	952,988,880.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,684,951,642.71

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2014年6月14日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司第四届董事会审议通过,同意陈洪先生辞去公司副总经理职务。

2、2014年9月27日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司2014年第二次股东会议审议通过,聘请魏海诺(Mr. Bruno Weil)先生担任本公司监事。同时,谷若鸿(Mr. Laurent couraudon)先生不再担任本公司监事。

3、2014年10月24日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司第四届董事会第四次会议审议通过,聘请孟辉先生担任本公司副总经理。

4、2014年11月4日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司第四届董事会第四次会议审议通过,聘请何树方先生担任本公司副总经理。

5、2014年11月4日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司第四届董事会第四次会议审议通过,聘请戴德舜先生担任本公司副总经理。

6、2015年1月17日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司职工代表大会民主选举,公司股东会审议通过,聘请俞涛先生担任本公司职工监事,高勇前先生因个人原因离职,不再担任本公司职工监事。

7、2015年2月14日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司第四届董事会第三十六次临时会议审议通过,同意田仁灿先生辞去公司总经理职务,并决定由公司董事长张文伟先生代为履行总经理职务,代为履行总经理职务的期限不超过90日。公司已按有关规定向中国证券监督管理委员会和上海监管局报告。

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月3日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是100,000.00元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是9年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	1	2,086,959,420.78	16.70%	1,846,753.50	16.47%	-
海通证券	2	1,979,156,151.58	15.83%	1,773,620.27	15.82%	-
招商证券	2	1,483,642,976.57	11.87%	1,316,256.21	11.74%	-
上海证券	1	1,137,143,858.36	9.10%	1,035,254.66	9.23%	-
安信证券	2	1,046,775,414.99	8.37%	939,454.41	8.38%	-
瑞银证券	1	1,026,118,295.94	8.21%	934,173.07	8.33%	-
东兴证券	1	564,456,558.08	4.52%	513,884.09	4.58%	-
国元证券	1	494,002,023.77	3.95%	449,737.17	4.01%	-
中信证券	2	382,714,706.27	3.06%	345,601.03	3.08%	-
申银万国	1	376,638,942.40	3.01%	342,891.39	3.06%	-
中银国际	2	323,616,231.64	2.59%	290,132.76	2.59%	-
国都证券	1	252,576,701.45	2.02%	229,943.67	2.05%	-
财富证券	1	246,898,432.66	1.98%	224,775.78	2.00%	-
国信证券	2	233,504,138.62	1.87%	212,583.10	1.90%	-
东北证券	1	188,099,927.92	1.50%	166,450.27	1.48%	-
广发证券	1	170,029,984.46	1.36%	154,793.58	1.38%	-
齐鲁证券	1	147,180,718.85	1.18%	133,992.74	1.19%	-
华泰证券	1	123,758,480.66	0.99%	109,513.97	0.98%	-
银河证券	1	91,798,046.64	0.73%	62,873.16	0.56%	-
民生证券	1	89,355,560.17	0.71%	81,349.15	0.73%	-
国泰君安	1	44,128,346.77	0.35%	40,173.85	0.36%	-
中金公司	1	10,727,294.09	0.09%	9,766.15	0.09%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注:报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

(1)交易单元的选择标准 本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序 本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择:

<1> 推荐。投资部业务人员推荐,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见,并报公司总裁办公会核准。

<3>核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的总裁办公会核准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
德邦证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

§12 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2014年12月31日,海富通管理的公募基金资产规模为287亿元人民币。

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2014年12月31日,海富通为80多家企业超过347亿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2014年12月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过65亿元。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。

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2014年12月31日,投资咨询及海外业务规模超过220亿元人民币。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RQFII(人民币合格境外机构投资者)业务资格,能够在香港筹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RQFII产品。

2012年3月,国内权威财经媒体《中国证券报》等授予海富通基金管理有限公司"中国基金业金牛基金管理公司"大奖,《证券时报》授予 海富通精选混合基金"2011年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金"荣誉。2013年4月,《上海证券报》授予海富通精选混合基金2012年"金基金"奖——分红基金奖。

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。

海富通基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日