海富通国策导向股票型证券投资基金

【2013】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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年三月三十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2013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

基金名称	海富通国策导向股票
基金主代码	519033
交易代码	519033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月16日
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
报告期末基金份额总额	623,734,541.34份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将从受益于国家政策,尤其是产业政策的行业中,精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极投资,同时辅以适度的资产配置,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将以政策受益作为投资主线,资产配置将利用多因素分析,着重考虑国家的宏观经济政策影响;如财政政策和货币政策等;行业配置与个股精选将着重以国家的产业政策为主要考虑因素,深入挖掘受益于国家政策的上市公司的价值。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金属股票型基金,属于高风险、高预期收益的投资品种。其预期收益、预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	戚万荣	谢祥麟
	联系电话	021-38650891	95566
	电子邮箱	wrq@hftfund.com	fxk@bank of china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

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	2013年	2012年	2011年11月16日(基金合同生效日)至2011年12月31日
本期已实现收益	-101,862,461.59	3,159,216.24	1,041,689.21
本期利润	-65,982,316.21	6,510,036.15	1,041,689.21
加权平均基金份额本期利润	-0.3309	0.1020	0.0019
本期基金份额净值增长率	37.39%	0.10%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.2463	-0.0133	0.0019
期末基金资产净值	859,628,581.65	54,557,031.54	554,322,816.44
期末基金份额净值	1.378	1.003	1.002

注:1.本基金合同生效日为2011年11月16日。

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.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。

4.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

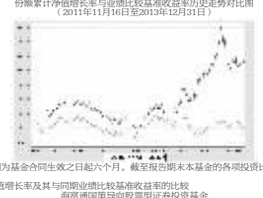
3.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.40%	1.57%	-2.24%	0.90%	-10.16%	0.67%
过去六个月	26.54%	1.77%	6.50%	1.01%	20.04%	0.76%
过去一年	37.39%	1.68%	-2.33%	1.08%	39.72%	0.60%
自基金合同生效起至今	37.80%	1.38%	-9.15%	1.06%	46.95%	0.32%

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

海富通国策导向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

(2011年11月16日至2013年12月31日)

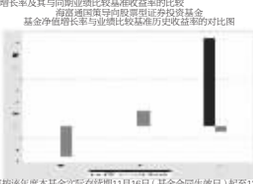


注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分(二)投资范围、(七)投资限制中规定的各项比例。

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

海富通国策导向股票型证券投资基金

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注:图中列示的2011年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期11月16日(基金合同生效日)起至12月31日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位: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
2013	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
2011	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金合同于2011年11月16日生效,未实施利润分配。

§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。本海富通国策导向股票型证券投资基金是基金管理人管理的第二十只公募基金;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、海富通稳健添诚平衡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、海富通稳健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、海富通稳进增利分级债券型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通股息管理货币市场基金、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和海富通内需热点股票型证券投资基金二十五只公募基金。

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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牟永宁	本基金的基金经理;海富通收益增长混合基金经理;海富通风格优势股票基金经理	2011-11-16	2013-10-25	18年	中国籍,硕士,CFA,历任申银万国证券股份有限公司分析师,申万巴黎基金管理有限公司股票分析师,2004年8月加入海富通基金管理有限公司,任策略分析师、研究总监。2009年1月至2011年4月任海富通收益增长混合基金经理。2009年10月至2012年1月任海富通中证100指数(LOF)基金经理。2011年4月至2013年10月任海富通风格优势股票基金经理。2011年11月至2013年10月任海富通国策导向股票基金经理。2012年1月至2013年10月任海富通收益增长混合基金经理。
黄春雨	本基金的基金经理;海富通收益增长混合基金经理;海富通内需热点股票基金经理	2013-07-31	-	6年	中国籍,博士,持有基金从业人员资格证书,历任宝盈基金管理有限公司研究部研究员,上投摩根基金管理有限公司研究高行业专家,2010年6月加入海富通基金管理有限公司,历任股票分析师、高级股票分析师,2013年4月至7月任海富通收益增长混合和海富通国策导向股票基金经理助理,2013年7月起任海富通收益增长混合和海富通国策导向股票基金经理,2013年12月起兼任海富通内需热点股票基金经理。

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、制度和流程规范了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了投权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节。同时,公司投资交易业务组织架构规范了各投资组合投资经理、投资决策委员会、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的机会、风险、利益冲突的公平分配和控制。公司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施。

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投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动环环不得妨碍公平对待。各投资组合均采用投权指示、法规公司制度执行投资交易,保证公平交易制度的执行和实施。

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,并采取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的于分布检验,结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、资金规模、交易方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。经果表明,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2013年,年初股市表现不错,主要得益均迎来两位数以上的涨幅。然而,政府随后对房市的大力抑制(“国五条”)再度带来悲观气氛,自此,股市开始呈现随消息面起伏的走势。从“新型城镇化”、6月“钱荒”、自贸区、通信和传媒板块的活跃、优先股试点消息发布,再到年底的十八届三中全会、中央经济会议、中央农村工作会议及新股发行制度改革和重启时点的变化,可以说“你未唱罢我便登场”的态势持续年动着2013年市场的神经;美联储QE退出进程更全年主导着市场的预期心理。在改革预期和资金面的影响下,股市债市均维持震荡格局,而各板块之间在热点纷呈的主题带领下,演绎出分化的行情,创业板指数表现异军突起。

整年度来看,股市表现结结分化,整年度上证综指以5.96%收官,而自2012年下半年开始起涨的创业板指仍保持强劲势头,整年度涨幅高达82.73%。债市则是在资金性持续紧张的压力下,表现仍旧疲弱,整年度中债全债指数收益为4%~6%。

整年度行业表现,若剔除中信一级行业,当中有15个行业整年度表现超过10%,表现最好的是传媒(+102.56%),其次是计算机(+75.72%)和通信(+45.25%)。另外,跌幅超过10%有四个行业,均为周期股,如煤炭(-40.30%),有色金属(-29.75%),钢铁(-16.49%)和房地产(-11.69%)。

本基金在第一季度大部分时间里推升了较高的股票仓位比例,但进入3月份后因为主动在股票持仓上的调整,本基金主要增持了医药、大众食品、农业、消费电子以及环保等成长类资产以及一些低估值的蓝筹股,减持了非银金融、地产、化工、建材、金属、机械等周期类资产。在二季度维持了偏高的股票资产配置比例,结构上增持了传媒、食品饮料和生物医药板块的投资比例,全面减持了金融、房地产等传统行业个股的配置。三季度继续专注于成长、周期改革比较明确的板块,比如传媒、上地改革等,在股票持仓结构上,本基金略微降低了医药的相关配置,继续坚守传媒等,增加了政策方向的农业相关个股的配置。仓位上一直维持高位,但是由于二季度规模增加较快,一定程度上影响了仓位。四季度原分减持了前期超额收益巨大的传媒、电子等成长股,期加了医药食品饮料的配置。

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37.39%,同期基金业绩比较基准收益率为-2.33%,基金净值跑赢业绩比较基准39.72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2014年,2013年对美国经济数据来说可谓是个好年份,经济逐步复苏有望逐步加速。而欧洲方面,欧元区经济内部增长动力主要来源于融资条件改善,外部动力主要来源于美国,中国经济改善。2014年欧洲经济在欧央行宽松政策和美国经济复苏的带动下有望继续温和复苏。

国内投资方面,受房地产投资增速下行拖累,2014年固定资产投资增速将略有下行;制造业投资受制于整体过剩的产能和高企的资金成本也将有所下降,而出口在美国和欧洲复苏的带动下有望继续回暖,消费受益于投权改革,2014年可能会出现投权提速。总体而言进入2014年,国内经济将保持平稳。总体而言进入2014年,国内经济将保持平稳。向下的风险不大,但向上也缺乏弹性。就业方面,受制于高企的成本约束及产能过剩,2014年就业压力仍旧较大;海外资金价格上升,美国量化宽松政策将可以及时推出增长推进等因素,2014年整体的流动性仍将偏紧,估值方面,随着时间推移,2013年的300指数的市盈率已接近历史低位,继续向下的空间可能不大。中国股市目前所处的大的背景仍是改革和转型,股市的估值体系正在重塑,结构性仍是市场的重点。因此,寻找那些符合经济转型方向的领域和小股机会或将成为投资的主线。

基于上述判断,2014年本基金继续看好在结构转型和经济低速增长背景下,成长行业、成长股的行情。因此,未来会继续坚持自下而上的选股策略,精选具有长期成长性的行业和成长性的个股。尤其是在互联网应用蓬勃发展的背景下,相关行业在未来国民经济中的地位会越来越高,将会出现很多能够成长壮大的优秀公司,力争为投资者带来更好回报。

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,委员会成员目有3 位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和采纳了(即时)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可靠,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负责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

根据基金合同的规定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于期末可供分配利润的20%。

本基金本报告期内未进行利润分配,且符合基金合同规定。

§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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对海富通国策导向股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况,财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内),投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:海富通国策导向股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	47,761,800.99	6,470,486.17
结算备付金	7,971,875.98	110,580.15
存出保证金	799,775.41	251,133.57
交易性金融资产	652,749,035.02	44,956,848.25
其中:股票投资	652,749,035.02	44,956,848.25
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	-	-
应收证券清算款	183,102,389.69	-
应收利息	54,218.25	1,395.01
应收股利	-	-
应收申购款	270,780.70	6,857,905.23
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	892,709,876.04	58,648,348.38
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31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	23,225,886.74	3,479,031.75
应付赎回款	4,211,021.75	81,366.98
应付管理人报酬	1,082,495.04	53,842.84
应付托管费	180,415.82	8,973.80
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,985,750.39	101,782.14
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	395,724.65	366,299.33
负债合计	33,081,294.39	4,091,316.84
所有者权益:		
实收基金	623,734,541.34	54,378,511.41
未分配利润	235,894,040.31	178,520.13
所有者权益合计	859,628,581.65	54,557,031.54
负债和所有者权益总计	892,709,876.04	58,648,348.38

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.378元,基金份额总额623,734,541.34份。

7.2 利润表

会计主体:海富通国策导向股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

姓名	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一.收入	-50,500,552.70	9,877,352.45
1.利息收入	623,659.50	484,908.87
其中:存款利息收入	411,909.22	391,712.91
债券利息收入	-	1,409.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	211,750.28	91,786.15
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-87,847,316.59	5,333,668.06
其中:股票投资收益	-88,183,340.89	4,744,164.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-24,999.91
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	336,024.30	614,413.81
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	35,880,145.38	3,350,819.91
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	842,959.01	707,955.61
减:二.费用	15,481,763.51	3,367,316.30
1.管理人报酬	3,996,154.51	1,066,698.14
2.托管费	651,025.79	177,783.01
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	10,518,661.57	1,745,956.19
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	405,921.64	376,878.96
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-65,982,316.21	6,510,036.15
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	-65,982,316.21	6,510,036.15

【2013】年度报告摘要

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通国策导向股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	54,378,511.41	178,520.13	54,557,031.54
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-65,982,316.21	-65,982,316.21
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)	569,356,029.93	301,697,836.39	871,053,866.32
其中:1.基金申购款	1,064,232,056.88	476,515,223.03	1,540,747,279.91
2.基金赎回款	-494,876,026.95	-174,817,386.64	-669,693,413.59
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)	623,734,541.34	235,894,040.31	859,628,581.65

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	553,281,127.23	1,041,689.21	554,322,816.44
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,510,036.15	6,510,036.15
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)	-498,902,615.82	-7,373,205.23	-506,275,821.05
其中:1.基金申购款	62,483,353.57	-2,304,989.12	60,178,364.45
2.基金赎回款	-561,385,969.39	-5,068,216.11	-566,454,185.50
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)	54,378,511.41	178,520.13	54,557,031.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告21至74,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:田仁迪,主管会计工作负责人:蒋小庆,会计机构负责人:高勇前

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通国策导向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【2011】1339号文核准,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《海富通基金管理有限公司公开募集、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653,165,647.55元,已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(2011)第421号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《海富通国策导向股票型证券投资基金基金合同》于2011年11月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为653,281,127.23份基金份额,其中认购资金利息折合1!15,470.08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《海富通国策导向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)。基金投资组合中股票、权证资产占基金资产的60%~95%,其中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,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%。 法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,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:MSCI 中国A 股指数×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2014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》、《海富通国策导向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2011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12月31日的财务状况以及2013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

本基金本报告期内没有会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内没有会计估计变更。

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。基金实现股票、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。

(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

项目	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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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:*上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

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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间应支付关联方的佣金。

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,906,154.51	1,066,698.14
其中:支付销售机构的客户维护费	1,569,372.50	255,652.28

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	651,025.79	177,783.01

注:支付基金托管人中国银行股份有限公司的管理人报酬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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国银行	47,761,800.99	351,189.52	6,470,486.17	144,064.16

注:本基金托管人中国银行股份有限公司管理人中国银行保管,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

金额单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
海通证券	113003	重工转债	老股东配债	6,250	625,000.00

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其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2013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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时性停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时性停牌等流通受限股票。

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)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。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据公允价值计量时计量整体具有意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层级:直接比如取自价格或间接比如根据价格推算的可观察到的,除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的方法推算的资产或负债的输入值不可观察输入值。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为652,749,035.02元,无属于第二层级和第二层级的余额。(2012年12月31日:第一层级44,956,848.25元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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将其纳入第一层级的公允价值列入第一层级,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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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