海富通精选贰号混合型证券投资基金

【2014】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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年八月二十九日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月28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2014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	海富通精选贰号混合
基金主代码	519015
交易代码	519015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月9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	1,618,262,123.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行资产配置的投资策略,实施全程风险管理,在保证资产良好流动性的前提下,在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金的投资策略分两个层次:第一层次为适度主动的资产配置,以控制或规避市场系统性风险;第二层次为积极主动的精选证券,以分散或规避个券风险。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。
业绩比较基准	MSCI China A指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险度适中的品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcsd@bankofchina.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(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	-50,700,961.78
本期利润	-42,339,955.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0251
本期基金份额净值增长率	-3.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3472
期末基金资产净值	1,056,414,526.06
期末基金份额净值	0.653

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)。

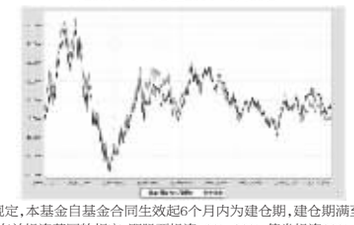
3.2 基金净值表现

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	2.35%	0.75%	0.54%	0.52%	1.81%	0.23%
过去三个月	3.82%	0.72%	0.82%	0.57%	3.00%	0.15%
过去六个月	-3.55%	0.82%	-3.44%	0.67%	-0.11%	0.15%
过去一年	4.98%	0.84%	1.86%	0.75%	3.12%	0.09%
过去三年	-11.40%	0.90%	-14.42%	0.84%	3.02%	0.06%
自基金合同生效起至今	8.12%	1.22%	1.22%	1.21%	6.90%	0.01%

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

海富通精选贰号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
(2007年4月9日至2014年6月30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,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,即股票投资50%-80%,债券投资20%-50%,权证投资0-3%;并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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。本海富通精选贰号混合型证券投资基金是基金管理人管理的第七只公募基金;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、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二十七只公募基金。

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		
蒋征	本基金的基金经理;海富通强化回报混合基金经理;海富通精选混合基金经理;投资副总监	2012-01-20	2014-01-22	16年	工商管理硕士,持有基金从业人员资格证书。历任中国保险信托投资公司业务经理,嘉实基金管理有限公司丰和基金经理助理,2003年1月至2004年4月任泰和基金经理,2004年8月至2006年5月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选基金经理,2005年12月至2006年5月任基金兴安基金经理。2006年6月加入海富通基金管理有限公司。2006年9月至2014年1月任海富通强化回报混合基金经理,2007年1月至2009年1月任海富通股票基金经理,2007年10月至2013年1月任股票相对收益组合部总监,2009年1月至2012年1月任海富通收益增长混合基金经理,2010年9月至2012年1月任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理。2012年1月至2014年1月任海富通精选混合及海富通精选贰号混合基金经理。2013年1月至2014年1月任投资副总监。
丁俊	本基金的基金经理;海富通精选混合基金经理;海富通收益增长混合基金经理;海富通股票基金经理;投资副总监	2014-01-17	-	12年	硕士。持有基金从业人员资格证书。2002年7月至2006年4月就职于平安资产管理公司,曾任权益投资部研究主管,2006年4月加入海富通基金管理有限公司,任海富通精选混合和海富通风格优势股票基金经理助理,2007年8月至2012年1月任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2012年1月至2014年3月任海富通基金管理有限公司研究总监。2014年1月起任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2014年3月起任投资副总监。2014年4月起兼任海富通收益增长混合和海富通股票基金经理。

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。

3、本公司于2014年8月12日发布公告,自2014年8月12日起,聘任黄峰先生担任本基金的基金经理助理,协助基金经理进行本基金的投资运作。

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 管理人对报告期内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

2014年上半年,A股市场在宏观经济持续疲弱、IPO重启、两会以及微刺激政策的交错影响下呈现窄幅震荡格局。年初,市场延续了结构化行情,断档一年多的IPO重新开闸和两会前的维稳预期,令创业板和两会政策利好板块轮番上涨。随着国内经济下行对市场造成的压力逐渐加大,市场风险偏好下降,政府连续出台了铁路建设、棚户区改造、小微企业减税、"定向降准"、地产放松等一系列微调政策,短期内对大盘股带来一定支撑,市场风格有向蓝筹转换的倾向。二季末,在稳增长政策的持续作用下,经济企稳预期增强,IPO重启对市场资金的分流效果也有所减轻,加上央行连续在公开市场实现净投放,资金面在季末时点维持相对宽松的状态,各大指数纷纷上扬。

指数方面,除创业板在上半年上涨7.69%外,上证综指下跌3.20%,深证成指跌幅达9.59%,中小板指下跌3.72%。行业方面,今年以来的市场热点始终围绕在政策长期支持的领域,计算机、通信、餐饮旅游、轻工制造、传媒等板块上半年表现较佳;煤炭、非银行金融、农林牧渔、商贸零售、食品饮料等板块则较为疲弱。

2014年一季度本基金减持了部分成长性不明显的价值股,增持了部分业绩增长相对确定的公司。至于新兴成长,本基金较之于2013年也加大了配置力度,选择了部分业绩有望明显受益于经济转型的公司。同时也配置了一批积极转型的传统产业公司,以期获得估值提升的空间。二季度随着创业板跌破1300点,本基金开始增持以创业板为代表的股票资产,提高组合弹性,该部分增仓在随后的市场反弹中获取了不错的收益。但组合中部分稳定增长的资产今年股价表现持续低迷,拖累了组合反弹中的表现。临近季末,创业板反弹已累积一定幅度,且即将中报来临,部分股价已大幅反弹的成长股又将面临业绩压力。基于此,本基金对该类资产进行了减持,同时将股票配置比例降到较低水平。

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-3.55%,同期基金业绩比较基准收益率为-3.44%,基金净值跑输业绩比较基准0.11个百分点。主要原因为一月份调整组合结构对净值形成拖累。

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,鉴于2013年三季度高基数的影响,经济增速依然存在压力,预计政府将进一步加大微刺激力度,全年实现政府经济增长目标无忧。但市场会随着经济数据和政策变化而宽幅波动。以创业板为代表的成长类资产已经取代周期类资产成为市场情绪的风向标。但随着时间推移,成长类资产将面临越来越大的业绩和估值压力。如何消化这一压力将成为下半年市场的重要不确定性。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,其股价有望震荡上行。同时,估值已达历史底部的大盘蓝筹公司是否能随着市场对经济担忧的消除而出现一定的估值修复也将是市场下半年面临的课题之一。

本基金将继续以股票配置比例变动来应对系统性风险变化。资产选择上,政策受益型资产和代表未来经济发展方向的成长类资产后续值得重点跟踪。

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。

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")在对海富通精选贰号混合型证券投资基金(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,完全尽职尽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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:海富通精选贰号混合型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	281,689,483.07	159,372,282.47
结算备付金	785,983.25	158,703.48
存出保证金	388,222.55	276,302.51
交易性金融资产	773,936,623.80	1,024,808,685.61
其中:股票投资	554,959,569.80	728,093,197.61
基金投资	-	-
债券投资	218,977,054.00	296,715,488.00
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	-	-
应收利息	3,323,968.53	3,640,253.60
应收股利	-	-
应收申购款	1,869.31	16,829.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,060,126,150.51	1,188,273,056.92
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30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	-	-
应付赎回款	1,489,556.35	926,649.97
应付管理人报酬	1,294,800.45	1,522,502.50
应付托管费	215,800.06	253,750.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	513,100.37	388,353.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,367.22	400,014.67
负债合计	3,711,624.45	3,491,270.54
所有者权益:		
实收基金	1,618,262,123.92	1,750,516,586.39
未分配利润	-561,847,597.86	-565,734,800.01
所有者权益合计	1,056,414,526.06	1,184,781,786.38
负债和所有者权益总计	1,060,126,150.51	1,188,273,056.92

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值0.653元,基金份额总额1,618,262,123.92份。

6.2利润表

会计主体:海富通精选贰号混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-29,766,927.24	19,752,817.81
1.利息收入	6,339,632.31	5,182,377.06
其中:存款利息收入	642,798.94	396,306.62
债券利息收入	5,686,868.86	4,658,538.04
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	9,964.51	127,532.40
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-44,468,234.08	41,147,113.50
其中:股票投资收益	-45,512,501.74	32,750,292.23
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,086,357.93	415,560.00
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	3,130,625.59	7,981,261.27
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	8,361,005.92	-26,695,947.27
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	668.61	119,274.52
减:二、费用	12,573,028.62	14,314,401.33
1.管理人报酬	8,134,670.85	9,539,536.12
2.托管费	1,355,778.45	1,589,922.60
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,866,215.40	2,970,784.22
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	216,363.92	214,158.39
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-42,339,955.86	5,438,416.48
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-42,339,955.86	5,438,416.48

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通精选贰号混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	1,750,516,586.39	-565,734,800.01	1,184,781,786.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-42,339,955.86	-42,339,955.86
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)	-132,254,462.47	46,227,158.01	-86,027,304.46
其中:1.基金申购款	1,472,829.96	-515,710.81	957,119.15
2.基金赎回款	-133,727,292.43	46,742,868.82	-86,984,423.61
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)	1,618,262,123.92	-561,847,597.86	1,056,414,526.06
项目	上年度可比期间 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)	2,191,219,586.94	-829,831,708.02	1,361,387,878.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,438,416.48	5,438,416.48
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)	-275,184,275.03	100,643,316.80	-174,540,958.23
其中:1.基金申购款	3,598,761.52	-1,281,276.76	2,317,484.76
2.基金赎回款	-278,783,036.55	101,924,593.56	-176,858,442.99
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)	1,916,035,311.91	-723,749,974.74	1,192,285,337.17

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:

基金管理人负责人: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

海富通精选贰号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")证监基金字[2007]第63号《关于同意海富通精选贰号混合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《海富通精选贰号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8,596,643,748.57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(2007)第031号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》于2007年4月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为8,599,641,740.00份基金份额,其中认购资金利息折合2,997,991.43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《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票投资50%-80%,债券投资20%-50%,权证投资0%-3%,并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:MSCI China A指数×65%+上证国债指数×35%。

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8月28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》、《海富通精选贰号混合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2014年上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2014年6月30日的财务状况以及2014年上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[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期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
中国银行股份有限公司("中国银行")	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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,134,670.85	9,539,536.12
其中:支付销售机构的客户维护费	1,460,379.47	1,710,357.18

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,355,778.45	1,589,922.60

注:支付基金托管人中国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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国银行	281,689,483.07	628,931.64	124,119,417.34	378,267.23

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,并按银行间同业利率计息。

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购买其承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项.

6.4.9 期末(2014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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 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	中航投资	2014-03-20	2015-03-19	非公开发行	14.54	14.98	750,000	10,905,000.00	11,235,000.00	-

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。

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
300271	华宇软件	2014-06-27	重大事项	40.30	-	-	162,744	5,153,345.66	6,558,583.20	-
300295	三六五网	2014-04-11	重大事项	96.81	2014-07-08	105.00	17,700	1,588,000.75	1,713,537.00	-
300379	东方通	2014-06-23	重大事项	62.17	2014-08-15	67.39	112,726	5,634,498.32	7,008,175.42	-

注:本基金截至2014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

本基金本报告期未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	554,959,569.80	52.35
	其中:股票	554,959,569.80	52.35
2	固定收益投资	218,977,054.00	20.66
	其中:债券	218,977,054.00	20.66
	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	282,475,466.32	26.65
7	其他各项资产	3,714,060.39	0.35
8	合计	1,060,126,150.51	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	16,381,324.59	1.55
B	采矿业	-	-
C	制造业	379,648,391.81	35.94
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	8,715,765.28	0.83
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	110,727,746.30	10.48
J	金融业	11,235,000.00	1.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,435,369.22	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,240,921.25	1.06
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	5,575,051.35	0.53
S	综合	-	-
	合计	554,959,569.80	52.53

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	000625	长安汽车	4,314,817	53,115,397.27	5.03
2	002415	海康威视	1,892,077	32,051,784.38	3.03
3	002065	东华软件	1,556,584	31,318,470.08	2.96
4	000541	佛山照明	2,068,700	20,604,252.00	1.95
5	600703	三安光电	832,752	19,511,379.36	1.85
6	600352	浙江龙盛	1,103,072	17,814,612.80	1.69
7	600201	金宇集团	549,535	17,101,529.20	1.62
8	000400	许继电气	837,608	16,794,040.40	1.59
9