基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年八月二十九日

海富通强化回报混合型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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。

基金托管人招商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	海富通强化回报混合
基金主代码	519007
交易代码	519007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月25日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,902,354,792.32份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	每年超越三年期定期存款(税前)加权平均收益率。
投资策略	本基金认为,灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源,而收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。因此,本基金将运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略,实现基金的投资目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率
风险收益特征	追求每年高于一定正回报的投资品种。属于适度风险、适中收益的混合型基金,其长期的预期收益和风险高于债券基金,低于股票基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	臧万荣	张燕
	联系电话	021-38650891	0755-83199084
	电子邮箱	wrzs@hftfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		40088-40099	95555
传真		021-33830166	0755-83195201

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	-135,579,455.03
本期利润	-157,753,961.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0747
本期基金份额净值增长率	-10.23%
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	-0.3862
期末基金资产净值	1,167,679,448.58
期末基金份额净值	0.614

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)。

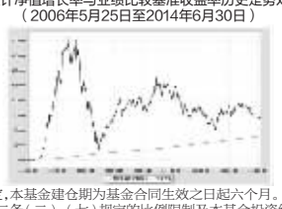
3.2 基金净值表现

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	1.66%	0.42%	0.35%	0.01%	1.31%	0.41%
过去三个月	0.00%	0.42%	1.04%	0.01%	-1.04%	0.41%
过去六个月	-10.23%	0.61%	2.09%	0.01%	-12.32%	0.60%
过去一年	-1.60%	0.74%	4.25%	0.01%	-5.85%	0.73%
过去三年	-20.26%	0.97%	14.11%	0.01%	-34.37%	0.96%
自基金合同生效起至今	73.07%	1.33%	39.89%	0.01%	33.18%	1.32%

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

海富通强化回报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
(2006年5月25日至2014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十二条(二)、(七)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"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。本海富通强化回报混合型证券投资基金是基金管理人管理的第五只公募基金;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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蒋征	本基金的基金经理;海富通精选混合及海富通精选贰号混合基金经理;投资副总监	2006-09-26	2014-01-17	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市和基金经理助理,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。
邵佳民	本基金的基金经理;海富通稳健添利债券基金经理;海富通稳固收益债券基金经理;海富通稳进增利分级债券基金经理;投资副总监	2006-05-25	-	17年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师,2005年1月至2008年1月任海富通货币基金经理,2006年5月起任海富通强化回报混合基金经理,2007年10月至2013年1月任固定收益组合管理部总监,2008年10月起兼任海富通稳健添利债券基金经理,2010年11月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2013年1月起任投资副总监并兼任海富通稳进增利分级债券基金经理。
谢志刚	本基金的基金经理;海富通养老收益混合基金经理;海富通领先成长股票基金经理;海富通国策导向股票基金经理	2014-01-17	-	13年	MBA、硕士,持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安证券研究所行业研究员、美国康奈尔资本公司助理投资经理、华宝兴业基金管理有限公司高级研究员、西蒙莫瑞中国基金公司研究总监、信诚基金管理有限公司Eastspring China Dragon A Share Fund(QFII)投资经理(该基金由信诚基金担任投资顾问),2013年9月加入海富通基金管理有限公司,2013年10月起担任海富通养老收益混合基金经理,2014年1月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2014年4月起兼任海富通领先成长股票和海富通国策导向股票基金经理。

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 管理人对投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

从股市上来看,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。

本基金在上半年维持较低的股票仓位,结构上增加了电力设备、养殖、计算机和化工等行业的配置,减持了机械、LED和医药板块。

从债市上来看,2014年上半年的债券市场走出了持续的上涨行情。随着经济增长速度下降,政府更多地要求"稳增长",货币政策也转向宽松。首先,中央银行开始向市场投放资金;其次,"开启定向降准,降低部分金融机构的法定存款准备金率。2013年的持续调整,使得债券收益率达到相当高的水平。十年期政策性金融债达到5.8%,主流城投债则普遍在8%附近。资金面的宽松推动了债券市场的上涨。一季度的上涨相对温和,市场还处于"半信半疑"的状态,十年期政策性金融债的收益率从5.8%附近的超调状态恢复到5.5%左右的均衡水平,主流城投债的收益率则下降到8%以下。二季度末资金面的平稳和经济数据的下行,刺激了二季度的债券行情。四月份开始,债券收益率逐级下降,市场热情逐渐点燃,更多的资金入场。随着更多"微刺激"的政策出台,市场的做多情绪始终浓厚。到二季度末,政策性金融债收益率下降到5%以内,主流城投债收益率则在7%以内,投资者获利较多。虽然二季度信用事件也有所发生,交易所市场对信用债折算为回购标准券的要求越来越严格,但信用债总体呈现稳定上涨的局面,部分私有公司的债券发行则遇到困难,中小企业私募债的新发行陷入冰点。可转债方面,虽然存在一定的投资价值,但受制于股票市场的不景气,可转债的表现总体一般,个别品种有独立表现。

基金在第一季度对信用债增加投资,对转债进行了波段操作。二季度继续加仓部分信用债。

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-10.23%,同期基金业绩比较基准收益率为2.09%,基金净值跑输业绩比较基准12.32%。 基金跑输基准是因为在上半年市场较弱的情况下,以创业板为代表的成长股经过上一年大涨风险较大,本基金年初对创业板较为谨慎,从而错过了年初的创业板泡沫膨胀所带来的行情。而该基金的基准为三年期定期存款利率,因而其收益永远为正,且是随着时间的推移而累积的。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从股市上来看,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。

本基金认为市场下半年机会不大,但主板指数向下的空间也有限,在这种市场状况下结构性机会仍会相对活跃,投资策略上仍以波段操作、成长股为主。行业上仍将重点关注计算机,互联网,消费电子(含汽车电子),新能源汽车,军工,医疗大健康等板块。但由于这些板块在估值高位,下半年选股难度加大,短期将根据中报数据选择质地优良、业绩能够顺利切换的个股。另外,10月份即将迎来"沪港通",有望带来一波低估值蓝筹股的估值修复,本基金也将积极利用这一机会,以力争获取比较高的收益。

从债市上来看,基金管理人认为,2014年下半年,债券市场需要保持一定的谨慎,尤其是第三季度。主要原因是:货币政策不会有大力度的放松,除银行间市场外,实体经济的资金面仍然偏紧,贷款利率居高不下,对发债有较强需求。主流机构的配置需求得到一定的满足,在收益率下降的条件下,没有大规模增加配置的动力。基本面可能有所好转,投资者的风险偏好可能上升。低等级信用债和可转债的机会在临近。随着整体信用风险的上升,投资者需要对信用债精挑细选。本基金将以中高等级信用债为基础,严格控制信用风险和流动性风险,力争为持有人带来稳定的回报。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人--招商银行股份有限公司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》及其他有关法律法规、基金合同,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

本半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:海富通强化回报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	16,952,475.21	181,804,020.30
结算备付金	8,284,029.81	1,934,403.21
存出保证金	952,758.82	344,421.20
交易性金融资产	921,288,463.85	1,118,393,923.21
其中:股票投资	426,634,903.85	962,562,999.21
基金投资	-	-
债券投资	494,653,560.00	155,830,924.00
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	199,600,274.40	416,490,144.74
应收证券清算款	24,163,110.45	-
应收利息	10,455,083.98	1,076,872.13
应收股利	-	-
应收申购款	7,403.49	14,274.49
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,181,703,600.01	1,720,058,059.28
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	8,078,196.18	99,828,944.74
应付赎回款	1,659,478.16	1,595,885.52
应付管理人报酬	1,438,190.23	1,883,739.21
应付托管费	239,698.37	313,956.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,838,577.72	920,895.89
应交税费	571,641.60	571,641.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,369.17	400,049.12
负债合计	14,024,151.43	105,515,112.61
所有者权益:		
实收基金	1,902,354,792.32	2,360,626,710.65
未分配利润	-734,675,343.74	-746,083,763.98
所有者权益合计	1,167,679,448.58	1,614,542,946.67
负债和所有者权益总计	1,181,703,600.01	1,720,058,059.28

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值0.614元,基金份额总额1,902,354,792.32份。

6.2利润表

会计主体:海富通强化回报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	-138,001,526.92	77,655,730.89
1.利息收入	12,137,002.22	3,750,341.71
其中:存款利息收入	644,659.70	1,022,506.24
债券利息收入	10,032,312.95	1,539,021.00
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,460,029.57	1,188,814.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-128,198,953.39	76,187,993.90
其中:股票投资收益	-130,790,672.91	64,236,535.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,875,524.11	2,876,434.91
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	716,195.41	9,075,023.48
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-22,174,506.88	-2,285,724.33
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	234,931.13	3,119.61
减:二、费用	19,752,434.99	19,841,147.35
1.管理人报酬	9,980,199.07	12,171,401.51
2.托管费	1,663,366.51	2,028,566.95
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,441,836.06	5,419,817.02
5.利息支出	442,159.36	-
其中:卖出回购金融资产支出	442,159.36	-
6.其他费用	224,873.99	221,361.87
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-157,753,961.91	57,814,583.54
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-157,753,961.91	57,814,583.54

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通强化回报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)	2,360,626,710.65	-746,083,763.98	1,614,542,946.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-157,753,961.91	-157,753,961.91
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)	-458,271,918.33	169,162,382.15	-289,109,536.18
其中:1.基金申购款	3,512,190.80	-1,267,783.63	2,244,407.17
2.基金赎回款	-461,784,109.13	170,430,165.78	-291,353,943.35
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)	1,902,354,792.32	-734,675,343.74	1,167,679,448.58

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)	2,840,879,803.81	-1,105,825,478.48	1,735,054,325.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,814,583.54	57,814,583.54
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)	-602,997,713.40	207,096,892.62	-395,900,820.78
其中:1.基金申购款	5,750,221.89	-2,040,412.48	3,709,809.41
2.基金赎回款	-608,747,935.29	209,137,305.10	-399,610,630.19
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)	2,237,882,090.41	-840,914,002.32	1,396,968,088.09

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

海富通强化回报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[2006]第58 号《关于同意海富通强化回报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《海富通强化回报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2,563,360,601.57 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(2006)第63 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》于2006 年5月25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,564,312,627.02 份基金份额,其中认购资金利息折合952,025.45 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,基金托管人为招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《海富通强化回报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国内依法公开发行上市的股票、债券、货币市场金融工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置:股票资产0%-95%,权证投资0%-3%,债券5%-95%;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三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率。

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》、《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的有关规定编制。

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

本基金报告期内不存在重大会计差错。

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("海富通")	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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	9,980,199.07	12,171,401.51
其中:支付销售机构的客户维护费	2,117,478.20	2,476,256.56

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	1,663,366.51	2,028,566.95

注:支付基金托管人招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与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
招商银行	16,952,475.21	574,528.35	399,778,345.21	992,184.84

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,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
603168	莎普爱思	2014-06-24	2014-07-02	新股流通受限	21.85	21.85	9,892	216,140.20	216,140.20	-
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	新股流通受限	12.20	12.20	2,152	26,254.40	26,254.40	-

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	重大资产重组	40.30	-	-	300,930	11,925,997.30	12,127,479.00	-

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	426,634,903.85	36.10
	其中:股票	426,634,903.85	36.10
2	固定收益投资	494,653,560.00	41.86
	其中:债券	494,653,560.00	41.86
	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	199,600,274.40	16.89
	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	25,236,505.02	2.14
7	其他各项资产	35,578,356.74	3.01
8	合计	1,181,703,600.01	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