

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:二〇一四年八月二十九日

## 1 重要提示

1.1 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。

基金管理人和基金托管人根据本基金合同规定，于2014年5月28日对核查了本报告所载的财务指标、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，保证复核报告不存在虚假记载、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。

本报告期财务数据未经审计。

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	海富通中小盘股票型证券投资基金
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1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	748,452,810份
基金合同终止日期	无

## 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，在严格控制风险的前提下追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将综合分析宏观经济形势、微观经济数据、市场环境要素，通过定量和定性分析相结合和中长期预测来动态跟踪，在投资范围内确定相对大类资产配置比例，其次通过行业及个股进行定量化分析并结合的精选，精选具有高成长潜力和盈利能力的中小盘优质股票进行投资。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为70%沪深300指数+30%银河证券中小盘股票型证券投资基金成立以来年度平均收益率。
风险收益特征	本基金是股票型基金，属高风险、高预期收益的投资品种。其预期收益、预期风险均高于货币基金和债券基金。

## 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
姓名	奚方宏	胡金军
信息披露负责人	奚方宏	胡金军
联系电话	021-38650891	010-66105799
电子邮箱	wxf@hfifund.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

报告期内基金年度报告正文的管理人互联网网址:

基金年度报告备查地点:

基金管理人和基金托管人办公地址:

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	-27,596,191.43	
本期利润	7,772,800.11	
加权平均基金份额利润	0.0108	
本期基金份额净值增长率	0.38%	
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	-0.1773	
期末基金份额净值	787,566,285.18	
期末基金份额净值	1.052	

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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.期初可供分配利润采用月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(即期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长速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(%)	份额净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去一个月	3.34%	0.97%	1.68%	0.73%	1.66%	0.24%
过去三个月	0.77%	1.01%	1.51%	0.78%	-0.74%	0.23%
过去六个月	0.38%	1.37%	-1.19%	0.95%	1.57%	0.42%
过去一年	8.45%	1.64%	10.46%	1.02%	-2.01%	0.62%
过去三年	1.94%	1.44%	-14.88%	1.14%	16.82%	0.30%
自基金合同生效日起	5.20%	1.44%	-18.55%	1.20%	23.75%	0.24%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计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图  
(2010年4月14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制度

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人寿保险公司(现更名为“法国巴黎投资管理BIP控股公司”)于2003年1月1日共同设立。本公司是基金管理人海富通管理的第一只公募基金,除本基金外,基金管理人目前还管理海富通中小盘股票型证券投资基金、海富通增强收益债券型证券投资基金、海富通货币市场基金、海富通股票型证券投资基金、海富通精选债券型集合资产管理计划、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、海富通行业50指数证券投资基金、海富通行业50交易型开放式指数型证券投资基金、海富通货币市场基金、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、海富通纯债分级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等十七只公募基金。

4.1.2 基金经理——基金经理助理及其他人员

4.1.2.1 基金经理

基金经理奚方宏,男,1970年出生,硕士研究生,海富通基金管理有限公司基金经理。

4.1.2.2 其他人员

基金经理助理李争林,男,1973年出生,大学本科,海富通基金管理有限公司基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内基金运作情况的专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

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、基金合同的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责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 管理人对报告期内基金交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指引》和《证券投资基金公平交易行为规范》,未发现本基金存在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经营运作和尚存在的问题及今后的计划说明

4.4.1 基金报告期内基金投资策略的运作分析

2014年上半年, A股市场在宏观经济持续疲弱,IPO重启、两市两会以及微刺激政策的交错影响下呈现震荡整理格局,年初市场一度出现熔断,随后在政策的不断呵护下,市场逐步企稳并有所反弹,上证综指年内涨幅达3.20%,深证成指跌幅达9.50%,创业板上涨近7.69%。上证综指下跌后出现V型反转,创业板则在政策的大力支持下,呈现反弹趋势,而深证成指在政策的支撑下,呈现震荡整理格局,整体来看,市场在政策的扶持下,呈现震荡整理的格局。

4.4.2 基金报告期内基金的经营运作分析

报告期内,本基金在宏观经济持续疲弱,IPO重启、两市两会以及微刺激政策的交错影响下呈现震荡整理格局,年初市场一度出现熔断,随后在政策的不断呵护下,市场逐步企稳并有所反弹,上证综指年内涨幅达3.20%,深证成指跌幅达9.50%,创业板上涨近7.69%。上证综指下跌后出现V型反转,创业板则在政策的大力支持下,呈现反弹趋势,而深证成指在政策的支撑下,呈现震荡整理格局,整体来看,市场在政策的扶持下,呈现震荡整理的格局。

4.4.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指引》和《证券投资基金公平交易行为规范》,未发现本基金存在不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4.4 报告期内基金的经营运作和尚存在的问题及今后的计划说明

4.4.4.1 基金报告期内基金投资策略的运作分析

2014年上半年,A股市场在宏观经济持续疲弱,IPO重启、两市两会以及微刺激政策的交错影响下呈现震荡整理格局,年初市场一度出现熔断,随后在政策的不断呵护下,市场逐步企稳并有所反弹,上证综指年内涨幅达3.20%,深证成指跌幅达9.50%,创业板上涨近7.69%。上证综指下跌后出现V型反转,创业板则在政策的大力支持下,呈现反弹趋势,而深证成指在政策的支撑下,呈现震荡整理格局,整体来看,市场在政策的扶持下,呈现震荡整理的格局。

4.4.4.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指引》和《证券投资基金公平交易行为规范》,未发现本基金存在不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4.4.3 报告期内基金的经营运作和尚存在的问题及今后的计划说明

4.4.4.4 基金报告期内基金投资策略的运作分析

2014年上半年,A股市场在宏观经济持续疲弱,IPO重启、两市两会以及微刺激政策的交错影响下呈现震荡整理格局,年初市场一度出现熔断,随后在政策的不断呵护下,市场逐步企稳并有所反弹,上证综指年内涨幅达3.20%,深证成指跌幅达9.50%,创业板上涨近7.69%。上证综指下跌后出现V型反转,创业板则在政策的大力支持下,呈现反弹趋势,而深证成指在政策的支撑下,呈现震荡整理格局,整体来看,市场在政策的扶持下,呈现震荡整理的格局。

4.4.4.5 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指引》和《证券投资基金公平交易行为规范》,未发现本基金存在不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4.4.6 报告期内基金的经营运作和尚存在的问题及今后的计划说明

4.4.4.7 基金报告期内基金投资策略的运作分析

2014年上半年,A股市场在宏观经济持续疲弱,IPO重启、两市两会以及微刺激政策的交错影响下呈现震荡整理格局,年初市场一度出现熔断,随后在政策的不断呵护下,市场逐步企稳并有所反弹,上证综指年内涨幅达3.20%,深证成指跌幅达9.50%,创业板上涨近7.69%。上证综指下跌后出现V型反转,创业板则在政策的大力支持下,呈现反弹趋势,而深证成指在政策的支撑下,呈现震荡整理格局,整体来看,市场在政策的扶持下,呈现震荡整理的格局。

4.4.4.8 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指引》和《证券投资基金公平交易行为规范》,未发现本基金存在不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4.4.9 报告期内基金的经营运作和尚存在的问题及今后的计划说明

4.4.4.10 基金报告期内基金投资策略的运作分析

2014年上半年,A股市场在宏观经济持续疲弱,IPO重启、两市两会以及微刺激政策的交错影响下呈现震荡整理格局,年初市场一度出现熔断,随后在政策的不断呵护下,市场逐步企稳并有所反弹,上证综指年内涨幅达3.20%,深证成指跌幅达9.50%,创业板上涨近7.69%。上证综指下跌后出现V型反转,创业板则在政策的大力支持下,呈现反弹趋势,而深证成指在政策的支撑下,呈现震荡整理格局,整体来看,市场在政策的扶持下,呈现震荡整理的格局。

4.4.4.11 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易制度指引》和《证券投资基金公平交易行为规范》,未发现本基金存在不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4.4.12 报告期内基金的经营运作和尚存在的问题及今后的计划说明