

海富通国策导向股票型证券投资基金

2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 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

报告送出日期：二〇一三年八月二十四日

1 重要提示及目录

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 2013 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现	7
4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4	报表附注	19
7	投资组合报告	37
7.1	期末基金资产组合情况.....	37
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	47
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	47
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	47
7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47

7.10	投资组合报告附注.....	47
8	基金份额持有人信息.....	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
9	开放式基金份额变动.....	49
10	重大事件揭示	50
10.1	基金份额持有人大会决议.....	50
10.2	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.....	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4	基金投资策略的改变.....	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8	其他重大事件	52
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	54
12	备查文件目录	55
12.1	备查文件目录	55
12.2	存放地点	55
12.3	查阅方式	56

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型证券投资基金
基金简称	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	39,790,132.36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	本基金是股票型基金，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	奚万荣	唐州徽
	联系电话	021-38650891	95566
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		张文伟	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
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办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	4,540,050.32
本期利润	2,812,446.71
加权平均基金份额本期利润	0.0784
本期加权平均净值利润率	7.46%
本期基金份额净值增长率	8.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	3,526,819.93
期末可供分配基金份额利润	0.0886
期末基金资产净值	43,316,952.29
期末基金份额净值	1.089
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	8.90%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④

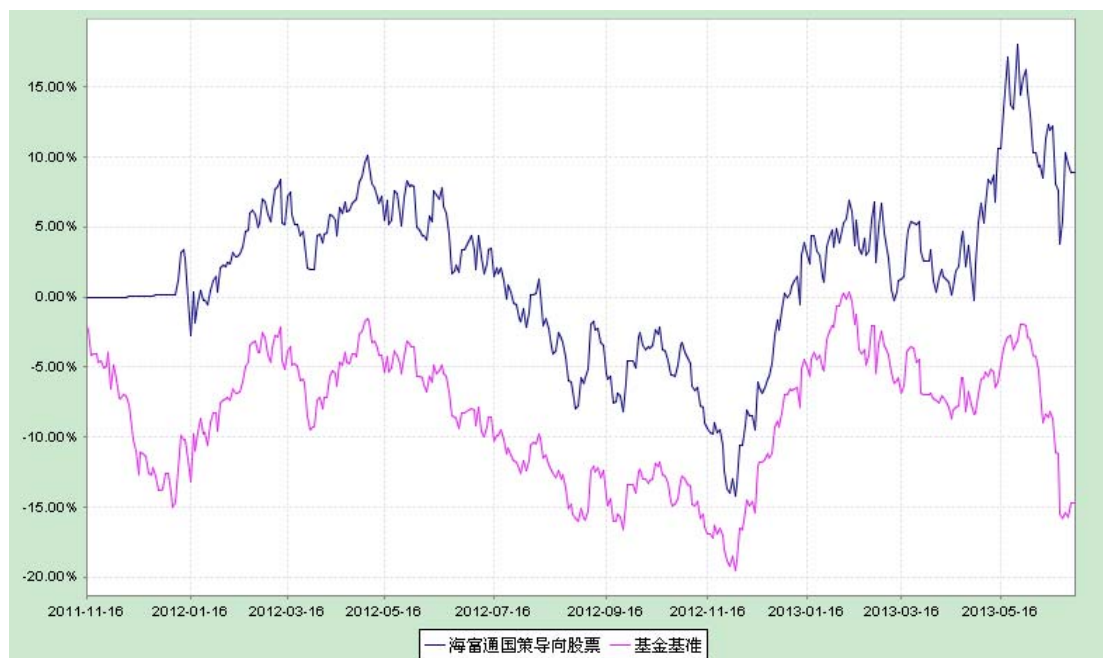
		②		准差④		
过去一个月	-5.06%	1.97%	-12.19%	1.45%	7.13%	0.52%
过去三个月	6.14%	1.76%	-8.31%	1.13%	14.45%	0.63%
过去六个月	8.57%	1.59%	-8.29%	1.16%	16.86%	0.43%
过去一年	5.32%	1.37%	-6.95%	1.08%	12.27%	0.29%
自基金合同 生效起至今	8.90%	1.23%	-14.69%	1.08%	23.59%	0.15%

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。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。

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二十二只公募基金。

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		
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	2011-11-16	-	18 年	中国国籍，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

	股票基金经 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 月起兼任海富通风格优势股票基金经理。2011 年 11 月起兼任海富通国策导向股票基金经理。2012 年 1 月起兼任海富通收益增长混合基金经理。
黄春雨	本基金的基金 经理助理,海富通 收益增长混 合基金经理 助理	2013-04-24	-	6 年	黄春雨先生，中国国籍，博士，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部行业专家，2010 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，担任股票分析师、高级股票分析师，2013 年 4 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助理。

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、海富通基金管理有限公司 2013 年 8 月 1 日发布公告，增聘黄春雨先生为海富通收益增长混合和海富通国策导向股票基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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并不显著，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

2013 年上半年，A 股市场受事件影响震荡剧烈，调控房地产“国五条”，理财产品清理“8 号文”，IPO 何时重启，“钱荒”等对市场造成较大冲击。同时我们看到，宏观经济背景仍不容乐观：传统企业复苏乏力，投资拉动增长模式难以为继，GDP 增速预期持续下滑。我们也看到新任领导人对于出台政策“治大国如烹小鲜”的谨慎态度，打消了以往经济不行靠政策的市场预期。而在传统行业萎靡不振的情况下，以传媒、电子、环保等为代表的新兴行业崛起，今年上半年上证指数虽然表现不佳，但以创业板为代表的成长股却一枝独秀，行业上分化也较为明显，其中信息服务、电子、医药生物等行业涨势喜人，有色、采掘等行业表现疲软。

本基金在一季度小幅加仓，在二季度开始加大了对 TMT，医药和食品饮料等的投资力度，在深入分析行业数据和公司报表的基础上，大力调整了投资比例，在二季度大幅度增加了传媒，医药，食品饮料和科技股的投资比例，减持了金融保险和地产等行业的配置。

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 8.57%，同期基金业绩比较基准收益率为-8.29%，基金净值跑赢业绩比较基准 16.86 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

展望下半年，美国方面，随着房地产的复苏和就业的持续好转使得美国家庭资产净值得到提升，居民的消费意愿也随之不断加强促进了消费的增长。随着美国经济复苏的加快，其对于货币政策正常化的讨论会逐步升级，QE 退出仍是一个大的趋势。欧洲方面，5 月以来欧洲经济景气小幅好转，其在衰退之中出现了企稳的迹象。

国内方面，下半年国内实体经济在去杠杆的背景下可能面临缓慢趋降的风险。虽然政府在“稳增长”与“调结构”并举的情况下，有可能向“稳增长”倾斜，出台一些定向的稳定增长措施，但力度尚不明晰。流动性方面，我们预计下半年社会融资总量余额增速会有所下降，资金价格将高于上半年。市场方面，在经历了前期流动性恐慌大幅调整之后，我们认为短期市场有望企稳。但在经济复苏力度较弱、资金面偏紧、IPO 开闸和限售股解禁减持依然处于高峰期的背景下，下半年 A 股市场趋势性的机会不多。结构上，由于经济的疲软，上游

原材料和中间制造业等传统周期行业的投资机会依然不大，机会依然来自于信息、消费和医药等增速快的行业。随着中报的公布，前期中小盘股普涨的行情也或将结束，但有业绩支撑、确定性高的成长股的表现可能依旧强劲。后续我们会关注中美货币政策的新举措、三中全会、社会融资总量增速、资金成本变化情况和 IPO 启动对股市的影响等。

基于对市场和宏观政策的判断，下半年我们对市场保持结构性行情的乐观态度。将在通过对国家相关政策深入分析的基础上，把握新的经济政策下各个行业发展的不同特点，把握结构性行情，不断努力在结构化行情中为投资者带来更好的回报。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金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，但符合基金合同规定。

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：海富通国策导向股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	9,330,009.19	6,470,486.17
结算备付金		777,878.24	110,580.15
存出保证金		38,767.29	251,133.57
交易性金融资产	6.4.7.2	34,382,720.92	44,956,848.25
其中：股票投资		34,382,720.92	44,956,848.25
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		87,296.15	-
应收利息	6.4.7.5	1,374.57	1,395.01
应收股利		-	-
应收申购款		122,242.22	6,857,905.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		44,740,288.58	58,648,348.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		804,908.64	3,479,031.75
应付赎回款		23,686.82	81,386.98
应付管理人报酬		50,573.10	53,842.84
应付托管费		8,428.84	8,973.80

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	344,269.42	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	6.4.7.8	191,469.47	366,299.33
负债合计		1,423,336.29	4,091,316.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	39,790,132.36	54,378,511.41
未分配利润	6.4.7.10	3,526,819.93	178,520.13
所有者权益合计		43,316,952.29	54,557,031.54
负债和所有者权益总计		44,740,288.58	58,648,348.38

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.089 元，基金份额总额 39,790,132.36 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		4,156,864.89	8,741,225.98
1.利息收入		26,146.95	462,392.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,146.95	370,196.44
债券利息收入		-	1,189.48
资产支持证券利息收		-	-

入			
买入返售金融资产收入		-	91,006.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		5,782,852.96	8,311,230.42
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	5,598,523.86	7,969,461.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	2,735.22
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	184,329.10	339,034.10
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.16	-1,727,603.61	-678,867.67
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	6.4.7.17	75,468.59	646,470.33
减: 二、费用		1,344,418.18	2,324,738.92
1. 管理人报酬		284,585.84	743,060.39
2. 托管费		47,430.99	123,843.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	816,316.86	1,268,676.89
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	196,084.49	189,158.22
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		2,812,446.71	6,416,487.06
减: 所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,812,446.71	6,416,487.06
-------------------	--	--------------	--------------

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	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）	-	2,812,446.71	2,812,446.71
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）	-14,588,379.05	535,853.09	-14,052,525.96
其中：1. 基金申购款	50,384,870.53	5,168,494.03	55,553,364.56
2. 基金赎回款	-64,973,249.58	-4,632,640.94	-69,605,890.52
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）	39,790,132.36	3,526,819.93	43,316,952.29
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	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）	-	6,416,487.06	6,416,487.06
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）	-502,612,805.06	-5,757,662.82	-508,370,467.88
其中：1. 基金申购款	8,300,145.07	503,739.50	8,803,884.57
2. 基金赎回款	-510,912,950.13	-6,261,402.32	-517,174,352.45
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）	50,668,322.17	1,700,513.45	52,368,835.62

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：

基金管理公司负责人：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《海富通国策导向股票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 553,165,647.55 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。经向中国证监会备案,《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 553,281,127.23 份基金份额,其中认购资金利息折合 115,479.68 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 2013 年 8 月 22 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》、《海富通国策导向股票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 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税,暂不征收企业所得税。

(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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	9,330,009.19
定期存款	-
存款期限1月以内	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-

合计	9,330,009.19
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		32,759,504.62	34,382,720.92	1,623,216.30
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		32,759,504.62	34,382,720.92	1,623,216.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产 / 负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,043.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	315.09
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	15.66
合计	1,374.57

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	344,269.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	344,269.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	56.54
预提费用	191,412.93
合计	191,469.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,378,511.41	54,378,511.41
本期申购	50,384,870.53	50,384,870.53
本期赎回（以“-”号填列）	-64,973,249.58	-64,973,249.58
本期末	39,790,132.36	39,790,132.36

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-722,500.25	901,020.38	178,520.13
本期利润	4,540,050.32	-1,727,603.61	2,812,446.71
本期基金份额交易产生的 变动数	2,208,262.68	-1,672,409.59	535,853.09
其中：基金申购款	8,163,804.97	-2,995,310.94	5,168,494.03
基金赎回款	-5,955,542.29	1,322,901.35	-4,632,640.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,025,812.75	-2,498,992.82	3,526,819.93

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,853.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,975.78
其他	317.79
合计	26,146.95

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	275,442,101.31
减：卖出股票成本总额	269,843,577.45
买卖股票差价收入	5,598,523.86

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日

股票投资产生的股利收益	184,329.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	184,329.10

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,727,603.61
——股票投资	-1,727,603.61
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,727,603.61

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	75,468.59
合计	75,468.59

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	816,316.86
银行间市场交易费用	-
合计	816,316.86

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	32,728.42
信息披露费	158,684.51
银行汇划费用	4,671.56
合计	196,084.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	284,585.84	743,060.39
其中：支付销售机构的客户维护费	100,481.46	164,618.30

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应	47,430.99	123,843.42

支付的托管费		
--------	--	--

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	9,330,009.19	22,853.38	3,089,355.82	124,633.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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6月30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)	总金额

				股/张)	
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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	首次公开发 行	6,250	625,000.00

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未实施利润分配。

6.4.12 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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
300027	华谊兄弟	2013-06-05	重大事项	28.55	2013-07-24	31.41	100,355	2,833,879.99	2,865,135.25	-
30005	三维	2013-05-	重	14.60	2013-0	16.0	36,100	501,452.2	527,060.0	-

6	丝	10	大 资 产 重 组		7-11	2		4	0	
30013 3	华策 影视	2013-05- 28	重 大 资 产 重 组	24.43	2013-0 7-30	26.8 7	62,656	1,273,709. 54	1,530,686. 08	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对

公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的四层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2012 年 12 月 31 日：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合

指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,330,009.19	-	-	-	9,330,009.19
结算备付金	777,878.24	-	-	-	777,878.24
存出保证金	38,767.29	-	-	-	38,767.29
交易性金融资产	-	-	-	34,382,720.92	34,382,720.92

应收证券清算款	-	-	-	87,296.15	87,296.15
应收利息	-	-	-	1,374.57	1,374.57
应收申购款	-	-	-	122,242.22	122,242.22
资产总计	10,146,654.72	-	-	34,593,633.86	44,740,288.58
负债					
应付证券清算款	-	-	-	804,908.64	804,908.64
应付赎回款	-	-	-	23,686.82	23,686.82
应付管理人报酬	-	-	-	50,573.10	50,573.10
应付托管费	-	-	-	8,428.84	8,428.84
应付交易费用	-	-	-	344,269.42	344,269.42
其他负债	-	-	-	191,469.47	191,469.47
负债总计	-	-	-	1,423,336.29	1,423,336.29
利率敏感度缺口	10,146,654.72	-	-	33,170,297.57	43,316,952.29
上年度末 2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,470,486.17	-	-	-	6,470,486.17
结算备付金	110,580.15	-	-	-	110,580.15
存出保证金	-	-	-	251,133.57	251,133.57
交易性金融资产	-	-	-	44,956,848.25	44,956,848.25
应收利息	-	-	-	1,395.01	1,395.01
应收申购款	-	-	-	6,857,905.23	6,857,905.23
资产总计	6,581,066.32	-	-	52,067,282.06	58,648,348.38
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,479,031.75	3,479,031.75
应付赎回款	-	-	-	81,386.98	81,386.98

应付管理人报酬	-	-	-	53,842.84	53,842.84
应付托管费	-	-	-	8,973.80	8,973.80
应付交易费用	-	-	-	101,782.14	101,782.14
其他负债	-	-	-	366,299.33	366,299.33
负债总计	-	-	-	4,091,316.84	4,091,316.84
利率敏感度缺口	6,581,066.32	-	-	47,975,965.22	54,557,031.54

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2012 年 12 月 31 日：同）

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”与“自下而上”相结合的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；同时通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%，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%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	34,382,720.92	79.37	44,956,848.25	82.40
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	34,382,720.92	79.37	44,956,848.25	82.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币)	
		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约216.00万元	增加约272.00万元
	业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约216.00万元	减少约272.00万元

注：影响金额为约数，精确到万元。

6.4.14 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	34,382,720.92	76.85
	其中：股票	34,382,720.92	76.85
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	10,107,887.43	22.59
6	其他各项资产	249,680.23	0.56
7	合计	44,740,288.58	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	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	19,454,234.87	44.91
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	-	-
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	4,581,006.00	10.58
J	金融业	835,263.00	1.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,384,440.00	3.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,253,010.72	2.89
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	6,874,766.33	15.87
S	综合	-	-
	合计	34,382,720.92	79.37

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300027	华谊兄弟	100,355	2,865,135.25	6.61

2	002292	奥飞动漫	106,100	2,375,579.00	5.48
3	600880	博瑞传播	132,500	2,335,975.00	5.39
4	300315	掌趣科技	66,320	2,187,233.60	5.05
5	600594	益佰制药	70,100	2,166,791.00	5.00
6	300273	和佳股份	99,530	2,131,932.60	4.92
7	300337	银邦股份	81,456	2,041,287.36	4.71
8	600535	天士力	50,223	1,966,230.45	4.54
9	300026	红日药业	52,600	1,785,244.00	4.12
10	300133	华策影视	62,656	1,530,686.08	3.53
11	002038	双鹭药业	24,060	1,409,916.00	3.25
12	300058	蓝色光标	33,200	1,384,440.00	3.20
13	300253	卫宁软件	31,774	1,290,024.40	2.98
14	300070	碧水源	33,254	1,253,010.72	2.89
15	600389	江山股份	35,650	1,213,526.00	2.80
16	600557	康缘药业	40,800	1,083,240.00	2.50
17	002570	贝因美	38,590	1,078,590.50	2.49
18	002456	欧菲光	18,219	868,317.54	2.00
19	600369	西南证券	108,900	835,263.00	1.93
20	300054	鼎龙股份	46,918	806,520.42	1.86
21	600637	百视通	25,041	701,148.00	1.62
22	300056	三维丝	36,100	527,060.00	1.22
23	300212	易华录	13,420	402,600.00	0.93
24	601928	凤凰传媒	17,000	142,970.00	0.33

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300251	光线传媒	5,567,750.97	10.21
2	300027	华谊兄弟	4,673,766.83	8.57
3	300077	国民技术	4,542,941.46	8.33
4	300315	掌趣科技	3,849,126.92	7.06
5	300205	天喻信息	3,808,096.07	6.98
6	300228	富瑞特装	3,527,906.60	6.47
7	000562	宏源证券	3,429,623.62	6.29
8	601166	兴业银行	3,247,610.08	5.95
9	002005	德豪润达	3,159,954.97	5.79
10	000525	红太阳	3,123,641.37	5.73
11	600535	天士力	3,104,161.11	5.69
12	600880	博瑞传播	3,042,488.28	5.58
13	002460	赣锋锂业	3,039,078.92	5.57
14	002456	欧菲光	3,011,138.05	5.52
15	600352	浙江龙盛	2,993,642.07	5.49
16	600389	江山股份	2,795,585.50	5.12
17	300351	永贵电器	2,743,931.27	5.03
18	600369	西南证券	2,717,191.97	4.98
19	600016	民生银行	2,637,994.79	4.84
20	300337	银邦股份	2,589,599.30	4.75
21	002466	天齐锂业	2,524,824.65	4.63
22	000002	万科A	2,522,513.00	4.62
23	002570	贝因美	2,521,125.37	4.62
24	000001	平安银行	2,427,014.98	4.45
25	601901	方正证券	2,386,649.00	4.37
26	002038	双鹭药业	2,348,281.76	4.30

27	600383	金地集团	2,263,180.50	4.15
28	000049	德赛电池	2,184,731.27	4.00
29	300273	和佳股份	2,172,052.65	3.98
30	300168	万达信息	2,069,028.60	3.79
31	300070	碧水源	2,054,798.38	3.77
32	002292	奥飞动漫	1,999,059.00	3.66
33	600594	益佰制药	1,998,190.81	3.66
34	002658	雪迪龙	1,990,155.30	3.65
35	300133	华策影视	1,943,567.03	3.56
36	600557	康缘药业	1,924,106.95	3.53
37	600637	百视通	1,900,563.40	3.48
38	000538	云南白药	1,889,240.69	3.46
39	300113	顺网科技	1,874,892.00	3.44
40	002055	得润电子	1,865,324.51	3.42
41	002573	国电清新	1,861,712.39	3.41
42	002690	美亚光电	1,846,891.20	3.39
43	600519	贵州茅台	1,818,505.00	3.33
44	300054	鼎龙股份	1,813,780.00	3.32
45	300026	红日药业	1,797,901.00	3.30
46	600388	龙净环保	1,765,132.67	3.24
47	300104	乐视网	1,733,092.00	3.18
48	300183	东软载波	1,725,942.40	3.16
49	600728	佳都新太	1,709,932.51	3.13
50	002635	安洁科技	1,703,480.30	3.12
51	300253	卫宁软件	1,695,463.52	3.11
52	300207	欣旺达	1,659,670.00	3.04
53	000625	长安汽车	1,639,815.40	3.01
54	002508	老板电器	1,614,832.00	2.96

55	002385	大北农	1,583,496.00	2.90
56	002646	青青稞酒	1,552,348.00	2.85
57	600596	新安股份	1,536,136.66	2.82
58	300032	金龙机电	1,521,247.90	2.79
59	002241	歌尔声学	1,510,196.02	2.77
60	600887	伊利股份	1,497,193.90	2.74
61	600446	金证股份	1,488,455.38	2.73
62	002477	雏鹰农牧	1,474,249.56	2.70
63	002415	海康威视	1,472,771.00	2.70
64	300059	东方财富	1,464,326.60	2.68
65	002683	宏大爆破	1,457,243.22	2.67
66	600765	中航重机	1,448,260.00	2.65
67	600312	平高电气	1,405,489.50	2.58
68	601169	北京银行	1,374,543.00	2.52
69	300058	蓝色光标	1,371,445.65	2.51
70	000869	张裕 A	1,370,537.83	2.51
71	002244	滨江集团	1,361,465.17	2.50
72	002065	东华软件	1,359,200.48	2.49
73	002273	水晶光电	1,353,457.76	2.48
74	600028	中国石化	1,338,069.01	2.45
75	600199	金种子酒	1,322,823.00	2.42
76	000671	阳光城	1,300,788.64	2.38
77	002325	洪涛股份	1,268,523.88	2.33
78	600315	上海家化	1,267,408.00	2.32
79	002475	立讯精密	1,264,738.23	2.32
80	600703	三安光电	1,263,086.52	2.32
81	600563	法拉电子	1,237,414.40	2.27
82	000050	深天马 A	1,227,811.00	2.25

83	601009	南京银行	1,222,548.00	2.24
84	300232	洲明科技	1,203,799.50	2.21
85	002458	益生股份	1,199,675.99	2.20
86	300090	盛运股份	1,157,198.80	2.12
87	600000	浦发银行	1,128,826.00	2.07
88	601336	新华保险	1,120,726.00	2.05
89	600015	华夏银行	1,094,321.15	2.01
90	300212	易华录	1,093,045.00	2.00

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。

7.4.2 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	300251	光线传媒	5,456,447.50	10.00
2	300077	国民技术	4,725,853.57	8.66
3	300205	天喻信息	4,387,120.41	8.04
4	300228	富瑞特装	3,706,538.37	6.79
5	000562	宏源证券	3,421,876.33	6.27
6	300090	盛运股份	3,312,089.94	6.07
7	600519	贵州茅台	3,232,859.89	5.93
8	002005	德豪润达	3,130,200.32	5.74
9	000525	红太阳	3,073,433.48	5.63
10	601166	兴业银行	3,056,604.41	5.60
11	300351	永贵电器	2,982,624.78	5.47
12	600352	浙江龙盛	2,907,744.30	5.33

13	002460	赣锋锂业	2,694,676.38	4.94
14	600030	中信证券	2,667,936.95	4.89
15	600016	民生银行	2,642,478.00	4.84
16	002385	大北农	2,502,343.38	4.59
17	000002	万 科 A	2,452,406.72	4.50
18	002466	天齐锂业	2,447,111.05	4.49
19	601901	方正证券	2,375,412.94	4.35
20	000001	平安银行	2,346,137.41	4.30
21	002456	欧菲光	2,342,465.95	4.29
22	002273	水晶光电	2,328,382.87	4.27
23	000656	金科股份	2,325,178.89	4.26
24	600011	华能国际	2,270,787.46	4.16
25	000049	德赛电池	2,252,754.76	4.13
26	002055	得润电子	2,078,593.32	3.81
27	600383	金地集团	2,078,135.47	3.81
28	300027	华谊兄弟	2,067,930.16	3.79
29	600703	三安光电	2,062,047.81	3.78
30	002658	雪迪龙	2,047,678.10	3.75
31	002065	东华软件	2,029,453.79	3.72
32	601318	中国平安	2,023,699.09	3.71
33	300168	万达信息	2,001,726.71	3.67
34	002635	安洁科技	1,986,190.03	3.64
35	600389	江山股份	1,962,273.11	3.60
36	300315	掌趣科技	1,944,101.52	3.56
37	300113	顺网科技	1,933,777.17	3.54
38	002573	国电清新	1,915,078.56	3.51
39	002690	美亚光电	1,883,467.53	3.45
40	000538	云南白药	1,857,239.96	3.40

41	600388	龙净环保	1,828,292.99	3.35
42	300207	欣旺达	1,826,755.89	3.35
43	600369	西南证券	1,794,515.32	3.29
44	600728	佳都新太	1,757,536.64	3.22
45	300183	东软载波	1,750,497.67	3.21
46	000625	长安汽车	1,744,110.95	3.20
47	300212	易华录	1,731,635.61	3.17
48	600557	康缘药业	1,724,081.72	3.16
49	002683	宏大爆破	1,660,465.83	3.04
50	300104	乐视网	1,651,020.06	3.03
51	000961	中南建设	1,647,352.33	3.02
52	600585	海螺水泥	1,639,850.83	3.01
53	002415	海康威视	1,619,285.02	2.97
54	002508	老板电器	1,570,900.88	2.88
55	600153	建发股份	1,557,984.29	2.86
56	300032	金龙机电	1,553,304.20	2.85
57	600446	金证股份	1,548,093.37	2.84
58	002241	歌尔声学	1,540,017.58	2.82
59	600887	伊利股份	1,506,362.58	2.76
60	600596	新安股份	1,503,934.45	2.76
61	002646	青青稞酒	1,487,276.32	2.73
62	300059	东方财富	1,471,984.00	2.70
63	002450	康得新	1,469,008.17	2.69
64	002570	贝因美	1,460,861.64	2.68
65	600637	百视通	1,455,752.50	2.67
66	002477	雏鹰农牧	1,455,473.35	2.67
67	600765	中航重机	1,444,011.70	2.65
68	000869	张裕 A	1,408,083.29	2.58

69	002475	立讯精密	1,387,815.88	2.54
70	601169	北京银行	1,381,483.83	2.53
71	600312	平高电气	1,356,310.66	2.49
72	000671	阳光城	1,344,413.04	2.46
73	002458	益生股份	1,340,621.66	2.46
74	600199	金种子酒	1,325,671.29	2.43
75	600563	法拉电子	1,296,719.28	2.38
76	002589	瑞康医药	1,294,559.86	2.37
77	601009	南京银行	1,292,703.81	2.37
78	002244	滨江集团	1,279,210.70	2.34
79	600028	中国石化	1,277,233.00	2.34
80	000050	深天马 A	1,276,121.76	2.34
81	600315	上海家化	1,275,659.85	2.34
82	300232	洲明科技	1,256,148.34	2.30
83	002325	洪涛股份	1,255,592.41	2.30
84	600535	天士力	1,234,679.38	2.26
85	300070	碧水源	1,233,609.48	2.26
86	600066	宇通客车	1,209,903.01	2.22
87	300147	香雪制药	1,159,109.97	2.12
88	002035	华帝股份	1,144,816.73	2.10
89	000338	潍柴动力	1,128,493.99	2.07
90	600527	江南高纤	1,118,550.02	2.05
91	601336	新华保险	1,100,093.44	2.02
92	300110	华仁药业	1,098,040.69	2.01

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。

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	260,997,053.73
卖出股票的收入（成交）总额	275,442,101.31

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。

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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合约。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	38,767.29
2	应收证券清算款	87,296.15
3	应收股利	-
4	应收利息	1,374.57
5	应收申购款	122,242.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	249,680.23

7.10.4 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。

7.10.5 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	300027	华谊兄弟	2,865,135.25	6.61	重大事项
2	300133	华策影视	1,530,686.08	3.53	重大资产重组

8 基金份额持有人信息

8.1 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
1,462	27,216.23	2,982,242.36	7.49%	36,807,890.00	92.51%

8.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	303,805.14	0.7635%

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年11月16日）基金份额总额	553,281,127.23
本报告期期初基金份额总额	54,378,511.41
本报告期基金总申购份额	50,384,870.53
减：本报告期基金总赎回份额	64,973,249.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	39,790,132.36

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2013 年 3 月 21 日，海富通基金管理有限公司发布公告，公司股东会增聘高勇前先生担任本公司职工监事。

2013 年 4 月 10 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，聘请陶网雄先生担任公司副总经理。

2013 年 5 月 9 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司 2013 年第一次股东会及第四届董事会第一次会议审议并通过，并向中国证券监督管理委员会报告，经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】628 号文核准批复，公司聘请张文伟先生担任公司董事长，邵国有先生因退休转任本公司董事。

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信证券	2	280,677,373.36	52.32%	250,424.19	52.24%	-
中信建投	2	255,569,490.08	47.64%	228,792.56	47.73%	-
国金证券	1	192,291.60	0.04%	175.06	0.04%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

2、(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,并报公司业务管理委员会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的业务管理委员会核准。

10.7.2 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
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司旗下基金2012年最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通广发银行借记卡网上直销业务并实行费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-01-07
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金新增天天基金为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-01-11
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在天天基金参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-01-11
5	海富通基金管理有限公司关于提请投资者及时更新一代身份证件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-01-18

		报》	
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行开通定期定额投资业务暨开展定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-02-22
7	海富通基金管理有限公司关于新增监事会成员的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-03-21
8	海富通基金管理有限公司关于基金对账单邮寄服务形式调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-03-25
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续在中国工商银行股份有限公司开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-03-29
10	海富通基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-04-10
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-04-19
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在和讯信息科技有限公司开展网上银行及基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-04-19
13	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-04-24
14	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-05-09

15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在好买基金开通基金定期定额业务及参加基金定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-06-03
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京展恒为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-06-20
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京展恒参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2013-06-24

11 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 23 只公募基金。截至 2013 年 6 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模超过 225 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 2013 年 6 月 30 日,海富通为近 80 家企业超过 285 亿元的企业年金基金和养老金产品担任了投资管理人。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 2013 年 6 月 30 日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过 46 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 2013 年 6 月 30 日,投资咨询及海外业务规模超过 198 亿元人民币。

2010 年 11 月 25 日,海富通全资香港子公司——海富通资产管理(香港)有限公司正式开业,注册资本为 6000 万港元。

2011 年 12 月,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,准许在香港筹集人民币资金投资境内证券市场,并首批获得国家外汇管理局批准的 11 亿元人民币 RQFII (人民币合格境外机构投资者)投资额度。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。2013 年 5 月,

海富通资产管理（香港）有限公司再度获得证监会核准批复 QFII（合格境外机构投资者）资格。

2012 年 3 月，海富通在由中国证券报社主办、银河证券、天相投顾、招商证券、海通证券等协办的“2011 年度中国基金业金牛奖”评选中荣获“2011 年十大金牛基金管理公司”；2012 年 3 月，在《证券时报》社主办的“中国基金业明星奖”评选中，《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，“海富通精选混合基金”荣获《上海证券报》社主办的“金基金”奖之“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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通国策导向股票型证券投资基金的文件
- （二）海富通国策导向股票型证券投资基金基金合同
- （三）海富通国策导向股票型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通国策导向股票型证券投资基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- （六）报告期内海富通国策导向股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇一三年八月二十四日