海富通领先成长股票型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2009 年 8 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 8 月 25 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 2009 年 4 月 30 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通领先成长股票
交易代码	519025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年 4 月 30 日
报告期末基金份额总额	1,655,920,220.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	从具有领先发展的行业中,精选出具有高度成长性的股票,在控制风险并保持资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金运用已经得到市场检验和认可的国际先进投资理念,通过上市公司基本面的分析和研究,坚持寻找价值"洼地"和长线投资,来获得超额收益。在投资组合构建和管理的过程中,本基金采取"自上而下"与"自下而上"相结合的方法,在具有领先发展的行业中,精选出具有高度成长性的股票。
业绩比较基准	MSCI China A 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,属于较高风险、较高收益的投资品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	尹东
	联系电话	021-38650891	010-67595003
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		40088-40099	010-67595096
传真		021-33830166	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告/半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/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(2009 年 04 月 30 日至 2009 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	99,725,758.46
本期利润	293,158,824.69
加权平均基金份额本期利润	0.1195
本期基金份额净值增长率(%)	12.90
3.1.2 期末数据和指标	
期末可供分配基金份额利润	0.0446
期末基金资产净值	1,868,930,924.06
期末基金份额净值	1.129

注:1、本基金合同生效日为 2009 年 04 月 30 日,本期主要财务指标的计算期间为 2009 年 04 月 30 日至 2009 年 06 月 30 日。基金合同生效日至报告期末未满半年。

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。

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	9.51%	1.15%	10.86%	0.93%	-1.35%	0.22%
自基金成立起至今	12.90%	1.27%	16.17%	1.00%	-3.27%	0.27%

注:基金合同生效日至报告期末未满半年。

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

海富通领先成长股票累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:1、本基金合同于 2009 年 4 月 30 日生效,截至报告期末本基金合同生效未满半年;

2、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。自 2009 年 4 月 30 日合同生效日起至 2009 年 6 月 30 日,本基金运作时间未满六个月,仍处于建仓期中。

§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于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。本海富通领先成长股票型证券投资基金是基金管理人管理的第十只开放式基金;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和海富通稳健添利债券型证券投资基金九只开放式基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
陈绍胜	本基金的基金经理;海富通股票基金基金经理	2009年 4 月 30 日	-	18年	博士,持有基金从业人员资格证书。历任香港英皇金融集团外汇投资经理、原上海万国证券公司证券分析师,海通证券交易总部投资经理。拥有中国证券业协会基金从业人员资格证书。2003 年 4 月至 2004 年 2 月任海富通基金管理有限公司股票分析师、策略分析师,2004 年 3 月至 2009 年 1 月任海富通收益增长混合基金基金经理,2009 年 1 月起任海富通股票基金基金经理,2009 年 4 月起兼任海富通领先成长股票基金基金经理。

注:1、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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司自成立以来,就建立了公平交易制度,并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于 2008 年 3 月 20 日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司根据该指导意见的具体要求,已完善现有的业务流程,建立了公平交易监控系统,进行定期监控,以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据本基金合同,公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

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。

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

自去年 11 月份中国政府推出 4 万亿经济刺激计划以来,国内股市从全球金融危机集中爆发引起的恐慌性抛售中牵先探底回升。2009 年上半年,上证指数出现了连续六个月的上涨,累计涨幅达 62.53%,A 股市场的表现位居全球主要市场榜首。中央政府出台的一系列刺激经济、扩大内需的计划有效减少了外需萎缩对我国经济的冲击,国内经济出现企稳回升的势头。市场流动性充裕,投资者信心也有所改善。机械制造、钢铁、汽车等受益于经济复苏和产业振兴政策的板块出现反弹。而随着全球流动性被大量投放,国际大宗商品价格强劲回升,通胀预期抬头,带动了国内有色金属、房地产和金融板块的上涨。

本基金成立于 2009 年 4 月 30 日,成立之初便大幅加仓,并在大部分时间里高仓位运行,组合结构上增持并超配了金融地产,且金融地产成为本基金组合中的主要配置。考虑到未来通胀的因素,本基金还适当增持了食品饮料、商业零售、医药等行业的配置。

本报告期内,海富通领先成长股票基金净值增长率为 12.90%,同期业绩比较基准收益率为 16.17%,基金净值落后业绩比较基准 3.27 个百分点。基金业绩跑输基准的主要原因是新基金处在建仓期,而仓位提升是渐进的。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,中国经济正在面临历史上难得的一段时光,高速增长、没有通胀。在全球经济刚刚止跌趋稳的大背景下,中国经济的增长依然要依靠投资来拉动。我们可喜的看到,投资已经开始从公共部门为主题蔓延到私人部门,国家 4 万亿"的投资放大效应初现。我们相信货币政策在出现明显的经济过热的迹象之前,不会出现明显的变化,适当的微调对于持续增长是有利的。我们看好和私人投资部门密切相关的产业链,并关注资源类资产,以及央企兼并重组等主题带来的机会。

本基金将重点关注:1)受益于通胀预期的资产、资源品;2)受益于产业政策大力扶持的低碳产业;3)受益于经济复苏的相关产业。

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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,中国建设银行股份有限公司按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

中国建设银行股份有限公司复核审查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。

§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:海富通领先成长股票型证券投资基金

报告截止日:2009 年 06 月 30 日

单位:人民币元

资产	本期末 2009年 06 月 30 日
资产:	
银行存款	316,754,270.28
结算备付金	29,583,119.09
存出保证金	-
交易性金融资产	1,537,631,964.66
其中:股票投资	1,537,631,964.66
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	297,000,348.50
应收证券清算款	-
应收利息	160,655.03
应收股利	-
应收申购款	2,698,368.12
其他资产	-
资产总计	2,183,828,725.68
负债和所有者权益	本期末 2009年 06 月 30 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	204,034,593.74
应付赎回款	102,198,514.72
应付管理人报酬	3,009,920.62
应付托管费	501,653.42
应付销售服务费	-
应付交易费用	4,677,218.18
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	475,900.94
负债合计	314,897,801.62
所有者权益:	
实收基金	1,655,920,220.07
未分配利润	213,010,703.99
所有者权益合计	1,868,930,924.06
负债和所有者权益总计	2,183,828,725.68

注:基金成立日为 2009 年 04 月 30 日,本报告截止日 2009 年 06 月 30 日,基金份额净值 1.129 元,基金份额总额 1,655,920,220.07 份。本基金自 2009 年 4 月 30 日基金合同生效,无上年度可比数据。后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:海富通领先成长股票型证券投资基金

本报告期:2009 年 04 月 30 日至 2009 年 06 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2009年 04 月 30 日至 2009 年 06 月 30 日
一、收入	308,721,592.15
1.利息收入	1,104,546.83
其中:存款利息收入	1,096,026.01
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	8,520.82
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	112,522,584.05
其中:股票投资收益	103,250,652.11
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	9,271,931.94
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	193,433,066.23
4.其他收入(损失以"-"号填列)	1,661,395.04
二、费用	-15,562,767.46
1.管理人报酬	-6,492,081.51
2.托管费	-1,082,013.56
3.销售服务费	-
4.交易费用	-7,894,215.91
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	-94,456.48
三、利润总额	293,158,824.69

注:本基金自 2009 年 4 月 30 日基金合同生效,无上年度可比数据。后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通领先成长股票型证券投资基金

本报告期:2009 年 04 月 30 日至 2009 年 06 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2009年 04 月 30 日至 2009 年 06 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)	2,665,319,248.10	-	2,665,319,248.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	293,158,824.69	293,158,824.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以"-"号填列)	-1,009,399,028.03	-80,148,120.70	-1,089,547,148.73
其中:1.基金申购款	218,537,215.38	21,594,102.90	240,131,318.28
2.基金赎回款	-1,227,936,243.41	-101,742,223.60	-1,329,678,467.01
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)	1,655,920,220.07	213,010,703.99	1,868,930,924.06

注:本基金自 2009 年 4 月 30 日基金合同生效,无上年度可比数据。后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

6.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2009 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2009 年 6 月 30 日。

6.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已经终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润(累计亏损)。

6.4.1.9 收入(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.1.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

2009年 6 月 30 日

6.4.1.12 其他重要的会计政策和会计估计

(1)计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外,一般采用历史成本计量。

(2)根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(i)对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(ii)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会基金部通知[2006]37 号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

报告期内不存在会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

报告期内不存在会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

报告期内不存在重大会计差错。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
中国建设银行股份有限公司("建设银行")	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009 年 04 月 30 日(基金合同生效日)至 2009 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
海通证券	1,006,751,476.04	17.99

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009 年 04 月 30 日(基金合同生效日)至 2009 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
海通证券	831,610.83	17.78	831,610.83	17.78

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009 年 04 月 30 日(基金合同生效日)至 2009 年 06 月 30 日
当期应支付的管理费	6,492,081.51
其中:当期已支付	3,482,160.89
期末未支付	3,009,920.62

注:支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理费是按前一日基金资产净值的年费率(1.5%)计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009 年 04 月 30 日(基金合同生效日)至 2009 年 06 月 30 日
当期应支付的托管费	1,082,013.56
其中:当期已支付	580,360.14
期末未支付	501,653.42

注:支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值的年费率(0.25%)计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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

本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.4.5 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 2009 年 04 月 30 日(基金合同生效日)至 2009 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	316,754,270.28	1,061,991.39

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期不存在在承销期内参与关联方承销证券情况。

6.4.5 期末(2009 年 06 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券,包括银行间市场债券正回购和交易所市场债券正回购。

§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	1,537,631,964.66	70.41
	其中:普通股	1,537,631,964.66	70.41
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	297,000,348.50	13.60
	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	346,337,389.37	15.86
6	其他资产	2,859,023.15	0.13
7	合计	2,183,828,725.68	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	采掘业	130,608,662.54	6.99
C	制造业	288,421,933.51	15.43
C0	食品、饮料	20,088,478.90	1.07
C1	纺织、服装、皮毛	34,775,065.92	1.86
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9,900,069.52	0.53
C4	石油、化学、塑胶、塑料	28,347,273.60	1.52
C5	电子	55,441,590.16	2.97
C6	金属、非金属	40,467,022.27	2.17
C7	机械、设备、仪表	89,464,050.90	4.79
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	9,938,382.24	0.53
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	10,739,849.64	0.57
G	信息技术业	70,888,575.26	3.79
H	批发和零售贸易	8,873,349.25	0.47
I	金融、保险业	476,332,322.39	25.49
J	房地产业	378,322,573.71	20.24
K	社会服务业	103,043,091.04	5.51
L	传播与文化产业	7,243,780.31	0.39
M	综合类	63,157,827.01	3.38
	合计	1,537,631,964.66	82.27

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	600383	金地集团	7,452,631	120,136,411.72	6.43
2	600000	浦发银行	5,000,000	115,100,000.00	6.16
3	601166	兴业银行	2,599,950	96,484,144.50	5.16
4	000002	万 科 A	7,000,000	89,250,000.00	4.78
5	600016	民生银行	9,999,998	79,199,984.16	4.24
6	600048	保利地产	2,806,181	78,264,388.09	4.19
7	600036	招商银行	2,799,954	62,746,969.14	3.36
8	000069	华侨城 A	2,820,095	58,939,985.50	3.15
9	601601	中国太保	2,629,233	58,842,234.54	3.15
10	601628	中国人寿	2,125,443	58,555,954.65	3.13

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于 www.hftfund.com 网站的半年度报告正文。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科 A	152,477,454.55	8.16
2	600000	浦发银行	117,699,796.65	6.30
3	600383	金地集团	116,822,679.55	6.25
4	601168	西部矿业	112,741,276.47	6.03
5	601166	兴业银行	98,430,064.27	5.27
6	000898	鞍钢股份	92,960,108.27	4.97
7	000630	铜陵有色	79,181,865.33	4.24
8	600348	国阳新能	71,896,604.54	3.85
9	600649	城投控股	71,094,394.50	3.80
10	000937	金牛能源	69,129,477.96	3.70
11	600036	招商银行	63,424,086.56	3.39
12	600016	民生银行	63,065,499.08	3.37
13	600048	保利地产	62,896,218.01	3.37
14	000024	招商地产	62,421,578.15	3.34
15	600005	武钢股份	59,546,127.30	3.19
16	600478	科力远	58,987,180.81	3.16
17	000839	中信国安	57,703,487.17	3.09
18	601628	中国人寿	56,302,900.99	3.01
19	601601	中国太保	55,619,695.88	2.98
20	002202	金风科技	55,354,094.13	2.96
21	000069	华侨城 A	54,899,098.95	2.94
22	000009	中国宝安	54,113,038.65	2.90
23	601088	中国神华	53,787,698.76	2.88
24	600028	中国石化	53,697,461.40	2.87
25	600547	山东黄金	52,769,052.63	2.82
26	600586	金晶科技	49,444,465.86	2.65
27	600675	中华企业	49,057,125.82	2.62
28	600754	锦江股份	47,624,190.93	2.55
29	600550	天威保变	44,629,835.75	2.39
30	600231	凌钢股份	44,156,036.06	2.36
31	600102	莱钢股份	42,311,018.78	2.26
32	600366	宁波韵升	41,888,130.11	2.24
33	000677	山东海龙	40,503,464.01	2.17
34	600644	乐山电力	38,720,407.88	2.07

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000898	鞍钢股份	122,220,614.18	6.54
2	000002	万 科 A	101,511,805.78	5.43
3	000630	铜陵有色	81,693,723.40	4.37
4	600348	国阳新能	75,472,650.53	4.04
5	000937	金牛能源	75,421,533.40	4.04
6	601168	西部矿业	68,090,387.16	3.64
7	600005	武钢股份