# 海富通股票证券投资基金

## 2012年度报告摘要

2012年12月31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:二〇一三年三月二十七日**

### §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3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 海富通股票 |
| 基金主代码 | 519005 |
| 交易代码 | 519005 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年7月29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 | 5,881,842,664.27份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合,分享中国经济高速成长的成果,谋求基金资产的长期最大化增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用双层次的投资策略:第一层次主要通过对股票市场的系统性风险进行分析,确定股票和现金资产的配置比例;第二层次主要是通过对行业景气循环和个股的研究,精选适合本投资组合风险收益特征的股票。 |
| 业绩比较基准 | 80%MSCI China A+20%上证国债 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的股票型基金产品。 |

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 | 010-66594855 |
| | 电子邮箱 | wrxi@hftfund.com | tgcxpl@bank-of-china.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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2012年 | 2011年 | 2010年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -519,625,752.29 | -566,812,068.70 | 225,075,648.20 |
| 本期利润 | -61,738,595.19 | -1,448,054,505.94 | 318,064,531.32 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0101 | -0.2291 | 0.0468 |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.63% | -29.05% | 6.72% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2012年末 | 2011年末 | 2010年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.4573 | -0.4483 | -0.2223 |
| 期末基金资产净值 | 3,191,942,601.12 | 3,524,703,395.92 | 5,085,534,489.45 |
| 期末基金份额净值 | 0.543 | 0.552 | 0.778 |

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

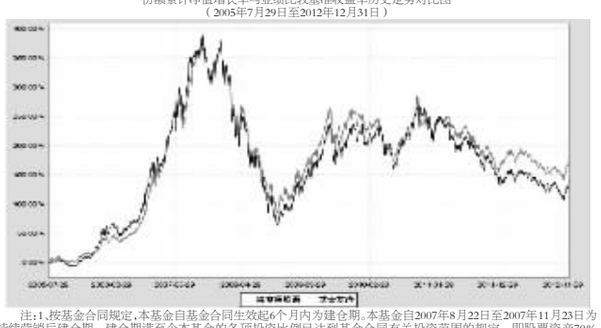
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 4.22% | 1.24% | 7.42% | 1.03% | -3.20% | 0.21% |
| 过去六个月 | -1.27% | 1.23% | 1.46% | 1.00% | -2.73% | 0.23% |
| 过去一年 | -1.63% | 1.23% | 6.42% | 1.04% | -8.05% | 0.19% |
| 过去三年 | -25.51% | 1.34% | -21.39% | 1.12% | -4.12% | 0.22% |
| 过去五年 | -46.82% | 1.72% | -38.22% | 1.56% | -8.60% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 141.27% | 1.68% | 178.52% | 1.52% | -37.25% | 0.16% |

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

海富通股票证券投资基金

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

(2005年7月29日至2012年12月31日)



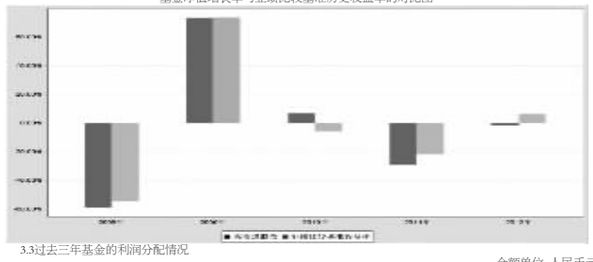
注:1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。本基金自2007年8月22日至2007年11月23日为持续营销后建仓期。建仓期满至今本基金的各项投资比例已达到基金合同有关投资范围的规定,即股票资产70%-95%,一年期以内的国家债券和现金的比例不低于5%。同时满足第14章(七)有关投资组合限制的各项比例要求。

2、为了能更公允地体现基金投资业绩,海富通基金管理有限公司自2007年1月1日起调整海富通股票基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为MSCI China A指数,相应的基准权重不变。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通股票证券投资基金

基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



3.3过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2012 | - | - | - | - | - |
| 2011 | - | - | - | - | - |
| 2010 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - |

注:本基金过去三年未实施利润分配。

### §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。本海富通股票证券投资基金是基金管理人管理的第四只公募基金;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、海富通上证非周期行业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、海富通益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和海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金二十只公募基金。

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(助理)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;海富通领先成长股票基金经理 | 2009-01-12 | 2012-02-17 | 21年 | 中国国籍,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,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经理,2009年1月至2012年2月任海富通股票基金经理,2009年4月至2012年4月任海富通领先成长股票基金经理。 |
| 陈静 | 本基金的基金经理;海富通风格优势股票基金经理;海富通领先成长股票基金经理 | 2012-02-17 | - | 9年 | 中国国籍,硕士,历任浙江省财政厅副主任科员、上海新理益投资管理有限公司高级经理、国元证券有限责任公司研究员、中国科技产业投资基金管理有限公司投资总监。2008年5月加入海富通基金管理有限公司,任投资经理。2012年2月起任海富通股票、海富通风格优势股票基金经理。2012年4月起任海富通领先成长股票基金经理。 |

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 管理人对投资组合管理的内控制度

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公平交易制度和控制方法

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。同时,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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、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)公司管理的不同投资组合同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明,报告期内公司对旗下各投资组合公平对待,不存在利益输送行为。

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,未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2012年股票市场呈现触底反弹的走势,虽然年初宏观经济、欧债危机和通胀形势均不容乐观,但市场对货币、财政政策放松有一定预期,指数在1-4月大幅上涨,进入5月后,政策放松预期部分落空,加上整体经济形势和上市公司业绩持续走低,市场一路下跌。进入12月后,经过连续几个月的观察,部分经济先行指标如PMI、发电量等数据反映国内经济已进入企稳复苏阶段;新一届政府领导班子上台后对于新型城镇化的发言,更指明了未来一段时期中国经济增长的方向,加上外资借助QFII等通道进入国内市场推高指数,市场连续大幅上涨。上证指数全年累计上涨3.17%,板块方面,房地产、建筑行业、金融服务涨幅领先,而信息技术、纺织服装、文化传播等行走表现较差。

本年度本基金一直保持了较高的仓位。而结构上,随着市场风格的变化有较大的调整:上半年,大配置主要集中在早周期、非银行金融以及稳定类蓝筹股;年中,逐步增加了TMT配置以及成长股;8月底,再次大幅提高地产行业的配置;12月份,增配了银行股,但配置比例仍偏低,同样非银行金融的配置比例也偏低。

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-1.63%,同期业绩比较基准收益率为6.42%,基金净值跑输业绩比较基准8.05个百分点。跑输的原因在于:1季度和4季度大幅跑输基准。一季度本能及时提高股票仓位,且在行业配置上周期类资产偏少;四季度银行业持仓比例太低。

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2013年,国际经济形势或将继续有所好转。美国经济稳定复苏,欧元区的最坏时间也已过去,欧债相关市场的情绪将继续缓和,欧元区银行信心也开始恢复,外需好转和金融体系的稳定将给欧元区国家带来经济功际的改善。

而国内方面,中国经济仍然处于复苏的过程中,但经济增长的步伐将渡过一条相对平稳的道路,从经济三驾马车来看,消费在2012年对GDP的贡献近6年来首次超过了投资,我们预计2013年也将稳步提升。此外,进出口或将随着国际经济得转暖继续有所好转,但考虑到目前中国出口占全球的比重已超过10%,进一步上升的空间有限,投资方面,由于地产销售的或超预期和城镇化的不断推进将有超预期的可能。但随着经济的企稳,下半年通胀的压力可能将开始逐渐显现。

从市场表现上看,A股的估值无论是横向比较还是纵向比较均属于相对较低的水平。短期看A股预期修复的行情还在进行之中。但随后市场能否继续转好,则需关注后续的经济复苏力度、通胀水平、企业盈利的改善幅度、经济的结构调整、IPO开闸和大小非减持等情况。

基于上述判断,13年将保持偏乐观的策略。在大类资产配置上,关注周期类行业以及成长股的投资机会;并保持适度偏高的仓位。我们将紧抓经济复苏,重点关注未来一到两个季度环比或同比复苏的周期性行业和公司;基于中长期民生改善的逻辑,开始布局中低端可选消费。同时,顺应新政府的政策走向,深挖政策红利,把握投资机会。

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负责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")在对海富通股票证券投资基金(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 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

### §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:海富通股票证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 355,682,953.58 | 196,250,131.17 |
| 结算备付金 | 2,102,544.67 | 12,615,338.81 |
| 存出保证金 | 2,017,846.45 | 3,612,937.82 |
| 交易性金融资产 | 2,864,295,183.71 | 2,960,196,826.27 |
| 其中:股票投资 | 2,864,295,183.71 | 2,766,786,826.27 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | 193,410,000.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 400,610,800.92 |
| 应收证券清算款 | - | 11,663,026.84 |
| 应收利息 | 72,137.11 | 3,629,951.86 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 57,608.16 | 149,179.58 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 3,224,228,273.68 | 3,588,728,193.27 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011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 | 22,190,424.29 | 51,257,836.89 |
| 应付赎回款 | 1,266,075.97 | 528,391.10 |
| 应付管理人报酬 | 3,761,204.17 | 4,700,658.66 |
| 应付托管费 | 626,867.36 | 783,443.11 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 2,285,789.28 | 4,529,412.46 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 2,155,311.49 | 2,225,055.13 |
| 负债合计 | 32,285,672.56 | 64,024,797.35 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 5,881,842,664.27 | 6,388,497,190.05 |
| 未分配利润 | -2,689,900,063.15 | -2,863,793,794.13 |
| 所有者权益合计 | 3,191,942,601.12 | 3,524,703,395.92 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,224,228,273.68 | 3,588,728,193.27 |

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.543元,基金份额总额5,881,842,664.27份。

7.2 利润表

会计主体:海富通股票证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 23,694,469.77 | -1,328,294,570.82 |
| 1.利息收入 | 6,496,051.68 | 10,579,632.57 |
| 其中:存款利息收入 | 2,273,563.34 | 3,523,741.48 |
| 债券利息收入 | 3,784,665.22 | 4,031,665.37 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 437,823.12 | 3,024,225.72 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -440,818,423.97 | -458,103,606.61 |
| 其中:股票投资收益 | -484,232,131.26 | -479,884,777.80 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 2,192,854.70 | 25,424.67 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 41,220,852.59 | 21,755,746.52 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 457,887,157.10 | -881,242,437.24 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 129,684.96 | 471,840.46 |
| 减:二、费用 | 85,433,064.96 | 119,759,935.12 |
| 1.管理人报酬 | 49,133,965.23 | 64,684,515.38 |
| 2.托管费 | 8,188,994.23 | 10,780,752.65 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 27,664,650.88 | 43,757,904.94 |
| 5.利息支出 | - | 11,859.19 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | 11,859.19 |
| 6.其他费用 | 445,454.62 | 524,902.96 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -61,738,595.19 | -1,448,054,505.94 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -61,738,595.19 | -1,448,054,505.94 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通股票证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31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) | 6,388,497,190.05 | -2,863,793,794.13 | 3,524,703,395.92 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -61,738,595.19 | -61,738,595.19 |
| 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) | -506,654,525.78 | 235,632,326.17 | -271,022,199.61 |
| 其中:1.基金申购款 | 288,175,917.36 | -128,463,648.54 | 159,712,268.82 |
| 2.基金赎回款 | -794,830,443.14 | 364,095,974.71 | -430,734,468.43 |
| 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) | 5,881,842,664.27 | -2,689,900,063.15 | 3,191,942,601.12 |
| 项目 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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) | 6,535,698,398.32 | -1,450,163,908.87 | 5,085,534,489.45 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -1,448,054,505.94 | -1,448,054,505.94 |
| 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) | -147,201,208.27 | 34,424,620.68 | -112,776,587.59 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,154,278,949.92 | -323,747,316.24 | 830,531,633.68 |
| 2.基金赎回款 | -1,301,480,158.19 | 358,171,936.92 | -943,308,221.27 |
| 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) | 6,388,497,190.05 | -2,863,793,794.13 | 3,524,703,395.92 |

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

海富通股票证券投资基金(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[2005]85号《关于同意海富通股票证券投资基金募集申请的批复》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《海富通股票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419,517,490.36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(2005)第107号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通股票证券投资基金基金合同》于2005年7月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为419,612,160.22份基金份额,其中认购资金利息折合94,669.86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《海富通股票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,包括为国内依法公开发行上市的股票、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,本基金投资组合的基本范围为:股票资产70%-95%,权证投资0-3%,一年期以内的政府债券和现金的比例不低于5%。本基金的业绩比较基准为:MSCI China A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3月22日批准报出。

7.4.2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"),中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通股票证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012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2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4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。

7.4.5会计政策变更的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金报告期内不存在会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金报告期内不存在重大会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6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[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》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) 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,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。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定按20%代扣代缴个人所得税。

(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。

7.4.7关联方关系

| 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 |
| 海通证券股份有限公司("海通证券") | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 法国巴黎投资管理BE控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding) | 基金管理人的股东 |

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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 海通证券 | 2,466,301,389.56 | 13.55% | 6,036,387,992.87 | 21.16% |

7.4.8.1.2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。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31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 | 2,106,033.29 | 13.62% | 33,333.42 | 1.46% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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 | 5,130,915.95 | 21.64% | 615,447.24 | 13.60% |

注:1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 49,133,965.23 | 64,684,515.38 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 8,887,476.90 | 11,949,693.88 |

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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 8,188,994.23 | 10,780,752.65 |

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。

7.4.8.3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。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1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。

7.4.8.4.2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

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末 2012年12月31日 | | 上年度末 2011年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 中国银行 | - | - | 194,132.34 | 0.003% |

7.4.8.5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 2012年1月1日至2012年12月31日 | | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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 | 355,682,953.58 | 2,135,260.44 | 196,250,131.17 | 3,323,568.16 |

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。

7.4.8.6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 2012年1月1日至2012年12月31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 | 老股东配售 | 306,520 | 30,652,000.00 |
| 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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 |
| - | - | - | - | - | - |

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1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

7.4.9.1.1 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002029 | 七匹狼 | 2012-06-26 | 2013-06-27 | 非公开发行 | 23.00 | 18.88 | 1,000,000 | 23,000,000.00 | 18,880,000.00 | - |
| 600863 | 内蒙华电 | 2012-03-21 | 2013-03-21 | 非公开发行 | 7.76 | 7.50 | 3,500,000 | 27,160,000.00 | 26,250,000.00 | - |

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。

7.4.9.2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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000002 | 万科A | 2012-12-26 | 重大事项 | 10.12 | 2013-01-21 | 11.13 | 10,595,116 | 84,051,712.33 | 107,222,573.92 | - |

注:本基金截至2012年12月31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。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

本基金在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。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金在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。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2012年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为2,711,942,609.79元,属于第二