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: 二〇一四年八月二十九日

# 海富通收益增长证券投资基金

## 2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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 | 海富通收益增长混合 |
| 基金主代码 | 519003 |
| 交易代码 | 519003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年3月12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 | 3,491,782,766.44份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 建立随时间推移非负增长的收益增长线,运用优化组合保险机制实现风险预算管理,力争基金份额净值高于收益增长线水平。在此基础上,通过精选证券和适度主动地把握市场时机,将中国经济的高速成长转化为基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 整体投资策略分为三个层次:第一层次,以优化投资组合保险策略为核心,并结合把握市场时机,确定和调整基金资产在债券和股票间的配置比例,实现风险预算管理、降低系统性风险,保证基金投资目标的实现;第二层次,采用自上而下的策略,以久期管理为核心,从整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次进行积极主动的债券投资管理,保证基金份额净值超越收益增长线;第三层次,从定价指标、盈利预测指标和流动性指标三个方面,积极主动精选个股和构建分散化的股票组合,控制非系统性风险,充分获取股市上涨收益。 |
| 业绩比较基准 | 40%MSCI China A+60%上证国债 |
| 风险收益特征 | 属于证券投资基金中风险较低的产品,追求在风险预算目标下基金资产增值的最大化。 |

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 | 王永民 |
| | 联系电话 | 021-38650891 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | wrxi@hftfund.com | fcid@bankofchina.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 | -19,367,694.68 |
| 本期利润 | -49,619,581.72 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0137 |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.15% |
| 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 | -0.3159 |
| 期末基金资产净值 | 2,388,749,227.41 |
| 期末基金份额净值 | 0.684 |

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

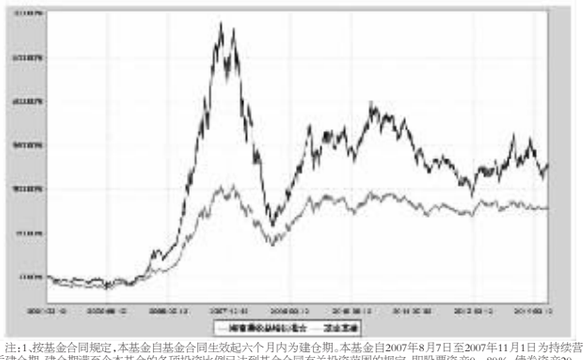
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 3.32% | 0.77% | 0.46% | 0.32% | 2.86% | 0.45% |
| 过去三个月 | 1.18% | 0.78% | 0.91% | 0.35% | 0.27% | 0.43% |
| 过去六个月 | -2.15% | 1.14% | -1.45% | 0.41% | -0.70% | 0.73% |
| 过去一年 | 7.38% | 1.20% | 2.29% | 0.46% | 5.09% | 0.74% |
| 过去三年 | -15.76% | 1.06% | -4.93% | 0.52% | -10.83% | 0.54% |
| 自基金合同生效起至今 | 129.39% | 1.24% | 79.32% | 0.71% | 50.07% | 0.53% |

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

海富通收益增长证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年3月12日至2014年6月30日)



注:1.按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。本基金自2007年8月7日至2007年11月1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0—80%、债券资产20—100%,同时满足第18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日起调整海富通收益增长混合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。

## 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。本海富通收益增长证券投资基金是基金管理人管理的第二只公募基金;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、海富通稳健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、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、海富通中证沪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、海富通券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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 黄春雨 | 本基金的基金经理;海富通股票基金经理;海富通国策导向股票基金经理,海富通内需热点股票基金经理 | 2013-07-31 | 2014-04-28 | 7年 | 博士。持有基金从业人员资格证书。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月至7月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,2013年7月至2014年4月任海富通收益增长混合和海富通国策导向股票基金经理,2013年12月至2014年4月兼任海富通内需热点股票基金经理。2014年4月兼任海富通股票基金经理。 |
| 丁俊 | 本基金的基金经理;海富通精选混合基金经理;海富通精选贰号混合基金经理;海富通股票基金经理;投资副总监 | 2014-04-11 | - | 12年 | 硕士。持有基金从业人员资格证书。2002年7月至2006年4月就职于平安资产管理公司,曾任权益投资部研究主管,2006年4月加入海富通基金管理有限公司,任海富通精选混合和海富通风格优势股票基金经理助理,2007年8月至2012年1月任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2012年1月至2014年3月任海富通基金管理有限公司研究总监。2014年1月起任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2014年3月起任投资副总监。2014年4月起兼任海富通收益增长混合和海富通股票基金经理。 |
| 王金祥 | 本基金的基金经理助理 | 2013-04-24 | 2014-02-26 | 10年 | 硕士,持有基金从业人员资格证书。历任东莞证券、新疆证券及兴业证券行业分析师,2009年9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月至2014年2月任海富通收益增长混合基金经理助理。 |

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.本公司于2014年8月12日发布公告,自2014年8月12日起,聘任黄峰先生担任本基金的基金经理助理,协助基金经理进行本基金的投资运作。

4.2 管理人对投资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,涵盖了投权、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

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。

本基金在一季度维持了中性偏低的股票资产配置比例,结构上增持了新能源汽车、医疗服务、智慧城市和京津冀的投资比例,全面减持了传统传媒、电子等传统成长行业个股的配置。二季度本基金随着创业板指数的下跌,进行了部分资产调整,减持了部分已累计一定涨幅的地产资产,逢低增持了具备持续较高增速潜力的成长股,在之后的创业板反弹中获取了不错的收益。临近季末,创业板反弹已累积一定幅度,且期将中报来临,部分股价已大幅反弹的成长股又将面临业绩压力,基于此本基金对该类资产进行了减持,同时将股票配置比例降到较低水平。

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-2.15%,同期基金业绩比较基准收益率为-1.45%,基金净值跑输业绩比较基准0.70个百分点。主要原因为初期在一些传统成长行业个股上的配置比较重,今年市场在追逐新成长热点上切换比较快,传统成长行业个股的估值压力比较大。在配置切换上不够及时,导致业绩表现未能跑赢基准。

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,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,其股价有望获涨上行。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。

本基金将继续以股票配置比例变动来应对系统性风险变化。资产选择上,政策受益型资产和代表未来经济发展方向的成长类资产后续值得重点跟踪。

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对海富通收益增长证券投资基金(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:海富通收益增长证券投资基金

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 | 441,097,320.32 | 183,010,696.83 |
| 结算备付金 | 1,994,472.63 | 10,200,106.46 |
| 存出保证金 | 1,411,904.56 | 1,220,527.22 |
| 交易性金融资产 | 1,651,744,901.40 | 2,386,431,947.52 |
| 其中:股票投资 | 1,160,752,501.40 | 1,812,434,897.52 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 490,992,400.00 | 573,997,050.00 |
| 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 | 267,930,773.97 | - |
| 应收证券清算款 | 22,182,282.45 | 98,573,832.69 |
| 应收利息 | 11,763,633.24 | 10,241,473.61 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 4,720.44 | 10,375.46 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,398,130,009.01 | 2,689,688,959.79 |
| 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 | - | 55,914,483.58 |
| 应付赎回款 | 2,682,833.91 | 2,892,953.20 |
| 应付管理人报酬 | 2,902,488.66 | 3,284,356.05 |
| 应付托管费 | 483,748.11 | 547,392.69 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,644,351.62 | 5,977,265.93 |
| 应交税费 | 1,468,939.32 | 1,468,939.32 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 198,419.98 | 400,233.94 |
| 负债合计 | 9,380,781.60 | 70,485,624.71 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 3,491,782,766.44 | 3,749,010,005.30 |
| 未分配利润 | -1,103,033,539.03 | -1,129,806,670.22 |
| 所有者权益合计 | 2,388,749,227.41 | 2,619,203,335.08 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,398,130,009.01 | 2,689,688,959.79 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.684元,基金份额总额 3,491,782,766.44份。

6.2 利润表

会计主体:海富通收益增长证券投资基金

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 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -11,203,188.58 | 6,275,330.57 |
| 1.利息收入 | 12,732,200.33 | 11,355,483.03 |
| 其中:存款利息收入 | 1,688,298.83 | 813,868.00 |
| 债券利息收入 | 10,509,402.77 | 10,178,427.21 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 534,498.73 | 363,187.82 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 6,292,379.51 | 149,765,390.58 |
| 其中:股票投资收益 | 123,689.48 | 134,802,464.32 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 1,339,290.00 | - |
| 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 | 4,829,400.03 | 14,962,926.26 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -30,251,887.04 | -154,848,885.15 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 24,118.62 | 3,342.11 |
| 减:二、费用 | 38,416,393.14 | 44,223,031.23 |
| 1.管理人报酬 | 18,784,960.69 | 19,976,502.14 |
| 2.托管费 | 3,130,826.80 | 3,329,416.98 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 16,278,441.22 | 20,690,506.10 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 222,164.43 | 226,606.01 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -49,619,581.72 | -37,947,700.66 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -49,619,581.72 | -37,947,700.66 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通收益增长证券投资基金

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) | 3,749,010,005.30 | -1,129,806,670.22 | 2,619,203,335.08 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -49,619,581.72 | -49,619,581.72 |
| 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) | -257,227,238.86 | 76,392,712.91 | -180,834,525.95 |
| 其中:1.基金申购款 | 28,934,758.51 | -8,433,348.22 | 20,501,410.29 |
| 2.基金赎回款 | -286,161,997.37 | 84,826,061.13 | -201,335,936.24 |
| 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) | 3,491,782,766.44 | -1,103,033,539.03 | 2,388,749,227.41 |

| 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) | 4,168,989,503.05 | -1,469,323,487.42 | 2,699,666,015.63 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -37,947,700.66 | -37,947,700.66 |
| 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) | -194,939,629.78 | 65,974,694.84 | -128,964,934.94 |
| 其中:1.基金申购款 | 5,798,371.64 | -1,986,687.23 | 3,811,684.41 |
| 2.基金赎回款 | -200,738,001.42 | 67,961,382.07 | -132,776,619.35 |
| 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) | 3,974,049,873.27 | -1,441,296,493.24 | 2,532,753,380.03 |

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

海富通收益增长证券投资基金(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[2004]第87号《关于同意海富通收益增长证券投资基金设立的批复》核准,由海富通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《海富通收益增长证券投资基金基金契约》(后更名为《海富通收益增长证券投资基金基金合同》)发起,并于2004年3月12日募集成立。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13,066,513,423.19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(2004)第38号验资报告予以验证。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《海富通收益增长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0-80%,债券资产20-100%,权证投资0-3%,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:MSCI China A 指数×40%+上证国债指数×60%。

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》、《海富通收益增长证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

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2014年6月30日的财务状况以及2014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[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 |

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

金额单位: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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 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 | 1,994,049,539.09 | 18.25% | 3,417,495,147.42 | 25.10% |

6.4.8.1.2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。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014年6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 | 1,785,264.13 | 19.25% | 331,335.98 | 20.18% |

| 关联方名称 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6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 | 3,058,399.55 | 25.29% | 1,367,163.58 | 29.79% |

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,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后的净额列示。债券交易不计佣金 。

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。

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 | 18,784,960.69 | 19,976,502.14 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 3,063,779.49 | 3,306,342.32 |

注:1.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。

2.根据《海富通收益增长证券投资基金基金合同》的规定,如果本基金份额净值低于收益增长线,基金管理人将从下一日开始暂停收取管理人报酬,直至基金份额净值不低于收益增长线。

收益增长线为基金管理人通过风险预算管理和组合保险策略,建立的一条随时间推移呈现非负增长的安全收益增长曲线。收益增长线按日历计算的每180天调整一次,每期期初按照上期基金份额资产净值增长率的60%和上期期末日的收益增长线水平来确定当期期末日的收益增长线水平。当期任何一天的收益增长线水平为上期期末和当期期末的收益增长线水平的线性插值。如果上期基金份额资产净值为零增长或负增长,则当期收益增长线保持上期期末水平。如果当期基金分红,收益增长线水平在分红除权日(含分红除权日)扣除分红额度向下调整。收益增长线从本基金开放日起计算,第一期收益增长线水平固定为0.920元。

3.本基金在本半年度基金份额净值高于收益增长线水平,管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提(2013年上半年度;同)。本基金截至2014年6月30日止的累计基金份额净值2.299元(2013年6月30日:2.252元),高于累计收益增长线水平1.326元(2013年6月30日:1.320元)。

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 | 3,130,826.80 | 3,329,416.98 |

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。

6.4.8.3 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

本基金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

本基金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 |
| 中国银行 | 441,097,320.32 | 1,589,717.39 | 223,215,552.29 | 707,416.23 |

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。

6.4.8.6 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券流通受限的证券。

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 | - | - | 802,892 | 20,831,087.36 | 32,356,547.60 | - |
| 300369 | 绿盟科技 | 2014-06-26 | 重大资产重组 | 61.27 | - | - | 320,000 | 18,973,072.82 | 19,606,400.00 | - |
| 300379 | 东方通 | 2014-06-23 | 重大资产重组 | 62.17 | 2014-08-15 | 67.39 | 247,886 | 16,543,509.53 | 15,411,072.62 | - |

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 | 1,160,752,501.40 | 48.40 |
| | 其中:股票 | 1,160,752,501.40 | 48.40 |
| 2 | 固定收益投资 | 490,992,400.00 | 20.47 |
| | 其中:债券 | 490,992,400.00 | 20.47 |
| | 资产支持证