海富通稳固收益债券型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通稳固收益债券
基金主代码	519030
交易代码	519030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月23日
报告期末基金份额总额	935,523,825.68份
投资目标	通过合理运用投资组合优化策略,力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	本基金的整体投资策略分为三个层次:第一层次,即资产配置策略,将以优化投资组合保险策略为核心,实现基金投资目标;第二层次,即债券投资策略,将采用自上而下的策略,以久期管理为核心;第三层次,即股票投资策略,包括新股申购策略和积极的精选个股策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,134,863.95
2.本期利润	780,459.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0007
4.期末基金资产净值	944,784,848.63
5.期末基金份额净值	1.010

注:①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。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-0.10%	0.14%	1.16%	0.01%	-1.26%	0.13%

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

海富通稳固收益债券型证券投资基金

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

(2010年11月23日至2011年6月30日)

注:1.本基金合同于2010年11月23日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年;

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。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分(二)投资范围、(六)投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
邵佳民	本基金的基金经理;海富通强化回报混合基金基金经理;海富通稳健添利债券基金基金经理;海富通强化回报债券基金基金经理;固定收益组合管理部总监	2010-11-23	-	14年	中国国籍,硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师,2005年1月至2008年1月任海富通货币基金基金经理,2006年5月起任海富通强化回报混合基金基金经理,2007年10月起兼任海富通稳健添利债券基金基金经理,2010年11月起兼任海富通稳固收益债券基金基金经理。

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:目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,本基金管理人以真遵循《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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年第二季度,消费物价指数(CPI)连创新高,当季公布的3月到5月消费物价指数均超过5%,而6月份更预期超过6%,通货膨胀的压力非常大。同时,第二季度的经济增长数据也不乐观,采购经理人指数呈现阶梯下降态势。

第二季度的货币政策将控制通货膨胀放在优先位置。存款准备金政策维持了"一月一调"的原则,继续紧缩,银行间拆借利率也逐月上涨,6月中下旬更加创出本年新高,超过春节期间的水平,绝大多数债券的收益率与短期资金利率相比出现倒挂。民间利率持续高涨,远远超过债券市场的收益率。资金利率的高涨,也刺激了债券发行。第二季度开始进入债券发行旺季,公司债券的发行审批速度大大加快,城投类债券也有所提速。

所有以上因素,导致二季度债券市场开始下挫,城投类债券也有所提速。

股票市场整体下跌,调整幅度超出市场预期。可转换债券在股票市场的带动下也出现下跌。

基金在二季度控制债券投资,组合的剩余期限控制在两年以下,同时减少对可转债的投资,投资比例降低到30%以下。股票投资方面,整体大幅度减少投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳固收益债券型证券投资基金的净值增长率为-0.10%,同期业绩比较基准收益率为1.16%。

4.6 市场展望和投资策略

本基金认为,2011年第三季度的债券市场相对保持谨慎。主要原因是,消费物价指数仍处于高水平,三季度明显下降的可能性不大;中央银行面对居高不下的物价压力,很难进行实质性的放松。二季度加息不足也导致紧缩政策还在空间。债券发行的压力非常大,并且以低评级品种为主,信用品种更加不被看好。由于二季度出现了违约方面的消息,投资者对低评级高收益债券的态度有所转变。股票市场整体以震荡为主,国际经济施加的影响较大。

我们预期,三季度的收益率曲线有所陡峭,在合适的时机延长组合剩余期限应该是较好的选择。股票投资仍保持阶段投资的策略,控制投资比例。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	16,241,742.90	1.71
	其中:股票	16,241,742.90	1.71
2	固定收益投资	901,549,251.10	94.74
	其中:债券	901,549,251.10	94.74
	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	24,062,368.44	2.53
6	其他各项资产	9,799,660.32	1.03
7	合计	951,653,022.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,685,742.90	0.50
C0	食品、饮料	4,676,642.90	0.49
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	9,100.00	0.00
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
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	7,398,000.00	0.78
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	30,000.00	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,128,000.00	0.44
	合计	16,241,742.90	1.72

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601333	广深铁路	1,800,000	7,398,000.00	0.78
2	002582	好想你	90,022	4,676,642.90	0.49
3	600811	东方集团	600,000	4,128,000.00	0.44
4	300240	飞力达	1,500	30,000.00	0.00
5	300238	冠昊生物	500	9,100.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	248,125,000.00	26.26
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	470,397,851.10	49.79
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	183,026,400.00	19.37
8	其他	-	-
9	合计	901,549,251.10	95.42

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101023	11央行票据23	2,500,000	248,125,000.00	26.26
2	113001	中行转债	930,000	98,189,400.00	10.39
3	126005	07武钢债	810,000	78,853,500.00	8.35
4	110015	石化转债	690,000	74,416,500.00	7.88
5	126016	08宝钢债	700,000	62,216,000.00	6.59

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,481,913.96
2	应收证券清算款	4,467,233.91
3	应收股利	-
4	应收利息	3,821,718.83
5	应收申购款	28,793.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,799,660.32

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	98,189,400.00	10.39
2	110011	歌华转债	3,399,300.00	0.36

5.8.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300240	飞力达	30,000.00	0.00	新股流通受限
2	300238	冠昊生物	9,100.00	0.00	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,260,764,938.41
本报告期基金总申购份额	44,171,855.33
减:本报告期基金总赎回份额	369,412,968.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	935,523,825.68

§7 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18只开放式基金。截至2011年6月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过392亿元人民币。

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2011年6月30日,海富通为50多家企业超过150亿元的企业年金基金担任了投资管理人。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2011年6月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近25亿元。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2011年6月30日,投资咨询及海外业务规模达219亿元人民币。

4月8日,在《证券时报》主办的第八届中国"金基金奖"评选中,海富通基金获得2010年度金基金公司奖——海外投资回报公司"奖。4月10日,在《中国证券报》主办的"第八届中国基金业金牛奖"评选中,海富通基金获得2010年度金牛基金管理公司"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公益林。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"率福投资"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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通稳固收益债券型证券投资基金的文件

(二)海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同

(三)海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书

(四)海富通稳固收益债券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)报告期内海富通稳固收益债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

8.2 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。

8.3 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
二〇一一年七月二十日

海富通稳健添利债券型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通稳健添利债券	
基金主代码	519023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年10月24日	
报告期末基金份额总额	98,917,843.71份	
投资目标	在强调本金安全的基础上,积极追求资产长期稳健的增值。	
投资策略	本基金通过价值分析,采用自上而下确定投资策略,采取久期管理、类属配置和现金管理策略等积极投资策略,发现、确认并利用细分市场失衡,实现组合增值。	
业绩比较基准	中证全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
下属两级基金的交易代码	519024	519023
报告期末下属两级基金的份额总额	8,957,769.54份	89,960,074.17份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)	
	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
1.本期已实现收益	-242,194.88	-1,753,340.64
2.本期利润	23,037.65	-444,849.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0020	-0.0041
4.期末基金资产净值	9,248,604.05	92,618,033.10
5.期末基金份额净值	1.032	1.030

注:①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。

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海富通稳健添利债券型证券投资基金于2009年3月13日刊登公告,自2009年3月18日起增加一种新的收费模式-A类收费模式,该类别收取申购费和赎回费,不收取销售服务费。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1.海富通稳健添利债券A:

阶段	净值增长率①	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	-0.48%	0.16%	0.90%	0.11%	-1.38%	0.05%

2.海富通稳健添利债券C:

阶段	净值增长率①	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	-0.48%	0.15%	0.90%	0.11%	-1.38%	0.04%

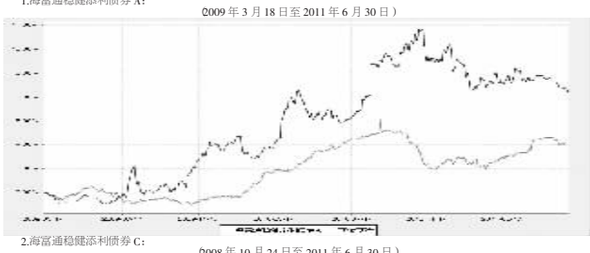
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通稳健添利债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1.海富通稳健添利债券A:

(2009年3月18日至2011年6月30日)



2.海富通稳健添利债券C:

(2008年10月24日至2011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十一章(二)投资范围、(六)投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
邵佳民	本基金的基金经理;海富通强化回报混合基金基金经理;海富通稳固收益债券基金基金经理;固定收益组合管理部总监	2008-10-24	-	14年	中国国籍,硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师,2005年1月至2008年1月担任海富通货币基金基金经理。2006年5月起任海富通强化回报混合基金基金经理,2007年10月起任固定收益组合管理部总监,2008年10月起兼任海富通稳健添利债券基金基金经理,2010年11月起兼任海富通稳固收益债券基金基金经理。

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为:目参加证券行业的相关工作开始计算。

本报告期内,本基金管理人以真遵循《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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年第二季度,消费物价指数(CPI)连创新高,当季公布的3月到5月消费物价指数均超过5%,而6月份更预期超过6%,通货膨胀的压力非常大。同时,第二季度的经济增长数据也不乐观,采购经理人指数呈现阶梯下降态势。

第二季度的货币政策将控制通货膨胀放在优先位置。存款准备金政策维持了"一月一调"的原则,继续紧缩,银行间拆借利率也逐月上涨,6月中旬更加创出本年新高,超过春节期间的水平,绝大多数债券的收益率与短期资金利率相比出现倒挂。民间利率持续高涨,远远超过债券市场的收益率。资金利率的高涨,也刺激了债券发行。第二季度开始进入债券发行旺季,公司债券的发行审批速度大大加快,城投类债券也有所提速。

所有以上因素,导致二季度债券市场先扬后抑,6月下旬由于资金极度紧张,部分信用债券大幅度调整,部分利率产品的发行则出现问题。股票市场整体下跌,调整幅度超出市场预期。可转换债券在股票市场的带动下也出现下跌。

基金在二季度控制债券投资,组合的剩余期限控制在三年以下;股票投资方面,一季度开始大幅度减少投资。同时减少对可转债的投资,投资比例一度降低到20%以下。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳健添利债券C类基金净值增长率为-0.48%,同期业绩比较基准收益率为0.90%;海富通稳健添利债券A类基金净值增长率为-0.48%,同期业绩比较基准收益率为0.90%。

4.6 市场展望和投资策略

本基金认为,2011年第三季度的债券市场相对保持谨慎。主要原因是,消费物价指数仍处于高水平,三季度明显下降的可能性不大;中央银行面对居高不下的物价压力,很难进行实质性的放松。二季度加息不足也导致紧缩政策还在空间。债券发行的压力非常大,并且以低评级品种为主,信用品种更加不被看好。由于二季度出现了违约方面的消息,投资者对低评级高收益债券的态度有所转变。股票市场整体以震荡为主,国际经济施加的影响较大。

我们预期,三季度的收益率曲线有所陡峭,在合适的时机延长组合剩余期限应该是较好的选择。新股投资仍保持阶段投资的策略,控制投资比例。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	10,000.00	0.01
	其中:股票	10,000.00	0.01
2	固定收益投资	110,630,533.40	94.16
	其中:债券	110,630,533.40	94.16
	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	4,995,959.87	4.25
6	其他各项资产	1,854,966.72	1.58
7	合计	117,491,459.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
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	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	10,000.00	0.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	10,000.00	0.01

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300240	飞力达	500	10,000.00	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,980,200.00	10.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	69,021,683.40	67.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	30,628,650.00	30.07
8	其他	-	-
9	合计	110,630,533.40	108.60

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	135,000	14,559,750.00	14.29
2	126008	08上汽债	140,000	12,723,200.00	12.49
3	113001	中行转债	120,000	12,669,600.00	12.44
4	111055	09华西债	120,000	11,928,000.00	11.71
5	010110	21国债(1)	110,000	10,980,200.00	10.78

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	138,331.05
2	应收证券清算款	879,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	760,032.35
5	应收申购款	77,603.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,854,966.72

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	12,669,600.00	12.44
2	110011	歌华转债	3,399,300.00	3.34

5.8.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300240	飞力达	10,000.00	0.01	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通稳健添利债券A	海富通稳健添利债券C
本报告期期初基金份额总额	48,427,167.81	137,639,022.80
本报告期基金总申购份额	682,135.64	2,248,982.67
减:本报告期基金总赎回份额	40,151,533.91	49,927,931.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,957,769.54	89,960,074.17

§7 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18只开放式基金。截至2011年6月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过392亿元人民币。

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2011年6月30日,海富通为50多家企业超过150亿元的企业年金基金担任了投资管理人。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2011年6月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近25亿元。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2011年6月30日,投资咨询及海外业务规模达219亿元人民币。

4月8日,在《证券时报》主办的第八届中国"金基金奖"评选中,海富通基金获得2010年度金基金公司奖——海外投资回报公司"奖。4月10日,在《中国证券报》主办的"第八届中国基金业金牛奖"评选中,海富通基金获得2010年度金牛基金管理公司"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公益林。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"率福投资"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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通稳健添利债券型证券投资基金的文件

(二)海富通稳健添利债券型证券投资基金基金合同

(三)海富通稳健添利债券型证券投资基金招募说明书

(四)海富通稳健添利债券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)报告期内海富通稳健添利债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

8.2 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。

8.3 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
二〇一一年七月二十日

海富通中国海外精选股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2011年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中国海外股票(QDII)
基金主代码	519601
交易代码	519601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月27日
报告期末基金份额总额	198,783,874.27份
投资目标	本基金以在香港、美国等海外证券交易所上市的具有"中国概念"的上市公司为主要投资对象,本基金管理人将深入研究全球及内地经济状况以及政策导向,采取主动精选证券和适度资产配置的投资策略,实施全程风险管理,在保证资产良好流动性的前提下,在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	根据对境内外证券市场投资经验的认识和对证券市场的实证分析,本基金管理人将基金的整体投资策略分为二个层次:第一层次为适度主动的资产配置,以控制或规避市场系统性风险;第二层次为积极主动的精选证券,以分散或规避个券风险。主动精选证券是本基金投资策略的重点,本基金不积极谋求寻找市场的拐点,主要从控制系统性风险出发适度调整资产配置。
业绩比较基准	MSCI中国指数(以美元计价)
风险收益特征	本基金是股票型基金,其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。
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
境外资产托管人英文名称	The Bank of New York Mellon Corporation
境外资产托管人中文名称	纽约梅隆银行

注:本基金管理人于2011年2月14日发布公告,自2011年2月14日起解除与法国巴黎投资管理BE控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding)签署的投资顾问协议,自该日起法国巴黎投资管理BE控股公司不再担任本基金的投资顾问。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	17,086,757.39
2.本期利润	-9,322,668.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0