海富通货币市场证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9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○一一年十月二十四日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通货币	
基金主代码	519505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年1月4日	
报告期末基金份额总额	3,675,801,656.64份	
投资目标	在力争本金安全和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	根据宏观经济指标(主要包括:利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率),决定债券组合的剩余期限(长/中/短)和比例分布。根据各类资产的流动性特征(主要包括:平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量、分拆转换进程),决定组合中各类资产的投资比例。根据债券的信用等级及担保状况,决定组合的风险级别。	
业绩比较基准	税后一年期银行定期存款利率	
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的证券投资基金品种。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通货币A	海富通货币B
下属两级基金的交易代码	519505	519506
报告期末下属两级基金的份额总额	1,007,314,996.38份	2,668,486,660.26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7月1日-2011年9月30日)	
	海富通货币A	海富通货币B
1.本期已实现收益	10,187,761.09	32,723,926.17
2.本期利润	10,187,761.09	32,723,926.17
3.期末基金资产净值	1,007,314,996.38	2,668,486,660.26

注:(1)本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

(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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.海富通货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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3个月	1.0436%	0.0016%	0.8669%	0.0002%	0.1767%	0.0014%

2.海富通货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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3个月	1.1042%	0.0016%	0.8669%	0.0002%	0.2373%	0.0014%

注:本基金收益分配按月结转份额。

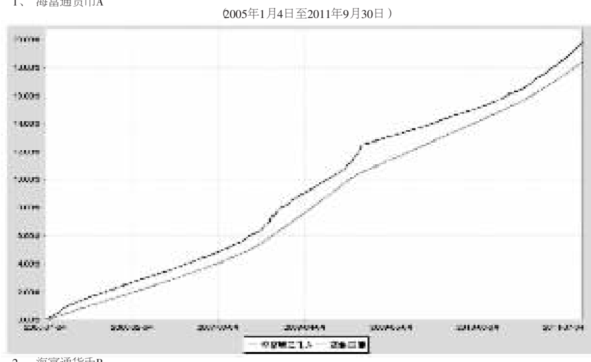
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通货币市场证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

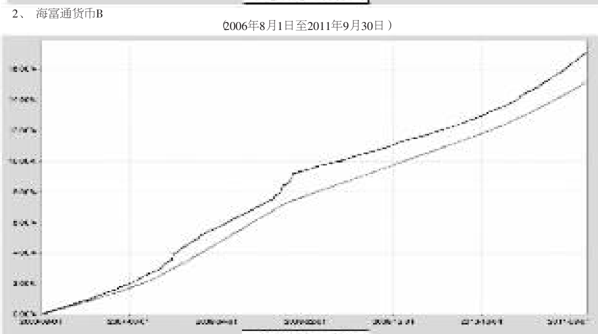
1、海富通货币A

(2005年1月4日至2011年9月30日)



2、海富通货币B

(2006年8月1日至2011年9月30日)



注:1、本基金合同于2005年1月4日生效,按基金合同规定,本基金自基金合同生效起3个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资组合中规定的各项比例。

2、本基金的历任基金经理为邵佳民先生,任职时间为2005年1月至2008年1月。

§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		
张丽洁	本基金的基金经理;海富通稳进增利分级债券基金基金经理	2008-2-14	-	9年	经济学学士学位,2002年7月至2004年7月就职于南京银行股份有限公司,从事债券交易工作,2004年8月加入海富通基金管理有限公司,任助理固定收益分析师、组合经理,2008年2月起任海富通货币基金基金经理。2011年9月起兼任海富通稳进增利分级债券基金基金经理。

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:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年三季度经济略有降温,市场对于经济降速判断一致预期,但是降幅和降速存在差异;通胀压力依旧较大,7-9月份CPI都在历史高位徘徊,对于CPI在10月份之后走势,市场给出不同的下降路径;欧债危机加速恶化,市场对于世界经济形势不乐观。央行本季度宣布扩大了上调准备金率调整范围,对于此举市场反应不一,但是没有更加明显的紧缩信号。市场资金面基本保持稳定,市场利率普遍开始下降,没有季末的冲高行情。但是对于城投债从7月份开始却出现了较大的信用担忧,由此带动整个信用债市场的大幅度调整,城投债的发行和交易陷入瘫痪,信用债券的估值节节升高。虽然由于资金面的宽松带动了几个小波段债券行情,仅仅为窄幅调整。

海富通货币基金这个季度的规模相对稳定。海富通货币在三季度中保守投资,无论对于利率还是信用,本基金都谨慎规避没有主动增加仓位。总体而言海富通货币保持了较好的流动性和较高的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A级基金净值收益率为1.0436%,同期业绩比较基准收益率为0.8669%;B级基金净值收益率为1.1042%,同期业绩比较基准收益率为0.8669%。

4.6 市场展望和投资策略

本基金认为年底前通胀将小幅回落,但是否能在年底前回到4以内尚不明朗。央行的货币政策预计在本季度相对会适当宽松,所以资金面变化除年底时点外保持平稳为主。城投债的发行会在本季度开始启动,所以城投债的流动性在本季度应该会有所改善。对于利率债券,本基金认为年底前会有一波小行情,相对而言,信用债券的高票息也具备投资价值。介于本轮大幅度调整后,债券相对风险已经不大了,四季度本基金将适时增加债券久期和仓位。

§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	固定收益投资	1,545,388,149.46	41.93
	其中:债券	1,545,388,149.46	41.93
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,055,002,182.50	28.62
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,058,723,633.96	28.73
4	其他各项资产	26,527,558.85	0.72
5	合计	3,685,641,524.77	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.85	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在本报告期本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	28.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.27	-
2	30天(含)—60天	8.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	22.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.18	-
4	90天(含)—180天	26.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.45	-
5	180天(含)—397天(含)	13.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.54	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	299,585,396.72	8.15
	其中:政策性金融债	299,585,396.72	8.15
4	企业债券	534,966,700.90	14.55
5	企业短期融资券	710,836,051.84	19.34
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,545,388,149.46	42.04
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	584,649,353.92	15.91

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	058031	05中信债1	1,800,000	177,646,664.26	4.83
2	0980147	09中航工债浮	1,600,000	162,115,929.23	4.41
3	1181252	11浙商集CP01	1,500,000	150,181,446.60	4.09
4	110222	11国开22	1,500,000	149,913,558.51	4.08
5	068007	06首都机场债	1,300,000	126,963,396.19	3.45
6	1181084	11浙小商CP01	1,000,000	100,093,427.62	2.72
7	100231	10国开31	1,000,000	99,989,185.19	2.72
8	1181249	11神火CP01	800,000	80,102,394.57	2.18
9	1181067	11悦达CP01	700,000	70,113,785.26	1.91
10	068019	06京投债	700,000	68,240,711.22	1.86

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1419%
报告期内偏离度的最低值	-0.1342%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0791%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

2007年7月1日基金实施新会计准则后,本基金所持有的债券(包括票据)采用摊余成本法进行估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	26,526,358.85
4	应收申购款	1,200.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	26,527,558.85

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通货币A	海富通货币B
本报告期期初基金份额总额	664,321,727.60	2,474,020,014.84
本报告期基金总申购份额	3,003,242,065.54	4,288,805,038.41
减:本报告期基金总赎回份额	2,660,248,796.76	4,094,338,392.99
本报告期期末基金份额总额	1,007,314,996.38	2,668,486,660.26

§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19只公募基金。截至2011年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过351亿元人民币。

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9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9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近28亿元。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9月30日,投资咨询及海外业务规模达206亿元人民币。

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"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。

§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货币市场证券投资基金的文件

(二)海富通货币市场证券投资基金基金合同

(三)海富通货币市场证券投资基金招募说明书

(四)海富通货币市场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)报告期内海富通货币市场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○一一年十月二十四日

海富通稳健添利债券型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9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○一一年十月二十四日

§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10月21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7月1日起至9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	87,373,251.61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	6,505,040.54份	80,868,211.07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7月1日-2011年9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	-319,853.58	-4,056,678.62
2.本期利润	-462,459.98	-5,623,193.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0627	-0.0662
4.期末基金资产净值	6,288,608.51	77,891,560.65
5.期末基金份额净值	0.967	0.963

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	-6.30%	0.25%	0.03%	0.13%	-6.33%	0.12%

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	-6.50%	0.25%	0.03%	0.13%	-6.53%	0.12%

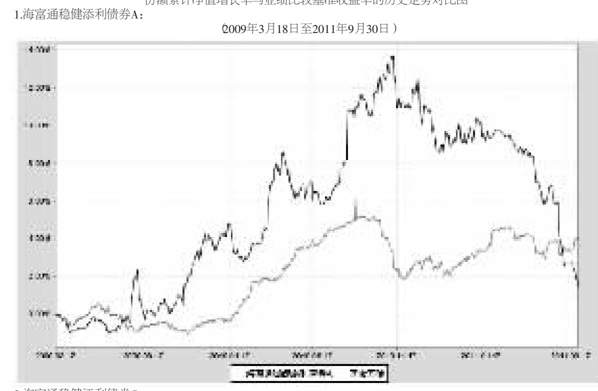
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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9月30日)



2.海富通稳健添利债券C:

(2008年10月24日至2011年9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:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年第三季度,消费物价指数(CPI)继续向上,7月份和8月份分别达到6.5%和6.2%的水平,食品价格的推动作用明显。7月份中央银行进行了今年以来的第三次存贷款基准利率上调,一年期存款利率达到3.5%。存款准备金率没有继续提高,而是扩大了计算缴存的口径,把保证金存款纳入,紧缩的基调不变。

三季度贷款增长继续受到限制,导致民间利率继续上扬,对所有投资品种形成挤压。股票和债券的发行保持较高速度,供需关系也不利于市场行情。特别是,中国石化在8月底宣布计划发行第二期可转换债券,极大地改变了市场的预期,导致可转换债券市场出现连续暴跌,转股期权价值迅速下降。城投债虽然受到市场环境影响,新发行不多,但机构投资者的减持导致其价格一路走低,季度末多个品种的年收益率超过10%。

基金在三季度控制债券组合的久期,大幅度减少股票投资,不参与新股的网下申购,严格控制风险。但基金净值主要受到可转换债券的影响,仍出现了下跌。

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-6.50%,同期业绩比较基准收益率为0.03%;海富通稳健添利债券A类基金净值增长率为-6.30%,同期业绩比较基准收益率为0.03%。基金跑输基准的原因在于权益市场和债券市场的下跌。

4.6 市场展望和投资策略

本基金认为,2011年第四季度的债券市场继续保持谨慎。主要原因是,消费物价指数仍处于高水平,虽然可能出现下降,但仍然处于较高水平。发行人出于各种考虑,会继续增加债券的发行,甚至不排除增加国债在未来的发行。中央银行面对以食品价格为主要推动力的物价压力,短期内很难进行实质性的放松。可转换债券方面,虽然大部分品种已经有一定纯债券价值,但是市场对股票市场中期并不看好,因此也缺乏向上的动力。

我们预期,四季度政府类债券可能保持平稳,信用产品的收益率继续上升,但年底可能迎来信用产品的投资时机。权益类投资继续保持谨慎。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	72,415,880.00	83.50
	其中:债券	72,415,880.00	83.50
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	6,000,000.00	6.92
	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	6,943,746.29	8.01
6	其他各项资产	1,362,333.39	1.57
7	合计	86,721,959.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	27,048,600.00	32.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	42,555,110.00	50.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,812,170.00	3.34
8	其他	-	-
9	合计	72,415,880.00	86.02

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	010112	21国债(12)	270,000	27,048,600.00	32.13
2	111055	09华西债	105,000	9,434,145.00	11.21
3	126001	06马钢债	75,000	7,481,250.00	8.89
4	126019	09长虹债	78,000	6,138,600.00	7.29
5	126013	08青啤债	60,000	5,286,600.00	6.28

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	250,000.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,102,396.96
5	应收申购款	9,936.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,362,333.39

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	110015	石化转债	1,311,150.00	1.56
2	110007	博汇转债	975,600.00	1.16
3	110011	歌华转债	525,420.00	0.62

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§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	8,957,769.54	89,960,074.17
本报告期基金总申购份额	386,469.96	3,215,650.83
减:本报告期基金总赎回份额	2,839,198.96	12,307,513.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,505,040.54	80,868,211.07

§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19只公募基金。截至2011年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过351亿元人民币。

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9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9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近28亿元。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9月30日,投资咨询及海外业务规模达206亿元人民币。

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"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。

§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○一一年十月二十四日

海富通中证100 指数证券投资基金(LOF)

2011 第三季度 报告

2011年9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○一一年十月二十四日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中证100指数(LOF)
基金主代码	162307
交易代码	162307
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月30日
报告期末基金份额总额	1,787,816,017.28份
投资目标	采用指数化投资方式,通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段,控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度,实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
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。
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

§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7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-18,873,582.93
2.本期利润	-223,717,868.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1199
4.期末基金资产净值	1,284,844,851.14
5.期末基金份额净值	0.719

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

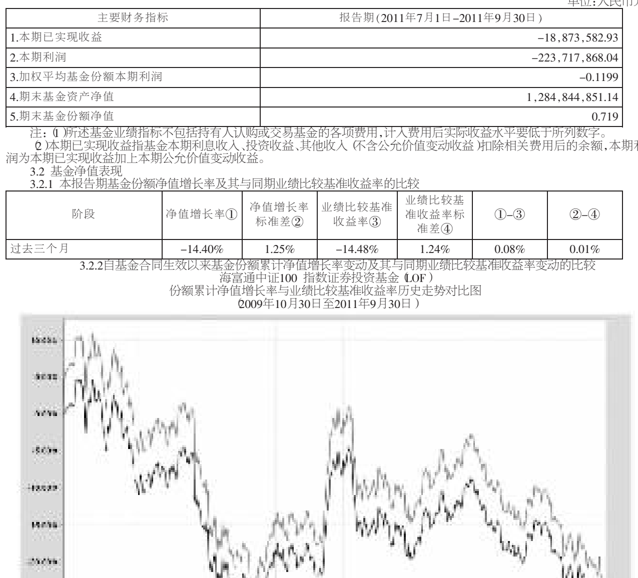
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.40%	1.25%	-14.48%	1.24%	0.08%	0.01%

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

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)

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

(2009年10月30日至2011年9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。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十五条(二)、(七)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§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		
牟永宁	本基金的基金经理;海富通风格优势股票基金基金经理	2009-10-30	-	16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基金经理;2009年10月起任海富通中证100指数(LOF)基金基金经理。2011年4月起兼任海富通风格优势股票基金基金经理。

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: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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年第三季度在内外部不利因素的共同作用下,A股市场的表现令投资者失望。欧债危机进一步恶化,以及美国经济增长放缓,使得欧美股市出现了大幅波动,而国内通胀居高不下,紧缩调控政策并没有如期放松,存款准备金基数扩大等打击了投资者的热情。在外需减弱,投资放缓,成本上升等各种严峻挑战下,企业盈利也出现了下降。从行业板块表现来看,房地产、钢铁、有色、金融等周期性行业跌幅居前,消费等防御类行业表现略好。

作为指数基金,在操作上我们严格遵守基金合同,应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通中证100指数(LOF)基金净值增长率为-14.40%,同期基金业绩比较基准收益率为-14.48%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0015%,年化跟踪误差为0.78%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 市场展望和投资策略

展望四季度,美国经济在经过数月回落后开始企稳。欧债的风险救助框架正在形成,但其进展较缓,仍有较大不确定性存在。希腊违约问题仍将是短期内扰动市场的重要变量。就国内而言,欧债危机对中国出口的打击可能会和房地产投资滞后性回落出现叠加,导致中国经济在四季度继续下滑。与此同时,由于通胀压力的慢慢减缓,四季度的信贷规模可能会稍有放松。但鉴于CPI仍处高位,政策转向的可能性很小,大幅度的放松概率较低。对于行业而言,由于通胀的缓慢回落,可能会出现量价齐跌的情况,从而促使上市公司盈利预期下滑的担忧继续演绎。因此,四季度股市将依然面临着宏观环境和资金环境偏紧的问题,系统性的投资机会可能不大,但结构性的投资机会依然存在。在板块上我们认为,四季度国家产业政策支持的领域依然有望成为市场的热点,与民生消费相关的行业领域也可能会受到市场的青睐。

本基金将继续严格按照基金合同的要求,秉承指数化投资策略,提高组合与指数的拟合度。

§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	1,217,666,912.21	94.61
	其中:股票	1,217,666,912.21	94.61
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	68,417,150.52	5.32
6	其他各项资产	1,007,690.13	0.08
7	合计	1,287,091,752.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2 指数投资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	2,459,109.80	0.19
B	采掘业	161,696,427.45	12.58
C	制造业	340,421,316.89	26.50
C0	食品、饮料	89,503,653.84	6.97
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	17,407,980.96	1.35
C5	电子	1,915,507.74	0.15
C6	金属、非金属	76,486,070.22	5.95
C7	机械、设备、仪表	142,799,068.43	11.11
C8	医药、生物制品	12,309,035.70	0.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	22,572,938.83	1.76
E	建筑业	37,071,111.72	2.89
F	交通运输、仓储业	43,831,036.78	3.41
G	信息技术业	28,772,354.14	2.24
H	批发和零售贸易	17,012,917.26	1.32
I	金融、保险业	503,597,078.72	39.20
J	房地产业	49,418,344.01	3.85
K	社会服务业	6,760,326.06	0.53
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,053,950.55	0.32
	合计	1,217,666,912.21	94.77

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股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	600036	招商银行	5,099,690	56,402,571.40	4.39
2	600030	中信证券	4,861,088	54,687,240.00	4.26
3	600016	民生银行	8,631,935	47,648,281.20	3.71
4	601318	中国平安	1,297,821	43,567,850.97	3.39
5	601328	交通银行	8,877,363	39,770,586.24	3.10
6	601166	兴业银行	3,187,424	39,492,183.36	3.07
7	600000	浦发银行	4,377,231	37,381,552.74	2.91
8	601088	中国神华	1,276,291	32,341,213.94	2.52
9	600519	贵州茅台	158,456	30,200,129.04	2.35
10	000858	五粮液	750,300	27,235,890.00	2.12

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期内中国证监会于2011年4月29日发布《中国证监会行政处罚决定书(五粮液、唐桥等8名责任人员)》,五粮液(000858)因其信息披露违法问题被中国证监会给予警告并处以60万元罚款。

对该股票投资决策程序的说明:该股票根据股票池审批流程后进入本基金备选库,根据核心股票池审批流程后进入本基金管理人核心股票池,由研究员定期跟踪并分析。《中国证监会行政处罚决定书(五粮液、唐桥等8名责任人员)》公布后,本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析,认为此事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对该上市公司的投资判断。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	219,336.70
4	应收利息	13,819.58
5	应收申购款	9,409.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.14
8	其他	-
9	合计	1,007,690.13

5.8.4 报告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。

5.8.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§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	1,920,800,441.55
本报告期基金总申购份额	19,994,733.78
减:本报告期基金总赎回份额	152,979,158.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,787,816,017.28

§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19只公募基金。截至2011年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过351亿元人民币。

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9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9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近28亿元。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9月30日,投资咨询及海外业务规模达206亿元人民币。

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"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。

§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中证100指数证券投资基金(LOF)的文件

(二)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)基金合同

(三)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)招募说明书

(四)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)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)报告期内海富通中证100指数证券投资基金(LOF)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○一一年十月二十四日