海富通精选贰号混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月23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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通精选贰号混合
基金主代码	519015
交易代码	519015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月9日
报告期末基金份额总额	1,831,960,558.67份
投资目标	本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行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	本基金的投资策略分两个层次: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。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。
业绩比较基准	MSCI China A指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险度适中的品种。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	6,668,284.17
2.本期利润	126,558,885.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0672
4.期末基金资产净值	1,262,597,344.04
5.期末基金份额净值	0.689

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

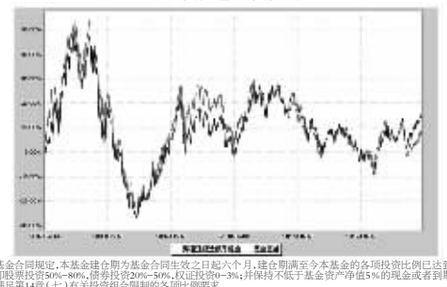
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.77%	0.90%	7.31%	0.90%	3.46%	0.00%

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

海富通精选贰号混合型证券投资基金

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

(2007年4月9日至2013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,即股票投资50%-80%,债券投资0%-50%,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。同时满足第14章(七)有关投资组合限制的各项比例要求。

§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		
蒋征	本基金的基金经理;海富通强化回报混合基金经理;海富通精选混合基金经理;投资副总监	2012-1-20	-	16年	工商管理硕士,持有基金从业人员资格证书。历任中国保险信托投资公司证券业务经理,嘉实基金管理有限公司丰和基金经理助理,2003年1月至2004年4月任泰和基金经理,2004年8月至2006年5月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选基金经理,2005年12月至2006年5月任基金兴安基金经理。2006年6月加入海富通基金管理有限公司。2006年9月起任海富通强化回报混合基金经理,2007年1月至2009年1月兼任海富通股票基金经理,2007年10月至2013年1月任股票组合管理部总监(2012年1月更名为股票相对收益组合部总监),2009年1月至2012年1月兼任海富通收益增长混合基金经理,2010年9月至2012年1月任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理,2012年1月起任海富通精选混合及海富通精选贰号混合基金经理。2013年1月起任投资副总监。

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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾二季度市场,沪深300和创业板指数都有较大幅度的上涨,6月底钱荒使得市场对于资金面尤其是月末的资金面程度高度关注,但央行关键时点的逆回购打消了市场疑虑,事件因素成为二季度走势的主导力量;光大乌龙指虽然短期引发市场动荡,但一定程度上也测试出了市场空方力量的薄弱;9月以来上海自贸区概念发酵带动大盘上涨,受益于自贸区以开放促改革的经济发展新格局,与之相关的物流、地产、商贸等板块连续上涨;创业板指数继续高歌猛进创历史新高,主要是通信、传媒等板块的连续发力所致。银行优先股试点、美联储推迟退出QE等也对市场上涨形成助力,行业表现上,三季度文化传媒、信息服务、商业贸易等行业涨幅领先,建筑、食品饮料等行业表现较弱。

本基金在三季度增加了仓位配置,结构上增加了移动互联网、光伏太阳能、LED、医药等行业的配置,减持了建材和估值较高的环保股。

从债市上来看,三季度央行“紧平衡”流动性的步措对银行的债券配置行为冲击严重,且三季度债券供给过大,配置需求不足导致的一二级市场“负反馈”加大了债券市场的调整程度,10年期国债收益率触及4.14%的本轮收益率新高,进入9月中下旬后,利率债一级市场发行量下降和QE延迟退出的利好,使得利率债走势有所回暖。三季度信用债收益率上行明显,其中,短融中票收益率升至年内高点,部分中低等级交易所个券遭遇负面评级冲击调整幅度,但随后投机者的介入使其超跌反弹。

转债方面,从6月底开始,在股市情绪恢复、债基赎回压力减弱的影响下,转债有所反弹。但进入7月中旬,转债再度走弱。9月,涨幅较大的题材股和低价股出现大幅调整,对转债表现构成拖累。

建仓初期,为应对债券市场变化以及基金的流动性管理需要,基金的债券资产配置主要以利率债券为主,同时积极参与了可转换债券的一级市场发行。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为10.77%,同期基金业绩比较基准收益率为7.31%,基金净值跑赢业绩比较基准3.46个百分点。

4.6 市场展望和投资策略

展望四季度,美国方面,美国经济仍将延续温和复苏的路径,两党在财政问题上的争端可能会影响其四季度的GDP,但财政僵局或将拖延美联储QE退出的步伐,欧洲方面,德国大选尘埃落定,默克尔的连任基本消除了欧洲政策的不确定性,四季度欧洲经济整体将步入温和的复苏阶段。

国内方面,我们认为四季度经济景气度可能难以持续向上,经济数据有旺季不旺的可能性。随着三中会的临近,关于经济改革的更多细节将逐步明朗,改革预期的提升或将带来整体风险偏好的提升,但市场面临的风险也将逐渐增加。因此,我们认为四季度三中会会前市场可能会维持缓慢震荡向上的走势,结构性的投资机会仍将此起彼伏。后续我们会更加关注:三中会的进程、后续的经济数据表现、通胀水平的回升、地方政府债务统计数据和三季报的业绩表现等。

尽管本基金长期看好符合经济结构调整方向的成长股,但短期估值泡沫已现。四季度经济数据不佳可能引发投资者的避险情绪,另外,

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	1,252,270.00	0.10
B	采矿业	9,855,889.80	0.78
C	制造业	462,024,834.08	36.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,135,253.35	1.36
E	建筑业	14,990,682.15	1.19
F	批发和零售业	128,660,836.78	10.19
G	交通运输、仓储和邮政业	22,853,092.08	1.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,539,566.10	3.77
J	金融业	40,010,547.33	3.17
K	房地产业	8,231,137.00	0.65
L	租赁和商务服务业	8,892,776.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	33,448,680.05	2.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,949,946.54	0.55
S	综合	-	-
	合计	801,845,511.26	63.51

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	600153	建发股份	16,152,316	114,681,443.60	9.08
2	000063	中兴通讯	2,754,954	45,732,236.40	3.62
3	600352	浙江龙盛	3,618,220	44,323,195.00	3.51
4	600686	金龙汽车	3,657,831	34,932,286.05	2.77
5	300070	碧水源	579,018	23,566,032.60	1.87
6	002415	海康威视	887,098	23,419,387.20	1.85
7	002023	海特高新	1,677,819	23,406,565.27	1.85
8	601006	大秦铁路	3,139,161	22,853,092.08	1.81
9	600887	伊利股份	511,255	22,842,873.40	1.81
10	002440	闰土股份	658,383	20,653,474.71	1.64

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	81,850,000.00	6.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	197,282,000.00	15.63
	其中:政策性金融债	197,282,000.00	15.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	24,806,620.96	1.96
8	其他	-	-
9	合计	303,938,620.96	24.07

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	110217	11国开17	1,000,000	97,680,000.00	7.74
2	010107	21国债(7)	600,000	61,860,000.00	4.90
3	130236	13国开36	400,000	39,948,000.00	3.16
4	130308	13进出08	400,000	39,704,000.00	3.14
5	113002	工行转债	218,880	24,258,470.40	1.92

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	460,965.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,792,390.68
5	应收申购款	3,247.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,256,603.80

5.10.4 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	113002	工行转债	24,258,470.40	1.92

5.10.5 报告期末前十名股票中存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	002023	海特高新	11,176,000.00	0.89	非公开发行

§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	1,916,035,311.91
本报告期基金总申购份额	792,765.03
减:本报告期基金总赎回份额	84,867,518.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,831,960,558.67

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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23只公募基金,截至2013年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模为近231亿元人民币。

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2013年9月30日,海富通为280多家企业超过292亿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2013年9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过45亿元,2010年12月,海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012年9月,中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。

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2013年9月30日,投资咨询及海外业务规模近198亿元人民币。2011年12月,海富通全资子公司——海富通资产管理(香港)有限公司获得证监会核准批复RQFII(人民币合格境外机构投资者)业务资格,能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012年2月,海富通资产管理(香港)有限公司已募集发行了首只RQFII产品。

2012年3月,国内权威财经媒体《中国证券报》等授予海富通基金管理有限公司“中国基金业金牛基金管理公司”大奖,《证券时报》授予海富通精选混合基金“2011年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金”荣誉,2013年4月,《上海证券报》授予海富通精选混合基金2012年“金基金”奖——分红基金奖。

海富通同时还在不断践行社会责任,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环保公益林。几年来,海富通的公益行动进一步升级,持续为上海民工小学学生捐献生活物资,并向安徽农村小学捐赠图书室。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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通精选贰号混合型证券投资基金的文件

(二)海富通精选贰号混合型证券投资基金金合同

(三)海富通精选贰号混合型证券投资基金招募说明书

(四)海富通精选贰号混合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)报告期内海富通精选贰号混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 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层基金管理人办公地址。

9.3 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
二〇一三年十月二十四日

海富通中国海外精选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十四日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月23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2013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	137,515,791.91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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	17,190,098.32
2.本期利润	20,565,762.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1415
4.期末基金资产净值	187,650,204.14
5.期末基金份额净值	1.365

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

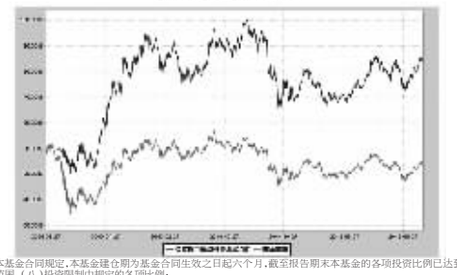
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.52%	1.14%	11.19%	1.16%	0.33%	-0.02%

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

海富通中国海外精选股票型证券投资基金

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

(2008年6月27日至2013年9月30日)



注:1.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十二条(二)投资范围、(八)投资限制中规定的各项比例;

2.本基金的业绩比较基准为MSCI中国指数(美元计价),在与同期业绩进行比较时,该基准已经转换为与本基金相同的计价货币(人民币)。

§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		
杨铭	本基金的基金经理;海富通大中华股票(QDII)基金经理	2010-1-13	-	16年	中国籍,特许金融分析师(CFA),经济学学士。持有基金从业人员资格证书。历任富兰克林国海证券投资顾问有限公司,2004年4月加入海富通基金管理有限公司,任股票分析师,2008年6月至2010年1月任海富通中国海外股票(QDII)基金经理助理,2010年1月起任海富通中国海外股票(QDII)基金经理,2011年1月起任海富通大中华股票(QDII)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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

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。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季一二年第二季度,美国QE的退出预期已经被市场基本消化后,中国6月底钱荒的疑虑被央行的行动所打消,随后美联储推迟退出QE也对市场上涨形成助力,海外中国股票走出第一轮不断上升的行情,以美国为代表的全球大部分经济体的经济继续增长,中国经济增长继续调势,自贸区和金融改革的推出印证深化体制改革依然稳步推进,国际资金主要流入发达国家股市,整个第三季度,发达市场股市表现好于新兴市场股市,海外中国股票表现更好。

报告期内,本基金灵活调整了股票仓位,主要增持了原材料行业的配置,减持了生活消费品和公用事业行业的配置。

4.6 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为11.52%,同期业绩比较基准收益率11.19%,基金净值跑赢业绩比较基准0.33个百分点。

4.7 市场展望和投资策略

展望二季一三年第四季度,我们认为美国经济保持稳步复苏,财政争端终将解决,QE退出略有推迟但势在必行。德国大选尘埃落定基本消除了欧洲政策的不确定性,欧洲经济整体将步入温和的复苏阶段。中国经济企稳,通胀水平将慢以大幅上行。随着三中会会召临近,关于经济改革的更多细节将逐步明朗,改革预期的提升或将带来整体风险偏好的提升,但市场面临的风险也将逐渐增加。四季度电子产品新品上市的拉动将继续,就市场而言,公司业绩增速将企稳,市场情绪已经消化了QE退出的影响,海外中国股票的整体估值仍处于偏低水平,因此,四季度市场将会处于一个震荡格局,结构性机会依然较多。

对于三一季一二年第四季度的市场判断,我们持谨慎乐观的态度,我们将继续密切关注国内外宏观经济形势和政策的变化,在投资上我们将灵活应对经济形势和市场的变化,结合三季报情况,坚持深入估值合理且业绩增长较为确定的成长股,受益于中国民生政策扶持、4G投资、内需拉动和经济转型的行业和公司,更强调结构性的机会和个股的基本面研究。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	150,062,949.69	75.16
	其中:普通股	146,392,593.69	73.32
	存托凭证	3,670,356.00	1.84
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,835,865.69	12.94
8	其他各项资产	23,763,950.62	11.90
9	合计	199,662,766.00	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	131,489,718.75	70.07
美国	16,271,173.82	8.67
新加坡	2,302,057.12	1.23
合计	150,062,949.69	79.97

注:国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定;ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金融	51,169,401.94	27.27
信息技术	42,778,402.55	22.80
原材料	18,642,887.98	9.93
非日常生活消费品	12,242,314.55	6.52
日常消费品	9,113,058.96	4.86
能源	5,967,131.12	3.18
工业	5,371,115.66	2.86
医疗保健	4,724,410.46	2.52
公共事业	54,226.47	0.03
合计	150,062,949.69	79.97

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	325,000	14,853,810.44	7.92
2	China Minsheng Banking Corp.,Ltd.	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港证券交易所	中国香港	1,980,000	14,551,244.20	7.75
3	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	42,500	13,706,452.93	7.30
4	SOHU.COM INC	搜狐公司	SOHU US	纳斯达克股票市场	美国	26,000	12,600,817.82	6.72
5	Citic Securities Company Limited	中信证券股份有限公司	6030 HK	香港证券交易所	中国香港	996,500	12,292,553.31	6.55
6	China National Building Material Company Limited	中国建材股份有限公司	3323 HK	香港证券交易所	中国香港	1,200,000	7,087,494.32	3.78
7	Great Wall Motor Company Limited	长城汽车股份有限公司	2333 HK	香港证券交易所	中国香港	205,000	6,834,001.44	3.64
8	Shanghai Fudan Microelectronics Group Company Limited	上海复旦微电子集团股份有限公司	8102 HK	香港证券交易所	中国香港	1,135,000	6,442,643.32	3.43
9	ZTE Corporation	中兴通讯股份有限公司	763 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	6,358,132.48	3.39
10	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港证券交易所	中国香港	1,240,000	5,967,131.12	3.18

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	17,230,423.92
3	应收股利	317,045.07
4	应收利息	407.89
5	应收申购款	24,092.24
6	其他应收款	6,191,981.50
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,763,950.62

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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	148,872,514.06
本报告期基金总申购份额	3,144,608.86
减:本报告期基金总赎回份额	14,501,331.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	137,515,791.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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23只公募基金,截至2013年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模为近231亿元人民币。

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2013年9月30日,海富通为80多家企业超过292亿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2013年9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过45亿元,2010年12月,海富通基金管理有限公司被全国社会保