海富通中小盘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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	海富通中小盘股票
基金主代码	519026
交易代码	519026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
报告期末基金份额总额	704,611,035.53份
投资目标	本基金通过投资于具有高成长潜力和良好基本面的中小盘股票,在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的持续增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等,对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控,在投资范围内确定相应大类资产配置比例;其次通过对行业及个股进行定量与定性相结合的分析,精选具有良好基本面和成长潜力的中小盘上市公司进行投资。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=中证700指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于高风险、高预期收益的投资品种。其预期收益、预期风险高于货币型基金和债券型基金。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	61,834,060.92
2.本期利润	181,181,124.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.2359
4.期末基金资产净值	849,515,518.80
5.期末基金份额净值	1.206

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

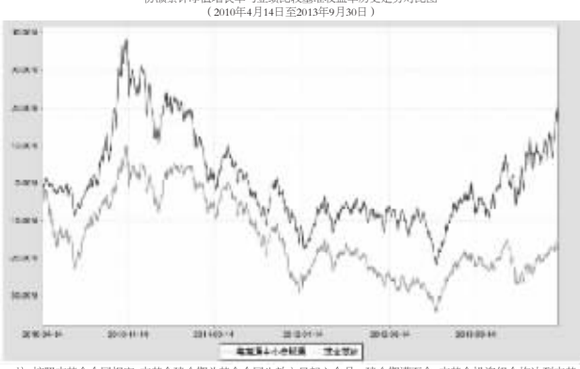
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	24.33%	1.91%	13.08%	1.11%	11.25%	0.80%

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

海富通中小盘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

(2010年4月14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,本基金投资组合均达到本基金合同第十一条(二)、(五)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		
程崇	本基金的基金经理,海富通养老收益混合基金经理	2010-4-14	-	10年	中国国籍,硕士,特许金融分析师(CFA),持有基金从业人员资格证书。历任金信管理研究公司研究所研究员,国金证券研究所研究员,曾当选《财富》2005年度最佳行业分析师。2006年7月加入海富通基金管理有限公司,历任股票分析师、非公募股票组合投资经理。2010年4月起任海富通中小盘股票基金经理,2013年5月起兼任海富通养老收益混合基金经理。

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,表明投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

回顾三季度市场,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。事件因素成为三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。

本基金在第三季度大幅增加了股票资产配置比例,结构上大幅增持了移动互联网相关的行业和个股,包括手游等传媒行业,并在楼锁门事件发生以后,增加了软件行业的配置。本基金目前保持高仓位,并根据业绩情况增减个股。

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24.33%,同期基金业绩比较基准收益率为13.08%,基金净值跑赢业绩比较基准11.25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。随着三中全会的临近,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全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:三中全会的进程、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。

基于上述判断,本基金在四季度维持对A股市场谨慎乐观的判断,关注结构性机会和改革红利机会,聚焦成长股,深挖受益于经济转型的新兴产业板块和个股,根据三季报情况以及草根调研,捕捉景气类成长股。

§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	802,051,285.35	92.87
	其中:股票	802,051,285.35	92.87
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	50,408,056.12	5.84
6	其他各项资产	11,200,687.84	1.30
7	合计	863,660,029.31	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	采矿业	-	-
C	制造业	346,520,443.71	40.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,189,111.85	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	224,068,054.25	26.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	77,734,863.88	9.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,512,000.00	3.47
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	107,026,811.66	12.60
S	综合	-	-
	合计	802,051,285.35	94.41

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	600332	白云山	2,250,000	80,055,000.00	9.42
2	300090	盛运股份	1,949,826	64,441,749.30	7.59
3	002241	歌尔声学	1,000,000	42,280,000.00	4.98
4	300071	华谊嘉信	1,033,962	41,544,593.16	4.89
5	002292	奥飞动漫	1,049,972	38,575,971.28	4.54
6	002690	美亚光电	1,300,000	38,376,000.00	4.52
7	600557	康缘药业	1,299,811	37,889,490.65	4.46
8	600633	浙报传媒	749,977	36,523,879.90	4.30
9	002400	省广股份	824,192	36,190,270.72	4.26
10	300315	掌趣科技	1,255,368	35,087,535.60	4.13

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 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合约。

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合约。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本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或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	757,835.75
2	应收证券清算款	9,886,683.29
3	应收股利	-
4	应收利息	11,050.31
5	应收申购款	545,118.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,200,687.84

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

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	002292	奥飞动漫	38,575,971.28	4.54	重大资产重组
2	002400	省广股份	36,190,270.72	4.26	重大资产重组
3	300315	掌趣科技	35,087,535.60	4.13	重大资产重组

§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	808,296,593.09
本报告期基金总申购份额	55,859,306.56
减:本报告期基金总赎回份额	159,544,864.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	704,611,035.53

§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献图书室。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中小盘股票型证券投资基金的文件

(二)海富通中小盘股票型证券投资基金基金合同

(三)海富通中小盘股票型证券投资基金招募说明书

(四)海富通中小盘股票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)报告期内海富通中小盘股票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层本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

海富通领先成长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	海富通领先成长股票
基金主代码	519025
交易代码	519025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月30日
报告期末基金份额总额	461,705,528.01份
投资目标	从具有领先发展的行业中,精选出具有高度成长性的股票,在控制风险并保持资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金运用已经得到市场检验和认可的国际先进投资理念,通过上市公司基本面的分析和研究,坚持寻找价值“洼地”和长线投资,来获得超额收益。在投资组合构建和管理的过程中,本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的方法,在具有领先发展的行业中,精选出具有高度成长性的股票。
业绩比较基准	MSCI China A指数×80%+上证国债指数×20%
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	中国建设银行股份有限公司

§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	10,926,904.33
2.本期利润	55,252,564.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.1162
4.期末基金资产净值	449,290,541.50
5.期末基金份额净值	0.973

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

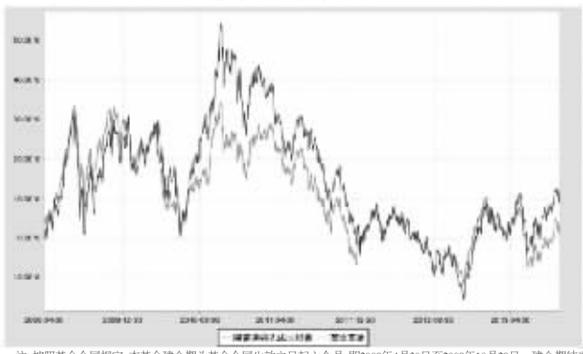
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.40%	1.19%	8.94%	1.11%	4.46%	0.08%

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

海富通领先成长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

(2009年4月30日至2013年9月30日)



注:按照基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,即2009年4月30日至2009年10月29日。建仓期结束时本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(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		
陈静	本基金的基金经理;海富通股票基金经理;海富通风格优势股票基金经理	2012-4-9	-	10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

报告期内,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,表明投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

回顾三季度市场,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。事件因素成为三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。

本基金在第三季度大幅增加了股票资产配置比例,结构上大幅增持了移动互联网相关的行业和个股,包括手游等传媒行业,并在楼锁门事件发生以后,增加了软件行业的配置。本基金目前保持高仓位,并根据业绩情况增减个股。

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13.40%,同期基金业绩比较基准收益率为8.94%,基金净值跑赢业绩比较基准4.46%。

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。随着三中全会的临近,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全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:三中全会的进程、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。

基于上述判断,本基金将继续在组合层面保持均衡配置,相对超配经济结构转型的行业,同时注意防范部分行业与个股的高估值风险。

§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	395,770,705.87	87.75
	其中:股票	395,770,705.87	87.75
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	55,085,899.73	12.21
6	其他各项资产	162,735.41	0.04
7	合计	451,019,341.01	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	3,735,561.22	0.83
B	采矿业	6,207,507.92	1.38
C	制造业	171,909,662.05	38.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,006,052.02	2.00
E	建筑业	11,703,987.77	2.60
F	批发和零售业	20,731,174.32	4.61
G	交通运输、仓储和邮政业	7,330,559.80	1.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,682,489.06	4.38
J	金融业	108,064,114.35	24.05
K	房地产业	22,763,142.29	5.07
L	租赁和商务服务业	4,579,031.74	1.02
M	科学研究和技术服务业	786,631.23	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	6,536,583.38	1.45
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	2,734,208.72	0.61
S	综合	-	-
	合计	395,770,705.87	88.09

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	601166	兴业银行	1,053,079	11,762,892.43	2.62
2	601318	中国平安	328,990	11,744,943.00	2.61
3	600887	伊利股份	257,330	11,497,504.40	2.56
4	600030	中信证券	900,411	11,066,051.19	2.46
5	600000	浦发银行	992,234	10,011,641.06	2.23
6	600705	中航投资	487,770	9,394,450.20	2.09
7	002440	闰土股份	268,849	8,433,793.13	1.88
8	002501	利源铝业	649,542	8,216,706.30	1.83
9	000001	平安银行	627,135	7,450,363.80	1.66
10	300147	香雪制药	336,104	7,424,537.36	1.65

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 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合约。

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合约。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本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或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	117,240.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,683.18
5	应收申购款	33,811.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	162,735.41

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	486,056,992.75
本报告期基金总申购份额	3,572,871.65
减:本报告期基金总赎回份额	27,924,336.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	461,705,528.01

§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献图书室。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领先成长股票型证券投资基金的文件

(二)海富通领先成长股票型证券投资基金基金合同

(三)海富通领先成长股票型证券投资基金招募说明书

(四)海富通领先成长股票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)报告期内海富通领先成长股票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层本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

海富通稳健添利债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	海富通稳健添利债券
基金主代码	519023
基金运作方式