海富通国策导向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	海富通国策导向股票
基金主代码	519033
交易代码	519033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月16日
报告期末基金份额总额	255,422,650.61份
投资目标	本基金将从受益于国家政策、尤其是产业政策的行业中,精选具有良好成长性及基本面的股票进行积极投资,同时辅以适度的资产配置,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将以政策受益作为投资主线,资产配置将利用多因素分析,着重考虑国家的宏观经济政策影响,如财政政策和货币政策等;行业配置与个股精选将着重以国家的产业政策为主要考虑因素,深入挖掘受益于国家政策的上市公司的价值。
业绩比较基准	MSCI中国A股指数×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、预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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	33,325,906.33
2.本期利润	62,030,618.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.6543
4.期末基金资产净值	401,902,180.77
5.期末基金份额净值	1.573

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	44.44%	1.87%	8.94%	1.11%	35.50%	0.76%

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

海富通国策导向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

(2011年11月16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。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分(二)投资范围、(七)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		
牟永宁	本基金的基金经理;海富通收益增长混合基金经理;海富通风格优势股票基金经理	2011-11-16	-	18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经理;2009年10月至2012年1月任海富通中证100指数(LOF)基金经理,2011年4月起兼任海富通风格优势股票基金经理,2011年11月起兼任海富通国策导向股票基金经理,2012年1月起兼任海富通收益增长混合基金经理。
黄春雨	本基金的基金经理,海富通收益增长混合基金经理	2013-7-31	-	6年	黄春雨先生,中国国籍,博士,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月起任海富通收益增长混合和海富通国策导向股票基金经理。

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: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

经历六月份的"钱荒"后,由于中央银行的密切关注,三季度虽然没有出现资金面极度紧张的局面。但是,银行理财产品等市场参与方,在政策和市场的双重推动下持续进行资产转换,信用债需求减少,导致收益率持续调整。利率债方面,由于货币市场资金成本居高不下,银行等主要配置机构对利率债的需求减少;加上时间窗口的原因,三季度的利率债发行是一个高峰,致使一级市场收益率持续走高,并带动二级市场收益率向上,标志性的10年期国债收益率一度达到4.14%的水平。进入9月份,利率债收益率已经能够覆盖银行等机构的资金成本,机构的资产配置调整也初步完成,债券市场收益率趋于稳定。

可转债方面呈现分化趋势。大部分转债由于发行人不属于热点行业,表现一般,部分行业符合市场热点的品种有较好表现,停牌后复牌的中国重工转债则成为拉开业绩差距的利器。

基金在本季度以调整结构为主,提高流动性和信用等级要求,适当降低杠杆,并对可转换债券进行波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳进增利债券型证券投资基金的净值增长率为0.34%,同期业绩比较基准收益率为-0.09%。

4.6 市场展望和投资策略

基金管理人认为,2013年第四季度,债券市场能够保持平稳,但仍然缺乏持续性和趋势性的投资机会。由于房地产行业及相关行业对资金的吸收能力很强,而中央银行在强大的成本推动压力前也难以放松货币政策,因此短期资金和长期资金偏紧张的局面短期内难以改变。另一方面,在经历吹盘率上涨后,利率债和信用债的收益率水平对场外资金有一定吸引力,因此相信能够保持平稳。从结构上看,目前信用债的收益率还没有拉开,整体风险补偿不足。可转债方面,仍然有结构性机会,但新股IPO和转债供给可能有一定冲击。

基金将精选个券,进一步提高组合流动性,寻找合适的加杠杆机会,同时在进出时点方面更加认真把握,争取为持有人带来更好回报。

§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	305,972,840.85	96.01
	其中:债券	305,972,840.85	96.01
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,000,000.00	0.31
	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	5,606,769.45	1.76
6	其他各项资产	6,095,776.42	1.91
7	合计	318,675,386.72	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	261,225,700.85	99.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	44,747,140.00	16.98
8	其他	-	-
9	合计	305,972,840.85	116.10

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	126018	08江铜债	270,000	23,989,500.00	9.10
2	111051	09怀化债	220,000	23,483,680.00	8.91
3	1280030	12丹投债	200,000	21,160,000.00	8.03
4	122661	12怀化债	200,000	20,834,000.00	7.91
5	124352	13平凉债	200,000	19,993,775.34	7.59

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 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北大荒(600598)于2013年9月5日收到中国证监会黑龙江监管局行政监管措施决定书【2013】7、8、9号文件。文件对公司在信息披露方面出现的违规行为进行了警示、责令公司采取改正措施并责令公司董事、监事及高级管理人员参加相关培训。

报告期内本基金投资的北大荒(600598)因公司资金拆借金额巨大,未及时进行披露以及公司董事、总经理丁晓枫因直接实施了相关资金拆借行为,对公司未及时履行信息披露义务负有不可推卸的责任,上海证券交易所于2012年11月28日对北大荒以及公司董事、总经理丁晓枫进行了公开谴责。

对该股票投资决策程序的说明:管理人预计公司未来承包费呈稳定增长趋势。公司未来的看点在地租租金呈稳定提升趋势,而几无成本;耕地面积由于公司仍有可耕荒地的储备还有提升空间。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该股票被纳入本基金的实际投资组合。

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。

5.10.2 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	129,288.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,386.41
5	应收申购款	62,297,524.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,438,198.91

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在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的说明

§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	39,790,132.36
本报告期基金总申购份额	450,894,901.41
减:本报告期基金总赎回份额	235,262,383.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	255,422,650.61

§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"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。

§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国策导向股票型证券投资基金的文件

(二)海富通国策导向股票型证券投资基金基金合同

(三)海富通国策导向股票型证券投资基金招募说明书

(四)海富通国策导向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)报告期内海富通国策导向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

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

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通上证非周期ETF联接
基金主代码	519032
交易代码	519032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月27日
报告期末基金份额总额	147,370,519.71份
投资目标	通过投资于上证非周期行业100ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金通过主要投资于上证非周期行业100ETF,标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数的表现。建仓完成后,正常情况下投资于上证非周期行业100ETF的比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证非周期行业100指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,同时本基金为上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金的联接基金,具有与上证非周期行业100指数相似的风险收益特征。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510120
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年6月8日
基金管理人名称	海富通基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

注:本表所列的基金主代码510120为目标基金的二级市场交易代码,目标基金的一级市场申购赎回代码为510121。

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数,按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,进行被动式指数化投资,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	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证非周期行业100指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,属于高风险、高预期收益的投资品种。本基金为指数型基金,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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	-1,990,947.60
2.本期利润	13,593,067.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0862
4.期末基金资产净值	117,511,452.92
5.期末基金份额净值	0.797

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

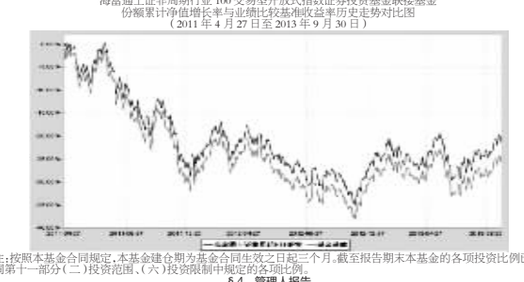
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.10%	1.16%	11.44%	1.19%	0.66%	-0.03%

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

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

(2011年4月27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三个月。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		
刘理	本基金的基金经理;海富通上证非周期ETF基金经理;海富通上证周期ETF基金经理;海富通上证100指数(LOF)基金经理;海富通中证内地低碳指数基金经理;指数投资部指数投资负责人	2011-4-27	-	12年	管理学硕士,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经理,2006年5月起任海富通强化回报混合基金经理,2007年10月至2013年1月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经理,2010年11月起兼任海富通稳健固收益债券基金经理。2013年1月起任投资副总监并兼任海富通稳进增利分级债券基金经理。

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,离任日期指公司作出决定之日;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

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较横震荡向上的走势,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。

未来,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	142,056.00	0.12
	其中:股票	142,056.00	0.12
2	基金投资	111,415,968.45	94.47
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	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	6,339,081.57	5.37
7	其他各项资产	42,737.68	0.04
8	合计	117,939,843.70	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	海富通基金管理有限公司	111,415,968.45	94.81

5.3 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	93,240.00	0.08
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	48,816.00	0.04
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	142,056.00	0.12

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	600690	青岛海尔	7,000	93,240.00	0.08
2	600058	五矿发展	3,600	48,816.00	0.04

5.5 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。

5.6 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,603.74
2	应收证券清算款	26,562.85
3	应收股利	-
4	应收利息	1,274.65
5	应收申购款	296.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,737.68

5.11.4 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。

5.11.5 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	600690	青岛海尔	93,240.00	0.08	重大事项
2	600058	五矿发展	48,816.00	0.04	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	161,224,136.69
本报告期基金总申购份额	133,198.67
减:本报告期基金总赎回份额	13,986,815.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	147,370,519.71

§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"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。

§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的文件

(二)海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金基金合同

(三)海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

(四)海富通上证非周期行业100交易型开放式指数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

海富通稳进增利分级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	海富通稳进增利分级债券(场内简称:海富增利)
基金主代码	162308
基金运作方式	契约型基金,本基金基金合同生效后,封闭期为三年(含三年),封闭期届满后转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2011年9月1日
报告期末基金份额总额	220,512,565.45份
投资目标	本基金在控制风险和保持资产适当流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为债券型基金,对债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断,对固定收益类资产、权益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。固定收益类资产中,本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等积极投资策略,在不同券种之间进行配置。
业绩比较基准	本基