海富通内需热点股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通内需热点股票
基金主代码	519056
交易代码	519056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月19日
报告期末基金份额总额	349,504,825.30份
投资目标	本基金将从受益于国家扩大内需促进经济发展政策的热点行业中,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;其次通过对受益于内需增长的热点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上市公司进行投资。
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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	37,951,938.76
2.本期利润	27,644,953.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0842
4.期末基金资产净值	372,543,043.67
5.期末基金份额净值	1.066

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。

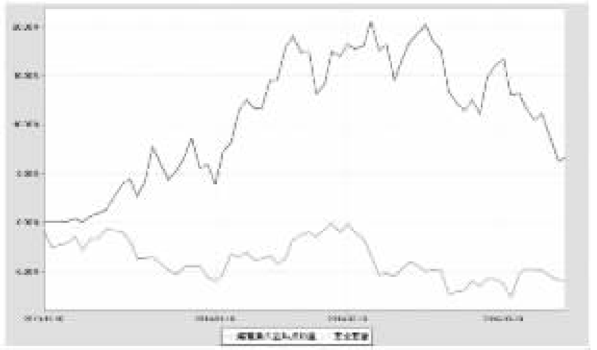
3.2 基金净值表现

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	5.23%	1.83%	-5.35%	0.94%	10.58%	0.89%

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

海富通内需热点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
(2013年12月19日至2014年3月31日)



注:1、本基金合同于2013年12月19日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,自2013年12月19日合同生效日起至2014年3月31日,本基金运作时间未满6个月,仍处于建仓期中。

§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		
黄春雨	本基金的基金经理,海富通收益增长混合基金经理,海富通国策导向股票基金经理	2013-12-19	-	7年	博士,持有基金从业人员资格证书,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,2013年12月起兼任海富通内需热点股票基金经理。

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

进入2014年,宏观经济数据显示经济持续孱弱,A股市场延续了去年的结构化行情,资金在各主题热点中快速切换,一季度股市总体下跌,创业板指略有上涨。1月,经济数据延续疲弱态势拖累大盘及周期股表现,而断档一年多的IPO重新开闸令创业板在市场的火热情绪下屡创新高。2月,受央行节前释放大量流动性和IPO暂缓影响,市场资金面迎来相对宽松的阶段,加上两会前维稳预期升温,两会政策利好的相关板块轮番上涨,前期涨逝的创业板开始走弱。3月,经济下行趋势对股市表现持续带来压力,信用风险事件的首度出现,央行逐步收紧流动性重回中性偏紧的方向,使得市场风险偏好下降,银行、地产等低估值的周期性板块在优先股、区域经济建设、地产再融资开闸等利好政策下大幅上涨,而成长股在前期获利盘累积、4月初第二批IPO重启预期的情况下,整体大幅回调。就中信证券一级行业指数表现来看,一季度计算机、餐饮旅游、轻工制造和电力设备等行业涨幅领先,煤炭、非银金融、农林牧渔和国防军工等行业表现较弱。

本基金在一季度维持了中性偏高的股票资产配置比例,结构上增持了新能源汽车、医疗服务、互联网的垂直网站和互联网金融、京津冀的行业配置比例,全面减持了传统传媒、电子等传统成长行业个股的配置。

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5.23%,同期基金业绩比较基准收益率为-5.35%,基金净值跑赢业绩比较基准10.58个百分点。截止报告期末,本基金仍处于建仓期中。

4.6 市场展望和投资策略

展望二季度,经济预计依然将延续一季度的惯性,而最近政府释放出的稳增长信号有望缓解市场对经济失速的担忧。在此背景下,A股市场预计将宽幅震荡,结构化特征依然明显。随着年报和一季报的陆续公布,新兴成长股票的业绩分化也相当明显,部分公司业绩不达预期将令其股价面临压力。但考虑到新兴成长代表着中国经济转型的未来,因此在二季度仍将是市场博弈的核心资产。同时部分积极寻求转型的传统产业公司凭借其主业稳定增长和低估值也将获得市场的青睐。

基于上述判断,本基金认为未来市场是一个偏平衡波动的市场,市场依然存在结构性的机会。因此未来仍然会保持中性偏高仓位,积极寻找各类投资机会。本基金认为市场主要的投资机会可能存在于经济保底受益的京津冀相关产业链,以及改革受益的医疗服务,行业需求向上的新能源汽车等。在未来将继续加强精力,自下而上的寻找优质成长股。

§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	303,967,063.34	80.90
	其中:股票	303,967,063.34	80.90
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	55,240,936.59	14.70
7	其他资产	16,532,404.07	4.40
8	合计	375,740,404.00	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	181,404,712.44	48.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,348,957.84	1.97
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	72,641,154.47	19.50
J	金融业	3,068,605.68	0.82
K	房地产业	22,448,441.68	6.03
L	租赁和商务服务业	17,055,191.23	4.58
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	303,967,063.34	81.59

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	002223	鱼跃医疗	741,225	22,718,546.25	6.10
2	300212	易华录	415,929	19,548,663.00	5.25
3	002390	信邦制药	374,232	18,000,559.20	4.83
4	600884	杉杉股份	1,030,350	16,506,207.00	4.43
5	002460	赣锋锂业	473,988	15,641,604.00	4.20
6	601992	金隅股份	2,185,758	14,141,854.26	3.80
7	600340	华夏幸福	471,127	13,116,175.68	3.52
8	600887	伊利股份	332,255	11,904,696.65	3.20
9	300037	新宙邦	346,658	11,665,041.70	3.13
10	000700	模塑科技	1,022,291	11,265,646.82	3.02

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的信邦制药(002390)于2013年5月20日公告称,公司因未能及时披露"根据国家药监局新药审评技术要求和新出台的政策,通过贵州省药监局向国家药品审评中心请求撤回人参皂苷-Rd注射液的新药生产注册申请"的相关信息,违反了上海证券交易所《股票上市规则(2012年修订)》的相关条款,经上海证券交易所纪律处分委员会审议通过,上海证券交易所对公司及公司董事长兼总经理张观福、董事会秘书孔令忠给予通报批评的处分,并记入上市公司诚信档案,向社会公布。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人认为随着公司对医疗服务产业的布局逐步完善,未来将成功转型为贵州综合性的医疗服务集团,具备良好的成长潜力,发展前景向好。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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	260,700.73
2	应收证券清算款	7,816,699.33
3	应收股利	-
4	应收利息	12,820.38
5	应收申购款	8,442,183.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,532,404.07

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	002223	鱼跃医疗	22,718,546.25	6.10	筹划重大事项
2	002460	赣锋锂业	15,641,604.00	4.20	筹划发行股份购买资产

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	391,579,959.20
报告期期间基金总申购份额	320,062,072.46
减:报告期期间基金总赎回份额	362,137,206.36
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	349,504,825.30

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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26只公募基金。截至2014年3月31日,海富通管理的公募基金资产规模近228亿元人民币。

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2014年3月31日,海富通为80多家企业近300亿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2014年3月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模近55亿元。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2014年3月31日,投资咨询及海外业务规模超过212亿元人民币。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内需热点股票型证券投资基金的文件
(二)海富通内需热点股票型证券投资基金基金合同
(三)海富通内需热点股票型证券投资基金招募说明书
(四)海富通内需热点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)报告期内海富通内需热点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
二〇一四年四月二十二日

海富通双利分级债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通双利分级债券	
基金主代码	519055	
基金运作方式	契约型,以 运作周年滚动"的方式运作	
基金合同生效日	2013年12月4日	
报告期末基金份额总额	1,025,386,372.71份	
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资组合策略、信用类债券投资策略、中小企业私募债投资策略、杠杆策略、可转换债券投资策略、新股申购策略。	
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,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,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	海富通双利分级债券A	海富通双利分级债券B
下属两级基金的交易代码	519052	519053
报告期末下属两级基金的份额总额	717,474,010.21份	307,912,362.50份
下属两级基金的风险收益特征	双利 A将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	双利B则表现出较高风险、收益相对较高的特征。

§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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	16,607,911.95
2.本期利润	20,259,572.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0198
4.期末基金资产净值	1,047,346,833.19
5.期末基金份额净值	1.021

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。

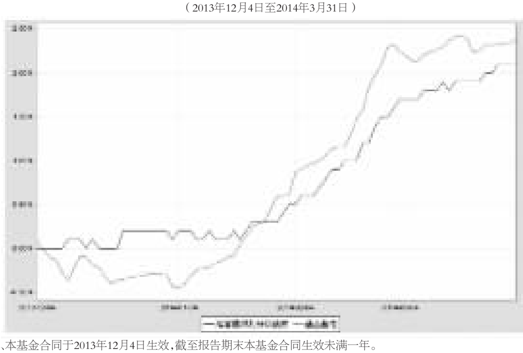
3.2 基金净值表现

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	1.90%	0.07%	2.66%	0.08%	-0.76%	-0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

海富通双利分级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
(2013年12月4日至2014年3月31日)



注:1、本基金合同于2013年12月4日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,自2013年12月4日合同生效日起至2014年3月31日,本基金运作时间未满6个月,仍处于建仓期中。

3.3 其他指标

其他指标	报告期末 2014年3月31日
双利A与双利B基金份额配比	2.33012408:1
期末双利A份额参考净值	1.016
期末双利A份额累计参考净值	1.016
期末双利B份额参考净值	1.035
期末双利B份额累计参考净值	1.035
双利A的预计年收益率	4.80%

§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		
赵恒毅	本基金的基金经理;海富通养老收益混合基金经理	2013-12-30	-	8年	金融学硕士, 持有基金从业人员资格证书。2005年7月至2008年3月任通用技术集团投资管理有限公司研究员,2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司研究员,2011年5月至2013年7月任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理,2012年5月至2013年7月任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理,2012年6月至2013年7月任富国可转换债券证券投资基金基金经理,2013年11月加入海富通基金管理有限公司。2013年12月起任海富通养老收益混合和海富通双利分级债券基金经理。
位健	本基金的基金经理,海富通货币基金经理,海富通养老收益混合基金经理,海富通一年定开债券基金经理	2013-12-4	2014-3-7	8年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2005年3月至2010年5月任银河基金基金经理,2006年3月至2008年4月担任银河银富货币市场基金基金经理助理,2008年4月至2010年5月担任银河银富货币市场基金基金经理。2010年6月至2012年9月任英大证券投资副总监。2012年9月至2012年11月任浙金信托投资总监。2012年12月加入海富通基金管理有限公司。2013年1月至2014年3月任海富通货币基金经理,2013年5月至2014年3月任海富通养老收益混合基金经理,2013年10月至2014年3月任海富通一年定开债券基金经理,2013年12月至2014年3月任海富通双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 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

一季度债券市场出现了一波超预期的行情,主要源于市场对央行货币政策预期的修正以及市场资金面的超预期宽松。利率债和中票在1月份已经开始上涨,而春节后一周内城投债便开始快速上涨,大有后来居上的气势。从整个一季度来看,城投债的行情比利率债和中票更具有持续性。2月下旬以来,人民币汇率出现了一波贬值行情,外汇占款投放流动性的作用下降,各类债券品种的收益率也基本处于区间波动状态。一季度出现了债券市场的第一个违约事件,投资者的配置被动向中高资质国有产业债和城投债集中。对于转债而言,由于受到经济增长数据下滑的影响,市场预期趋向悲观,大盘持续回落,除个别转债以外的大部分转债较难获得正收益。

一季度,本基金正处于建仓阶段,主要配置品种是短久期中等评级信用债和高利率同业存款。本基金适度参与了一季度债市的行情,但由于产品特征的原因对组合久期控制较严格。春节后债市收益率全面下行后,基金管理人主要进行了结构优化操作,减持了部分久期稍长和信用基本面发生变化的品种。对于利率债和转债,本基金极少参与。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为1.90%,同期业绩比较基准收益率为2.66%。截止报告期末,本基金仍处于建仓期中。

4.6 市场展望和投资策略

展望二季度,尽管央行希望市场流动性保持平稳,但是由于大行分红、企业年度缴税等季节性因素,加上人民币单边升值预期被打破后外汇占款规模有所下降,未来资金面趋于中性偏紧的概率在增大。同时,预计二季度利率债和信用债的发行规模仍将保持高位,但是各机构的配债需求被其他产品分流,供求关系并不乐观。因此,二季度债券市场出现趋势性行情的概率较小。信用风险将是未来一段时间市场的关注重点,机构配置需求仍会向中高等级国企债和中短久期上集中,收益率曲线会呈现较为陡峭的形态。

二季度,本基金优先端将迎来第一个开放期,做好开放期的流动性管理是基金管理人的首要工作。为此,基金管理人会在开放期之前提前进行组合调整,从评级分布、组合久期、杠杆比例、债券品种等多方面综合考虑。本基金力争在净值波动较小的前提下为持有人创造较高的绝对收益回报。因此,未来对于利率债和转债仍会较少参与。

§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	1,049,402,414.60	70.90
	其中:债券	1,049,402,414.60	70.90
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	396,949,824.21	26.82
7	其他资产	33,739,302.27	2.28
8	合计	1,480,091,541.08	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	960,051,414.60	91.67
5	企业短期融资券	9,999,000.00	0.95
6	中期票据	79,352,000.00	7.58
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,049,402,414.60	100.20

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	122904	10长城投	500,000	49,750,000.00	4.75
2	122911	10鞍城投	480,000	47,688,000.00	4.55
3	122028	09华发债	450,000	45,283,500.00	4.32
4	1182347	11新天山MTN1	400,000	39,636,000.00	3.78
5	122848	10桂林债	349,900	34,990,000.00	3.34

5.6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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	143,517.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,595,784.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,739,302.27

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

本基金本报告期末未持有股票。

§6 基金份额变动

单位:份

	海富通双利分级债券A	海富通双利分级债券B
报告期期初基金份额总额	717,474,010.21	307,912,362.50
报告期期间总申购份额	-	-
减:报告期期间总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	717,474,010.21	307,912,362.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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26只公募基金。截至2014年3月31日,海富通管理的公募基金资产规模近228亿元人民币。

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2014年3月31日,海富通为80多家企业近300亿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2014年3月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模近55亿元。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2014年3月31日,投资咨询及海外业务规模超过212亿元人民币。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双利分级债券型证券投资基金的文件
(二)海富通双利分级债券型证券投资基金基金合同
(三)海富通双利分级债券型证券投资基金招募说明书
(四)海富通双利分级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)报告期内海富通双利分级债券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
二〇一四年四月二十二日

海富通稳健添利债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4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2014年1月1日起至3月31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	69,949,897.72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	6,854,181.71份	63,095,716.01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(2014年1月1日-2014年3月31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	-1,430,550.13	-2,964,459.49
2.本期利润	-1,301,937.79	-614,186.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0498	-0.0093
4.期末基金资产净值	7,466,860.10	67,910,162.22
5.期末基金份额净值	1.089	1.076

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	-0.64%	0.24%	2.66%	0.08%	-3.30%	0.16%

2、海富通稳健添利债券C:

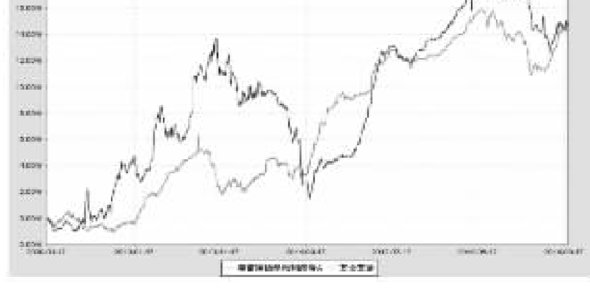
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.74%	0.25%	2.66%	0.08%	-3.40%	0.17%

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

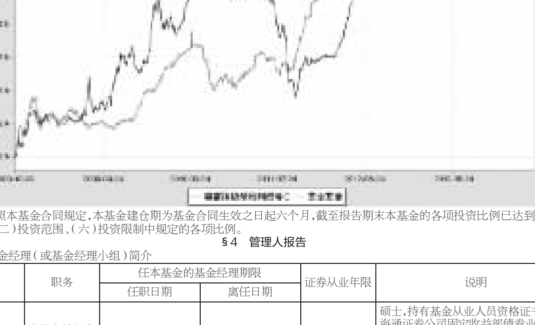
1. 海富通稳健添利债券A

(2009年3月18日至2014年3月31日)



2. 海富通稳健添利债券C

(2008年10月24日至2014年3月31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经理;海富通稳固收益债券基金经理;海富通稳进增利分级债券基金经理;投资副总监	2008-10-24	-	17年	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

2014年第一季度债券环境市场出现早于预期的回暖。经济增长和物价指标出现双双下降,中央银行保持了货币市场利率的宽松,银行间7天回购利率跌破3%,隔夜回购利率则最低下探到2%以下,点燃了市场的投资情绪。短期债券受影响最大,一年期以内品种的收益率下降幅度超过100个BP。中长期品种仍然受到预期不明朗的影响,收益率下降幅度小一些,在20到50BP左右。报告期内债券发行也非常活跃,但是由于超日债违约的影响,民营公司发债遇到极大困难,低等级品种的收益率迅速上升,信用利差扩大。一季度的股票市场整体表现较差,也影响到了可转债市场。从品种上看,以前较为沉闷的大盘转债在国有企业改革的刺激下,活跃度上升,差价机会增加。2014年第一季度管理人保持中等仓位,提高资产的流动性,同时增加可转债投资,进行波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳健添利债券C类基金净值增长率为-0.74%,同期业绩比较基准收益率为2.66%;海富通稳健添利债券A类基金净值增长率为-0.64%,同期业绩比较基准收益率为2.66%。

4.6 市场展望和投资策略

基金管理人认为,2014 年第二季度市场仍然面对一定的扩容压力,但另一方面货币政策也会保持相对宽松,债券市场的机会将是阶段性的。目前债券市场发行主体的融资需求相当数量仍然是延续到期债务,短期内难以压缩,对债券市场发行有刚性需求。债券购买端则受到多方面的影响,虽然2014年大概率不会出现类似2013年资金极度紧张的局面,但短期的资金价格波动仍然会对市场有一定冲击。可转债的机会在增加,但系统性机会的时机还不成熟。基金将保持中性仓位,精选个券,对上涨潜力大的可转债和高收益高资质的品种重点投资,对流动性低的品种有计划地置换,提高资产的流动性和收益性,力争为基金带来稳定的可持续的正收益。

§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	71,992,412.30	93.04
	其中:债券	71,992,412.30	93.04
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	2,865,812.18	3.70
7	其他资产	2,516,206.68	3.25
8	合计	77,374,431.16	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	9,989,000.00	13.25
	其中:政策性金融债	9,989,000.00	13.25
4	企业债券	43,227,727.30	57.35
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	18,775,685.00	24.91
8	其他	-	-
9	合计	71,992,412.30	95.51

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	110247	11国开47	100,000	9,989,000.00	13.25
2	1280185	12普洱国资债	100,000	9,895,000.00	13.13
3	122148	11吉高速	88,970	8,541,120.00	11.33
4	126016	08宝钢债	70,000	6,939,100.00	9.21
5	110024	隧道转债	60,000	6,204,600.00	8.23

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的石化转债(110015)于2014年1月13日公告,国务院对山东省青岛市"11.22"中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,认定是一起特别重大责任事故;公司及中国石化相关董事、监事、高级管理人员服从国务院事故调查组对本次事故责任的认定,并接受对相关责任人员的处理决定。

对该债券的投资决策程序的说明:该转债发行人是中国最大的石油产品和主要石化产品生产商和供应商,主体和债项均为AAA评级,整体偿债能力很强,违约风险较低。目前石化转债的混合所有制改革预期将继续发酵,绝对价格不高,具备一定债性,同时向上弹性较大,是波段操作的重点大盘转债品种。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该债券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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,574.12
2	应收证券清算款	1,000,334.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,477,298.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,516,206.68

5.11.4 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	110024	隧道转债	6,204,600.00	8.23
2	110015	石化转债	5,118,500.00	6.79
3	110018	国电转债	3,099,000.00	4.11
4	128003	华天转债	1,167,360.00	1.55
5	110012	海运转债	102,270.00	0.14

5.11.5 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
报告期期初基金份额总额	66,476,869.47	69,117,244.07
报告期基金总申购份额	7,831.56	86,390.23
减:报告期基金总赎回份额	59,630,519.32	6,107,918.29
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	6,854,181.71	63,095,716.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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26只公募基金。截至2014年3月31日,海富通管理的公募基金资产规模近228亿元人民币。

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2014年3月31日,海富通为80多家企业近300亿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2014年3月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模近55亿元。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2014年3月31日,投资咨询及海外业务规模超过212亿元人民币。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

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
二〇一四年四月二十二日