海富通货币市场证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年 6 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:二〇一四年七月十九日

§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 7 月 18 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 4 月 1 日起至 6 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	4,468,524,639.26 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	697,754,241.09 份	3,770,770,398.17 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 4 月 1 日-2014 年 6 月 30 日)	
	海富通货币 A	海富通货币 B
1.本期已实现收益	8,237,513.18	46,507,573.72
2.本期利润	8,237,513.18	46,507,573.72
3.期末基金资产净值	697,754,241.09	3,770,770,398.17

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
过去三个月	1.1647%	0.0031%	0.7397%	0.0000%	0.4250%	0.0031%

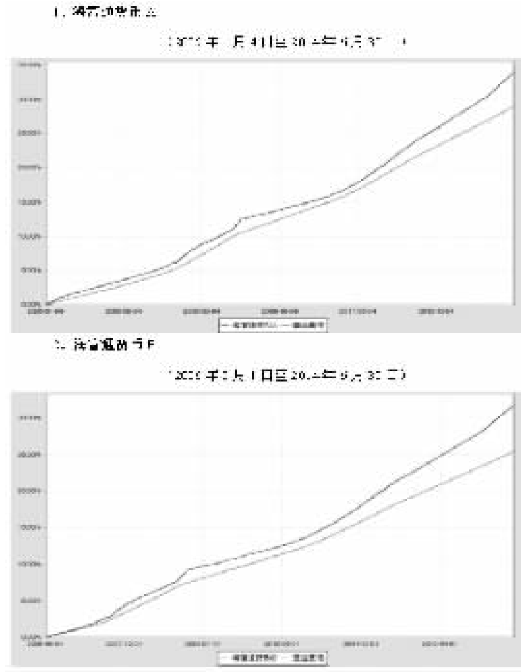
2. 海富通货币 B:

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
过去三个月	1.2251%	0.0031%	0.7397%	0.0000%	0.4854%	0.0031%

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



注: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。

§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		
陈轶平	本基金的基金经理	2013-8-29	-	5年	博士,持有基金从业人员资格证书,2009 年 1 月至 2009 年 8 月任 Mariner Investment Group LLC 分析师,2009 年 10 月至 2011 年 9 月任瑞银企业管理(上海)有限公司副董事,2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司,任债券投资经理,2013 年 8 月起任海富通货币基金经理。

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、勤勉尽责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

进入二季度末,经济企稳的信号逐渐增多:中采和汇丰制造业 PMI 已经连续 1 个季度改善,且中采 PMI 环比强于历史同期环比均值,而 5 月汇丰 PMI 也重新回到枯荣线以上,录得 50.8。但从分项来看,中采 PMI 主要分项仍全面弱于历史均值。5 月当月工业增加值为 8.8%,也暂时企稳。

中国央行控制力更强,流动性偏松基调不变。全球流动性宽松局面形成,但新兴市场不确定性加大。再加上人民币汇率双向波动预期的形成,外汇占款维持在千亿元左右甚至以下的低位可能成为常态,中国央行对流动性掌控力提升。随着定向降准、PSL 等工具的持续运用,国内流动性稳中偏松基调不变。

二季度市场前半段资金面维持较为宽裕的状态,可能会有较大规模的申购与赎回,组合结合负债端管理,对新增申购款进行资产期限匹配,维持着较高流动性。步入 6 月,基金规模逐步增大,随着季末效应带来资金利率的上行,开展了协议存款、利率债等多元资产的配置,在维持流动性、安全性的背景下,以争取获得更高收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,A 级基金净值收益率为 1.1647%,同期业绩比较基准收益率为 0.7397%;B 级基金净值收益率为 1.2251 %,同期业绩比较基准收益率为 0.7397%。

4.6 市场展望和投资策略

全球流动性宽松局面形成,但新兴市场不确定性加大。再加上人民币汇率双向波动预期的形成,外汇占款维持在千亿元左右甚至以下的低位可能成为常态,中国央行对流动性掌控力提升。随着定向降准、PSL 等工具的持续运用,国内流动性稳中偏松基调不变。我们预计三季度的 R007 中枢位于 3.5%以内,某些紧张时点可能出现短暂上冲,但是不会改变市场对于流动性偏松的预期。对于三季度而言,我们认为短端牛市格局比较明朗,首先基于经济基本面疲弱,反弹力度有限,利好整体债市,其次、通胀低位运行,近期无忧;第三是流动性宽松,央行定向宽松三季度可持续,预计 R007 价格中枢在 3%-3.5%,基于以上短融收益率能够进一步下行,但下行空间小于上半年。

有鉴于此,本基金将努力维持结构的稳定性,保持好组合流动性和收益性之间的平衡,在保证安全性的前提下,力争为持有人创造更好的投资收益。

§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	固定收益投资	2,151,366,645.55	40.47
	其中:债券	2,151,366,645.55	40.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	2,745,181,514.77	51.64
4	其他资产	419,653,228.63	7.89
5	合计	5,316,201,388.95	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	8.41	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	835,198,462.40	18.69
	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	123
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	133
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	110

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

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	17.59	18.69
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60 天	12.51	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.77	-
3	60天(含)—90 天	29.98	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.10	-
4	90天(含)—180 天	23.72	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.10	-
5	180天(含)—397 天(含)	25.77	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.58	18.69

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	338,610,626.86	7.58
	其中:政策性金融债	338,610,626.86	7.58
4	企业债券	158,251,664.52	3.54
5	企业短期融资券	1,503,293,212.54	33.64
6	中期票据	151,211,141.63	3.38
7	其他	-	-
8	合计	2,151,366,645.55	48.14
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	266,664,124.78	5.97

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	0982169	09宁国资 MTN1	1,000,000	101,184,299.50	2.26
2	140204	14国开 04	1,000,000	100,179,080.67	2.24
3	041373004	13甬城投 CP001	1,000,000	100,000,004.33	2.24
4	041452014	14日照港 CP001	900,000	90,000,110.20	2.01
5	041361054	13悦达 CP002	800,000	80,397,354.82	1.80
6	041455011	14苏交通 CP003	800,000	80,038,531.80	1.79
7	058031	05中信债 1	800,000	79,353,275.58	1.78
8	068007	06首都机场债	800,000	78,898,388.94	1.77
9	140212	14国开 12	700,000	70,039,382.40	1.57
10	011470005	14赣高速 SCP005	700,000	70,024,050.66	1.57

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	0.2348%
报告期内偏离度的最低值	0.1153%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1961%

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末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	71,146,898.22
4	应收申购款	348,506,330.41
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	419,653,228.63

§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
报告期期初基金份额总额	739,735,898.46	2,650,328,610.39
报告期期间基金总申购份额	861,359,098.61	5,119,688,925.46
减:报告期期间基金总赎回份额	903,340,755.98	3,999,247,137.68
报告期期末基金份额总额	697,754,241.09	3,770,770,398.17

§7 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 28 只公募基金。截至 2014 年 6 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模为 237 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 6 月 30 日,海富通为 80 多家企业超过 311 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 6 月 30 日,海富通旗下专户理财管理资产规模近 54 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 6 月 30 日,投资咨询及海外业务规模超过 215 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

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
二〇一四年七月十九日

海富通精选贰号混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年 6 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:二〇一四年七月十九日

§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 7 月 18 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 4 月 1 日起至 6 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	1,618,262,123.92 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(2014 年 4 月 1 日-2014 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-26,381,104.23
2.本期利润	39,751,139.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0240
4.期末基金资产净值	1,056,414,526.06
5.期末基金份额净值	0.653

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。

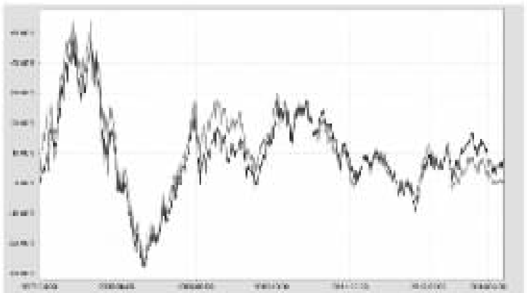
3.2 基金净值表现

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	3.82%	0.72%	0.82%	0.57%	3.00%	0.15%

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 2014 年 6 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 20%-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		
丁俊	本基金的基金经理;海富通精选混合基金经理;海富通收益增长混合基金经理;海富通股票基金经理;投资副总监	2014-1-17	-	12年	硕士。持有基金从业人员资格证书。2002 年 7 月至 2006 年 4 月就职于平安资产管理公司,曾任权益投资部研究主管,2006 年 4 月加入海富通基金管理有限公司,任海富通精选混合和海富通风格优势股票基金经理助理,2007 年 8 月至 2012 年 1 月任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2012 年 1 月至 2014 年 3 月任海富通基金管理有限公司研究总监。2014 年 1 月起任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2014 年 3 月起任投资副总监。2014 年 4 月起兼任海富通收益增长混合和海富通股票基金经理。

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

2014 年二季度,上证综指在宏观经济持续疲弱、政府频出微刺激政策、IPO 再度开闸下维持窄幅震荡,略有上涨;创业板则走出 V 字反弹行情。4 月,在经济下行压力加大的情况下,政府连续出台了铁路建设、棚户区改造、小微企业减税、"定向降准"等一系列微调政策,这些政策的出台均以经济托底为主线,对股票市场的刺激作用相对有限。5 月,市场在经济疲弱、IPO 临近和新国九条、地产限购政策松动、再贷款等利好政策的交互影响下艰难前行。月底超预期反弹的汇丰 PMI 数据等积极因素给市场带来一些上涨动力,尤其是中小板和创业板在前期调整后,5 月底出现较大幅度的反弹。6 月,在稳增长政策作用下,经济企稳预期增强,IPO 的再度开闸短期内对资金面影响较大,不过由于本次新股中签率较低,机构参与热情逐渐下降,月末 IPO 对市场资金的分流效果已经不再显著,加上央行在季末连续进行公开市场净投放,资金面在临近季末时点也维持着相对宽松的状态,月末各指数均有所上涨。就中信证券一级行业指数表现来看,二季度国防军工、计算机、通信和传媒等行业涨幅领先,交通运输、商贸零售、食品饮料和纺织服装等行业表现较弱。

二季度本基金随着创业板指数的下跌,进行了部分资产调整,减持了部分稳定增长的防御类资产,逢低增持了部分高弹性的成长股,在之后的创业板反弹中获取了一定收益。临近季末,创业板反弹已累积一定幅度,且即将中报来临,部分股价已大幅反弹的成长股又将面临业绩压力,基于此本基金对该类资产进行了减持,同时将股票配置比例降到较低水平。

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 3.82%,同期基金业绩比较基准收益率为 0.82%,基金净值跑赢业绩比较基准 3 个百分点。

4.6 市场展望和投资策略

展望三季度,鉴于 2013 年三季度高基数的影响,经济增速依然存在压力,预计政府将进一步加大微刺激力度。基于此,市场将随着经济数据和政策变化而继续宽幅波动。鉴于周期类资产业绩难以出现趋势性拐点,以创业板为代表的成长类资产取代周期类资产成为市场情绪的风向标。随着中报临近,成长类资产又将面临新一轮业绩和估值压力。但符合经济升级趋势、政策扶持方向等相关资产,其股价有望随着业绩的逐步释放而震荡上行。

本基金将继续以股票配置比例变动来应对系统性风险变化。资产选择上,政策受益型资产如地产等和代表未来经济发展方向的成长类资产后续值得重点跟踪。

§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	554,959,569.80	52.35
	其中:股票	554,959,569.80	52.35
2	固定收益投资	218,977,054.00	20.66
	其中:债券	218,977,054.00	20.66
	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	282,475,466.32	26.65
7	其他资产	3,714,060.39	0.35
8	合计	1,060,126,150.51	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	16,381,324.59	1.55
B	采矿业	-	-
C	制造业	379,648,391.81	35.94
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	8,715,765.28	0.83
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	110,727,746.30	10.48
J	金融业	11,235,000.00	1.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,435,369.22	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,240,921.25	1.06
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	5,575,051.35	0.53
S	综合	-	-
	合计	554,959,569.80	52.53

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	000625	长安汽车	4,314,817	53,115,397.27	5.03
2	002415	海康威视	1,892,077	32,051,784.38	3.03
3	002065	东华软件	1,556,584	31,318,470.08	2.96
4	000541	佛山照明	2,068,700	20,604,252.00	1.95
5	600703	三安光电	832,752	19,511,379.36	1.85
6	600352	浙江龙盛	1,103,072	17,814,612.80	1.69
7	600201	金宇集团	549,535	17,101,529.20	1.62
8	000400	许继电气	837,608	16,794,040.40	1.59
9	300212	易华录	487,569	15,270,661.08	1.45
10	002714	牧原股份	299,897	13,210,462.85	1.25

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	80,538,000.00	7.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	138,438,000.00	13.10
	其中:政策性金融债	138,438,000.00	13.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,054.00	0.00
8	其他	-	-
9	合计	218,977,054.00	20.73

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	110217	11国开 17	1,000,000	98,430,000.00	9.32
2	010107	21国债(7)	600,000	60,480,000.00	5.73
3	130236	13国开 36	400,000	40,008,000.00	3.79
4	130017	13附息国债 17	200,000	20,058,000.00	1.90
5	113002	工行转债	10	1,054.00	0.00

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。

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。

5.11.2 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	388,222.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,323,968.53
5	应收申购款	1,869.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,714,060.39

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	113002	工行转债	1,054.00	0.00

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

报告期期初基金份额总额	1,685,521,785.80
报告期期间基金总申购份额	591,558.24
减:报告期期间基金总赎回份额	67,851,220.12
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,618,262,123.92

§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 28 只公募基金。截至 2014 年 6 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模为 237 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 6 月 30 日,海富通为 80 多家企业超过 311 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 6 月 30 日,海富通旗下专户理财管理资产规模近 54 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 6 月 30 日,投资咨询及海外业务规模超过 215 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基金合同
(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
二〇一四年七月十九日

海富通精选证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年 6 月 30 日

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月十九日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 7 月 18 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通精选混合
基金主代码	519011
交易代码	519011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年 8 月 22 日
报告期末基金份额总额	7,813,992,596.76 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程度适中的品种。本基金力争通过适度主动的资产配置和积极主动的精选证券,识别和控制风险,实现风险限度内的超额回报。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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 4 月 1 日-2014 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-93,835,452.56
2.本期利润	146,525,548.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0181
4.期末基金资产净值	3,730,552,038.78
5.期末基金份额净值	0.4774

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。

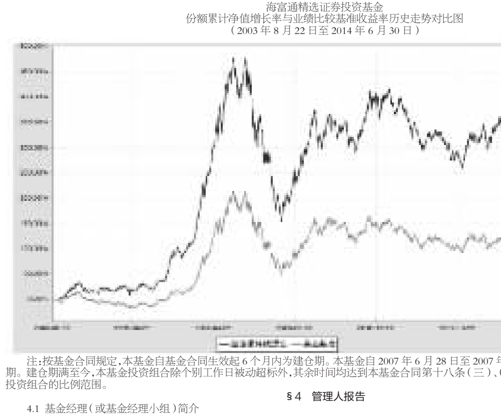
3.2 基金净值表现

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	3.96%	0.73%	0.82%	0.57%	3.14%	0.16%

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
(2003 年 8 月 22 日至 2014 年 6 月 30 日)



注: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。本基金自 2007 年 6 月 28 日至 2007 年 9 月 29 日,为持续营销后建仓期。建仓期满至今,本基金投资组合除个别工作日被动超标外,其余时间均达到本基金合同第十八条(三)、(六)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		
陈洪	本基金的基金经理;副总经理	2003-8-22	2014-6-4	21年	中国国籍,硕士,持有基金从业人员资格证书。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003 年 4 月至 2014 年 6 月任海富通精选混合基金经理,2003 年 4 月至 2012 年 9 月任海富通基金管理有限公司投资总监,2005 年 7 月至 2006 年 9 月任海富通股票基金经理,2006 年 3 月至 9 月任海富通收益增长混合基金经理,2006 年 5 月至 2014 年 6 月任海富通基金管理有限公司副总经理,2007 年 2 月至 2007 年 8 月任海富通风格优势股票基金经理,2007 年 4 月至 2007 年 8 月任海富通精选贰号混合基金经理,2008 年 6 月至 2011 年 2 月任海富通中国海外股票(QDII)基金经理。
丁俊	本基金的基金经理;海富通精选贰号混合基金经理;海富通收益增长混合基金经理;海富通股票基金经理;投资副总监	2014-1-17	-	12年	硕士。持有基金从业人员资格证书。2002 年 7 月至 2006 年 4 月就职于平安资产管理公司,曾任权益投资部研究主管,2006 年 4 月加入海富通基金管理有限公司,任海富通精选混合和海富通风格优势股票基金经理助理,2007 年 8 月至 2012 年 1 月任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2012 年 1 月至 2014 年 3 月任海富通基金管理有限公司研究总监。2014 年 1 月起任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2014 年 3 月起任投资副总监。2014 年 4 月起兼任海富通收益增长混合和海富通股票基金经理。

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

2014 年二季度,上证综指在宏观经济持续疲弱、政府频出微刺激政策、IPO 再度开闸下维持窄幅震荡,略有上涨;创业板则走出 V 字反弹行情。4 月,在经济下行压力加大的情况下,政府连续出台了铁路建设、棚户区改造、小微企业减税、"定向降准"等一系列微调政策,这些政策的出台均以经济托底为主线,对股票市场的刺激作用相对有限。5 月,市场在经济疲弱、IPO 临近和新国九条、地产限购政策松动、再贷款等利好政策的交互影响下艰难前行。月底超预期反弹的汇丰 PMI 数据等积极因素给市场带来一些上涨动力,尤其是中小板和创业板在前期调整后,5 月底出现较大幅度的反弹。6 月,在稳增长政策作用下,经济企稳预期增强,IPO 的再度开闸短期内对资金面影响较大,不过由于本次新股中签率较低,机构参与热情逐渐下降,月末 IPO 对市场资金的分流效果已经不再显著,加上央行在季末连续进行公开市场净投放,资金面在临近季末时点也维持着相对宽松的状态,月末各指数均有所上涨。就中信证券一级行业指数表现来看,二季度国防军工、计算机、通信和传媒等行业涨幅领先,交通运输、商贸零售、食品饮料和纺织服装等行业表现较弱。

二季度本基金随着创业板指数的下跌,进行了部分资产调整,减持了部分稳定增长的防御类资产,逢低增持了部分高弹性的成长股,在之后的创业板反弹中获取了一定收益。临近季末,创业板反弹已累积一定幅度,且即将中报来临,部分股价已大幅反弹的成长股又将面临业绩压力,基于此本基金对该类资产进行了减持,同时将股票配置比例降到较低水平。

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 3.96%,同期基金业绩比较基准收益率为 0.82%,基金净值跑赢业绩比较基准 3.14 个百分点。

4.6 市场展望和投资策略

展望三季度,鉴于 2013 年三季度高基数的影响,经济增速依然存在压力,预计政府将进一步加大微刺激力度。基于此,市场将随着经济数据和政策变化而继续宽幅波动。鉴于周期类资产业绩难以出现趋势性拐点,以创业板为代表的成长类资产取代周期类资产成为市场情绪的风向标。随着中报临近,成长类资产又将面临新一轮业绩和估值压力。但符合经济升级趋势、政策扶持方向等相关资产,其股价有望随着业绩的逐步释放而震荡上行。

本基金将继续以股票配置比例变动来应对系统性风险变化。资产选择上,政策受益型资产如地产等和代表未来经济发展方向的成长类资产后续值得重点跟踪。

§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	2,009,183,157.75	53.68
	其中:股票	2,009,183,157.75	53.68
2	固定收益投资	1,079,845,164.00	28.85
	其中:债券	1,079,845,164.00	28.85
	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	210,068,545.03	5.61
	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	422,594,838.17	11.29
7	其他资产	21,271,936.11	0.57
8	合计	3,742,963,641.06	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	58,051,227.04	1.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,372,819,895.37	36.80
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	31,587,877.56	0.85
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	400,492,710.74	10.74
J	金融业	44,940,000.00	1.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	40,111,051.74	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	41,565,683.25	1.11
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	19,614,712.05	0.53
S	综合	-	-
	合计	2,009,183,157.75	53.86

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	000625	长安汽车	15,919,405	195,967,875.55	5.25
2	002415	海康威视	6,994,312	118,483,645.28	3.18
3	002065	东华软件	5,457,488	109,804,658.56	2.94
4	000541	佛山照明	7,254,510	72,254,919.60	1.94
5	600703	三安光电	3,041,255	71,256,604.65	1.91
6	600352	浙江龙盛	4,083,239	65,944,309.85	1.77
7	600201	金宇集团	1,920,523	59,766,675.76	1.60
8	300212	易华录	1,808,248	56,634,327.36	1.52
9	002714	牧原股份	1,066,857	46,995,050.85	1.26
10	002475	立讯精密	1,392,641	45,650,771.98	1.22

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	1,011,564,000.00	27.12
	其中:政策性金融债	1,011,564,000.00	27.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	68,281,164.00	1.83
8	其他	-	-
9	合计	1,079,845,164.00	28.95

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	140327	14进出 27	3,500,000	350,910,000.00	9.41
2	130243	13国开 43	2,700,000	270,297,000.00	7.25
3	130236	13国开 36	1,100,000	110,022,000.00	2.95
4	140212	14国开 12	1,000,000	100,170,000.00	2.69
5	140436	14农发 36	1,000,000	100,160,000.00	2.68

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。

5.11.2 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	1,228,282.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,915,451.15
5	应收申购款	128,202.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,271,936.11

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	110023	民生转债	37,999,744.00	1.02
2	113002	工行转债	30,281,420.00	0.81

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

报告期期初基金份额总额	8,349,506,196.83
报告期期间基金总申购份额	91,253,167.91
减:报告期期间基金总赎回份额	626,766,767.98
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	7,813,992,596.76

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	30,195,269.25
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	30,195,269.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.39

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 28 只公募基金。截至 2014 年 6 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模为 237 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 6 月 30 日,海富通为 80 多家企业超过 311 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 6 月 30 日,海富通旗下专户理财管理资产规模近 54 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 6 月 30 日,投资咨询及海外业务规模超过 215 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精选证券投资基金的文件
(二)海富通精选证券投资基金基金合同
(三)海富通精选证券投资基金招募说明书
(四)海富通精选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
二〇一四年七月十九日