建信安心回报定期开放债券型

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19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7月17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	建信安心回报债券	
基金主代码	000105	
交易代码	000105	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月14日	
报告期末基金份额总额	468,945,322.88份	
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过积极主动的组合管理,力争获得高于业绩比较基准的投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。本基金在综合分析宏观经济、货币政策等因素的基础上,采用久期管理、期限管理、类属管理和风险管理相结合的投资策略。在个券选择上,本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率(税前)。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
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	建信安心回报债券A	建信安心回报债券C
下属两级基金的交易代码	000105	000106
报告期末下属两级基金的份额总额	250,490,885.66份	218,454,437.22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)	
	建信安心回报债券A	建信安心回报债券C
1.本期已实现收益	28,198,446.83	24,556,154.74
2.本期利润	21,565,861.01	18,090,838.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0154	0.0136
4.期末基金资产净值	261,764,816.01	226,856,397.64
5.期末基金份额净值	1.045	1.038

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)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损益。

2、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。

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

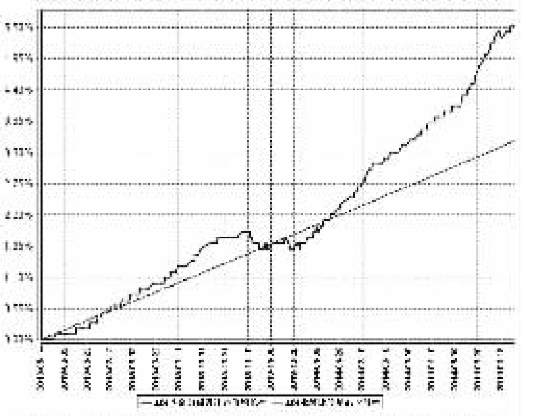
建信安心回报债券A

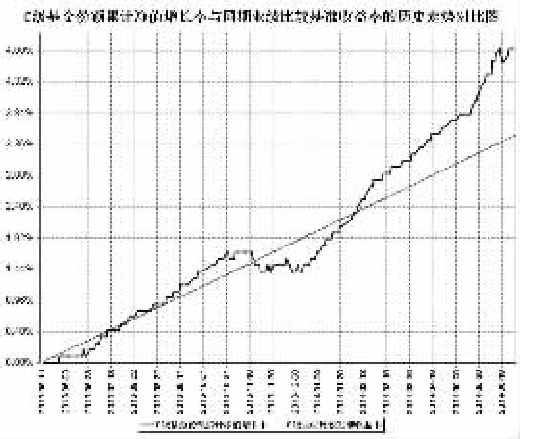
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.95%	0.05%	0.76%	0.01%	1.19%	0.04%

建信安心回报债券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	1.67%	0.05%	0.76%	0.01%	0.91%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





注:本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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		
朱建华	本基金的基金经理	2013年5月14日	-	6	硕士。曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长,2007年10月起任中诚信证券评估有限公司公司评级部总经理助理,2008年8月起任国泰基金管理公司高级研究员。朱建华于2011年6月加入本公司,历任高级债券研究员、货币市场基金的基金经理助理,2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年5月14日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,国内宏观形式严峻,主要经济数据增幅低于预期,保增长压力加大。为配合增长目标,央行的货币政策也从年初的中性开始转向偏宽松,定向降准、再贷款等一系列数量型政策的出台为银行间市场注入资金,资金面整体宽松,去年的"钱荒"未再现,加上127号文对同业非标的控制,债券市场做多热情较高,不仅短端收益率受资金面的影响出现下行,长端的吸引力明显增加,收益率也出现较大下行,信用息差出现缩窄。全市场呈现加杠杆与加久期的趋势。但目前银行整体资金成本仍明显高于历史平均水平,随着收益率的下行,利率债的短期风险也相应上升。

本季度,建信安心定期开放债券型基金打开申购赎回,为应付流动性冲击,总体上采用了偏稳健的投资风格。随着开放期的结束进入第二个运作周期,本基金再次增加了杠杆并适度增加久期,同时加配了交易所债券的配置。由于是一年期封闭产品,因此操作上相对没有太激进,预防未来的流动性风险一直摆在重要的位置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期安心回报A净值增长率1.95%,波动率0.05%,安心回报C净值增长率1.67%,波动率0.05%;业绩比较基准收益率0.76%,波动率0.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为国内经济仍面临较大压力,保增长的措施仍将持续,后续刺激政策的出台仍可期。货币政策方面,由于通胀还不到抬头之时,因此在目前的经济形式下央行的货币政策不会转向,仍将维持中性偏宽松的手段。但由于三季度面临财政存款上缴等诸多不利因素,除非央行公开市场明显大幅投放,否则资金面难言二季度的宽松,不排除资金面季度中出现波段性的紧张。信用风险方面,虽然风险事件的暴露市场上已经有相应预期,但风险事件的冲击仍有可能出现,对个券的甄别显得尤为重要。

建信安心定期开放债券型基金仍将保持稳健的投资风格,由于担心市场调整的风险,在追求绝对收益的同时采取短久期加杠杆的策略,以期获取稳健的收益。

§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	745,382,772.90	93.59
	其中:债券	745,382,772.90	93.59
	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	26,766,992.90	3.36
7	其他资产	24,281,444.55	3.05
8	合计	796,431,210.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

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

无。

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	321,991,772.90	65.90
5	企业短期融资券	423,391,000.00	86.65
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	745,382,772.90	152.55

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	041354051	13红狮CP001	800,000	80,624,000.00	16.50
2	041464033	14甘公投CP001	500,000	50,195,000.00	10.27
3	124161	13瑞水泥	500,000	48,800,000.00	9.99
4	041360063	13广汇集团CP002	400,000	40,420,000.00	8.27
5	041362039	13鲁宏桥CP002	400,000	40,360,000.00	8.26

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

无。

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

无。

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

无。

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 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	42,217.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,239,226.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,281,444.55

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信安心回报债券A	建信安心回报债券C
报告期期初基金份额总额	2,470,345,620.00	2,388,689,106.51
报告期期间基金总申购份额	43,592,289.26	33,399,609.68
减:报告期期间基金总赎回份额	2,263,447,023.60	2,203,634,278.97
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	250,490,885.66	218,454,437.22

注:上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信安心回报定期开放债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金托管协议》;
5、基金管理人业务资格批件和营业执照;
6、基金托管人业务资格批件和营业执照;
7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2014年7月19日

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)

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	海富通中证100指数(LOF)(场内简称:海富100)
基金主代码	162307
交易代码	162307
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月30日
报告期末基金份额总额	679,381,624.48份
投资目标	采用指数化投资方式,通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段,控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度,实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,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	中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
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	-12,986,644.78
2.本期利润	9,035,040.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0129
4.期末基金资产净值	431,363,403.40
5.期末基金份额净值	0.635

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。

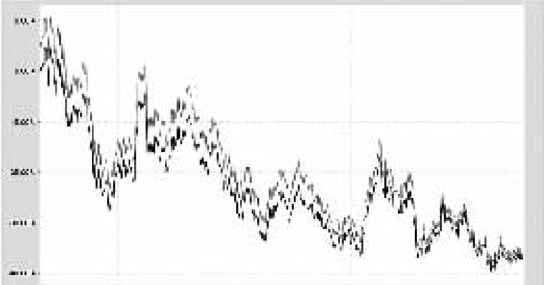
3.2 基金净值表现

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	1.93%	0.87%	0.75%	0.86%	1.18%	0.01%

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

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)
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10月30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,本基金投资组合均达到本基金合同第十五条(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		
刘璎	本基金的基金经理;海富通上证周期ETF基金经理;海富通上证周期ETF联接基金经理;海富通上证非周期ETF基金经理;海富通上证非周期ETF联接基金经理;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	2012-1-20	-	13年	管理学硕士,持有基金从业人员资格证书。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司,曾任华安上证180ETF基金经理助理;2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金经理,2008年4月至2010年6月担任华安中国A股增强指数基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司。2010年11月起任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理。2011年4月起任海富通上证非周期ETF及海富通上证非周期ETF联接基金经理。2012年1月起兼任海富通中证100指数(LOF)基金经理。2012年5月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。2013年10月起任指数投资部指数投资负责人。

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。

报告期间,本基金完成了年中的指数成份股调整。作为指数基金,在操作上我们严格遵守基金合同,应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。

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1.93%,同期业绩比较基准收益率为0.75%。年化跟踪误差为0.77%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0082%,在合同规定的目标控制范围之内。

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。

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	402,202,596.74	92.89
	其中:股票	402,202,596.74	92.89
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	30,665,802.28	7.08
7	其他资产	102,240.09	0.02
8	合计	432,970,639.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2 指数投资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	24,991,197.08	5.79
C	制造业	117,323,718.48	27.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,484,841.99	2.66
E	建筑业	13,800,232.33	3.20
F	批发和零售业	3,688,045.12	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	8,995,760.55	2.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,881,199.36	1.36
J	金融业	198,436,248.34	46.00
K	房地产业	15,485,638.21	3.59
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	2,115,715.28	0.49
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	402,202,596.74	93.24

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	623,655	24,534,587.70	5.69
2	600036	招商银行	2,227,523	22,809,835.52	5.29
3	600016	民生银行	3,565,914	22,144,325.94	5.13
4	600030	中信证券	1,842,084	21,110,282.64	4.89
5	601166	兴业银行	1,580,816	15,855,584.48	3.68
6	600000	浦发银行	1,469,125	13,295,581.25	3.08
7	000002	万科A	1,220,473	10,093,311.71	2.34
8	000651	格力电器	318,456	9,378,529.20	2.17
9	600519	贵州茅台	58,720	8,337,065.60	1.93
10	601288	农业银行	3,255,953	8,205,001.56	1.90

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

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中国平安(601318)于2013年10月15日发布《中国平安保险(集团)股份有限公司关于平安证券收到中国证监会行政处罚决定书的公告》,中国证券监督管理委员会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金系指数型基金,对该股票的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

报告期内本基金投资的农业银行(601288)于2013年10月22日披露称,中国农业银行股份有限公司作为债务融资工具主承销商,近期涉及未按规定开展后续管理工作、未合规履行持有人会议有关职责以及未按业务规程要求开展尽职调查等多项违反自律规则指引的情形。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予农业银行通报批评处分,并责令改正。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金系指数型基金,对该股票的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

其余八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	61,306.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,736.95
5	应收申购款	4,949.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.07
8	其他	-
9	合计	102,240.09

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 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	721,992,279.62
报告期期间基金总申购份额	1,504,126.10
减:报告期期间基金总赎回份额	44,114,781.24
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	679,381,624.48

§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中证100指数证券投资基金(LOF)的文件
(二)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)基金合同
(三)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)招募说明书
(四)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)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)报告期内海富通中证100指数证券投资基金(LOF)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

海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	海富通中证内地低碳指数
基金主代码	519034
交易代码	519034
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月25日
报告期末基金份额总额	61,000,336.86份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数。在正常市场情况下,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金将采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,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	中证内地低碳经济主题指数×95%+人民币税后活期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的投资品种,风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动投资的指数型基金,主要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。
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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-304,125.75
2.本期利润	-447,884.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0070
4.期末基金资产净值	68,430,054.35
5.期末基金份额净值	1.122

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。

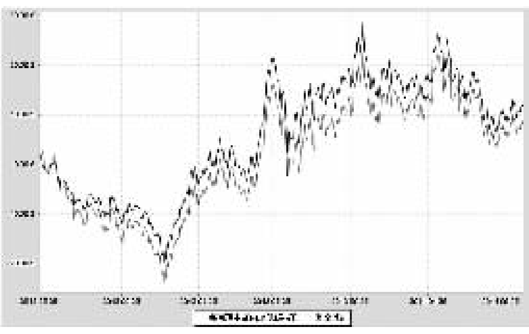
3.2 基金净值表现

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	-0.27%	1.01%	-0.26%	1.02%	-0.01%	-0.01%

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

海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金
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
(2012年5月25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。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		
刘璎	本基金的基金经理;海富通上证周期ETF基金经理;海富通上证周期ETF联接基金经理;海富通上证非周期ETF联接基金经理;海富通上证非周期ETF基金经理;海富通中证100指数(LOF)基金经理;指数投资部指数投资负责人	2012-5-25	-	13年	管理学硕士,持有基金从业人员资格证书。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司,曾任华安上证180ETF基金经理助理;2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金经理,2008年4月至2010年6月担任华安中国A股增强指数基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司。2010年11月起任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理。2011年4月起任海富通上证非周期ETF及海富通上证非周期ETF联接基金经理。2012年1月起兼任海富通中证100指数(LOF)基金经理。2012年5月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。2013年10月起任指数投资部指数投资负责人。

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。

报告期间,本基金完成了年中的指数成份股调整。作为指数基金,在操作上我们严格遵守基金合同,应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。

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-0.27%,同期业绩比较基准收益率为-0.26%。年化跟踪误差为1.09%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0101%,在合同规定的目标控制范围之内。

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。

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	63,953,642.73	92.35
	其中:股票	63,953,642.73	92.35
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	5,275,204.66	7.62
7	其他资产	25,253.64	0.04
8	合计	69,254,101.03	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资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	719,541.65	1.05
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	-	-
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	719,541.65	1.05

5.2.2 指数投资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	39,661,352.68	57.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,517,580.83	16.83
E	建筑业	589,190.35	0.86
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	4,469,758.98	6.53
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	6,996,218.24	10.22
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	63,234,101.08	92.41

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	600900	长江电力	802,644	4,992,445.68	7.30
2	600089	特变电工	569,939	4,838,782.11	7.07
3	002594	比亚迪	80,730	3,833,867.70	5.60
4	300070	碧水源	125,113	3,659,555.25	5.35
5	600406	国电南瑞	242,540	3,233,058.20	4.72
6	600703	三安光电	136,628	3,201,194.04	4.68
7	002202	金风科技	262,867	2,494,607.83	3.65
8	600674	川投能源	176,053	2,066,862.22	3.02
9	000400	许继电气	102,225	2,049,611.25	3.00
10	000826	桑德环境	88,444	2,020,945.40	2.95

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002638	勤上光电	50,851	719,541.65	1.05

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

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的,并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值。

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 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	15,597.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,134.01
5	应收申购款	8,521.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,253.64

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 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	002638	勤上光电	719,541.65	1.05	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	68,232,423.65
报告期期间基金总申购份额	2,239,074.11
减:报告期期间基金总赎回份额	9,471,160.90
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	61,000,336.86

§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中证内地低碳经济主题指数证券投资基金的文件
(二)海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同
(三)海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金招募说明书
(四)海富通中证内地低碳经济主题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)报告期内海富通中证内地低碳经济主题指数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