海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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: 二〇一四年十月二十五日

§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10月24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	41,105,121.87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7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	3,492,987.79
2.本期利润	10,965,718.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.1997
4.期末基金资产净值	54,446,620.12
5.期末基金份额净值	1.325

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。

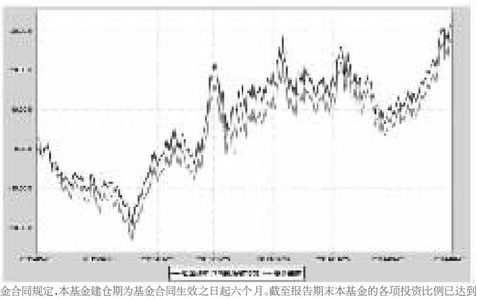
3.2 基金净值表现

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	18.09%	0.91%	18.36%	0.92%	-0.27%	-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年三季度,A股市场在多外的宏观经济数据、微刺激和改革政策、四中全会及沪港通预期的交错影响下震荡上行。经历了数周的波动之后,A股市场在地产政策放松、经济数据超预期好转等正面因素带动下,在7月下旬迎来了由大盘蓝筹估值修复推动的强劲反弹。8月,低于预期的宏观数据打击了大盘指数的表现,但市场在沪港通、国企改革和各行业政策利好不断推出的支撑下,仍保持乐观情绪,大盘涨幅明显收窄,创业板表现强劲。9月,市场在疲弱的经济数据和央行维稳流动性、四中全会及沪港通开通前积极预期的影响下,探高回落后再度反弹,市场氛围活跃,表现出结构性牛市的特征。

指数方面,大小盘指数出现普涨格局,上证综指上涨15.40%,深证成指上涨10.04%,创业板指涨幅为9.69%,中小板指涨幅达16.90%。各行业在三季度也同样悉数收涨,受政策利好驱动,国防军工、农林牧渔、纺织服装、交通运输、综合等热点板块表现抢眼;银行、家电、传媒、食品饮料、石油石化等板块涨幅相对较小。

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18.09%,同期业绩比较基准收益率为18.36%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0093%,年化跟踪误差为0.92%,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

展望四季度,预计经济内生增长依然维持弱势,同时政府仍将持续的保持微刺激,全年实现政府经济增长的目标不必过于担忧,经济延续弱平稳。市场对经济失速风险的担忧短期不会产生大的波动、但尾部风险的隐忧也始终存在。

预计市场仍将随着经济数据和政策变化而宽幅波动,以结构性机会为主。以创业板为代表的成长类资产以及转型类资产仍是市场情绪的风向标,该类资产是宏观经济弱势却乐观看好市场的典型代表。对于成长类资产,一方面其代表着未来经济发展大方向,另一方面短期又面临着估值与业绩的压力,二者之间如何平衡,将是四季度的重要不确定性。

改革与转型大背景下,随着改革的持续推进,优质存量资产的价值重估将是四季度的重点方向之一;而符合经济升级趋势、政策扶持方向等相关资产,如果能得到业绩的支撑,其股价仍将有望震荡上行。

而估值仍处于历史底部的价值蓝筹公司,能否随着市场对经济大周期系统风险担忧的进一步缓解,进而出现持续的估值修复,也将是四季度的重要课题之一。

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	51,525,461.77	92.99
	其中:股票	51,525,461.77	92.99
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	3,475,602.18	6.27
7	其他资产	407,386.01	0.74
8	合计	55,408,449.96	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	-	-
C	制造业	32,058,077.76	58.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,451,312.62	21.03
E	建筑业	360,908.64	0.66
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	3,546,916.74	6.51
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	4,108,246.01	7.55
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	51,525,461.77	94.63

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	652,280	5,153,012.00	9.46
2	600089	特变电工	337,858	3,368,444.26	6.19
3	600406	国电南瑞	157,504	2,698,043.52	4.96
4	600674	川投能源	145,018	2,575,519.68	4.73
5	002594	比亚迪	46,538	2,272,450.54	4.17
6	002202	金风科技	189,534	2,217,547.80	4.07
7	600703	三安光电	111,851	1,726,979.44	3.17
8	300070	碧水源	52,356	1,584,292.56	2.91
9	000826	桑德环境	63,051	1,502,505.33	2.76
10	002005	德豪润达	167,402	1,364,326.30	2.51

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

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川投能源(600674)于2014年8月21日公告称,公司控股股东四川省投资集团有限责任公司副董事长赵德胜涉嫌严重违纪违法,目前正接受组织调查。

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	9,748.65
2	应收证券清算款	304,261.36
3	应收股利	-
4	应收利息	743.36
5	应收申购款	92,632.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	407,386.01

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

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	002005	德豪润达	1,364,326.30	2.51	重大事项

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	61,000,336.86
报告期期间基金总申购份额	4,510,260.86
减:报告期期间基金总赎回份额	24,405,475.85
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	41,105,121.87

§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29只公募基金。截至2014年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模为243亿元人民币。

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9月30日,海富通为80多家企业超过324亿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9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过34亿元。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9月30日,投资咨询及海外业务规模近219亿元人民币。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
二〇一四年十月二十五日

海富通现金管理货币市场基金

2014 第三季度 报告

2014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: 二〇一四年十月二十五日

§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10月24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	海富通现金管理货币	
基金主代码	519528	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年3月13日	
报告期末基金份额总额	1,128,396,571.16份	
投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,力求将各类风险降到最低,在控制投资组合良好流动性的前提下为投资者获取稳定的收益。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	
下属两级基金的基金简称	海富通现金管理货币A	海富通现金管理货币B
下属两级基金的交易代码	519528	519529
报告期末下属两级基金的份额总额	10,189,418.2份	1,118,207,152.96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7月1日-2014年9月30日)	
	海富通现金管理货币A	海富通现金管理货币B
1. 本期已实现收益	162,540.64	8,682,585.99
2. 本期利润	162,540.64	8,682,585.99
3. 期末基金资产净值	10,189,418.20	1,118,207,152.96

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. 海富通现金管理货币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	0.8399%	0.0015%	0.3386%	0.0000%	0.5013%	0.0015%

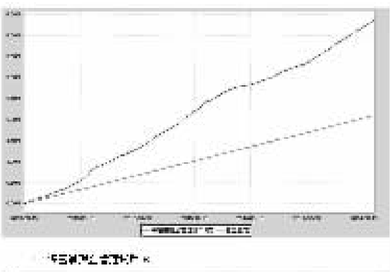
2. 海富通现金管理货币B:

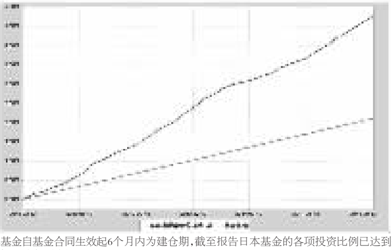
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9032%	0.0015%	0.3386%	0.0000%	0.5646%	0.0015%

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

海富通现金管理货币市场基金
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
(2013年3月13日至2014年9月30日)

1、 海富通现金管理货币A





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,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条(二)投资范围、(四)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		
凌超	本基金的基金经理,海富通一年定开债券基金经理;海富通纯债债券基金经理	2013-3-13	-	8年	硕士,持有基金从业人员资格证书,先后任职于长江证券股份有限公司、光大保德信基金管理有限公司,曾任光大保德信货币基金经理。2006年7月至2009 年6月在长江证券股份有限公司先后担任债券高级研究员、投资经理;2009年7月至2010年2月在光大保德信基金管理有限公司担任债券研究员,2010年2月至2010年8月担任光大保德信增利收益债券基金经理助理,2010年9月至2012 年2月担任光大保德信货币基金经理;2012年3月加入海富通基金管理有限公司,2013年3月起,任海富通现金管理货币基金经理。2013年12月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2014年4月起兼任海富通纯债债券基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理;海富通季季增利理财债券基金经理	2014-7-30	-	9年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2005年4月至2014年6月就职于华宝兴业基金管理有限公司,曾任产品经理、研究员、专户投资经理 、基金经理助理,2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年7月起任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。

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

2014年3季度,宏观经济指标未能持续2季度的企稳回升势头,工业增加值、固定资产投资、消费等均有较为显著的下滑。中央始终没有进一步扩大投资放松货币的政策意图,市场预期经济将进一步下行。同时,央行的货币政策维稳的意图较为明显,频频定向降准降息,货币市场稳定偏宽松,每月月末的新股申购对货币市场的扰动逐月减弱,央行在9月底做出的3个月SLF,缓解了传统季末资金紧张局面,3季末资金面非常平稳。经济下滑预期和央行定向宽松给中长期利率债带来了一波上涨机会,但对短期利率和短期信用债影响有限。由于季末资金宽松,货币基金配置重点的同业存款利率下行。交易所回购受新股申购周期影响,带来一定的配置机会。

本基金组合主要以流动性管理为主要侧重点,3季末降低了一点存款比例,增加了一点债券配置,依然以逆回购资产为主。目前基金资产风险较低、流动性状态也较为良好,收益率也处于一个相对稳定的区间。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,海富通现金管理货币A 类基金净值收益率为0.8399%,同期业绩比较基准收益率为0.3386%;海富通现金管理货币B 类基金净值收益率为0.9032%,同期业绩比较基准收益率为0.3386%。

4.6 市场展望和投资策略

今年三季度已经公布的宏观数据显示国内经济增长势头进一步趋弱,工业增加值、固定资产投资、消费和出口数据均显著下滑。资金成本的降低成为实体经济、政策制定者的共同要求,国庆节前央行宣布放松购房限贷政策,这可能不会是本轮政策的终点。央行已经体现出维持货币市场较宽松的意愿,目前外汇占款对基础货币的贡献非常有限,央行通过各种工具对货币市场流动性的影响力非常大。因此,未来可能会是一个有节制的偏宽松情况,出现过度宽松和过度紧张的可能性较小。这样的货币市场前景有利于货币基金的运作,有利于流动性控制,降低收益的波动性。

本基金仍将致力于做好流动性管理,控制好组合的各项风险指标。在此基础上,抓住关键时点做好资产配置。

§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	120,059,527.03	10.47
	其中:债券	120,059,527.03	10.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	904,600,000.00	78.91
	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	118,162,733.82	10.31
4	其他资产	3,535,364.40	0.31
5	合计	1,146,357,625.25	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	-	
	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	-	-
	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	33
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	44
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

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75天。本基金合同约定:本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过75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	83.55	1.41
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	7.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	8.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	1.77	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.28	1.41

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	100,093,360.23	8.87
	其中:政策性金融债	100,093,360.23	8.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,966,166.80	1.77
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	120,059,527.03	10.64
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	140204	14国开04	400,000	40,092,994.46	3.55
2	140320	14进出20	300,000	30,062,741.75	2.66
3	120301	12进出01	300,000	29,937,624.02	2.65
4	041453097	14京基投CP002	200,000	19,966,166.80	1.77

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	0.0035%
报告期内偏离度的最低值	-0.0103%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0018%

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	3,535,364.40
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,535,364.40

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通现金管理货币A	海富通现金管理货币B
报告期期初基金份额总额	102,488,650.64	974,087,709.64
报告期期间基金总申购份额	58,899,727.42	1,322,530,791.32
减:报告期期间基金总赎回份额	151,198,959.86	1,178,411,348.00
报告期期末基金份额总额	10,189,418.20	1,118,207,152.96

§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29只公募基金。截至2014年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模为243亿元人民币。

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9月30日,海富通为80多家企业超过324亿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9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过34亿元。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9月30日,投资咨询及海外业务规模近219亿元人民币。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现金管理货币市场基金的文件
(二)海富通现金管理货币市场基金基金合同
(三)海富通现金管理货币市场基金招募说明书
(四)海富通现金管理货币市场基金托管协议
(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)报告期内海富通现金管理货币市场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
二〇一四年十月二十五日

海富通国策导向股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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: 二〇一四年十月二十五日

§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10月24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	342,114,763.73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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	35,382,341.05
2.本期利润	60,560,421.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.1517
4.期末基金资产净值	516,268,183.69
5.期末基金份额净值	1.509

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。

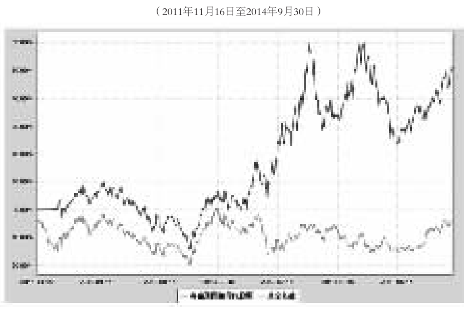
3.2 基金净值表现

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	11.61%	1.17%	11.80%	0.71%	-0.19%	0.46%

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2014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		
谢志刚	本基金的基金经理,海富通养老收益混合基金经理,海富通强化回报混合基金经理;海富通领先成长股票基金经理	2014-4-28	-	14年	MBA、硕士,持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安证券研究所行业研究员、美国康奈尔资本公司助理投资经理、华宝兴业基金管理有限公司高级研究员、西蒙莫瑞中国基金公司研究总监、信诚基金管理有限公司Eastspring China Dragon A Share Fund(QFII)投资经理(该基金由信诚基金担任投资顾问),2013年9月加入海富通基金管理有限公司,2013年10月起担任海富通养老收益混合基金经理,2014年1月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2014年4月起兼任海富通领先成长股票和海富通国策导向股票基金经理。
顾晓飞	本基金的基金经理	2014-8-27	-	6年	学士,持有基金从业人员资格证书。2008年5月至2010年6月任天隼投资咨询管理有限公司研究员,2010年6月至2011年7月任天治基金管理有限公司研究员,2011年8月至2011年10月任东吴基金管理有限公司研究员,2011年10月至2014年7月任国泰基金管理有限公司研究员及基金经理助理,2014年8月加入海富通基金管理有限公司。2014年8月起任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

2014年三季度,A股市场在多外的宏观经济数据、微刺激和改革政策、四中全会及沪港通预期的交错影响下震荡上行。经历了数周的波动之后,A股市场在地产政策放松、经济数据超预期好转等正面因素带动下,在7月下旬迎来了由大盘蓝筹估值修复推动的强劲反弹。8月,低于预期的宏观数据打击了大盘指数的表现,但市场在沪港通、国企改革和各行业政策利好不断推出的支撑下,仍保持乐观情绪,大盘涨幅明显收窄,创业板表现强劲。9月,市场在疲弱的经济数据和央行维稳流动性、四中全会及沪港通开通前积极预期的影响下,探高回落后再度反弹,市场氛围活跃,表现出结构性牛市的特征。

指数方面,大小盘指数出现普涨格局,上证综指上涨15.40%,深证成指上涨10.04%,创业板指涨幅为9.69%,中小板指涨幅达16.90%。各行业在三季度也同样悉数收涨,受政策利好驱动,国防军工、农林牧渔、纺织服装、交通运输、综合等热点板块表现抢眼;银行、家电、传媒、食品饮料、石油石化等板块涨幅相对较小。

本基金在三季度适当保持了较高的股票仓位,结构上继续超配军工、互联网、信息安全、新能源汽车等行业,减持了消费品、传统周期类行业。

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11.61%,同期基金业绩比较基准收益率为11.80%,基金净值跑输业绩比较基准0.19个百分点。基金跑输基准是因为7月份大盘风格变化没有及时调整行业配置。

4.6 市场展望和投资策略

展望四季度,预计经济内生增长依然维持弱势,同时政府仍将持续的保持微刺激,全年实现政府经济增长的目标不必过于担忧,经济延续弱平稳。市场对经济失速风险的担忧短期不会产生大的波动、但尾部风险的隐忧也始终存在。

预计市场仍将随着经济数据和政策变化而宽幅波动,以结构性机会为主。以创业板为代表的成长类资产以及转型类资产仍是市场情绪的风向标,该类资产是宏观经济弱势却乐观看好市场的典型代表。对于成长类资产,一方面其代表着未来经济发展大方向,另一方面短期又面临着估值与业绩的压力,二者之间如何平衡,将是四季度的重要不确定性。

改革与转型大背景下,随着改革的持续推进,优质存量资产的价值重估将是四季度的重点方向之一;而符合经济升级趋势、政策扶持方向等相关资产,如果能得到业绩的支撑,其股价仍将有望震荡上行。

而估值仍处于历史底部的价值蓝筹公司,能否随着市场对经济大周期系统风险担忧的进一步缓解,进而出现持续的估值修复,也将是四季度的重要课题之一。

本基金认为四季度结构性机会仍会相对活跃,投资方向上将以两个方面为主,其中一方面为符合政策方向,行业处于周期发展初期且空间较大的股票为主。另外一个方面以成熟行业中,股价跌幅较大,但供需及盈利出现好转的蓝筹股票为主。

§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	438,648,699.21	82.26
	其中:股票	438,648,699.21	82.26
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	28,061,078.66	5.26
7	其他资产	66,539,104.02	12.48
8	合计	533,248,881.89	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	5,090,300.00	0.99
B	采矿业	-	-
C	制造业	223,380,659.68	43.27
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	10,040,863.14	1.94
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	148,497,631.72	28.76
J	金融业	-	-
K	房地产业	17,916,232.00	3.47
L	租赁和商务服务业	11,188,440.05	2.17
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	22,534,572.62	4.36
S	综合	-	-
	合计	438,648,699.21	84.97

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	600893	航空动力	726,206	21,582,842.32	4.18
2	000768	中航飞机	1,166,817	18,424,040.43	3.57
3	603000	人民网	374,601	18,362,941.02	3.56
4	300322	硕贝德	899,832	18,086,623.20	3.50
5	600158	中体产业	1,400,800	17,916,232.00	3.47
6	000733	振华科技	951,086	17,880,416.80	3.46
7	600037	歌华有线	1,183,658	17,411,609.18	3.37
8	600118	中国卫星	703,800	16,884,162.00	3.27
9	600879	航天电子	1,059,980	16,599,286.80	3.22
10	300136	信维通信	874,442	14,646,903.50	2.84

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	499,341.05
2	应收证券清算款	65,719,916.79
3	应收股利	-
4	应收利息	7,897.57
5	应收申购款	311,948.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,539,104.02

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	000768	中航飞机	18,424,040.43	3.57	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	442,167,573.75
报告期期间基金总申购份额	11,622,708.82
减:报告期期间基金总赎回份额	111,675,518.84
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	342,114,763.73

§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29只公募基金。截至2014年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模为243亿元人民币。

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9月30日,海富通为80多家企业超过324亿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9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过34亿元。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9月30日,投资咨询及海外业务规模近219亿元人民币。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
二〇一四年十月二十五日