海富通领先成长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	海富通领先成长股票
基金主代码	519025
交易代码	519025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月30日
报告期末基金份额总额	432,792,626.03份
投资目标	从具有领先发展的行业中，精选出具有高度成长性的股票，在控制风险并保持资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金运用已经得到市场检验和认可的国际先进投资理念，通过上市公司基本面的分析和研究，坚持寻找价值"洼地"和长线投资，来获得超额收益。在投资组合构建和管理的过程中，本基金采取"自上而下"与"自下而上"相结合的方法，在具有领先发展的行业中，精选出具有高度成长性的股票。
业绩比较基准	MSCI China A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	21,932,604.41
2.本期利润	42,344,164.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0964
4.期末基金资产净值	442,096,723.31
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。

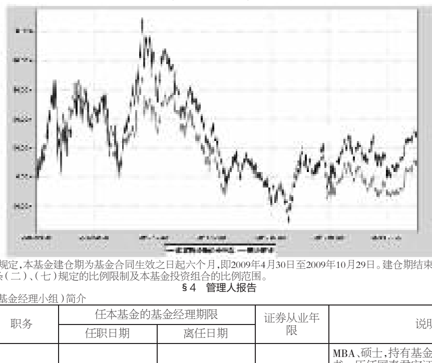
3.2 基金净值表现

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	10.62%	0.75%	11.80%	0.71%	-1.18%	0.04%

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

海富通领先成长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
（2009年4月30日至2014年9月30日）



注:按照基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月，即2009年4月30日至2009年10月29日。建仓期结束时本基金投资组合均达到本基金合同第十二条（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		
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；海富通国策导向股票基金经理	2014-4-11	-	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。

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

报告期内，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。

本基金三季度提高了股票仓位，结构上进一步加大了对汽车、农业的超配比例，保持了对医药的超配，适量增持机械军工，不断降低对银行、地产、食品饮料的配置，保持了对钢铁、煤炭板块的低配。

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10.62%，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1.18个百分点。本基金跑输基准主要是因为银行板块8月份以来的表现异常明显落后于其他板块，对净值拖累明显。

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，但局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，仍以结构性机会为主。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，改革红利受益型资产、政策受益型资产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。例如将重点关注存量市场巨大的传统领域改造与升级所带来的新兴成长资产，以及政府将大力培育与扶植的产业；重点关注改革主线下的个股优化。另外，传统板块领域内的个股补涨机会也是值得关注的。

§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	386,269,575.51	86.77
	其中:股票	386,269,575.51	86.77
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	58,727,879.40	13.19
7	其他资产	183,004.50	0.04
8	合计	445,180,459.41	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	15,492,610.18	3.50
B	采矿业	-	-
C	制造业	152,298,525.19	34.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,188,797.68	2.53
E	建筑业	12,773,080.45	2.89
F	批发和零售业	46,253,999.53	10.46
G	交通运输、仓储和邮政业	13,211,776.24	2.99
H	住宿和餐饮业	3,072,098.60	0.69
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,922,981.04	3.60
J	金融业	71,638,077.38	16.20
K	房地产业	18,165,780.58	4.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	21,177,619.30	4.79
N	水利、环境和公共设施管理业	383,728.00	0.09
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	4,690,501.34	1.06
S	综合	-	-
	合计	386,269,575.51	87.37

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	601318	中国平安	470,182	19,437,323.88	4.40
2	300008	上海佳豪	1,115,155	17,675,206.75	4.00
3	600705	中航资本	707,488	13,321,999.04	3.01
4	000030	富奥股份	1,121,845	8,918,667.75	2.02
5	600739	辽宁成大	533,880	8,659,533.60	1.96
6	600660	福耀玻璃	793,445	8,347,041.40	1.89
7	000625	长安汽车	608,006	8,329,682.20	1.88
8	600335	国机汽车	480,829	8,251,025.64	1.87
9	600699	均胜电子	306,698	7,728,789.60	1.75
10	600759	洲际油气	661,033	7,648,151.81	1.73

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投资。

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投资。

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：本基金管理人认为尽管短期缺乏催化因素，但该股票目前处于估值的历史底部区间，下行风险较小，并且业绩仍能保持稳定增长，长期投资价值凸显。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	113,512.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,478.52
5	应收申购款	58,013.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	183,004.50

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	600705	中航资本	13,321,999.04	3.01	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	418,321,529.59
报告期期间基金总申购份额	70,595,673.41
减:报告期期间基金总赎回份额	56,124,576.97
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	432,792,626.03

§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领先成长股票型证券投资基金的文件
（二）海富通领先成长股票型证券投资基金基金合同
（三）海富通领先成长股票型证券投资基金招募说明书
（四）海富通领先成长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）报告期内海富通领先成长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

海富通稳健添利债券型证券投资基金

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	216,919,907.74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	196,174,601.92份	20,745,305.82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	609,026.75	436,004.89
2.本期利润	-1,543,842.64	108,226.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0317	0.0048
4.期末基金资产净值	222,067,275.44	23,163,229.58
5.期末基金份额净值	1.132	1.117

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	0.53%	0.12%	1.56%	0.06%	-1.03%	0.06%

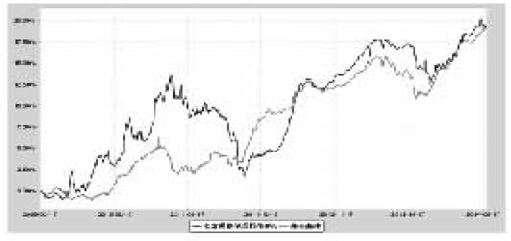
2、海富通稳健添利债券C：

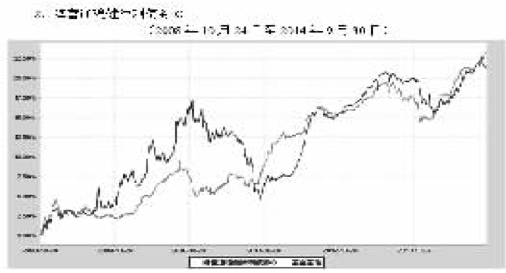
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.45%	0.12%	1.56%	0.06%	-1.11%	0.06%

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





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；总经理助理	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月加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益分析师、基金经理、固定收益组合管理部总监、投资副总监，现任总经理助理。2005年1月至2008年2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，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

从基本面来看，三季度经济整体疲弱，7月工业增加值同比增长9.0%，8月份骤降至6.9%，经济下行压力较大，货币政策延续定向宽松；资金面来看，三季度整体比较宽松，银行间7天回购利率7月份有所略有上行，7月下旬至9月底持续下行，中枢在3.4%左右；利率债7月份受经济预期向好、半年缴税资金面趋紧、新债发行密集等因素影响，收益率略有上行，7月底后随着央行下调正回购利率、经济数据的恶化，定向宽松货币政策的延续，利率债延续牛市行情，10年期国债、国开收益率三季度分别下行7.88BP、26BP。三季度资金面较宽松，信用债价格多上涨，受经济下行，违约风险逐渐暴露等影响，信用债等级间分化加剧，中高评级价格普遍上涨，低评级价格多下跌。信用利差来看，三季度普遍收窄，短端收窄幅度更大。品种上来看，城投债涨势依旧好于产业债。受到股市上涨推动，三季度转债表现十分出色，可转债指数上涨5.36%，转债也全线上涨。虽然从宏观数据看经济基本面仍持续疲软，但在宽松货币环境以及沪港通、全面改革等有利因素的带动下，股市整体情绪大幅提升，三季度上证综指上涨300多点，这也成为当季推动转债大幅上涨的主要驱动力。品种方面，国企改革、军工核电等题材型转债表现最为突出。本组合提高了信用债的配置比例，以中短期期限、中等以上资质的债券为主。

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0.45%，同期业绩比较基准收益率为1.56%；海富通稳健添利债券A类基金净值增长率为0.53%，同期业绩比较基准收益率为1.56%。

4.6 市场展望和投资策略

基金管理人认为，2014 年第四季度可以继续看多债券市场。货币政策缓慢放松的格局已经确立，但不会大幅度放松，仍有利于债券市场的慢牛行情继续演绎。经济增长仍然呈现缓慢回落的态势，通货膨胀的压力还不明显，基本面的支持仍然存在。信用债方面，相信仍然会爆发一定的风险事件，但对整体信用市场不构成压力。在股票市场风险偏好提升的背景下，可转债的表现仍值得期待。基金将保持较高仓位，提高资产流动性，寻找获得超额收益的机会。

§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	401,659,424.00	97.36
	其中:债券	401,659,424.00	97.36
	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	1,840,014.90	0.45
7	其他资产	9,063,394.68	2.20
8	合计	412,562,833.58	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	13,037,700.00	5.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	388,621,724.00	158.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	401,659,424.00	163.79

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	122767	11盐城南	200,000	21,296,000.00	8.68
2	122914	09榕建债	200,000	20,400,000.00	8.32
2	122823	11舟山债	200,000	20,400,000.00	8.32
2	122924	10巢湖债	200,000	20,400,000.00	8.32
5	122094	11海正债	200,000	20,386,000.00	8.31

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	18,921.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,042,473.37
5	应收申购款	2,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,063,394.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	3,358,127.14	24,042,067.61
报告期期间基金总申购份额	192,994,144.82	246,686.99
减:报告期期间基金总赎回份额	177,670.04	3,543,448.78
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	196,174,601.92	20,745,305.82

§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
二〇一四年十月二十五日

海富通中国海外精选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	海富通中国海外股票(QDII)
基金主代码	519601
交易代码	519601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月27日
报告期末基金份额总额	92,949,936.51份
投资目标	本基金以在香港、美国等海外证券交易所上市的具有"中国概念"的上市公司为主要投资对象。本基金管理人将深入研究全球及内地经济状况以及政策导向，采取主动精选证券和适度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	根据对境内外证券市场投资经验的认识和对证券市场的实证分析，本基金管理人将基金的整体投资策略分为二个层次：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。主动精选证券是本基金投资策略的重点，本基金不积极谋求寻找市场的拐点，主要从控制系统性风险出发适度调整资产配置。
业绩比较基准	MSCI中国指数（以美元计价）
风险收益特征	本基金是股票型基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，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	中国建设银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	The Bank of New York Mellon Corporation
境外资产托管人中文名称	纽约梅隆银行

注:本基金管理人于2011年2月14日发布公告，自2011年2月14日起解除与法国巴黎投资管理BE控股公司（BNP Paribas Investment Partners BE Holding）签署的投资顾问协议，自该日起法国巴黎投资管理BE控股公司不再担任本基金的投资顾问。

§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	-852,389.18
2.本期利润	-3,317,226.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0314
4.期末基金资产净值	130,581,293.49
5.期末基金份额净值	1.405

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。

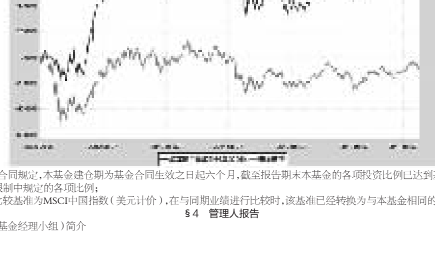
3.2 基金净值表现

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	-3.30%	0.82%	-0.78%	0.87%	-2.52%	-0.05%

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

海富通中国海外精选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
（2008年6月27日至2014年9月30日）



注:1、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条（二）投资范围、（八）投资限制中规定的各项比例；

2、本基金的业绩比较基准为MSCI中国指数（美元计价），在与同期业绩进行比较时，该基准已经转换为与本基金相同的计价货币（人民币）。

§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		
杨铭	本基金的基金经理；海富通大中华股票（QDII）基金经理；海富通资产管理（香港）有限公司大中华股票投资负责人	2010-1-13	-	17年	中国籍，特许金融分析师（CFA），经济学学士，持有基金从业人员资格证书。先后任职于香港东亚银行上海分行、上海瀚蓝投资顾问有限公司，2004年4月加入海富通基金管理与限公司，任股票分析师，2008年6月至2010年1月任海富通中国海外股票(QDII)基金经理助理，2010年1月起任海富通中国海外股票(QDII)基金经理，2011年1月起任海富通大中华股票（QDII）基金经理，2014年1月起兼任海富通资产管理（香港）有限公司大中华股票投资负责人。

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为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金管理人于2011年2月14日发布公告， 自2011年2月14日起解除与法国巴黎投资管理BE控股公司（BNP Paribas Investment Partners BE Holding）签署的投资顾问协议，自该日起法国巴黎投资管理BE控股公司不再担任本基金的投资顾问。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析

二零一四年第三季度一开始，全球经济增长稳定，美联储实施QE缓退的影响逐步被市场消化，欧央行最终兑现了更宽松的货币政策，全球通胀预期不断降低，全球资金流入了新兴市场。中国政府继续推进改革，微刺激政策不断出台，市场资金成本不断下降，市场对于经济企稳预期不断增强，阿里巴巴在美国成功上市，沪港通预期向好，因此中国海外股票和新兴市场股市走势一路上扬。但九月中旬起，美联储明年的政策风险浮现，全球经济增长减速和中国经济增长更加疲弱的负面消息打压了全球股市，苹果新手机上市的刺激被彻底消化，最终各个股指都基本回吐了本季度先前的涨幅。季度末，香港"占中"事件的影响也加剧了股票下跌。第三季度，发达市场股市表现好于新兴市场股市，中国海外股票表现好于发达市场股市。

报告期内，本基金增加了股票仓位，主要增持了金融、医疗保健和能源行业的配置，减持了信息技术和非日常消费品行业的配置。

4.6 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-3.30%，同期业绩比较基准收益率-0.78%，基金净值跑输业绩比较基准2.52个百分点。涨幅较大的电信运营行业配置不足导致了跑输。

4.7 市场展望和投资策略

展望二零一四年第四季度，我们认为美国经济保持稳步复苏，QE缓退将完成。欧洲经济整体将步入温和的复苏阶段，宽松的货币政策依然。中国经济在连续的微刺激政策后有望企稳，通胀压力不大，资金成本会继续降低。中国政府坚定改革和转型是最大的背景，四中全会将进一步增强市场的长期信心，市场对于政策放松和国企改革的预期会越来越高，沪港通开通将引入新的市场参与者，因此将提供更多的投资机会。就市场而言，公司业绩增速企稳，中国海外股票的整体估值仍处于偏低水平。因此，四季度市场将会处于一个震荡格局，机会依然较多。

对于二零一四年第四季度的市场判断，我们持谨慎乐观的态度。我们将继续密切关注国内外宏观经济形势和政策的变化，在投资上我们将灵活应对经济形势和市场的变化，灵活调整仓位和持仓结构，结合三季报情况，坚持深入挖掘估值合理且业绩增长较为确定的成长股，加大对传统产业中存在明显预期差的公司的关注以期获取超额收益，对受益于中国改革和民生政策扶持、新技术的投资和消费、内需拉动和经济转型的行业和公司，加深个股的基本面研究。

§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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	119,865,890.70	90.29
	其中:普通股	119,865,890.70	90.29
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,541,972.08	9.45
8	其他各项资产	348,324.41	0.26
9	合计	132,756,187.19	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国香港	117,487,026.58	89.97
新加坡	2,378,864.12	1.82
合计	119,865,890.70	91.79

注:国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定;ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	44,253,390.21	33.89
信息技术	18,605,629.70	14.25
能源	17,488,063.82	13.39
医疗保健	11,868,309.70	9.09
非日常生活消费品	9,689,621.87	7.42
工业	5,187,629.08	3.97
原材料	4,315,241.55	3.30
电信业务	3,676,359.92	2.82
日常消费品	2,535,420.63	1.94
公共事业	2,246,224.22	1.72
合计	119,865,890.70	91.79

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	4,000,000	11,029,079.76	8.45
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	110,000	10,066,412.24	7.71
3	PING AN INSURANCE GR	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	210,000	9,700,360.88	7.43
4	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港证券交易所	中国香港	1,200,000	9,460,288.24	7.24
5	CHINA PETROLEUM & CH	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港证券交易所	中国香港	1,490,000	8,027,775.58	6.15
6	CHINA CITIC BANK COR	中信银行股份有限公司	998 HK	香港证券交易所	中国香港	2,000,000	7,463,644.49	5.72
7	CHINA MINSHENG BANKI	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港证券交易所	中国香港	1,320,000	7,425,613.18	5.69
8	TIANNENG POWER INTL	天能动力国际有限公司	819 HK	香港证券交易所	中国香港	3,457,143	7,203,990.55	5.52
9	SHANGHAI FUDAN MICRO	上海复旦微电子集团股份有限公司	1385 HK	香港证券交易所	中国香港	905,000	5,377,864.86	4.12
10	CHINA VANKE CO LTD-H	万科企业股份有限公司	2202 HK	香港证券交易所	中国香港	400,000	4,348,246.39	3.33

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	211,387.54
4	应收利息	648.88
5	应收申购款	136,287.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	348,324.41

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中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	112,640,729.04
报告期期间基金总申购份额	1,160,509.07
减:报告期期间基金总赎回份额	20,851,301.60
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	92,949,936.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易份额	交易金额	适用费率
1	赎回	2014-09-05	-10,000,000.00	-15,250,000.00	0.00%
合计			-10,000,000.00	-15,250,000.00	

§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国海外精选股票型证券投资基金的文件
（二）海富通中国海外精选股票型证券投资基金基金合同
（三）海富通中国海外精选股票型证券投资基金招募说明书
（四）海富通中国海外精选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）报告期内海富通中国海外精选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