摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年十月二十七日

§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2010年10月22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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大摩卓越成长股票
基金主代码	233007
交易代码	233007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月18日
报告期末基金份额总额	1,508,137,198.11份
投资目标	通过深入研究,致力于挖掘并投资具备持续成长能力和估值优势的优秀上市公司,力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自下而上精选个股、积极主动的投资策略。 1)资产配置策略:大类资产配置实行在公司投资决策委员会统一指导下进行的大类资产配置机制。主要考察三方面的因素:宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素。行业配置策略主要目的是对投资组合中各行业波动率和集中度风险的管理。 2)股票投资策略:采取自下而上精选个股的投资策略,主要投资于具备持续成长能力并有一定估值优势的上市公司,即有形或无形资产持续增长的企业、市场占有率不断提升的企业、所处市场发展空间广阔的企业、技术或服务水平超越同侪的企业、突破瓶颈进入成长发展轨道的企业等等。通过定性和定量两种方法筛选股票,在股票选择和估值分析的基础上,构建股票投资组合。 3)固定收益投资策略:采用久期控制下的主动投资策略,包括利率策略、信用策略、可转换债券策略等。 4)权证等其他金融工具投资策略:对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险分析的基础上,以Black-Scholes模型和二叉树期权定价模型为基础来对权证进行分析定价,并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。
业绩比较基准	沪深300指数×80% +中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。
基金管理人	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-14,452,665.45
2.本期利润	132,089,474.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0648
4.期末基金资产净值	1,576,320,116.84
5.期末基金份额净值	1.0452

注:1.以上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(例如,开放式基金的申购赎回费等),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	6.10%	0.82%	11.76%	1.05%	-5.66%	-0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利华鑫卓越成长股票型证券投资基金

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

(2010年5月18日至2010年9月30日)

注:1.本基金基金合同于2010年5月18日正式生效,截至本报告期未未满一年。

2.按照本基金基金合同的规定,基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告期末,本基金仍处于建仓期。

§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		
何滨	本基金基金经理、基金投资部副总监	2010-5-18	-	13	本科学历,具有基金从业资格,曾任珠海鑫光集团股份有限公司职员、巨田证券有限责任公司投资管理部副经理。2007年5月加入本公司,曾任高级研究员、投资管理部总监助理。

注:1.任职日期为本基金合同生效之日。

2.基金经理(任职日)按规定在中国证券业协会办理完毕基金经理注册。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在认真控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,没有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

基金管理人依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,针对投资、研究、交易等业务建立了相关的公平交易制度,并加强对相关环节的行为监控及分析评估。

基金管理人建立了以投资决策委员会领导下的基金经理负责制的投资决策及授权制度。在投资研究过程中,坚持价值投资分析方法,强调以数据为事实为研究基础,降低主观估计给研究报告带来的影响,并以此建立了投资对象备选库、投资交易对手库,通过制度明确备选库、对手库的更新维护机制。同时基金管理人还建立了一系列交易管理制度以及内控实施细则,以确保在投资过程中的可能导致不公平交易行为以及其它各种异常交易行为得到有效监控及防范。基金管理人还建立了异常交易监控及评估细则以确保监控评估得以有效实施。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

基金管理人依据指导意见要求,对本报告期内本基金交易情况进行了分析。基金管理人旗下尚无与本基金投资风格相似的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

未发现本基金在报告期内出现异常交易行为。

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

A、大类资产配置:

①股票资产配置----本基金于5月18日成立,6月、7月采取逐步建仓核心品种的策略,由于行情比我们预想的要强,8月开始快速建仓,到三季度末股票仓位达91%。②债券资产配置----配置了部分金融债和可转债,三季度末债券持仓5%。

B、二级资产配置:

①股票资产配置----基于经济结构转型,配置了部分新能源、节能减排等新经济类品种;基于劳动报酬率提高预期,配置了医药、零售等品种;基于通货膨胀预期,配置了有色、煤炭、食品饮料、农林牧渔等品种;基于经济回落幅度已期且复放缓,经济增速接近底部区域,配置了金融、石化、化工等周期类品种。股票组合基本是"金融+新经济+大消费+周期"的品种配置结构。

②债券资产配置---- 持有部分金融债和信用债,以期提高现金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本季度截至2010年9月30日,本基金份额净值为1.0452元,累计份额净值为1.0452元,基金份额净值增长率为6.10%,同期业绩比较基准收益率为11.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济目三季度进入底部区域,从量度上看,经济回落的幅度已明显放缓,有望在明年一、二季度走出底部,然而向上复苏的力度还取决于国内实体经济的需求和国外经济的复苏。世界主要经济体维持宽松的货币政策,并表示不排除进一步的经济刺激措施,提高了通货膨胀的预期。在外需不振、经济结构调整尚待时日的环境下,目前的负利率状态可能会持续较长的时间,资金面充裕。

A股市场的估值水平在三季度进一步分化,部分品种已经开始透支未来的高成长,风险在积聚;而另一些品种则充分反映了目前投资者的悲观预期,并开始吸引长期投资者的关注。这种现象并不理智,但很难去判断它能够持续多长时间。

可以确定的是经济结构调整将会坚定不移地继续,因此新经济和大消费仍将是未来的希望。只是资本市场有时会跑的太快,现实中的盈利跟不上时回调就难以避免了。同时,在资金成本低廉的大环境下,通货膨胀预期将持续,相关主题也会持续受到关注。另外,由于资金的充裕和政府的干预,经济波动更为频繁、周期类品种也会有闪光的机会。

§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	1,442,913,322.17	90.72
	其中:股票	1,442,913,322.17	90.72
2	固定收益投资	80,337,265.30	5.05
	其中:债券	80,337,265.30	5.05
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	65,335,385.21	4.11
6	其他各项资产	1,939,345.65	0.12
7	合计	1,590,525,318.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	138,524,005.00	8.79
C	制造业	723,990,531.67	45.93
C0	食品、饮料	75,896,410.57	4.81
C1	纺织、服装、皮毛	25,252,414.55	1.60
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	46,234,504.62	2.93
C4	石油、化学、塑胶、塑料	231,132,656.01	14.66
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	105,496,160.06	6.69
C7	机械、设备、仪表	95,024,960.51	6.03
C8	医药、生物制品	144,953,425.35	9.20
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	58,489,084.36	3.71
E	建筑业	53,532,342.40	3.40
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	39,545,377.00	2.51
H	批发和零售贸易	221,244,937.68	14.04
I	金融、保险业	180,775,856.14	11.47
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	4,246,000.00	0.27
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	22,565,187.92	1.43
	合计	1,442,913,322.17	91.54

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	600030	中信证券	8,805,000	93,685,200.00	5.94
2	601628	中国人寿	3,504,638	75,454,856.14	4.79
3	000059	辽通化工	6,868,540	74,180,232.00	4.71
4	002243	通产丽星	5,100,439	64,979,592.86	4.12
5	600480	凌云股份	4,799,882	63,742,432.96	4.04
6	600323	南海发展	3,301,894	55,934,084.36	3.55
7	600469	风神股份	4,519,261	53,824,398.51	3.41
8	600993	马应龙	1,073,937	47,306,924.85	3.00
9	600963	岳阳纸业	4,506,287	46,234,504.62	2.93
10	601958	金钼股份	2,400,000	44,400,000.00	2.82

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	71,149,000.00	4.51
	其中:政策性金融债	71,149,000.00	4.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	9,188,265.30	0.58
7	其他	-	-
8	合计	80,337,265.30	5.10

5.5 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

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	080414	08农发14	500,000	51,065,000.00	3.24
2	060205	06国开05	200,000	20,084,000.00	1.27
3	113002	工行转债	82,310	9,188,265.30	0.58
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.8.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	396,597.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	565,212.47
5	应收申购款	977,535.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,939,345.65

5.8.4 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。

5.8.5 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	2,264,206,425.05
报告期期间基金总申购份额	44,288,010.43
报告期期间基金总赎回份额	800,357,237.37
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	1,508,137,198.11

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准本基金募集的文件;

2、本基金基金合同;

3、本基金托管协议;

4、本基金招募说明书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点

存放地点:基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,还可以通过基金管理人网站查阅或下载。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
二〇一〇年十月二十七日

海富通货币市场证券投资基金

2010 第三季度报告

2010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:二〇一〇年十月二十七日

§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2010年10月26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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2010年7月1日起至2010年9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	5,228,432,367.44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、分拆转换速程),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	454,438,711.36份	4,773,993,656.08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(2010年7月1日-2010年9月30日)	
	海富通货币A	海富通货币B
1.本期已实现收益	2,646,733.95	32,918,446.14
2.本期利润	2,646,733.95	32,918,446.14
3.期末基金资产净值	454,438,711.36	4,773,993,656.08

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3个月	0.5089%	0.0032%	0.5624%	0.0000%	-0.0535%	0.0032%

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3个月	0.5699%	0.0032%	0.5624%	0.0000%	0.0075%	0.0032%

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

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

1、 海富通货币A

(2005年1月4日至2010年9月30日)

注:1.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。

2.本基金的历任基金经理为邵佳民先生,任职时间为2005年1月至2008年1月。

§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		
张丽洁	本基金的基金经理	2008-1-31	-	8年	中国国籍,经济学学士学位,持有基金从业人员资格证书,2002年7月至2004年7月就职于南京银行股份有限公司,从事债券交易工作,2004年8月加入海富通基金管理有限公司,任助理固定收益分析师、组合经理。2008年1月起任海富通货币基金基金经理。

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 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

公司自成立以来,就建立了公平交易制度,并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司根据该指导意见的具体要求,已完善现有的业务流程,建立了公平交易监控系统,进行定期监控,以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据本基金合同,公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度货币政策方面没有重大的调整,通货膨胀预期也大幅度下降,但是资金利率又出现了季末行情,银行强力的吸储行为大幅推升了货币市场利率。9月末资金成本达到年度最高点,引起了中短期债券包括利率债券和信用债券的大幅度下跌。虽然央行票据发行利率没有变化,但是债券收益率曲线大幅上移,一年期利率产品上行了10BP以上,一年期信用产品上升了幅度更大,9月份交易商协会不断上调了发行指导价格以应对市场变化,反过来也不断推升了市场利率的不断走高预期。

海富通货币基金本季度末规模缩减,机构大量赎回,虽然在本季度中货币基金的信用债比例维持中性,但是由于赎回所以导致信用债比例冲高。银行存款依旧维持高比例,利率债券久期和仓位都降低较多,相对增加了长融券回购的比例。总体债券的久期较低,利率风险较小。在报告期内,本基金还投资于可提前支取、利率不变的定期存款,根据流动性管理的需要,本基金提前结束一存款合约,该投资行为不存在任何利息损失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A级基金净值收益率为0.5089%,同期业绩比较基准收益率为0.5624%;B级基金净值收益率为0.5699%,同期业绩比较基准收益率为0.5624%。

4.4.3 市场展望和投资策略

我们相信10月份开始资金利率将从目前高位逐步下行,但是对于四季度资金的预期大家都越来越谨慎,资金成本会维持相对较高位置;在宏观经济方面,9月份CPI同比涨幅有望再创年内新高,四季度中可能的通胀拐点目前并不明朗;在货币政策方面,我们认为年内存款单边加息的可能性有所增加,由于人民币汇率升值预期导致的外汇占款重新放量使得存款准备金率重新被市场重视,以上各项因素对债市产生负面影响。由于四季度债市供应相对减少,该因素有望稳定一下预期。我们认为目前债市收益率上行有利于为下个季度债市创造机会,但是利率下行幅度有限,四季度寻找适当的机会增加投资久期。

§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	2,644,638,165.38	47.00
	其中:债券	2,644,638,165.38	47.00
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,380,002,830.00	24.52
	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	1,560,998,489.86	27.74
4	其他各项资产	41,489,128.24	0.74
5	合计	5,627,128,613.48	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	4.20	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	389,999,325.00	7.46
	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交易日融资余额占基金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	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在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	57.35	7.46
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.34	-
2	30天(含)—60天	18.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	7.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.37	-
4	90天(含)—180天	10.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.56	-
5	180天(含)—397天(含)	13.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.83	7.46

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	630,355,265.83	12.06
	其中:政策性金融债	630,355,265.83	12.06
4	企业债券	536,918,526.60	10.27
5	企业短期融资券	1,477,364,372.95	28.26
6	其他	-	-
7	合计	2,644,638,165.38	50.58
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	536,918,526.60	10.27

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	090218	09国开18	5,000,000	500,009,502.32	9.56
2	0981228	09振华CP01	2,500,000	250,012,717.44	4.78
3	058031	05中信债1	1,800,000	176,062,198.64	3.37
4	0980147	09中航工债浮	1,600,000	159,507,433.04	3.05
5	068007	06首都机场债	1,400,000	133,865,173.83	2.56
6	060202	06国开02	1,300,000	130,345,763.51	2.49
7	1081285	10华谊CP01	1,300,000	130,003,865.52	2.49
8	1081223	10农六师CP01	1,200,000	120,452,654.85	2.30
9	1081002	10沪建工CP01	1,000,000	100,050,724.88	1.91
10	0981222	09沪城建CP01	1,000,000	99,972,804.09	1.91

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	15次
报告期内偏离度的最高值	0.2968%
报告期内偏离度的最低值	0.1229%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2078%

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未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	41,487,628.24
4	应收申购款	1,500.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	41,489,128.24

§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
本报告期期初基金份额总额	650,346,436.21	5,467,361,740.00
本报告期基金总申购份额	615,975,597.60	4,743,849,123.96
减:本报告期基金总赎回份额	811,883,322.45	5,437,217,207.88
本报告期期末基金份额总额	454,438,711.36	4,773,993,656.08

§7 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14只开放式基金。截至2010年三季度末,海富通管理的公募基金资产规模达420亿元人民币。

作为首批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2010年三季度末,海富通为50多家企业超过130亿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2010年三季度末,海富通旗下专户理财管理资产规模超过20亿元。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2010年三季度末,投资咨询业务规模超过230亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

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"公益林"。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。

§8 备查文件目录

8.1 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

8.2 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。

8.3 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
二〇一〇年十月二十七日

海富通中国海外精选股票型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010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:二〇一〇年十月二十七日

§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2010年10月26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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至2010年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	253,060,575.42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等向,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
境外投资顾问英文名称	BNP Paribas Investment Partners BE Holding
境外投资顾问中文名称	法国巴黎投资管理BE控股公司
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:本基金境外投资顾问法国巴黎投资管理BE控股公司原名为富通基金管理公司。

§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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	1,669,310.82
2.本期利润	29,354,122.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.1098
4.期末基金资产净值	347,486,932.76
5.期末基金份额净值	1.373

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