海富通股票证券投资基金

2010 第四季度报告

2010年12月31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：二〇一一年一月二十一日

§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2011年1月20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10月1日起至2010年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通股票
基金主代码	519005
交易代码	519005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年7月29日
报告期末基金份额总额	6,535,698,398.32份
投资目标	精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合，分享中国经济高速成长的成果，谋求基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采用双层次的投资策略：第一层次主要通过对股票市场的系统性风险进行分析，确定股票和现金资产的配置比例；第二层次主要是通过对行业景气循环和个股的研究，精选适合本投资组合风险收益特征的股票。
业绩比较基准	80%MSCI China A+20%上证国债
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的股票型基金产品。
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（2010年10月1日-2010年12月31日）
1.本期已实现收益	331,644,877.79
2.本期利润	283,202,718.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0416
4.期末基金资产净值	5,085,534,489.45
5.期末基金份额净值	0.778

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	6.14%	1.86%	5.33%	1.39%	0.81%	0.47%

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

海富通股票证券投资基金

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

（2005年7月29日至2010年12月31日）

注：1、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8月22日至2007年11月23日为持续营销后建仓期。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，即股票资产70%-95%，一年期以内的国家债券和现金的比例不低于5%。同时满足第14章（七）有关投资组合限制的各项比例要求。

2、本基金的历任基金经理分别为陈洪，任职时间为2005年7月至2006年9月；郑拓，任职时间为2005年7月至2007年3月；蒋征，任职时间为2007年1月至2009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		
陈经胜	本基金的基金经理；海富通领先成长股票基金基金经理	2009-1-12	-	19年	中国国籍，博士，持有基金从业人员资格证书。历任香港英皇金融集团外汇投资经理、原上海万国证券公司证券分析师、海通证券交易总部投资经理。2003年4月至2004年2月任海富通基金管理有限公司股票分析师、策略分析师，2004年3月至2009年1月任海富通收益增长混合基金基金经理，2009年1月起任海富通股票基金基金经理，2009年4月起兼任海富通领先成长股票基金基金经理。

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，目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

根据基金合同，公司旗下海富通股票和海富通精选贰号两基金风格相似。本报告期内，两基金净值增长率分别为：海富通股票7.52%，海富通精选贰号基金6.63%，两者净值增长率之差的绝对值为0.89%，低于5%。

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

A股市场10月份在美国货币新一轮量化宽松的货币政策刺激下，周期类股票带领指数出现一波放量普涨。但在之后的两个月内，伴随着央行准备金上调和加息，对宏观紧缩的担忧给市场造成了一定影响，股指出现了明显的回落。行业方面，采掘、电子、有色金属涨幅靠前，金融、房地产、商业贸易表现不佳。

本基金报告期股票仓位相对较高，主要参与了10月份周期股的反弹和11月份的消费类电子行情。但是在12月份受到大盘下跌的影响，基金净值出现了一定的波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为6.14%，同期基金业绩比较基准收益率为5.33%，基金净值跑赢业绩比较基准0.81个百分点。

4.4.3 市场展望和投资策略

展望未来，我们认为经济周期面临的波动比较剧烈，欧债危机、美国通胀预期加强以及全球库存周期等都对中国经济产生较大的影响，而我国的经济转型能否成功也取决于政策能否进一步发挥强有力的作用。从政府看重的GDP季调环比指标来看，我国经济已经出现偏热的现象。从资金面来看，公募基金、阳光私募和券商集合理财的资产规模变化并不大，而市场已经迎来了全流通时代。我们认为一季度股市面临的政策面依然趋于严厉。

基于上述判断，在行业选择上，我们将继续偏于选择受益于全球资金充裕的资源类行业，同时我们也继续在国家经济转型政策扶持的新兴行业中精选板块和个股，并希望从上市公司年报中发掘业绩优良未来成长性较好的品种。

§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	4,726,802,804.99	90.80
	其中：股票	4,726,802,804.99	90.80
2	固定收益投资	100,265,000.00	1.93
	其中：债券	100,265,000.00	1.93
	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	232,124,865.07	4.46
6	其他各项资产	146,628,523.13	2.82
7	合计	5,205,821,193.19	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	317,213,427.29	6.24
B	采掘业	174,581,505.07	3.43
C	制造业	2,439,337,937.83	47.97
C0	食品、饮料	208,299,391.74	4.10
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	14,695,091.04	0.29
C4	石油、化学、塑胶、塑料	496,881,591.96	9.77
C5	电子	195,108,977.62	3.84
C6	金属、非金属	486,920,284.42	9.57
C7	机械、设备、仪表	618,092,944.98	12.15
C8	医药、生物制品	337,762,004.61	6.64
C99	其他制造业	81,577,651.46	1.60
D	电力、煤气及水的生产和供应业	43,553,632.46	0.86
E	建筑业	80,893,667.90	1.59
F	交通运输、仓储业	48,981,000.00	0.96
G	信息技术业	750,382,847.53	14.76
H	批发和零售贸易	225,164,430.02	4.43
I	金融、保险业	101,898,997.38	2.00
J	房地产业	47,593,944.29	0.94
K	社会服务业	75,633,625.00	1.49
L	传播与文化产业	37,363,406.50	0.73
M	综合类	384,204,383.72	7.55
	合计	4,726,802,804.99	92.95

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	600415	小商品城	8,967,122	314,207,954.88	6.18
2	600406	国电南瑞	4,057,107	292,355,130.42	5.75
3	601989	中国重工	15,351,727	180,996,861.33	3.56
4	600585	海螺水泥	4,629,121	137,392,311.28	2.70
5	600518	康美药业	6,000,000	118,260,000.00	2.33
6	002038	双鹭药业	2,001,718	118,101,362.00	2.32
7	000998	隆平高科	3,501,700	114,050,369.00	2.24
8	000012	南玻A	4,899,938	96,773,775.50	1.90
9	600354	敦煌种业	2,599,949	94,378,148.70	1.86
10	000630	铜陵有色	2,617,369	91,738,783.45	1.80

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	100,265,000.00	1.97
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	100,265,000.00	1.97

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	0801035	08央票35	500,000	50,145,000.00	0.99
2	0801029	08央票29	500,000	50,120,000.00	0.99

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 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,726,093.57
2	应收证券清算款	136,036,168.38
3	应收股利	-
4	应收利息	3,623,534.61
5	应收申购款	1,242,726.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	146,628,523.13

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

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	600518	康美药业	118,260,000.00	2.33	配股期间连续停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	6,653,559,816.98
本报告期基金总申购份额	859,564,597.26
减：本报告期基金总赎回份额	977,426,015.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,535,698,398.32

§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15只开放式基金。截至2010年末，海富通管理的公募基金资产规模近472亿元人民币。

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年末，海富通为50多家企业超过136亿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年末，海富通旗下专户理财管理资产规模超过25亿元。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年末，投资咨询业务规模近240亿元人民币，海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2010年11月25日，海富通全资香港子公司——海富通资产管理（香港）有限公司正式开业，注册资本为6000万港元。经监管部门批复，海富通资产管理（香港）有限公司将开展第四类（就证券提供意见）、第九类（提供资产管理）业务。

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股票证券投资基金的文件

（二）海富通股票证券投资基金基金合同

（三）海富通股票证券投资基金招募说明书

（四）海富通股票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）报告期内海富通股票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
二〇一一年一月二十一日

海富通货币市场证券投资基金

2010 第四季度报告

2010年12月31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：二〇一一年一月二十一日

§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2011年1月20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10月1日起至2010年12月31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	6,499,050,219.88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	814,445,461.42份　　5,684,604,758.46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10月1日-2010年12月31日）	
	海富通货币A	海富通货币B
1.本期已实现收益	3,110,832.30	32,458,921.32
2.本期利润	3,110,832.30	32,458,921.32
3.期末基金资产净值	814,445,461.42	5,684,604,758.46

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	0.5972%	0.0074%	0.6156%	0.0003%	-0.0184%	0.0071%

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	0.6576%	0.0074%	0.6156%	0.0003%	0.0420%	0.0071%

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

1、 海富通货币A

（2005年1月4日至2010年12月31日）

2、 海富通货币B

（2006年8月1日至2010年12月31日）

注：1、本基金自同于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	-	7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，目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

根据基金合同，公司旗下海富通货币基金和海富通现金管理工具基金风格相似。本报告期内，两基金净值增长率分别为：海富通货币基金2.75%，海富通现金管理工具基金2.74%，两者净值增长率之差的绝对值为0.01%，低于5%。

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

四季度通货膨胀预期空前高涨，货币政策出击调控，3次上调准备金率，也上调了存贷款利率50点。市场资金面由于准备金上缴空前紧张，在11月、12月底市场资金利率都出现了并喷行情，交易价格不断刷新历史记录。加息的强烈预期以及资金面的紧张局面导致中短期债券包括利率债券和信用债券的急剧下跌。从债券估值来看，市场大致反映了未来还有500bps左右的加息预期。相比较而言，短期利率上升幅度较大，收益率曲线平坦化显示市场对于明年初的资金面预期乐观，对于明年加息的预期保持在500bps。目前信用利差已经略高于历史均值，但由于年底资金面和需求萎缩的因素，信用债券的流动性较差。另外考虑到目前还有加息预期，信用债券的利差保护仍然不足。

海富通货币基金本季度末规模基本稳定，持仓组合优先选择收益比较高的银行存款和回购资产，信用债券、利率债券维持相对稳定。总体的组合久期较低，利率风险较小。

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0.5972%，同期业绩比较基准收益率为0.6156%；B级基金净值收益率为0.6576%，同期业绩比较基准收益率为0.6156%。

4.4.3 市场展望和投资策略

12月份的加息只有50bps显示央行在加息方面仍较为慎重，物价虽然有所回落，但是核心通胀依旧值得关注。我们认为春节前再次加息的可能性较小，并年有望处于政策的相对真空期。2011年货币政策可能以灵活的数量型工具为主，但对于通胀引发加息的担忧仍然会弥漫市场，债市中期压力依然存在。货币基金在2011年初将继续保持低仓位策略，逐步提高信用债比例，选择合适的组合应对市场可能更加紧张的流动性考验。

§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	2,482,727,563.97	37.89
	其中：债券	2,482,727,563.97	37.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,122,912,129.35	32.40
	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	1,926,453,162.65	29.40
4	其他各项资产	20,912,541.30	0.32
5	合计	6,553,005,397.27	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	3.05	
	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	-	-
	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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	146
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

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	54.02	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.48	-
2	30天（含）-60天	9.76	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.06	-
3	60天（含）-90天	6.15	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）-180天	5.75	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.75	-
5	180天（含）-397天（含）	24.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.51	-

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	392,475,163.06	6.04
3	金融债券	550,805,259.25	8.48
	其中：政策性金融债	550,805,259.25	8.48
4	企业债券	538,809,239.74	8.29
5	企业短期融资券	1,000,637,901.92	15.40
6	其他	-	-
7	合计	2,482,727,563.97	38.20
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	538,809,239.74	8.29

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	1001095	10央行票据95	4,000,000	392,475,163.06	6.04
2	060202	06国开02	2,000,000	200,320,897.00	3.08
3	100231	10国开31	2,000,000	199,828,705.63	3.07
4	058031	05中信债1	1,800,000	175,546,629.24	2.70
5	0980147	09中航工债浮	1,600,000	161,216,494.00	2.48
6	068007	06首都机场债	1,400,000	134,134,440.00	2.06
7	1081285	10华证CP01	1,300,000	130,002,378.07	2.00
8	090309	09进出09	1,000,000	100,058,274.28	1.54
9	1081371	10阳煤CP02	800,000	80,079,671.98	1.23
10	1081282	10鲁商CP01	700,000	70,097,639.14	1.08

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	1次
报告期内偏离度的最高值	0.2508%
报告期内偏离度的最低值	-0.1461%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0974%

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	20,912,541.30
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,912,541.30

§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	454,438,711.36	4,773,993,656.08
本报告期基金总申购份额	1,576,330,543.38	6,461,706,054.13
减：本报告期基金总赎回份额	1,216,323,793.32	5,551,094,951.75
本报告期期末基金份额总额	814,445,461.42	5,684,604,758.46

§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15只开放式基金。截至2010年末，海富通管理的公募基金资产规模近472亿元人民币。

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年末，海富通为50多家企业超过136亿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年末，海富通旗下专户理财管理资产规模超过25亿元。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年末，投资咨询业务规模近240亿元人民币，海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2010年11月25日，海富通全资香港子公司——海富通资产管理（香港）有限公司正式开业，注册资本为6000万港元。经监管部门批复，海富通资产管理（香港）有限公司将开展第四类（就证券提供意见）、第九类（提供资产管理）业务。

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
二〇一一年一月二十一日

海富通精选贰号混合型证券投资基金

2010 第四季度报告

2010年12月31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：二〇一一年一月二十一日

§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2011年1月20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10月1日起至2010年12月31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	2,430,391,368.32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x65%+上证国债指数x35%
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（2010年10月1日-2010年12月31日）
1.本期已实现收益	198,998,123.96
2.本期利润	149,140,908.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0505
4.期末基金资产净值	1,798,481,702.29
5.期末基金份额净值	0.740

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	6.63%