海富通精选贰号混合型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:二〇一一年十月二十四日

§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10月21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2011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	2,894,808,703.80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×65%+上证国债指数×35%
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(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-38,534,078.57
2.本期利润	-217,933,964.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0748
4.期末基金资产净值	1,916,179,811.84
5.期末基金份额净值	0.662

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	-10.18%	0.84%	-10.06%	0.86%	-0.12%	-0.02%

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

海富通精选贰号混合型证券投资基金

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

(2007年4月9日至2011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,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,即股票投资50%-80%,债券投资20%-50%,权证投资0-3%;并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。同时满足第14章(七)有关投资组合限制的各项比例要求。

2.本基金历任基金经理为陈洪,任职时间为2007年4月至2007年8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		
丁俊	本基金的基金经理;海富通精选混合基金基金经理	2007-8-6	-	9年	中国国籍,硕士,持有基金从业人员资格证书。2002年7月至2006年4月就职于平安资产管理公司,曾任权益投资部研究主管,2006年4月加入海富通基金管理有限公司,任海富通精选混合基金和海富通风格优势股票基金基金经理助理,2007年8月起任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金基金经理。

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: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,公司旗下精选基金和精选贰号基金投资风格相似。本报告期内,两基金净值增长率分别为:精选基金-11.1%、精选贰号基金-10.18%,两者净值增长率之差的绝对值为0.92%,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运作分析

2011年第三季度在内外部不利因素的共同作用下,A股市场的表现令投资者失望。欧债危机进一步恶化,以及美国经济增长放缓,使得欧美股市出现了大幅波动,而国内通胀居高不下,紧缩调控政策并没有如期放松,存款准备金基数扩大等打击了投资者的热情。在外需减弱,投资放缓,成本上升等各种严峻挑战下,企业盈利也出现了下降。从行业板块表现来看,房地产、钢铁、有色、金融等周期性行业跌幅居前,消费等防御类行业表现略好。

鉴于国内通货膨胀高位徘徊时间超预期且欧债危机迟迟得不到有效解决,2011年第三季度海富通精选贰号基金在资产配置上降低了股票资产配置比例,结构上则减持了部分周期性资产和金融类资产,同时趁着市场系统性风险的释放,加大自下而上选股力度,择机增持符合国家政策支持方向的具备持续增长能力的个股。

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-10.18%,同期业绩比较基准收益率为-10.06%,基金净值跑输业绩比较基准0.12个百分点。跑输业绩基准主要原因为股票资产配置比例高于基准。

4.6 市场展望和投资策略

展望四季度,美国经济在经过数月回落后开始企稳。欧债的风险救助框架正在形成,但其进展较缓,仍有较大不确定性存在。希腊违约问题仍将是短期内扰动市场的重要变量。就国内而言,欧债危机对中国出口的打击可能会和房地产投资滞后性回落出现叠加,导致中国经济在四季度继续下滑。与此同时,由于通胀压力的慢慢减缓,四季度的信贷规模可能会稍有放松。但鉴于CPI仍处高位,政策转向的可能性很小,大幅度的放松概率较低。对于行业而言,由于通胀的缓慢回落,可能会出现量价齐跌的情况,从而促使上市公司盈利预期下滑的担忧继续演绎。因此,四季度股市将依然面临着宏观环境和资金环境偏紧的问题,系统性的投资机会可能不大,但结构性的投资机会依然存在。在板块上我们认为,四季度国家产业政策支持的领域依然有望成为市场的热点,与民生消费相关的行业领域也可能会受到市场的青睐。

基于上述判断,四季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,深入挖掘受益于国家宏观政策扶持,受益于经济转型的板块和公司。同时,努力挖掘业绩较好且有望超预期的个股和一些前期调整幅度较大,业绩较为确定的成长股。

§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	1,237,718,179.66	64.41
	其中:股票	1,237,718,179.66	64.41
2	固定收益投资	435,042,000.00	22.64
	其中:债券	435,042,000.00	22.64
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	174,600,581.90	9.09
	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	61,856,324.64	3.22
6	其他各项资产	12,540,647.60	0.65
7	合计	1,921,757,733.80	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	2,225,552.00	0.12
B	采掘业	37,402,161.36	1.95
C	制造业	489,750,230.26	25.56
C0	食品、饮料	90,622,113.10	4.73
C1	纺织、服装、皮毛	33,285,082.41	1.74
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	146,002,623.29	7.62
C5	电子	7,227,096.50	0.38
C6	金属、非金属	49,426,731.22	2.58
C7	机械、设备、仪表	138,212,453.36	7.21
C8	医药、生物制品	24,974,130.38	1.30
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	61,085,305.69	3.19
F	交通运输、仓储业	49,029,793.71	2.56
G	信息技术业	184,670,947.60	9.64
H	批发和零售贸易	128,045,481.60	6.68
I	金融、保险业	120,590,707.44	6.29
J	房地产业	152,300,000.00	7.95
K	社会服务业	12,618,000.00	0.66
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,237,718,179.66	64.59

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	600406	国电南瑞	4,350,666	152,186,296.68	7.94
2	600016	民生银行	17,999,947	99,359,707.44	5.19
3	601989	中国重工	9,000,000	96,480,000.00	5.04
4	600153	建发股份	10,000,000	74,100,000.00	3.87
5	000002	万 科A	10,000,000	72,400,000.00	3.78
6	600048	保利地产	6,000,000	55,500,000.00	2.90
7	600827	友谊股份	2,953,236	46,070,481.60	2.40
8	600519	贵州茅台	234,700	44,731,473.00	2.33
9	600970	中材国际	1,299,932	30,548,402.00	1.59
10	600309	烟台万华	1,900,000	30,229,000.00	1.58

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	146,700,000.00	7.66
3	金融债券	288,342,000.00	15.05
	其中:政策性金融债	288,342,000.00	15.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	435,042,000.00	22.70

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	1001060	10央票60	1,500,000	146,700,000.00	7.66
2	080213	08国开13	1,000,000	101,100,000.00	5.28
3	110217	11国开17	1,000,000	97,440,000.00	5.09
4	060416	06农发16	500,000	49,950,000.00	2.61
5	110222	11国开22	400,000	39,852,000.00	2.08

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,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	750,000.00
2	应收证券清算款	8,142,816.64
3	应收股利	-
4	应收利息	3,603,109.55
5	应收申购款	44,721.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,540,647.60

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在在流通受限情况。

§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	2,920,954,155.25
本报告期基金总申购份额	34,366,053.37
减:本报告期基金总赎回份额	60,511,504.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,894,808,703.80

§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19只公募基金。截至2011年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过351亿元人民币。

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2011年9月30日,海富通为50多家企业超过150亿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2011年9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近28亿元。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2011年9月30日,投资咨询及海外业务规模达206亿元人民币。

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精选贰号混合型证券投资基金的文件

(二)海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同

(三)海富通精选贰号混合型证券投资基金招募说明书

(四)海富通精选贰号混合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)报告期内海富通精选贰号混合型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
二〇一一年十月二十四日

海富通股票证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:二〇一一年十月二十四日

§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10月21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2011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	6,465,393,690.52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(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-186,868,365.58
2.本期利润	-548,010,710.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0861
4.期末基金资产净值	3,897,814,819.22
5.期末基金份额净值	0.603

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

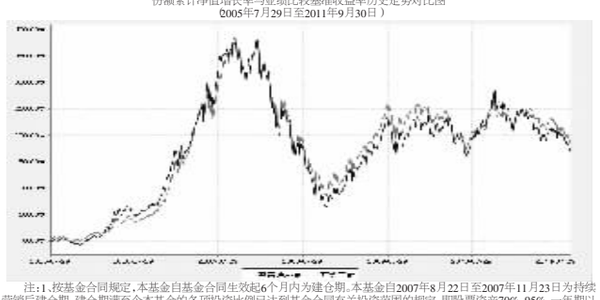
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.23%	1.03%	-12.51%	1.06%	0.28%	-0.03%

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历史走势对比图

(2005年7月29日至2011年9月30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		
陈绍胜	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	-	20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: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运作分析

2011年第三季度在内外部不利因素的共同作用下,A股市场的表现令投资者失望。欧债危机进一步恶化,以及美国经济增长放缓,使得欧美股市出现了大幅波动,而国内通胀居高不下,紧缩调控政策并没有如期放松,存款准备金基数扩大等打击了投资者的热情。在外需减弱,投资放缓,成本上升等各种严峻挑战下,企业盈利也出现了下降。从行业板块表现来看,房地产、钢铁、有色、金融等周期性行业跌幅居前,消费等防御类行业表现略好。

鉴于国内通胀高涨且欧债危机迟迟得不到有效解决,报告期本基金在资产配置上降低了股票资产配置比例,减持了部分周期性资产和中小盘股票类资产,以规避系统风险。

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-12.23%,业绩比较基准的增长率为-12.51%,基金净值跑赢业绩比较基准0.28个百分点。

4.6 市场展望和投资策略

展望四季度,美国经济在经过数月回落后开始企稳。欧债的风险救助框架正在形成,但其进展较缓,仍有较大不确定性存在。希腊违约问题仍将是短期内扰动市场的重要变量。就国内而言,欧债危机对中国出口的打击可能会和房地产投资滞后性回落出现叠加,导致中国经济在四季度继续下滑。与此同时,由于通胀压力的慢慢减缓,四季度的信贷规模可能会稍有放松。但鉴于CPI仍处高位,政策转向的可能性很小,大幅度的放松概率较低。对于行业而言,由于通胀的缓慢回落,可能会出现量价齐跌的情况,从而促使上市公司盈利预期下滑的担忧继续演绎。因此,四季度股市将依然面临着宏观环境和资金环境偏紧的问题,系统性的投资机会可能不大,但结构性的投资机会依然存在。在板块上我们认为,四季度国家产业政策支持的领域依然有望成为市场的热点,与民生消费相关的行业领域也可能会受到市场的青睐。

基于上述判断,四季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,深入挖掘受益于国家宏观政策扶持,受益于经济转型的板块和公司。同时,努力挖掘业绩较好且有望超预期的个股和一些前期调整幅度较大,业绩较为确定的成长股。

§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	2,924,561,651.74	74.73
	其中:股票	2,924,561,651.74	74.73
2	固定收益投资	144,840,000.00	3.70
	其中:债券	144,840,000.00	3.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	708,801,200.00	18.11
	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	127,734,828.06	3.26
6	其他各项资产	7,352,538.97	0.19
7	合计	3,913,290,218.77	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	217,406,271.32	5.58
B	采掘业	57,496,847.85	1.48
C	制造业	1,628,150,707.54	41.77
C0	食品、饮料	513,244,255.03	13.17
C1	纺织、服装、皮毛	21,684,241.80	0.56
C2	木材、家具	7,544,854.68	0.19
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	285,715,740.28	7.33
C5	电子	35,678,972.62	0.92
C6	金属、非金属	48,902,519.92	1.25
C7	机械、设备、仪表	337,449,036.64	8.66
C8	医药、生物制品	345,245,954.09	8.86
C99	其他制造业	32,685,132.48	0.84
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	26,825,433.00	0.69
F	交通运输、仓储业	42,804,200.00	1.10
G	信息技术业	369,063,474.06	9.47
H	批发和零售贸易	305,841,566.46	7.85
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	142,053,598.49	3.64
K	社会服务业	49,019,580.00	1.26
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	85,899,973.02	2.20
	合计	2,924,561,651.74	75.03

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	600406	国电南瑞	8,515,035	297,855,924.30	7.64
2	600519	贵州茅台	1,109,929	211,541,368.11	5.43
3	601989	中国重工	14,211,356	152,345,736.32	3.91
4	000858	五 粮 液	3,427,461	124,416,834.30	3.19
5	600153	建发股份	13,908,862	103,064,667.42	2.64
6	002038	双鹭药业	2,707,377	87,583,645.95	2.25
7	600827	友谊股份	4,962,950	77,422,020.00	1.99
8	600535	天士力	1,837,425	72,872,275.50	1.87
9	002385	大北农	1,627,835	55,818,462.15	1.43
10	600518	康美药业	3,788,972	53,613,953.80	1.38

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	144,840,000.00	3.72
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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	144,840,000.00	3.72

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	1101028	11央票28	1,500,000	144,840,000.00	3.72

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 报告期内中国证监会于2011年4月29日发布《中国证监会行政处罚决定书(五粮液、唐桥等8名责任人员)》,五粮液000858因其信息披露违法问题被中国证监会给予警告并处以60万元罚款。

对该股票投资决策程序的说明:该股票根据股票池审批流程后进入本基金备选库,根据核心股票池审批流程后进入本基金管理人核心股票池,由研究员定期跟踪并分析。《中国证监会行政处罚决定书(五粮液、唐桥等8名责任人员)》公布后,本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和分析,认为此事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对该上市公司的投资判断。

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。

5.8.2 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	3,567,662.09
2	应收证券清算款	1,304,145.61
3	应收股利	-
4	应收利息	2,307,952.56
5	应收申购款	172,778.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,352,538.97

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在在流通受限情况。

§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	5,993,106,193.56
本报告期基金总申购份额	604,793,759.13
减:本报告期基金总赎回份额	132,506,262.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,465,393,690.52

§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19只公募基金。截至2011年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过351亿元人民币。

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2011年9月30日,海富通为50多家企业超过150亿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2011年9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近28亿元。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2011年9月30日,投资咨询及海外业务规模达206亿元人民币。

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
二〇一一年十月二十四日

海富通精选证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十四日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月21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2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通精选混合
基金主代码	519011
交易代码	519011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月22日
报告期末基金份额总额	13,511,818,301.24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×65%+上证国债指数×35%
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。本基金力争通过适度主动的资产配置和积极主动的精选证券,识别和控制风险,实现风险限度内的超额回报。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-227,574,431.20
2.本期利润	-1,197,162,499.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0889
4.期末基金资产净值	9,587,781,255.41
5.期末基金份额净值	0.7096

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