

海富通大中华精选股票型证券投资基金

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

Table with 2 columns: 基金名称, 海富通大中华股票(QDII); 基金代码, S19602; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2011年1月27日; 报告期末基金份额总额, 108,526,059.94份; 投资目标, 本基金主要通过投资于在海外证券市场交易的大中华公司的优质股票,追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增长。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 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, -11,825,413.10; 2.本期利润, -29,525,079.79; 3.加权平均基金份额本期利润, -0.2680; 4.期末基金资产净值, 76,483,733.83; 5.期末基金份额净值, 0.705

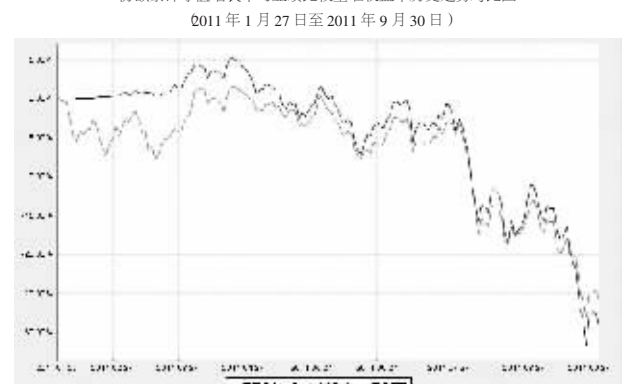
注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

Table with 6 columns: 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, -27.62%, 2.16%, -22.94%, 1.84%, -4.68%, 0.32%

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

海富通大中华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 2011年1月27日至2011年9月30日



- 注:1.本基金合同于2011年1月27日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年;
2.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条(三)投资范围、(九)投资限制中规定的各项比例;
3.本基金按照全球投资表现标准 CIPS 计算和表述投资业绩。

§4 管理人报告

4.1 基金经理 钱基经小组 简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 杨皓, 本基金的基金经理, 2011-1-27, 14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。

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 境外投资顾问向本基金提供投资建议的主要成员简介
本基金无境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵守内外部法律法规情况
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、勤勉尽责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 本基金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
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业绩表现说明
4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析
自8月起受到欧元区一些国家主权信用评级被下调,流动性收紧,美国宏观数据疲弱,中国的通胀仍在高位徘徊导致宏观政策维持收紧,经济继续缓慢减速,全球股市在8月初快速大跌。同期香港房地产市场面临跌价的风险,台湾开放自由化初期的大陆游客人数低于预期。进入9月,欧洲主权债务危机仍未决,银行间资金更为紧张,导致外资从新兴市场大量流出,整个9月份新兴市场股市一路下滑,损失惨重。整个三季度,发达市场股市表现好于新兴市场股市,新兴市场股市表现和大中华公司股票相同。大中华股票中的中国股票表现最差。

报告期内,本基金仓位基本稳定,寻机增加了能源、信息技术和消费品行业的配置,减持了金融、原材料和工业行业的配置。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内,本基金净值增长率为-27.62%,同期业绩比较基准收益率为-22.94%,基金净值跑输业绩比较基准4.68个百分点。主要是9月份的下跌中,基金的资产配置偏激进使得表现明显逊于基准。

4.5.3 市场展望和投资策略
展望二零一一年第四季度,欧洲主权债务危机有望缓和,发达国家和新兴市场国家的经济增长将在减速中缓慢企稳,中国通胀水平将回落,发达经济体的宽松货币政策将基本维持,新兴市场经济体适度的收紧政策也将告一段落。全球股市,尤其是新兴市场股市,估值处于很低水平。台湾地区领导人明年年初的选举之前的市场机遇,两岸三地的经济和金融合作将加深入都将提供相关的投资机会。

对于二零一一年第四季度的市场判断,我们持谨慎乐观的态度。如果欧债问题得到明确救助方案的支持,股市可有回暖的机会。在投资上我们将灵活应对经济形势和市场的变化,坚持深入

挖掘前期跌幅较大的,受益于中国内需拉动和经济转型、两岸三地经济加速融合的行业和公司,更强调结构性的机会和个股的基本面研究。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产的比例(%) ; 1 权益投资, 66,607,365.99, 85.97; 2 其中:普通股, 66,607,365.99, 85.97; 3 固定收益投资, -; 4 其中:债券, -; 5 资产支持证券, -; 6 金融衍生品投资, -; 7 其他各项资产, 9,003,224.53, 11.62; 8 合计, 77,472,976.37, 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

Table with 3 columns: 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, 39,636,659.93, 51.82; 中国台湾, 21,054,739.00, 27.53; 美国, 5,915,967.06, 7.73; 合计, 66,607,365.99, 87.09

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

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币元), 占基金资产净值比例(%) ; 能源, 7,656,919.80, 10.01; 原材料, 5,274,331.46, 6.90; 非日常生活消费品, 12,661,819.12, 16.55; 日常消费品, 3,694,328.24, 4.83; 医疗保健, 603,388.60, 0.79; 金融, 10,135,246.87, 13.25; 信息技术, 26,581,331.90, 34.75; 合计, 66,607,365.99, 87.09

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

Table with 8 columns: 序号, 证券代码, 公司名称(英文), 公司名称(中文), 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 SINA UW SINA CORP 新浪公司 纳斯达克交易市场 美国 13,000 5,915,967.06 7.73; 2 2903 TT FAB EASTERN DEPARTMENT STORE 远东百货 台湾交易所 中国台湾 494,600 4,144,662.87 5.42; 3 6121 TT SIMPO TECHNOLOGY CO LTD 新普科技 台湾交易所 中国台湾 100,000 3,971,037.84 5.19; 4 1928 HK Sanki China Ltd. 金沙中国有限公司 中国香港 250,000 3,799,717.40 4.97; 5 2474 TT CATCHER TECHNOLOGY CO LTD 可成科技 台湾交易所 中国台湾 100,000 3,731,316.39 4.88; 6 168 HK Tsingtao Brewery Company Limited 青岛啤酒股份有限公司 香港证券交易所 中国香港 105,000 3,694,328.24 4.83; 7 763 HK ZTE CORPORATION 中兴通讯股份有限公司 中国香港 200,000 3,652,947.20 4.78; 8 338 HK Sinopec Shanghai Petrochemical Company Limited 中国石化上海石油化工有限公司 中国香港 1,571,700 3,601,151.18 4.71; 9 700 HK Tencent Holdings Limited 腾讯控股有限公司 中国香港 26,000 3,481,062.99 4.55; 10 16 HK SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED 新鸿基地产发展有限公司 中国香港 45,000 3,318,841.15 4.34

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。

5.7 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序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人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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(人民币元); 1 存出保证金, 1,680,395.19; 2 应收证券清算款, 173,722.66; 3 应收利息, 250.93; 4 其他应收款, 38,017.07; 5 待摊费用, -; 6 其他, -; 7 合计, 1,862,385.85

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

Table with 2 columns: 项目, 单位:份; 本报告期初基金份额总额, 114,181,769.20; 本报告期基金总申购款, 8,719,134.75; 减:本报告期基金总赎回款, 14,374,844.10; 本报告期基金净变动份额, -5,655,709.15; 本报告期末基金份额总额, 108,526,059.94

§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,是中国首批批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公司,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。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履行其社会责任。公司于2008年启动“绿色与希望—撒钱公益环保计划”,针对汶川地震受灾学校、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念。

§8 备查文件目录

- (一)中国证监会核准设立海富通大中华精选股票型证券投资基金的文件
(二)海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同
(三)海富通大中华精选股票型证券投资基金招募说明书
(四)海富通大中华精选股票型证券投资基金托管协议
(五)中国证监会核准设立海富通基金管理有限公司的文件
(六)报告期内海富通大中华精选股票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

海富通风格优势股票型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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

Table with 2 columns: 基金名称, 海富通风格优势股票; 基金代码, S19013; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2006年10月19日; 报告期末基金份额总额, 4,447,825,062.09份; 投资目标, 在有效控制风险并保持资产良好流动性的前提下,通过积极选择不同风格优势的股票,力争为投资者提供长期稳定的超额回报。

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 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, -125,726,761.61; 2.本期利润, -578,493,179.10; 3.加权平均基金份额本期利润, -0.1195; 4.期末基金资产净值, 3,777,273,892.47; 5.期末基金份额净值, 0.849

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。

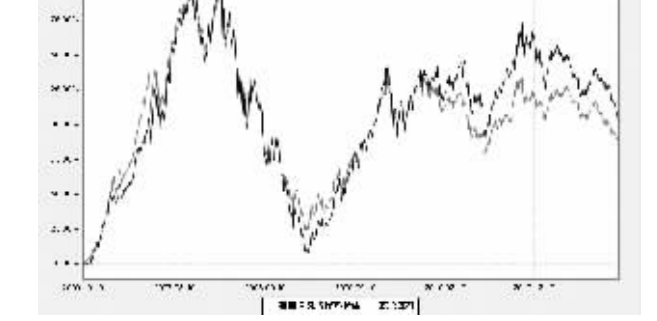
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 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

Table with 6 columns: 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, -12.74%, 1.05%, -11.70%, 0.99%, -1.04%, 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

海富通风格优势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 2006年10月19日至2011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,即2006年10月19日至2007年4月18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)、(六)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

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明; 钱基经, 本基金的基金经理, 2011-4-21, 16年, 中国籍,硕士,CFA,历任申银万国证券股份有限公司分析师,申万慧源基金管理有限公司基金经理,2004年8月加入海富通基金管理有限公司,任策略分析师,研究总监,2009年1月至2011年4月任海富通收益增长混合基金经理,2009年10月起任海富通中证100指数(LOF)基金经理,2011年4月起兼任海富通风格优势股票基金经理。

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 管理人报告期内本基金运作遵守内外部法律法规情况
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、勤勉尽责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 本基金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
本基金报告期内,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年第二季度在内外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,存款准备金率调升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良好。

报告期内本基金总体上降低了股票仓位,并在持仓结构上作了相应的调整,主要减持了银行、建材、化工以及钢铁等传统行业,增持了消费类以及成长型小盘股,但由于总体仓位仍然偏高,净值表现带来了负面影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内基金净值增长率为-12.74%,业绩比较基准的增长率为-11.70%,基金净值跑输业绩比较基准1.04个百分点,跑输基准的主要原因系本基金重仓的消费类股以及小盘股在9月份跌幅较大。

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将开始企稳。欧债的风险救助框架正在形成,但其进展较慢,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缓解,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,由于通胀的慢慢回落,可能会出现量价齐跌的情况,从而促使上市公司盈利预期的担忧继续发酵。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受到市场的青睐。

基于上述判断,四季度我们将继续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、业绩较好的成长股。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%) ; 1 权益投资, 3,101,183,898.42, 77.93; 2 其中:股票, 3,101,183,898.42, 77.93; 3 固定收益投资, 471,609,876.80, 11.85; 4 其中:债券, 471,609,876.80, 11.85; 5 资产支持证券, -; 6 金融衍生品投资, -; 7 买入返售金融资产, 198,000,417.00, 4.98; 8 其中:买断式回购的买入返售金融资产, -; 9 银行存款和结算备付金合计, 133,256,707.40, 3.35; 10 其他各项资产, 75,396,711.44, 1.89; 11 合计, 3,979,447,611.06, 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例; A 农林、牧、业, 31,848,244.36, 0.84; B 采掘业, 62,289,830.19, 1.65; C 制造业, 1,615,189,074.20, 42.76; D 食品、饮料, 371,970,245.10, 9.85; E 纺织、服装、皮毛, 102,970,372.44, 2.73; F 木材、家具, 788,452.00, 0.02; G 造纸、印刷, 26,733,687.49, 0.71; H 石油、化学、塑胶、塑料, 317,041,991.58, 8.39; I 电子, 70,128,706.98, 1.86; J 金属、非金属, -; K 机械、设备、仪表, 480,970,952.95, 12.73; L 医药、生物制品, 209,589,901.56, 5.55; M 其他制造业, 34,894,764.10, 0.92; N 电力、煤气及水的生产和供应业, -; O 建筑业, 94,485,384.73, 2.50; P 交通运输、仓储业, 130,792,243.89, 3.46; Q 信息技术业, 333,391,267.88, 8.83; R 批发和零售贸易, 353,585,541.60, 9.36; S 金融、保险业, 99,578,132.99, 2.64; T 房地产业, 232,281,294.81, 6.15; U 社会服务业, 78,607,289.22, 2.08; V 传播与文化业, -; W 综合类, 69,135,594.55, 1.83; 合计, 3,101,183,898.42, 82.10

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

Table with 5 columns: 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 600006 国电南瑞, 8,000,000, 279,840,000.00, 7.41; 2 600153 建发股份, 27,885,242, 206,629,643.22, 5.47; 3 600519 贵州茅台, 900,000, 171,531,000.00, 4.54; 4 601989 中国重工, 9,591,542, 102,821,320.24, 2.72; 5 000538 云南白药, 1,699,923, 96,045,649.50, 2.54; 6 601333 广深铁路, 26,001,126, 83,463,614.46, 2.21; 7 600760 中航复豹, 8,853,053, 82,311,478.27, 2.18; 8 002595 豪迈科技, 3,275,067, 79,514,128.10, 2.11; 9 600882 天地科技, 4,138,808, 77,147,381.12, 2.04; 10 000858 五粮液, 2,004,940, 72,779,322.00, 1.93

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 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, 48,280,000.00, 1.28; 3 金融债券, 149,865,000.00, 3.97; 4 其中:政策性金融债, 149,865,000.00, 3.97; 5 企业债券, -; 6 企业短期融资券, -; 7 中期票据, -; 8 可转债, 273,464,876.80, 7.24; 9 其他, -; 10 合计, 471,609,876.80, 12.49

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 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 113002 工行转债, 2,682,080, 273,464,876.80, 7.24; 2 100310 10进出10, 1,000,000, 99,920,000.00, 2.65; 3 100231 10国开31, 500,000, 49,945,000.00, 1.32; 4 1101028 11央行票据28, 500,000, 48,280,000.00, 1.28

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8.1 报告期内中国证监于2011年4月29日发布《中国证监会行政处罚决定书(伍粮液、唐桥等8名责任人)》,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:该股票根据股票审批流程后进入本基金备选库,根据核心股票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(伍粮液、唐桥等8名责任人)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。

其余九名责任人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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元); 1 存出保证金, 5,097,790.06; 2 应收证券清算款, 65,237,486.60; 3 应收利息, -; 4 应收股利, 4,673,401.40; 5 应收申购款, 388,035.12; 6 其他应收款, -; 7 待摊费用, -; 8 其他, -; 9 合计, 75,396,711.44

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细