海富通精选贰号混合型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011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:二〇一二年一月二十日

§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2012年1月19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10月1日起至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	2,866,147,159.24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(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-115,748,030.05
2.本期利润	-114,796,470.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0399
4.期末基金资产净值	1,782,402,580.60
5.期末基金份额净值	0.622

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

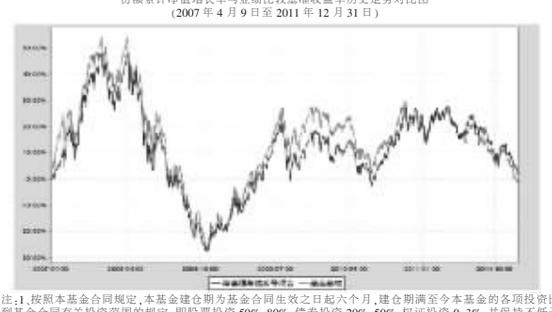
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.04%	0.93%	-6.08%	0.93%	0.04%	0.00%

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12月31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。本报告期,公司根据《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,对公司的公平交易制度进行了更新,完善现有的业务流程,改进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-6.95%,精选贰号基金-6.04%,两者净值增长率之差的绝对值为0.91%,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

进入2011年第四季度,在汇金增持四大行等利好作用下,A股市场在十月底迎来了一波反弹,但之后却出现了近两个月的下跌,国内经济转型艰难、欧债危机不断升级、金融体系流动性下降、宏观政策缺乏实质性放松,造成了市场逐级下探的走势。行业方面,有色金属、化工、采掘等跌幅居前,而金融、食品饮料等表现稍好。风格方面,大盘股表现优于小盘股。

虽然在四季度通货膨胀高位回落,但经济也随之呈现下滑趋势,且由于经济放缓程度在政府预料之内故市场预期的政策性放松迟迟未能兑现,但很多上市公司在估值上已经具有一定的吸引力,报告期本基金不仅小幅提高了股票配置比重,而且在资产配置上进行了结构调整,减持了周期性资产和大部分中小盘股票类资产,提高了大金融的配置比例。

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-6.04%,同期业绩比较基准收益率为-6.08%,基金净值跑赢业绩比较基准0.04个百分点。

4.6 市场展望和投资策略

展望未来,我们认为美国经济将继续复苏企稳,而欧元区由于高企的债务负担率和一些难以迅速扭转的结构性因素,其面临的债务问题难以在中短期内彻底解决,前景仍不容乐观。与此同时,国内的宏观经济形势也较为复杂。受房地产投资回落和出口增速减缓影响,经济增速将继续放缓。但随着通胀压力的减缓和经济增速下滑风险的显现,财政政策可能会略微积极,总体稳健和定向宽松仍将成为货币政策的主基调。就市场而言,A股市场在经历了前期连续调整后,整体估值已逐步趋于合理,市场恐慌情绪在一定程度上也得到了释放,但是我们仍然需要耐心等待政策给出的积极信号。行业上,受益于宏观政策扶持的农业、水利、大消费、技术创新和节能环保等或将值得关注。

§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	1,131,322,073.28	62.86
	其中:股票	1,131,322,073.28	62.86
2	固定收益投资	431,142,000.00	23.96
	其中:债券	431,142,000.00	23.96
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,880,351.32	5.61
	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	129,978,382.13	7.22
6	其他各项资产	6,387,890.68	0.35
7	合计	1,799,710,697.41	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	53,598,943.30	3.01
B	采掘业	14,359,411.24	0.81
C	制造业	340,216,783.32	19.09
C0	食品、饮料	78,761,648.13	4.42
C1	纺织、服装、皮毛	11,039,616.10	0.62
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	35,502,239.66	1.99
C5	电子	79,587,337.08	4.47
C6	金属、非金属	6,558,786.40	0.37
C7	机械、设备、仪表	85,954,139.54	4.82
C8	医药、生物制品	42,813,016.41	2.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	39,092,477.05	2.19
E	建筑业	11,448,328.35	0.64
F	交通运输、仓储业	42,255,044.48	2.37
G	信息技术业	218,112,680.49	12.24
H	批发和零售贸易	107,222,105.92	6.02
I	金融、保险业	162,727,406.10	9.13
J	房地产业	130,888,499.73	7.34
K	社会服务业	11,400,393.30	0.64
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,131,322,073.28	63.47

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	135,740,779.20	7.62
2	600016	民生银行	17,999,947	106,019,687.83	5.95
3	600153	建发股份	12,255,770	78,191,812.60	4.39
4	601989	中国重工	14,400,000	73,584,000.00	4.13
5	000002	万科A	9,489,759	70,888,499.73	3.98
6	600048	保利地产	6,000,000	60,000,000.00	3.37
7	600519	贵州茅台	249,927	48,310,889.10	2.71
8	601333	广深铁路	12,004,274	42,255,044.48	2.37
9	002236	大华股份	750,851	37,242,209.60	2.09
10	600015	华夏银行	3,000,099	33,691,111.77	1.89

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	187,740,000.00	10.53
3	金融债券	243,402,000.00	13.66
	其中:政策性金融债	243,402,000.00	13.66
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	431,142,000.00	24.19

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	148,140,000.00	8.31
2	080213	08国开13	1,000,000	102,090,000.00	5.73
3	110217	11国开17	1,000,000	101,340,000.00	5.69
4	110222	11国开22	400,000	39,972,000.00	2.24
5	1001037	10央票37	400,000	39,600,000.00	2.22

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	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,624,249.56
5	应收申购款	13,641.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,387,890.68

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

本报告期期初基金份额总额	2,894,808,703.80
本报告期基金总申购份额	6,137,571.70
减:本报告期基金总赎回份额	34,799,116.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,866,147,159.24

§7 影响投资者决策的其他重要信息

从2003年8月开始,海富通先后募集成立了20只公募基金,截至2011年12月31日,海富通管理的公募基金资产规模近325亿元人民币。

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12月31日,海富通为50多家企业近160亿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12月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模达28亿元。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。

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12月31日,投资咨询及海外业务规模近200亿元人民币。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,准许在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。

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。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
二〇一二年一月二十日

海富通股票证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011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:二〇一二年一月二十日

§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2012年1月19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10月1日起至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	6,388,497,190.05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10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-282,608,896.07
2.本期利润	-327,154,810.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0509
4.期末基金资产净值	3,524,703,395.92
5.期末基金份额净值	0.552

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

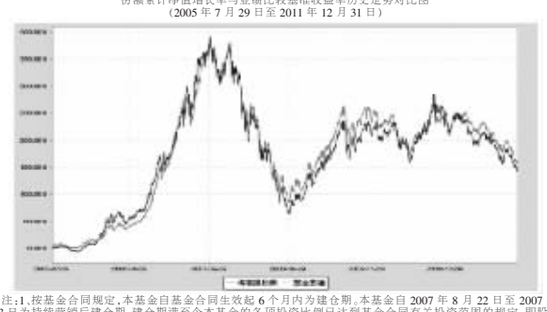
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.46%	1.24%	-7.77%	1.15%	-0.69%	0.09%

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。历任香港英监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。本报告期,公司根据《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,对公司的公平交易制度进行了更新,完善现有的业务流程,改进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

进入2011年第四季度,在汇金增持四大行等利好作用下,A股市场在十月底迎来了一波反弹,但之后却出现了近两个月的下跌,国内经济转型艰难、欧债危机不断升级、金融体系流动性下降、宏观政策缺乏实质性放松,造成了市场逐级下探的走势。行业方面,有色金属、化工、采掘等跌幅居前,而金融、食品饮料等表现稍好。风格方面,大盘股表现优于小盘股。

虽然在四季度通货膨胀高位回落,但经济也随之呈现下滑趋势,且由于经济放缓程度在政府预料之内,故市场预期的政策性放松迟迟未能兑现,但很多上市公司在估值上已经具有一定的吸引力,报告期本基金不仅小幅提高了股票配置比重,而且在资产配置上进行了结构调整,减持了周期性资产和大部分中小盘股票类资产,提高了大金融的配置比例。

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-8.46%,业绩比较基准的增长率为-7.77%,基金净值跑输业绩比较基准0.69个百分点,跑输基准的主要原因是资产配置在结构上存在不尽合理的现象。

4.6 市场展望和投资策略

展望未来,我们认为美国经济将继续复苏企稳,而欧元区由于高企的债务负担率和一些难以迅速扭转的结构性因素,其面临的债务问题难以在中短期内彻底解决,前景仍不容乐观。与此同时,国内的宏观经济形势也较为复杂。受房地产投资回落和出口增速减缓影响,经济增速将继续放缓。但随着通胀压力的减缓和经济增速下滑风险的显现,财政政策可能会略微积极,总体稳健和定向宽松仍将成为货币政策的主基调。就市场而言,A股市场在经历了前期连续调整后,整体估值已逐步趋于合理,市场恐慌情绪在一定程度上也得到了释放,但是我们仍然需要耐心等待政策给出的积极信号。行业上,受益于中国宏观政策扶持的农业、水利、大消费、技术创新和节能环保等或将值得关注。

基于上述判断,在2012年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产业政策扶持、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。另外,我们对大股东增持个股也给予一定关注。

§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	2,766,786,826.27	77.10
	其中:股票	2,766,786,826.27	77.10
2	固定收益投资	193,410,000.00	5.39
	其中:债券	193,410,000.00	5.39
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	400,610,800.92	11.16
	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	208,865,469.98	5.82
6	其他各项资产	19,055,096.10	0.53
7	合计	3,588,728,193.27	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	137,125,213.69	3.89
B	采掘业	17,154,274.50	0.49
C	制造业	891,003,233.28	25.28
C0	食品、饮料	35,662,720.16	1.01
C1	纺织、服装、皮毛	8,129,034.44	0.23
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	166,834,652.49	4.73
C5	电子	91,305,730.05	2.59
C6	金属、非金属	37,027,493.60	1.05
C7	机械、设备、仪表	281,053,958.50	7.97
C8	医药、生物制品	229,093,562.54	6.50
C99	其他制造业	41,896,081.50	1.19
D	电力、煤气及水的生产和供应业	93,852,987.43	2.66
E	建筑业	67,288,785.62	1.91
F	交通运输、仓储业	192,048,796.04	5.45
G	信息技术业	419,941,654.04	11.91
H	批发和零售贸易	209,146,778.19	5.93
I	金融、保险业	210,463,392.17	5.97
J	房地产业	328,446,439.59	9.32
K	社会服务业	44,612,714.59	1.27
L	传播与文化产业	155,702,557.13	4.42
M	综合类	-	-
	合计	2,766,786,826.27	78.50

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	8,433,562	263,127,134.40	7.47
2	600048	保利地产	15,022,839	150,228,390.00	4.26
3	601333	广深铁路	35,224,862	123,991,514.24	3.52
4	601398	工商银行	21,379,921	90,650,865.04	2.57
5	601989	中国重工	16,723,889	85,459,072.79	2.42
6	002038	双鹭药业	2,398,400	78,787,440.00	2.24
7	600637	百视通	4,709,806	70,882,580.30	2.01
8	600535	天士力	1,652,072	69,287,899.68	1.97
9	600036	招商银行	5,771,042	68,502,268.54	1.94
10	002041	登海种业	2,387,429	68,328,217.98	1.94

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	193,410,000.00	5.49
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	193,410,000.00	5.49

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	145,095,000.00	4.12
2	1101088	11央票88	500,000	48,315,000.00	1.37

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	3,612,937.82
2	应收证券清算款	11,663,026.84
3	应收股利	-
4	应收利息	3,629,951.86
5	应收申购款	149,179.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,055,096.10

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

本报告期期初基金份额总额	6,465,393,690.52
本报告期基金总申购份额	16,807,157.37
减:本报告期基金总赎回份额	93,703,657.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	6,388,497,190.05

§7 影响投资者决策的其他重要信息

从2003年8月开始,海富通先后募集成立了20只公募基金,截至2011年12月31日,海富通管理的公募基金资产规模近325亿元人民币。

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12月31日,海富通为50多家企业近160亿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12月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模达28亿元,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。

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12月31日,投资咨询及海外业务规模近200亿元人民币。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,准许在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。

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。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
二〇一二年一月二十日

海富通大中华精选股票型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011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:二〇一二年一月二十日

§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2012年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通大中华股票(QDII)
基金主代码	519602
交易代码	519602
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	105,397,663.08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、持续增值。
投资策略	本基金通过对全球宏观经济和大中华地区区域经济的基本面分析,采用自上而下的策略对资产进行有效资产配置;对股票的选择采用自下而上的"三站式"精选策略,挖掘定价合理、具备竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	MSCI金龙净总收益指数
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于高预期风险、高预期收益的投资品种。其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金。同时,本基金投资的目标市场是海外市场,除了需要承担市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。
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
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)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10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-6,601,687.96
2.本期利润	206,726.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0019
4.期末基金资产净值	74,365,668.49
5.期末基金份额净值	0.706

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 |