海富通货币市场证券投资基金

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	2,970,685,377.29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	759,029,037.90份	2,211,656,339.39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(2011年10月1日-2011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	10,474,823.20	28,584,607.06
2.本期利润	10,474,823.20	28,584,607.06
3.期末基金资产净值	759,029,037.90	2,211,656,339.39

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②表中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
过去三个月	1.1136%	0.0029%	0.8709%	0.0000%	0.2427%	0.0029%

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
过去三个月	1.1748%	0.0029%	0.8709%	0.0000%	0.3039%	0.0029%

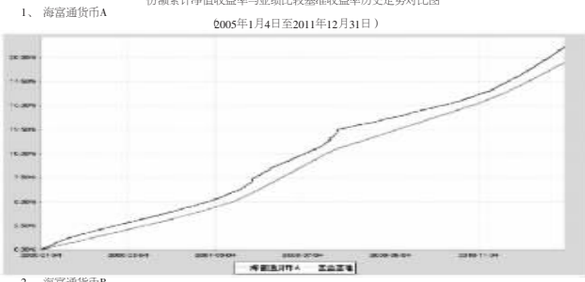
注:本基金收益分配按月结转份额。

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

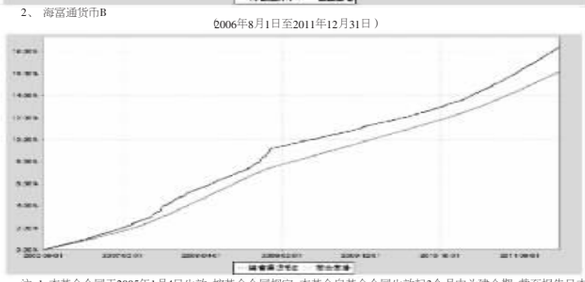
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年1月4日至2011年12月31日)



2、海富通货币B

(2006年8月1日至2011年12月31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;海富通稳进增利分级债券基金基金经理	2008-2-14	-	9年	经济学学士学位,2002年7月至2004年7月就职于南京银行投份有限公司,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2月起任海富通货币基金基金经理。2011年9月起兼任海富通稳进增利分级债券基金基金经理。

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。

3、张丽洁女士自2011年12月15日开始休假。张丽洁女士休假期间,我公司基金经理邵佳民先生暂代管理本基金。该事项2011年12月12日在指定媒体公开披露。

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。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

消费物价指数(CPI)在到达7月份的高点后,在2011年第四季度出现较为明显的下降,跌到6%和5%以下,对市场信心起到了增强的作用。债券市场在10月份开始反映基本面的变化,出现上涨。国债等政府类债券,以及高信用等级债券的上涨幅度较为明显,十年期国债的收益率下降了50个基点以上。低信用等级债券的表现缺乏持续性,无论是持续不断的发行,还是投资者对信用市场的担心,都相约了低信用等级债券的收益率下降。十一月底中央银行宣布下调存款准备金率,货币政策转向的意图更明显。

货币市场利率在整个四季度保持较高水平,主要原因是:银行有较大的吸收存款压力;中央银行的基础货币释放未完全满足市场的需求;各种直接融资活动保持在较高频率;节假日因素等。因此四季度有利于货币市场基金的收益率保持在相对高水平。

基金在四季度加大存款的投资力度,使资产继续保持高流动性,同时通过回购市场增加收益。组合平均剩余期限保持在较低水平。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,本基金提前结束多笔存款合约,该投资行为不存在任何利息损失。

4.5 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1.1136%,同期业绩比较基准收益率为0.8709%;B级基金净值收益率为1.1748%,同期业绩比较基准收益率为0.8709%。

4.6 市场展望和投资策略

本基金认为,2012年第一季度的债券市场可以看好。主要原因是,物价水平出现趋势性的下降,即使将来有所反复,但上半年的下降是可以预期的,从而解除了基本面方面的担心;存款准备金率相信会继续下降,资金面能够相对宽松;而随着实体经济的下行,更多的资金将有避险需求,从而有利于高信用等级债券的表现。不利因素有:我们认为2012年债券供给仍然较多;银行吸收存款的动力较强,从而抬高收益率水平;信用事件仍将制约低信用等级债券;通货膨胀的威胁未能消除;等等。但基于对经济下行的判断,各种投资机会的减少,投资债券仍具有吸引力。

货币市场收益率水平可能保持在较高水平,有利于货币市场基金的表现。

基金管理人将把高信用等级短期限的信用债作为投资重点,保持对存款的投资力度,时刻注意保持资产的流动性和安全性。

§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	1,326,827,910.17	44.44
	其中:债券	1,326,827,910.17	44.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,440,195.66	1.69
	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	1,578,600,915.60	52.87
4	其他各项资产	29,989,648.37	1.00
5	合计	2,985,858,669.80	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	4.28
	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银行间市场交易日融资余额占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	66
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

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	18.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.46	-
2	30天(含)-60天	37.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.63	-
3	60天(含)-90天	17.84	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	25.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.93	-
5	180天(含)-397天(含)	0.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.50	-

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	149,954,353.79	5.05
	其中:政策性金融债	149,954,353.79	5.05
4	企业债券	446,326,830.52	15.02
5	企业短期融资券	730,546,725.86	24.59
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,326,827,910.17	44.66
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	446,326,830.52	15.02

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	058031	05中信债1	1,800,000	176,800,430.69	5.95
2	0980147	09中航工债浮	1,600,000	162,111,680.80	5.46
3	1181252	11浙商集CP01	1,500,000	150,110,644.03	5.05
4	110222	11国开22	1,500,000	149,954,353.79	5.05
5	1181084	11浙小商CP01	1,000,000	100,039,197.42	3.37
6	1181249	11神火CP01	800,000	80,062,596.00	2.70
7	068007	06首都机场债	800,000	78,234,628.91	2.63
8	1181067	11悦达CP01	700,000	70,044,199.41	2.36
9	1181054	11海航商CP01	600,000	60,041,279.40	2.02
10	1181070	11玉柴CP01	500,000	50,034,345.95	1.68

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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1463%
报告期内偏离度的最低值	-0.1200%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0830%

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	29,989,048.37
4	应收申购款	600.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,989,648.37

§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	1,007,314,996.38	2,668,486,660.26
本报告期基金总申购份额	1,380,749,619.83	2,256,614,809.68
减:本报告期基金总赎回份额	1,629,035,578.31	2,713,445,130.55
本报告期期末基金份额总额	759,029,037.90	2,211,656,339.39

§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-橄榄校公益环保计划",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
二〇一二年一月二十日

海富通精选证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	13,476,623,864.16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程度适中的品种。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10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-549,763,862.69
2.本期利润	-652,781,007.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0487
4.期末基金资产净值	8,898,453,606.67
5.期末基金份额净值	0.6603

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表中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

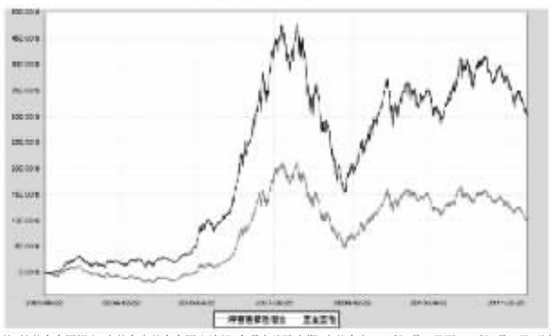
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.95%	0.98%	-6.08%	0.93%	-0.87%	0.05%

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

(2003年8月22日至2011年12月31日)



注: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6月28日至2007年9月29日,为持续营销后建仓期。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十八条(三)、(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

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		
陈洪	本基金的基金经理;副总经理;投资总监	2003-8-22	-	19年	中国国籍,硕士,持有基金从业人员资格证书。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选混合基金基金经理,2005年7月至2006年9月任海富通股票基金基金经理,2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金基金经理,2006年5月起,任海富通基金管理有限公司副总经理,2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金基金经理,2007年4月至2007年8月任海富通精选贰号混合基金基金经理,2008年6月至2011年2月任海富通中国海外股票(QDII)基金基金经理。
丁俊	本基金的基金经理;海富通精选贰号混合基金基金经理	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3月至今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、食品饮料等表现相好。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-8.25%,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0.48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	5,917,521,716.09	66.18
	其中:股票	5,917,521,716.09	66.18
2	固定收益投资	2,171,173,492.00	24.28
	其中:债券	2,171,173,492.00	24.28
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	553,191,669.80	6.19
	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	209,693,508.66	2.35
6	其他各项资产	89,764,916.30	1.00
7	合计	8,941,345,302.85	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	341,687,836.29	3.84
B	采掘业	71,801,665.76	0.81
C	制造业	1,621,587,991.32	18.22
C0	食品、饮料	412,262,047.40	4.63
C1	纺织、服装、皮毛	18,708,106.45	0.21
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	256,925,948.43	2.89
C5	电子	414,659,571.92	4.66
C6	金属、非金属	32,815,842.40	0.37
C7	机械、设备、仪表	448,806,769.42	5.04
C8	医药、生物制品	37,409,705.30	0.42
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	194,541,769.86	2.19
E	建筑业	74,129,018.28	0.83
F	交通运输、仓储业	306,491,662.08	3.44
G	信息技术业	1,163,200,008.71	13.07
H	批发和零售贸易	508,742,577.52	5.72
I	金融、保险业	682,614,126.26	7.67
J	房地产业	673,503,464.38	7.57
K	社会服务业	279,221,595.63	3.14
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	5,917,521,716.09	66.50

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	600016	民生银行	96,000,028	565,440,164.92	6.35
2	600406	国电南瑞	18,000,761	561,623,743.20	6.31
3	601989	中国重工	80,000,722	408,803,689.42	4.59
4	000002	万科A	50,000,354	373,502,644.38	4.20
5	600153	建发股份	50,000,404	319,002,577.52	3.58
6	600048	保利地产	30,000,082	300,000,820.00	3.37
7	600519	贵州茅台	1,200,000	231,960,000.00	2.61
8	601333	广深铁路	56,000,003	197,120,010.56	2.22
9	002236	大华股份	3,800,949	188,527,070.40	2.12
10	000525	红太阳	13,000,639	180,318,862.93	2.03

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	172,911,492.00	1.94
2	央行票据	494,100,000.00	5.55
3	金融债券	1,504,162,000.00	16.90
	其中:政策性金融债	1,504,162,000.00	16.90
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	2,171,173,492.00	24.40

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	4,000,000	395,040,000.00	4.44
2	030201	03国开01	3,500,000	349,300,000.00	3.93
3	110414	11农发14	2,800,000	280,868,000.00	3.16
4	110257	11国开57	2,000,000	202,820,000.00	2.28
5	110224	11国开24	2,000,000	201,040,000.00	2.26

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	2,353,913.63
2	应收证券清算款	27,286,651.38
3	应收股利	-
4	应收利息	37,971,089.19
5	应收申购款	22,153,262.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,764,916.30

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	13,511,818,301.24
本报告期基金总申购份额	299,404,567.26
减:本报告期基金总赎回份额	334,599,004.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,476,623,864.16

§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-橄榄校公益环保计划",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证券投资基金的文件

(二)海富通精选证券投资基金基金合同

(三)海富通精选证券投资基金招募说明书

(四)海富通精选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

海富通领先成长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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	海富通领先成长股票
基金主代码	519025