

上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年12月31日

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,受房地产投资回升和出口增速减缓影响,经济增速将继续放缓。随着通胀压力的减轻和经济增速下降风险的显现,财政政策可能会略趋宽松,总供给和总需求仍将作为货币政策的基本遵循。就市场而言,A股市场在经历了前期连续调整后,整体估值已逐步回归合理,市场恐慌情绪在一定程度上得到了释放,但是我们仍需要耐心等待政策给出的积极信号。行业上,受益于国家大力支持发展的农业、水利、大消费、技术创新和节能环保等值得关注。

本基金将继续严格按照基金合同的要求,秉承价值化投资策略,提高组合的长期增值能力。我们将密切关注国内外经济走势的变化,以既定的投资目标为指导,规范运作,勤勉尽责,力争为A股投资者的长期、稳定的投资

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	366,642,533.47	95.79
	其中:股票	366,642,533.47	95.79
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	16,122,478.32	4.21
6	其他各项资产	6,494.00	0.00
7	合计	382,771,505.79	100.00

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	-	-
B	采掘业	65,851,389.10	17.46
C	制造业	25,525,202.07	6.77
C1	食品、饮料	-	-
C9	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
G4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	25,525,202.07	6.77
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	14,522,795.14	3.85
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	244,240,434.79	64.74
J	房地产业	16,493,712.37	4.37
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	366,642,533.47	97.19

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	600036	招商银行	2,399,743	28,494,949.41	7.55
2	600016	民生银行	4,528,987	26,675,733.43	7.07
3	600000	中信证券	2,595,989	25,207,053.19	6.68
4	601318	中国平安	628,671	21,651,429.24	5.74
5	601328	交通银行	4,370,748	19,580,951.04	5.19
6	601166	兴业银行	1,513,758	18,952,250.16	5.02
7	600000	浦发银行	2,144,062	18,203,086.38	4.83
8	601939	建设银行	3,683,934	16,725,660.36	4.43
9	601088	中国神华	631,096	15,985,661.68	4.24
10	601661	中国太平	613,172	11,779,034.12	3.12

5.4 报告期内未发生债券品种和分类的债券投资违约
本基金本报告期未发生债券违约。
5.5 报告期内按公允价值计值基金资产净值比例大排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告期内按公允价值计值基金资产净值比例大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 报告期内按公允价值计值基金资产净值比例大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均未被监管部门立案调查，没有存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
5.8.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资于超目标基金合同所规定备选库之外的股票。

序号	名称	金额(元)
1	有价证券	-
2	应收账款清算款	3,072.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,421.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,494.00

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券为

5.8.5 报告期末前十名股票持有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
本报告期初基金份额总额	207,016,764
本报告期基金总申购份额	24,600,000
减：本报告期基金总赎回份额	41,400,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	190,216,764

[illegible][illegible]

E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-

H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	64,960.00	0.03
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	64,960.00	0.03

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投资明细					0.00	0.00
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	601009	南京银行	7,000	64,960.00	0.03	
5.5 报告期末按债券品种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						

5.8	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		
5.9	报告期末未持有权证。		
5.9.1	报告期末未持有权证。		
5.9.2	本基金投资的前十名证券中，没有投资于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、处罚的股票。		
5.9.3	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。		
5.9.4	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	-	

3	应收股利	-
4	应收利息	4,885.88
5	应收中购款	396.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	6,072.00
	合计	11,354.79

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。	
5.9.5 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
本报告期初基金份额总额	377,971,870.27
本报告期基金总申购份额	9,251,390.12
减:本报告期基金总赎回份额	35,102,584.28
本报告期基金份额变动的净额	
本报告期末基金份额总额	352,120,756.11

57 影响投资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 2010 年 12 月 31 日,海富通管理的公募基金资产规模达 325 亿元人民币。

作为国家大力和鼓励并全国保障创业投资企业基金投资管理企业,截至 2011 年 12 月 31 日,海富通为 50 多家企业办理了基金托管业务,并担任了投资管理人,资产规模确定于“资产管理”类资产的基金资产如下:截至 2011 年 12 月 31 日,16 只基金投资于“资产管理”类资产,资产规模达 20.20 亿元人民币;截至 2010 年 12 月 31 日,海富通基金管理有限公司被认定为“全国社会保障基金理事会”受托管理“社保基金”。

海富通为 QDII 合格境外机构投资者及其他各家境外机构投资者担任托管人,截至 2011 年 12 月 31 日,托管合格境外机构投资者规模达 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,投资在香港境外合格境外机构投资者规模达 200 亿元人民币,并负责在香港境外人民币投资资金跨境内证市场。

[illegible]

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