海富通货币市场证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年 09 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:2009 年 10 月 29 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 2009 年 10 月 28 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2009 年 7 月 1 日起至 2009 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	海富通货币	
基金运作方式:	契约型开放式	
交易代码	519505	
基金合同生效日:	2005年 1 月 4 日	
报告期末基金份额总额:	5,198,257,862.22 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:	973,032,836.33 份	4,225,225,025.89 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	A级报告期(2009-07-01 至 2009-09-30)	B级报告期(2009-07-01 至 2009-09-30)
1.本期已实现收益	4,954,903.80	25,007,710.48
2.本期利润	4,954,903.80	25,007,710.48
3.期末基金资产净值	973,032,836.33	4,225,225,025.89

注:(1)本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

(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,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

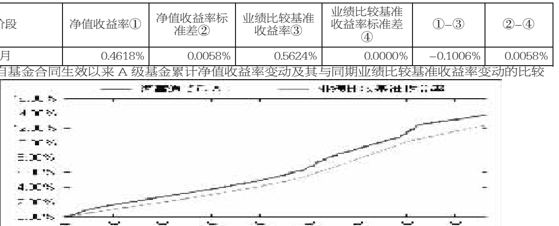
3.2.1 本报告期 A 级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 3 个月	0.4009%	0.0058%	0.5624%	0.0000%	-0.1615%	0.0058%

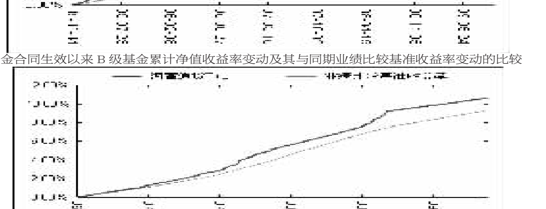
本报告期 B 级基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 3 个月	0.4618%	0.0058%	0.5624%	0.0000%	-0.1006%	0.0058%

3.2.2 自基金合同生效以来 A 级基金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



自基金合同生效以来 B 级基金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



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	2008年 1 月 31 日	-	7年	中国国籍,经济学学士学位,持有基金从业人员资格证书,2002 年 7 月至 2004 年 7 月就职于南京银行股份有限公司,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 1 月起任海富通货币基金基金经理。

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。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业绩表现说明

(1)行情回顾及运作分析

2009 年第三季度"通胀"一词慢慢淡出,市场转向货币政策的持续性讨论,政府试图通过对货币政策实行"微调"来控制信贷的增长速度,而受到放贷能力以及资本充足率等指标的限制,商业银行的贷款增长速度下降,股票等资产市场的上涨受到抑制。债券市场短期品种保持基本稳定,中长期利率仍然有一定上升,尤其是长期信用品种上升明显,已经超过贷款利率。新股申购收益率保持在较高水平,特别是随着创业板申购开闸,打新热情高涨,减弱了债券的吸引力,市场资金利率调升到 1.6-1.7%的水平。一年票据的发行持续稳定在 1.76%水平,资金涌入短期信用类债券。

海富通货币基金本季度规模下降明显,为维持稳定积极调整组合仓位,维持低剩余期限策略和适当信用债券比例,稳定管理基金。

(2)本基金业绩表现

本报告期内,A 级基金净值收益率为 0.4009%,同期业绩比较基准收益率为 0.5624%;B 级基金净值收益率为 0.4618%,同期业绩比较基准收益率为 0.5624%。

(3)市场展望和投资策略

本基金认为,未来半年左右债券市场仍不乐观。主要原因是:世界主要经济体的货币政策目标尚未转向防范通货膨胀,对通货膨胀有一定的容忍;国内债券发行人的融资需求不断上升,但投资者在减少,债券市场的供求矛盾加剧,特别在新股申购收益率保持较高水平的条件下;国内货币政策可能从上半年的非常宽松调整为比较理想的适度宽松,市场各方对资金的竞争可能增加。无论如何,收益率继续向上突破的压力存在,谨慎仍是主题,我们将积极观察央行票据的发行,一年票据发行利率的变动越来越成为市场的风向标。货币基金在下个季度将继续保持较短的组合久期,提高防御能力,适时积极配置拉长久期。

§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	3,074,942,155.59	58.94
	其中:债券	3,074,942,155.59	58.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,557,674,216.51	29.86
	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	569,366,113.09	10.91
4	其他资产	15,020,244.47	0.29
5	合计	5,217,002,729.66	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	57,211,748,841.60	12.45
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每交易日的融资余额的合计数,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交易日融资余额占基金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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

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	46.07	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.30	-
2	30天(含)—60 天	-	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90 天	17.26	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.64	-
4	90天(含)—180 天	15.85	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.22	-
5	180天(含)—397 天(含)	20.89	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.07	-

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	196,681,628.96	3.78
3	金融债券	1,246,944,606.67	23.99
	其中:政策性金融债	752,032,737.26	14.47
4	企业债券	241,221,768.40	4.64
5	企业短期融资券	1,390,094,151.56	26.74
6	其他	-	-
7	合计	3,074,942,155.59	59.15
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	736,133,637.81	14.16

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	050406	05农发 06	5,500,000	551,857,601.26	10.62
2	0981031	09光明 CP01	3,000,000	300,456,669.17	5.78
3	050503	05工行 03	3,000,000	295,410,003.32	5.68
4	0981117	09酒钢 CP01	2,500,000	249,320,608.47	4.80
5	070417	07农发 17	2,000,000	200,175,136.00	3.85
6	040705	04建行 03 浮	2,000,000	199,501,866.09	3.84
7	0901044	09央行票据 44	2,000,000	196,681,628.96	3.78
8	058031	05中信债 1	1,500,000	145,839,325.58	2.81
9	0981046	09开滦 CP01	1,200,000	120,011,796.74	2.31
10	0981053	09苏国信 CP01	1,000,000	100,074,016.39	1.93

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	-
报告期内偏离度的最高值(%)	0.2180
报告期内偏离度的最低值(%)	0.0760
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值(%)	0.1752

注:以上数据按交易日统计。

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 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	15,018,744.47
4	应收申购款	1,500.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	15,020,244.47

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	A级	B级
报告期期初基金份额总额	1,568,970,334.83	9,847,956,658.63
报告期期间基金总申购份额	1,485,952,736.80	4,534,167,269.26
报告期期间基金总赎回份额	-2,081,890,235.30	-10,156,898,902.00
报告期期末基金份额总额	973,032,836.33	4,225,225,025.89

§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 10 只开放式基金。截至 2009 年 9 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模超过 354.2 亿元人民币。

2005 年 8 月,海富通率先获得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资格。截至 2009 年三季度末,正式投入运作的年金账户 40 余家,合计管理资产规模超过 90 亿元人民币。2007 年 8 月,海富通获得中国证监会核准的 QDII(合格境内机构投资者)业务资格。从 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 2009 年三季度末,投资咨询业务规模超过 210.46 亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2009 年以来,海富通旗下基金的业绩表现较为出色。根据晨星 Morning Star 排名,截至 2009 年 9 月 30 日,海富通风格优势股票基金今年以来净值增长率达到 57.18%,在股票型基金中位列前 1/4。根据银河证券同期排名,海富通首只 QDII 基金产品海富通中国海外股票(QDII)基金净值增长率在所有 9 只 QDII 基金中位列第一,截至三季度末,该基金今年以来净值增长率已高达 64.93%。

成立六年多来,海富通始终坚持"专业、专心、专注"的职业精神。2004 年 9 月,海富通在我国基金业内率先聘请全球著名资产管理人评估机构惠誉评级(Fitch Ratings)为公司进行资产管理业务评级,并于 2005 年、2006 和 2007 年连续获得"惠誉 M2(中国)"资产管理人优秀评级,在 2008 年复评中又被升级为"惠誉 M2+(中国)"资产管理人优秀评级,2009 年再度获得"惠誉 M2+(中国)"资产管理人优秀评级。惠誉认为,最新的这次评级,反映了海富通拥有具有可比性的在中国资产管理业的较长经验、组织的稳定性以及发展的可控性,也反映了海富通投资流程的质量和专用于投资管理的额外资源的质量,同时该评级还受益于海富通的公司治理标准和有高管充分监督的多层风险管理程序。

海富通同时还在不断践行其社会责任。自 2008 年启动"绿色与希望 - 橄榄枝公益环保计划"以来,先后捐赠了因汶川地震严重受灾的四川德阳什邡洛水小学、捐助内蒙古库伦旗植树壹万棵捐建公益林、向上海利民民工小学、华博利星行民工小学捐赠电脑、为安徽省金寨县杨山小学扶贫助学并捐赠教学物资、前往上海唐四民工小学担当志愿者等等。

此外,海富通还积极推进投资者教育工作,在与上海交大安泰经管学院合作建立的"海富通 - 上海交大投资者教育研究中心"推出的数万余字的投资者行为学调研报告 -《股市与幸福感》的基础上,海富通于三季度启动了新一轮投资者教育活动:海富通幸福投资行动。其中包括:为期三个月的"幸福投资路"网络游戏、海富通幸福投资大解码网络互动、理财周报 16 版幸福投资密码特刊、记者专访、有关幸福投资理念宣传的各类报刊栏目撰写等。

三季度内,海富通在《理财周报》举行的"2009 中国最受尊敬基金公司评选"活动中,海富通荣膺:"2009 最佳品牌塑造基金公司"、"2009 最受尊敬基金公司",总裁田仁灿先生获评"2009 最受尊敬基金公司总裁:最具社会责任总裁"。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

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
海富通货币市场证券投资基金基金合同
海富通货币市场证券投资基金招募说明书
海富通货币市场证券投资基金托管协议
中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
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

上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36、37 楼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
2009 年 10 月 29 日

海富通精选证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年 09 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:2009 年 10 月 29 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 2009 年 10 月 28 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 2009 年 7 月 1 日起至 2009 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	海富通精选混合
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:	10,476,679,309.56 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(2009-07-01 至 2009-09-30)
1.本期已实现收益	562,444,482.89
2.本期利润	-460,019,939.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0428
4.期末基金资产净值	8,103,102,094.42
5.期末基金份额净值	0.7734

(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。

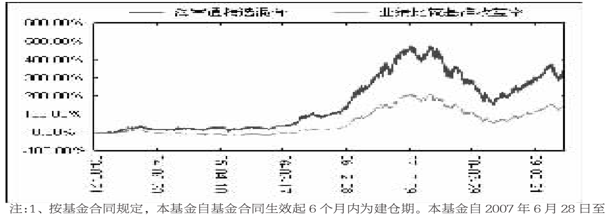
3.2 基金净值表现

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 3 个月	-5.60%	1.65%	-1.74%	1.52%	-3.86%	0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

海富通精选混合累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 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;海富通中国海外股票(QDII)基金基金经理;副总经理;投资总监	2003年 8 月 22 日	-	18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 月起兼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年 8 月 6 日	-	8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。

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 -5.60%、精选贰号基金 -4.98%,两者净值增长率之差的绝对值为 0.62%,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业绩表现说明

(1)行情回顾及运作分析

2009 年第三季度,A 股市场结束了单边上涨的行情,出现了大幅震荡。由于流动性预期改变、前期涨幅过快、市场扩容担忧等因素影响,上证综指在连涨七个月后,8 月份的调整幅度达到了 21%,A 股市场成为全球跌幅最大的股市。步入 9 月份,由于经历了 8 月份的大跌以及宏观基本面的不确定性因素,市场呈现了先扬后抑、缩量整理的态势。行业表现方面,医疗保健、消费、信息技术涨幅靠前,而金融、原材料跌幅较大。

报告期内,本基金认为经济复苏引发的上涨动力基本得到充分反映,市场单边上升周期已经暂告结束,但是考虑到基于基数效应经济增速依然具备上行动力,因此资产配置上未作大的变动。行业配置上,我们对房地产业和周期类资产进行了较大幅度的阶段性减持,同时增持医药等防御类资产,但由于超额配置的金融行业资产本季度走势低迷,造成本基金本季度净值表现不佳,跑输基准。

(2)本基金业绩表现

本报告期内,海富通精选混合基金净值增长率为 -5.60%,同期业绩比较基准收益率为 -1.74%,基金净值落后业绩比较基准 3.86 个百分点。

(3)市场展望和投资策略

展望未来,经济继续增长是毫无疑问的,不断的财政投资刺激依然可能是主基调,但经济增长对股市持续上涨刺激的边际效应在明显减弱。在调结构保增长的新形势下,基于适度宽松货币政策的不断微调,市场将呈现与上半年或者去年同期大不相同的风格特征。

基于上述判断,在行业选择方面,我们将密切关注私人部门投资的改善,重点考察新一轮通货膨胀预期和美元贬值形势下的受益资产特征;在个股选择方面,我们将寻找具备持续增长潜力的品种,以及具有独特盈利模式的个股进行重点投资。

§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	5,570,404,189.85	68.54
	其中:股票	5,570,404,189.85	68.54
2	固定收益投资	1,813,866,010.90	22.32
	其中:债券	1,813,866,010.90	22.32
	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	691,260,626.21	8.50
6	其他资产	52,257,096.77	0.64
7	合计	8,127,787,923.73	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	26,270,000.00	0.32
B	采掘业	700,159,251.60	8.64
C	制造业	1,917,006,185.68	23.66
C0	食品、饮料	115,511,467.04	1.43
C1	纺织、服装、皮毛	577,704.60	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	61,913,342.70	0.76
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	626,880,067.64	7.74
C7	机械、设备、仪表	493,447,687.17	6.09
C8	医药、生物制品	574,715,916.53	7.09
C99	其他制造业	43,960,000.00	0.54
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	133,068,943.53	1.64
F	交通运输、仓储业	159,693,394.68	1.97
G	信息技术业	366,364,888.12	4.52
H	批发和零售贸易	166,871,996.07	2.06
I	金融、保险业	1,367,423,756.51	16.88
J	房地产业	163,067,456.12	2.01
K	社会服务业	148,016,243.00	1.83
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	422,462,074.54	5.21
	合计	5,570,404,189.85	68.74

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	600415	小商品城	6,000,000	237,600,000.00	2.93
2	000063	中兴通讯	6,000,766	229,109,245.88	2.83
3	600028	中国石化	20,000,000	226,000,000.00	2.79
4	601628	中国人寿	8,000,000	221,440,000.00	2.73
5	601318	中国平安	4,000,000	202,800,000.00	2.50
6	600000	浦发银行	10,000,000	196,500,000.00	2.42
7	000009	中国宝安	18,000,202	184,862,074.54	2.28
8	601009	南京银行	10,000,000	176,400,000.00	2.18
9	601169	北京银行	10,000,077	172,301,326.71	2.13
10	600583	海油工程	15,000,000	149,550,000.00	1.85

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	63,168,862.50	0.78
2	央行票据	806,445,000.00	9.95
3	金融债券	939,883,000.00	11.60
	其中:政策性金融债	939,883,000.00	11.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	4,369,148.40	0.05
7	其他	-	-
8	合计	1,813,866,010.90	22.38

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	030201	03国开 01	3,500,000	355,775,000.00	4.39
2	0801023	08央票 23	2,500,000	258,650,000.00	3.19
3	0701098	07央票 98	2,000,000	203,800,000.00	2.52
4	070410	07农发 10	2,000,000	201,660,000.00	2.49
5	0901042	09央票 42	2,000,000	196,560,000.00	2.43

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中兴通讯(000063)于 2008 年 10 月 7 日发布《关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处 2007 年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》,中兴通讯因其 2007 年度会计信息质量问题被处以行政罚款金额计人民币 16 万元整并补缴企业所得税人民币 380 万元。

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。《关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处 2007 年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,377,271.23
2	应收证券清算款	19,049,887.13
3	应收股利	1,260,000.00
4	应收利息	26,296,699.26
5	应收申购款	273,239.15
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	52,257,096.77

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600583	海油工程	149,550,000.00	1.85	非公开发行

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	11,112,477,031.09
报告期期间基金总申购份额	103,198,519.95
报告期期间基金总赎回份额	-738,996,241.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	10,476,679,309.56

§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 10 只开放式基金。截至 2009 年 9 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模超过 354.2 亿元人民币。

2005 年 8 月,海富通率先获得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资格。截至 2009 年三季度末,正式投入运作的年金账户 40 余家,合计管理资产规模超过 90 亿元人民币。2007 年 8 月,海富通获得中国证监会核准的 QDII(合格境内机构投资者)业务资格。从 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 2009 年三季度末,投资咨询业务规模超过 210.46 亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2009 年以来,海富通旗下基金的业绩表现较为出色。根据晨星 Morning Star 排名,截至 2009 年 9 月 30 日,海富通风格优势股票基金今年以来净值增长率达到 57.18%,在股票型基金中位列前 1/4。根据银河证券同期排名,海富通首只 QDII 基金产品海富通中国海外股票(QDII)基金净值增长率在所有 9 只 QDII 基金中位列第一,截至三季度末,该基金今年以来净值增长率已高达 64.93%。

成立六年多来,海富通始终坚持"专业、专心、专注"的职业精神。2004 年 9 月,海富通在我国基金业内率先聘请全球著名资产管理人评估机构惠誉评级(Fitch Ratings)为公司进行资产管理业务评级,并于 2005 年、2006 和 2007 年连续获得"惠誉 M2(中国)"资产管理人优秀评级,在 2008 年复评中又被升级为"惠誉 M2+(中国)"资产管理人优秀评级,2009 年再度获得"惠誉 M2+(中国)"资产管理人优秀评级。惠誉认为,最新的这次评级,反映了海富通拥有具有可比性的在中国资产管理业的较长经验、组织的稳定性以及发展的可控性,也反映了海富通投资流程的质量和专用于投资管理的额外资源的质量,同时该评级还受益于海富通的公司治理标准和有高管充分监督的多层风险管理程序。

海富通同时还在不断践行其社会责任。自 2008 年启动"绿色与希望 - 橄榄枝公益环保计划"以来,先后捐赠了因汶川地震严重受灾的四川德阳什邡洛水小学、捐助内蒙古库伦旗植树壹万棵捐建公益林、向上海利民民工小学、华博利星行民工小学捐赠电脑、为安徽省金寨县杨山小学扶贫助学并捐赠教学物资、前往上海唐四民工小学担当志愿者等等。

此外,海富通还积极推进投资者教育工作,在与上海交大安泰经管学院合作建立的"海富通 - 上海交大投资者教育研究中心"推出的数万余字的投资者行为学调研报告 -《股市与幸福感》的基础上,海富通于三季度启动了新一轮投资者教育活动:海富通幸福投资行动。其中包括:为期三个月的"幸福投资路"网络游戏、海富通幸福投资大解码网络互动、理财周报 16 版幸福投资密码特刊、记者专访、有关幸福投资理念宣传的各类报刊栏目撰写等。

三季度内,海富通在《理财周报》举行的"2009 中国最受尊敬基金公司评选"活动中,海富通荣膺:"2009 最佳品牌塑造基金公司"、"2009 最受尊敬基金公司",总裁田仁灿先生获评"2009 最受尊敬基金公司总裁:最具社会责任总裁"。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准设立海富通精选证券投资基金的文件
海富通精选证券投资基金基金合同
海富通精选证券投资基金招募说明书
海富通精选证券投资基金托管协议
中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
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

上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36、37 楼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
2009 年 10 月 29 日

海富通强化回报混合型证券投资基金

2009年第三季度报告

2009年 09 月 30 日

基金管理人:海富通基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司 报告送出日期:2009 年 10 月 29 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 10 月 28 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2009 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	海富通强化回报混合
交易代码:	519007
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2006年 5 月 25 日
报告期末基金份额总额:	3,346,453,537.06 份
投资目标:	每年超越三年期定期存款(税前)加权平均收益率。
投资策略:	本基金认为,灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源,而收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。因此,本基金将运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略,实现基金的投资目标。
业绩比较基准:	三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率
风险收益特征:	追求每年高于一定正回报的投资品种。属于适度风险、适中收益的混合型基金,其长期的预期收益和风险高于债券基金,低于股票基金。
基金管理人:	海富通基金管理有限公司
基金托管人:	招商银行股份有限公司

§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(2009-07-01 至 2009-09-30)
1.本期已实现收益	112,594,152.43
2.本期利润	-91,006,640.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0264
4.期末基金资产净值	2,139,532,456.89
5.期末基金份额净值	0.639

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。

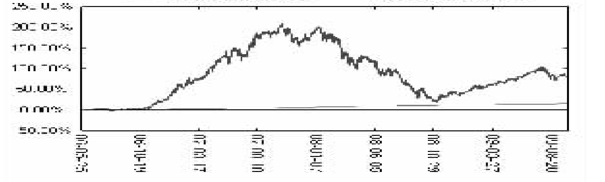
3.2 基金净值表现

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 3 个月	-4.48%	1.27%	0.83%	0.01%	-5.31%	1.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

海富通强化回报混合累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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,本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(二)、(七)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		
蒋征	本基金的基金经理;海富通收益增长混合基金基金经理;股票组合管理部总监	2006年 9 月 26 日	-	13年	中国国籍,工商管理硕士,持有基金从业人员资格证书。历任中国保险信托投资公司业务经理,嘉实基金管理有限公司丰和证券投资基金基金经理助理,2003 年 1 月至 2004 年 4 月任泰和证券投资基金基金经理,2004 年 8 月至 2006 年 5 月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选证券投资基金基金经理,2005 年 12 月至 2006 年 5 月任兴安证券投资基金基金经理。2006 年 6 月加入海富通基金管理有限公司,2006 年 9 月起任海富通强化回报混合基金基金经理,2007 年 1 月至 2009 年 1 月任海富通股票基金基金经理,2007 年 10 月起任股票组合管理部总监,2009 年 1 月起兼任海富通收益增长混合基金基金经理。
邵佳民	本基金的基金经理;海富通稳健添利债券基金基金经理;固定收益组合管理部总监	2006年 5 月 25 日	-	12年	中国国籍,硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003 年 4 月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师,2005 年 1 月至 2008 年 2 月任海富通货币市场基金基金经理,2006 年 5 月起任海富通强化回报混合基金基金经理,2007 年 10 月起任固定收益组合管理部总监,2008 年 10 月起兼任海富通稳健添利债券基金基金经理。

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业绩表现说明

(1)行情回顾及运作分析

从股市来看,2009 年第三季度,A 股市场结束了单边上涨的行情,出现了大幅震荡。由于流动性预期改变、前期涨幅过快、市场扩容担忧等因素影响,上证综指在连涨七个月后,8 月份的调整幅度达到了 21%,A 股市场成为全球跌幅最大的股市。步入 9 月份,由于经历了 8 月份的大跌以及宏观基本面的不确定性因素,市场呈现了先扬后抑、缩量整理的态势。行业表现方面,医疗保健、消费、信息技术涨幅靠前,而金融、原材料跌幅较大。

本基金在 2009 年第三季度初提高了股票资产的配置比例,在八月上旬,我们认为市场的单边上升周期已经结束,故降低了股票资产的仓位。在行业配置上,我们对房地产业和周期类资产进行了较大幅度的阶段性减持,但由于防御类资产配置不足,同时大幅超额配置的金融行业资产本季度走势低迷,造成本基金本季度净值表现不佳。

从债市来看,2009 年第三季度,债券市场面临的压力有所减轻,主要表现在:政府试图通过对货币政策实行"微调"来控制信贷的增长速度,而受到放贷能力以及资本充足率等指标的限制,商业银行的贷款增长速度下降,股票等资产市场的上涨受到抑制。国际大宗商品价格上涨的速度减缓,投资者对未来利率上升的担忧暂时减弱。债券市场表现为短期品种保持稳定,中长期利率仍然有一定上升,尤其是信用品种。新股申购收益率保持在较高水平,减弱了债券的吸引力,尤其是对于不能够进行回购融资、期限较长的债券。受到股票市场降温的影响,可转换债券出现较大幅度的调整。

本基金在第三季度的债券组合保持稳定,主要是将到期的短期品种进行再投资,增加国债等政府债券的投资,组合剩余期限继续保持在较低水平。

(2)本基金业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为 -4.48%,同期业绩比较基准收益率为 0.83%,基金净值落后业绩比较基准 5.31 个百分点。

(3)市场展望和投资策略

从股市来看,未来经济的继续增长是毫无疑问的,虽然不断的财政投资刺激依然可能是主基调。经济增长对股市持续上涨刺激的边际效应在明显减弱,在调结构保增长的新形势下,在适度宽松的货币政策不断微调的作用下,市场将呈现与上半年或者去年同期大不相同的风格特征。

在大类资产配置上,我们将采取更加灵活的方式进行资产切换,股票仓位的变化也将更加灵活;在行业选择方面,我们将密切关注私人部门投资的改善,将重点考察新一轮通货膨胀预期和美元贬值形势下的受益资产特征,并认真跟踪大型国企的兼并重组机会;在个股选择方面,我们将仔细寻找业绩优良未来成长性较好的品种,以及具有独特盈利模式的个股进行重点投资。

从债市来看,本基金认为,未来半年左右债券市场仍不乐观。主要原因是:世界主要经济体的货币政策目标尚未转向防范通货膨胀,对通货膨胀有一定的容忍;国内债券发行人的融资需求不断上升,但投资者在减少,债券市场的供求矛盾加剧,特别在新股申购收益率保持较高水平的条件下;国内货币政策可能从上半年的非常宽松调整为比较理想的适度宽松,市场各方对资金的竞争可能增加。

本基金将保持较短的组合久期,提高资产的流动性,提高防御能力,适当增加一些期限较短、信用等级高、收益率较高的品种。

§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	904,702,734.55	41.98
	其中:股票	904,702,734.55	41.98
2	固定收益投资	1,159,396,464.40	53.79
	其中:债券	1,159,396,464.40	53.79
	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	63,558,896.64	2.95
6	其他资产	27,596,585.64	1.28
7	合计	2,155,254,681.23	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	10,199,692.80	0.48
B	采掘业	44,955,000.00	2.10
C	制造业	325,551,768.54	15.22
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	17,432,189.28	0.81
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,005,801.56	0.75
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,121,529.00	0.47
C5	电子	5,006,662.14	0.23
C6	金属、非金属	45,656,138.83	2.13
C7	机械、设备、仪表	93,329,640.18	4.36
C8	医药、生物制品	116,759,807.55	5.46
C99	其他制造业	21,240,000.00	0.99
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	40,638,512.62	1.90
F	交通运输、仓储业	21,745,778.77	1.02
G	信息技术业	99,259,410.13	4.64
H	批发和零售贸易	13,087,691.93	0.61
I	金融、保险业	197,724,274.50	9.24
J	房地产业	46,015,788.06	2.15
K	社会服务业	24,978,143.60	1.17
L	传播与文化产业	7,068,000.00	0.33
M	综合类	73,478,673.60	3.43
	合计	904,702,734.55	42.29

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	600415	小商品城	1,699,916	67,316,673.60	3.15
2	600583	海油工程	4,500,000	44,955,000.00	2.10
3	000063	中兴通讯	1,050,000	40,089,000.00	1.87
4	601398	工商银行	7,000,000	33,390,000.00	1.56
5	601166	兴业银行	944,194	31,904,315.26	1.49
6	601009	南京银行	1,799,941	31,750,959.24	1.48
7	601318	中国平安	600,000	30,420,000.00	1.42
8	601169	北京银行	1,500,000	25,845,000.00	1.21
9	600765	中航重机	2,000,000	24,340,000.00	1.14
10	600648	外高桥	1,299,882	22,331,972.76	1.04

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	273,497,000.00	12.78
2	央行票据	99,670,000.00	4.66
3	金融债券	353,420,000.00	16.52
	其中:政策性金融债	302,130,000.00	14.12
4	企业债券	223,874,528.40	10.46
5	企业短期融资券	208,460,000.00	9.74
6	可转债	474,936.00	0.02
7	其他	-	-
8	合计	1,159,396,464.40	54.19

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	070420	07农发 20	3,000,000	302,130,000.00	14.12
2	0981028	09鲁高速 CP01	1,100,000	110,550,000.00	5.17
3	010110	21国债⑽	1,000,000	102,760,000.00	4.80
4	0901035	09央票 35	1,000,000	99,670,000.00	4.66
5	0981078	09晋煤 CP01	1,000,000	97,910,000.00	4.58

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中兴通讯(000063)于 2008 年 10 月 7 日发布《关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处 2007 年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》,中兴通讯因其 2007 年度会计信息质量问题被处以行政罚款金额计人民币 16 万元整并补缴企业所得税人民币 380 万元。

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。《关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处 2007 年度会计信息质量检查结论和处理决定的公告》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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,620,781.64
2	应收证券清算款	19,372,238.28
3	应收股利	-
4	应收利息	6,560,456.70
5	应收申购款	43,109.02
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	27,596,585.64

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600583	海油工程	44,955,000.00	2.10	非公开发行
2	600765	中航重机	24,340,000.00	1.14	非公开发行

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,607,388,207.74
报告期期间基金总申购份额	143,686,905.11
报告期期间基金总赎回份额	-404,621,575.79
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,346,453,537.06

§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 10 只开放式基金。截至 2009 年 9 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模超过 354.2 亿元人民币。

2005 年 8 月,海富通率先获得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资格。截至 2009 年三季度末,正式投入运作的年金账户 40 余家,合计管理资产规模超过 90 亿元人民币。2007 年 8 月,海富通获得中国证监会核准的 QDII(合格境内机构投资者)业务资格。从 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 2009 年三季度末,投资咨询业务规模超过 210.46 亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2009 年以来,海富通旗下基金的业绩表现较为出色。根据晨星 Morning Star 排名,截至 2009 年 9 月 30 日,海富通风格优势股票基金今年以来净值增长率达到 57.18%,在股票型基金中位列前 1/4。根据银河证券同期排名,海富通首只 QDII 基金产品海富通中国海外股票(QDII)基金净值增长率在所有 9 只 QDII 基金中位列第一,截至三季度末,该基金今年以来净值增长率已高达 64.93%。

成立六年多来,海富通始终坚持"专业、专心、专注"的职业精神。2004 年 9 月,海富通在我国基金业内率先聘请全球著名资产管理人评估机构惠誉评级(Fitch Ratings)为公司进行资产管理业务评级,并于 2005 年、2006 和 2007 年连续获得"惠誉 M2(中国)"资产管理人优秀评级,在 2008 年复评中又被升级为"惠誉 M2+(中国)"资产管理人优秀评级,2009 年再度获得"惠誉 M2+(中国)"资产管理人优秀评级。惠誉认为,最新的这次评级,反映了海富通拥有具有可比性的在中国资产管理业的较长经验、组织的稳定性以及发展的可控性,也反映了海富通投资流程的质量和专用于投资管理的额外资源的质量,同时该评级还受益于海富通的公司治理标准和有高管充分监督的多层风险管理程序。

海富通同时还在不断践行其社会责任。自 2008 年启动"绿色与希望 - 橄榄枝公益环保计划"以来,先后捐赠了因汶川地震严重受灾的四川德阳什邡洛水小学、捐助内蒙古库伦旗植树壹万棵捐建公益林、向上海利民民工小学、华博利星行民工小学捐赠电脑、为安徽省金寨县杨山小学扶贫助学并捐赠教学物资、前往上海唐四民工小学担当志愿者等等。

此外,海富通还积极推进投资者教育工作,在与上海交大安泰经管学院合作建立的"海富通 - 上海交大投资者教育研究中心"推出的数万余字的投资者行为学调研报告 -《股市与幸福感》的基础上,海富通于三季度启动了新一轮投资者教育活动:海富通幸福投资行动。其中包括:为期三个月的"幸福投资路"网络游戏、海富通幸福投资大解码网络互动、理财周报 16 版幸福投资密码特刊、记者专访、有关幸福投资理念宣传的各类报刊栏目撰写等。

三季度内,海富通在《理财周报》举行的"2009 中国最受尊敬基金公司评选"活动中,海富通荣膺:"2009 最佳品牌塑造基金公司"、"2009 最受尊敬基金公司",总裁田仁灿先生获评"2009 最受尊敬基金公司总裁:最具社会责任总裁"。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准设立海富通强化回报混合型证券投资基金的文件
海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同
海富通强化回报混合型证券投资基金招募说明书
海富通强化回报混合型证券投资基金托管协议
中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
报告期内海富通强化回报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

上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36、37 楼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
2009 年 10 月 29 日