海富通精选贰号混合型证券投资基金

2008年第三季度报告

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：2008 年 10 月 22 日

一、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 2008 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2008 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

二、基金产品概况

1.基金简称：	海富通贰号
2.基金代码：	519015
3.基金运作方式：	契约型开放式
4.基金合同生效日：	2007 年 7 月 9 日
5.报告期末基金份额总额：	3,062,274,279.02 份
6.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。
7.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。
8.业绩比较基准：	MSCI China A 指数×65％＋上证国债指数×35％
9.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。
10.基金管理人：	海富通基金管理有限公司
11.基金托管人：	中国银行股份有限公司

三、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	报告期（2008 年 7 月 1 日 -2008 年 9 月 30 日）
1.	本期已实现收益	-582,123,611.55
2.	本期利润	-489,404,906.63
3.	加权平均基金份额本期利润	-0.1567
4.	期末基金资产净值	2,546,488,633.37
5.	期末基金份额净值	0.832

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。

（二）基金净值表现

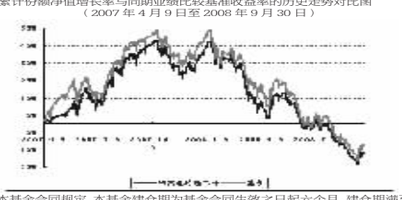
1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-15.79%	1.51%	-12.38%	1.80%	-3.41%	-0.29%

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：

海富通贰号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

（2007 年 4 月 9 日至 2008 年 9 月 30 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祚，任职时间为 2007 年 4 月至 2007 年 8 月。

四、管理人报告

（一）基金经理简介

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	离职日期		
丁俊	本基金的基金经理；海富通精选基金基金经理	2007年8月	—	7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 月就职于华安资产管理公司，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，任海富通精选基金和海富通风格优势基金基金经理助理。

（二）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。

（三）公平交易专项说明

1、公平交易制度的执行情况

公司自成立以来，就建立有公平交易制度，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，并进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

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 -19.41%，精选贰号基金 -15.79%，两者净值增长率之差的绝对值为 3.62%，小于 5%。

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。

（四）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

在前两个月连续大幅下挫后，7 月份上证综指围绕着 2700 点窄幅震荡。7 月 3 日，上证综指曾一度跌破 2600 点大关，市场弥漫悲观气氛。但在新华社发表社论以及证监会明确维护股市稳定的措施下，股市逐渐反弹。此后，银行业中报的良好预期以及提高纺织品退税的利好消息，对股市反弹起了一定支撑作用。受到美国次贷危机有继续蔓延趋势，市场担心奥运后经济增长减速等不利因素影响下，大盘进入 8 月以后一路下行。9 月股市继续深幅下挫，8 月的宏观经济数据显示 PPI 创 12 年新高，加剧了投资者对国内经济滑坡的担忧，在美国陷入金融危机以及央行调低贷款利率、准备金率的因素刺激下，银行股领跌，导致 A 股市场迅速下滑，逼近 1800 点。在紧急关头，政府 18 日宣布印花税单边征收以及一揽子利好政策，导致第二天 A 股全线涨停报收。然而受美国股市大幅走低，金融动荡持续的影响，A 股在第三季度最后几个交易日连续低开下探，虽然三大银行股依然表现坚挺，但无奈大多数股票走势疲弱，部分行业和板块更是出现加速下行。纵观 2008 年第三季度 A 股市场，虽有时期短暂震荡微幅上升，但奥运以后，股市被悲观气氛笼罩，受国内、国外多重不利因素影响，股指一路下探，在第三季度最后一个交易日，沪深两市分别以 2293.78 点及 7559.27 点收官。

2、本基金业绩表现

报告期内，精选贰号基金净值下跌了 15.79%，而同期基金业绩比较基准下跌 12.38%，基金净值落后业绩比较基准 3.41%。本季度基金业绩跑输基准，一是由于股票配置比例相对较高，二是虽大幅度减持了上游资产，但减持时机不够及时，拖累了业绩。

3、市场展望和投资策略

本轮美国金融危机对全球经济的影响还远远没有结束。次贷危机引发的美国金融震荡已经使得雷曼兄弟倒下，而其它投行也相继被收购和转型，投行模式彻底失败。中国企业持有雷曼兄弟的相关资产并不是很多，不会直接受到明显影响。但是美国实体经济的衰退还是会通过贸易等方式传导到中国，使得目前已经处于困境中的中国出口企业面临更大的挑战。中国本轮经济增长极大的提高了国家综合实力和居民的收入增长，但同时也引发了高房价和通货膨胀。在宏观调控的影响下，物价和房价都开始有所回落，但是宗商品价格走低而缓解成本压力的公司；二是如果政府政策重点转向经济增长而可能受益的行业；三是自下而上选择细分行业龙头或具备独特竞争力的公司长期持有。

五、投资组合报告

（一）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	1,614,023,769.66	61.88
	其中：股 票	1,614,023,769.66	61.88
2	固定收益投资	792,420,000.00	30.38
	其中：债 券	792,420,000.00	30.38
	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	187,502,342.08	7.19
6	其他资产	14,475,400.26	0.55
	合 计	2,608,421,511.90	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

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	274,008,534.23	10.76
C 制造业	589,337,866.82	23.14
C0 食品，饮料	62,873,466.82	2.47
C1 纺织，服装，皮毛	-	-
C2 木材，家具	-	-
C3 造纸，印刷	-	-
C4 石油，化学，塑胶，塑料	128,437,206.89	5.04
C5 电子	-	-
C6 金属，非金属	22,860,000.00	0.90
C7 机械，设备，仪表	262,209,545.64	10.30
C8 医药，生物制品	103,730,496.07	4.07
C99 其他制造业	9,227,151.60	0.36
D 电力，煤气及水的生产和供应业	50,656,669.10	1.99
E 建筑业	50,501,861.28	1.98
F 交通运输，仓储业	38,165,527.45	1.50
G 信息技术业	72,179,791.80	2.83
H 批发和零售贸易	107,504,330.10	4.22
I 金融，保险业	424,472,085.24	16.68
J 房地产业	-	-
K 社会服务业	7,198,103.54	0.28
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	-	-
合计	1,614,023,769.66	63.38

（三）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	000937	金牛能源	6,669,310.00	148,525,533.70	5.83
2	601398	工商银行	25,999,920.00	113,099,652.00	4.44
3	600030	中信证券	4,500,000.00	111,420,000.00	4.38
4	600036	招商银行	4,500,000.00	79,290,000.00	3.11
5	000792	盐湖钾肥	1,100,019.00	74,306,283.45	2.92
6	600028	中国石化	6,500,000.00	69,420,000.00	2.73
7	601766	中国南车	16,003,049.00	63,010,671.60	2.47
8	601628	中国人寿	2,299,934.00	58,096,332.84	2.28
9	600089	特变电工	3,255,477.00	53,910,699.12	2.12
10	600519	贵州茅台	400,000.00	52,756,000.00	2.07

（四）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	792,420,000.00	31.12
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	可转债	-	-
7	其他	-	-
	合计	792,420,000.00	31.12

（五）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	0801098	08央票98	3,000,000.00	288,480,000.00	11.33
2	0801047	08央票47	2,000,000.00	202,580,000.00	7.96
3	0801017	08央票17	2,000,000.00	202,420,000.00	7.95
4	0701032	07央票32	1,000,000.00	98,940,000.00	3.88
5	-	-	-	-	-

（六）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。

（七）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。

（八）投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产的构成：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,990,877.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,442,303.05
5	应收申购款	42,219.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	14,475,400.26

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、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	000792	盐湖钾肥	74,306,283.45	2.92	筹划重大资产重组

6、报告期内本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

六、开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,196,884,945.55
报告期期间基金总申购份额	3,227,710.11
报告期期间基金总赎回份额	136,838,376.64
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	3,062,274,279.02

七、备查文件目录

（一）备查文件目录

1.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

2.海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同

3.海富通精选贰号混合型证券投资基金招募说明书

4.海富通精选贰号混合型证券投资基金托管协议

5.中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

6.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

（二）存放地点

上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼本基金管理人办公地址。

（三）查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人海富通基金管理有限公司。

客户服务中心电话：40088—40099

公司网址：www.htfund.com

海富通基金管理有限公司

2008 年 10 月 22 日

海富通股票证券投资基金

2008年第三季度报告

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：2008 年 10 月 22 日

一、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 2008 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2008 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

二、基金产品概况

1.基金简称：	海富通股票
2.基金代码：	519005
3.基金运作方式：	契约型开放式
4.基金合同生效日：	2005 年 7 月 29 日
5.报告期末基金份额总额：	8,358,871,864.74 份
6.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。
7.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。
8.业绩比较基准：	80％MSCI China A＋20％上证国债
9.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。
10.基金管理人：	海富通基金管理有限公司
11.基金托管人：	中国银行股份有限公司

三、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	报告期（2008 年 7 月 1 日 -2008 年 9 月 30 日）
1.	本期已实现收益	-1,023,035,652.65
2.	本期利润	-979,000,427.89
3.	加权平均基金份额本期利润	-0.1236
4.	期末基金资产净值	4,018,142,389.74
5.	期末基金份额净值	0.481

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。

（二）基金净值表现

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	-21.15%	2.47%	-15.72%	2.26%	-5.43%	0.21%

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

海富通股票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

（2005 年 7 月 29 日至 2008 年 9 月 30 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。

四、管理人报告

（一）基金经理简介

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	离职日期		
蒋征	本基金的基金经理；海富通强化回报基金基金经理；股票组合管理部总监	2007年2月	—	12年	中国国籍，工商管理硕士，持有基金从业人员资格证书。历任香港英皇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，拥有中国证券业协会基金从业人员资格证书。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。

（二）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。

（三）公平交易专项说明

1、公平交易制度的执行情况

公司自成立以来，就建立有公平交易制度，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，并进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

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。

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。

（四）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

在前两个月连续大幅下挫后，7 月份上证综指围绕着 2700 点窄幅震荡。7 月 3 日，上证综指曾一度跌破 2600 点大关，市场弥漫悲观气氛。但在新华社发表社论以及证监会明确维护股市稳定的措施下，股市逐渐反弹。此后，银行业中报的良好预期以及提高纺织品退税的利好消息，对股市反弹起了一定支撑作用。受到美国次贷危机有继续蔓延趋势，市场担心奥运后经济增长减速等不利因素影响下，大盘进入 8 月以后一路下行。9 月股市继续深幅下挫，8 月的宏观经济数据显示 PPI 创 12 年新高，加剧了投资者对国内经济滑坡的担忧，在美国陷入金融危机以及央行调低贷款利率、准备金率的因素刺激下，银行股领跌，导致 A 股市场迅速下滑，逼近 1800 点。在紧急关头，政府 18 日宣布印花税单边征收以及一揽子利好政策，导致第二天 A 股全线涨停报收。然而受美国股市大幅走低，金融动荡持续的影响，A 股在第三季度最后几个交易日连续低开下探，虽然三大银行股依然表现坚挺，但无奈大多数股票走势疲弱，部分行业和板块更是出现加速下行。纵观 2008 年第三季度 A 股市场，虽有时期短暂震荡微幅上升，但奥运以后，股市被悲观气氛笼罩，受国内、国外多重不利因素影响，股指一路下探，在第三季度最后一个交易日，沪深两市分别以 2293.78 点及 7559.27 点收官。

2008 年第三季度，特别是奥运会召开之后，指数呈加速下跌态势。我们坚信宏观经济的健康发展，坚信决策层在提倡促进消费和保持社会稳定的大背景下提升对资本市场重要性的认识和呵护的力度。一方面我们通过寻找差异化行业和个股的相对优势抵抗市场的非理性下跌，重点配置三季报业绩好，估值低、成长性和防御性兼备的行业如银行煤炭铁路建设等，另一方面加大对阶段性优势行业和优势品种的波段操作力度，并在恰当时机减仓甚至空仓规避周期性和政治、突发因素出现的风险。实际操作中，我们在投资上依然坚持股票等多重利好推出之际，我们明显提高了金融行业特别是非银行金融业如券商和保险的持仓，获得了显著的阶段性收益。

2、本基金业绩表现

报告期内，股票基金净值下跌了 21.15%，而同期基金业绩比较基准下跌 15.72%，基金净值落后业绩比较基准 5.43%。本季度基金业绩跑输基准，一是由于股票配置比例相对较高，二是虽大幅度用券商保险类资产替代了银行类资产，但替换节奏不够及时，拖累了业绩。

3、市场展望和投资策略

本轮美国金融危机对全球经济的影响还远远没有结束。次贷危机引发的美国金融震荡已经使得雷曼兄弟倒下，而其它投行也相继被收购和转型，投行模式彻底失败。中国企业持有雷曼兄弟的相关资产并不是很多，不会直接受到明显影响。但是美国实体经济的衰退还是会通过贸易等方式传导到中国，使得目前已经处于困境中的中国出口企业面临更大的挑战。中国本轮经济增长极大的提高了国家综合实力和居民的收入增长，但同时也引发了高房价和通货膨胀。在宏观调控的影响下，物价和房价都开始有所回落，但是宗商品价格走低而缓解成本压力的公司；二是如果政府政策重点转向经济增长而可能受益的行业；三是自下而上选择细分行业龙头或具备独特竞争力的公司长期持有。

五、投资组合报告

（一）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	3,314,762,763.55	77.92
	其中：股 票	3,314,762,763.55	77.92
2	固定收益投资	399,840,000.00	9.40
	其中：债 券	399,840,000.00	9.40
	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	404,132,741.75	9.50
6	其他资产	135,539,341.65	3.18
	合 计	4,254,274,846.95	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 农，林，牧，渔业	24,591,609.60	0.61
B 采掘业	332,954,688.39	8.29
C 制造业	1,135,848,966.75	28.27
C0 食品，饮料	96,790,681.00	2.38
C1 纺织，服装，皮毛	85,522,881.36	2.13
C2 木材，家具	-	-
C3 造纸，印刷	46,569,600.00	1.16
C4 石油，化学，塑胶，塑料	158,654,084.54	3.95
C5 电子	14,292,919.04	0.36
C6 金属，非金属	148,291,241.30	3.69
C7 机械，设备，仪表	562,847,711.97	14.01
C8 医药，生物制品	6,584,327.04	0.16
C99 其他制造业	17,295,510.50	0.43
D 电力，煤气及水的生产和供应业	50,656,669.10	1.26
E 建筑业	50,501,861.28	1.26
F 交通运输，仓储业	72,179,791.80	1.80
G 信息技术业	107,504,330.10	2.68
H 批发和零售贸易	424,472,085.24	10.57
I 金融，保险业	424,472,085.24	10.57
J 房地产业	-	-
K 社会服务业	7,198,103.54	0.18
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	-	-
合计	1,614,023,769.66	40.19

（三）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	000937	金牛能源	6,669,310.00	148,525,533.70	5.83
2	601398	工商银行	25,999,920.00	113,099,652.00	4.44
3	600030	中信证券	4,500,000.00	111,420,000.00	4.38
4	600036	招商银行	4,500,000.00	79,290,000.00	3.11
5	000792	盐湖钾肥	1,100,019.00	74,306,283.45	2.92
6	600028	中国石化	6,500,000.00	69,420,000.00	2.73
7	601766	中国南车	16,003,049.00	63,010,671.60	2.47
8	601628	中国人寿	2,299,934.00	58,096,332.84	2.28
9	600089	特变电工	3,255,477.00	53,910,699.12	2.12
10	600519	贵州茅台	400,000.00	52,756,000.00	2.07

（四）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	207,520,000.00	5.16
2	央行票据	192,320,000.00	4.79
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	可转债	-	-
7	其他	-	-
	合计	399,840,000.00	9.95

（五）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	080014	08国债14	2,000,000	207,520,000.00	5.16
2	0801096	08央票96	2,000,000	192,320,000.00	4.79
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

（六）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。

（七）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。

（八）投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产的构成：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,827,727.19
2	应收证券清算款	128,846,853.08
3	应收股利	-
4	应收利息	2,039,348.98
5	应收申购款	1,825,412.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	135,539,341.65

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明细。

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	600031	三一重工	86,361,063.75	2.41	重大事项停牌
2	000792	盐湖钾肥	67,130,514.50	1.87	重大重组事宜停牌

6、报告期内本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

六、开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	8,057,308,113.07
报告期期间基金总申购份额	1,260,392,989.24
报告期期间基金总赎回份额	958,829,237.67
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	8,358,871,864.74

七、备查文件目录

（一）备查文件目录

1.中国证监会批准设立海富通股票证券投资基金的文件

2.海富通股票证券投资基金基金合同

3.海富通股票证券投资基金招募说明书

4.海富通股票证券投资基金托管协议

5.中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

6.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

（二）存放地点

上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼本基金管理人办公地址。

（三）查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人海富通基金管理有限公司。

客户服务中心电话：40088—40099

公司网址：www.htfund.com

海富通基金管理有限公司

2008 年 10 月 22 日

海富通中国海外精选股票型证券投资基金

2008年第三季度报告

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：2008 年 10 月 22 日

一、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 2008 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2008 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

二、基金产品概况

1.基金简称：	海富通海外
2.基金代码：	519601
3.基金运作方式：	契约型开放式
4.基金合同生效日：	2008年 6 月 27 日
5.报告期末基金份额总额：	121,652,347.32 份
6.投资目标：	本基金以在香港、美国等海外证券交易所上市的具有“中国概念”的上市公司为主要投资对象。本基金管理人将深入研究全球及内地经济状况以及政策导向，采取主动精选证券和适度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。
7.投资策略：	根据对境内外证券市场投资经验的认识和对证券市场的实证分析，本基金管理人将基金的整体投资策略分为三个层次：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。主动精选证券是本基金投资策略的重点，本基金不积极谋求寻找市场的拐点，主要从控制系统性风险出发适度调整资产配置。
8.业绩比较基准：	MSCI中国指数（以美元计价）
9.风险收益特征：	本基金是股票型基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。
10.基金管理人：	海富通基金管理有限公司
11.基金托管人：	中国建设银行股份有限公司
12.境外投资顾问：	英文名称：Fortis Investment Management SA 中文名称：富通基金管理公司
13.境外资产托管人	英文名称：The Bank of New York Mellon 中文名称：纽约梅隆银行

三、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	报告期（2008 年 7 月 1 日 -2008 年 9 月 30 日）
1	本期已实现收益	1,263,021.64
2	本期利润	-5,353,106.00
3	加权平均基金份额本期利润	-0.0197
4	期末基金资产净值	116,849,085.08
5	期末基金份额净值	0.961

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。

（二）基金净值表现

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	-3.90%	0.91%	-25.78%	3.00%	21.88%	-2.09%

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

海富通海外累计份额净值增