海富通强化回报混合型证券投资基金

【2009】第四季度报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2010年1月21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2010年1月20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	海富通强化回报混合
基金主代码	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	3,149,507,728.33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(2009-10-01至2009-12-31)
1.本期已实现收益	100,384,760.74
2.本期利润	220,515,269.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0679
4.期末基金资产净值	2,224,284,208.24
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。

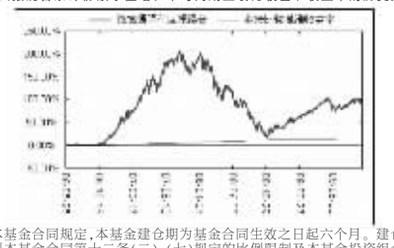
3.2 基金净值表现

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	①-③	②-④
过去3个月	10.49%	0.92%	0.83%	0.01%	9.66%	0.91%

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	基金经理(或基金经理小组)证券从业起始日期	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	1997年7月21日	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,募实基金管理有限公司主和基金基金经理助理,2003年1月至2004年4月任泰和基金基金经理,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基金基金经理,2005年12月至2006年5月任基金兴安基金经理。2006年6月加入海富通基金管理有限公司。2006年9月起任海富通回报基金基金经理,2007年1月至2009年1月兼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。
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	-	13年	1997-3-31	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。

注:1.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管理人对投资均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。

4.4.1报告期内基金投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金净值增长率为10.49%,同期业绩比较基准收益率为0.83%,基金净值跑赢业绩比较基准9.66个百分点。

从股市来看,展望未来,2010年一季度中国宏观经济必将继续保持高速增长的势头。但2009年A股市场的持续上涨已经在相当程度上反映了这一预期, 市场对于宏观刺激政策退出抑或转向的忧虑反而日渐增加,因此未来市场走势将取决于经济增长和宏观政策退出的力度和节奏,出口复苏程度和通货膨胀水平将成为关注的重要变量。

基于上述判断,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;在行业选择上,我们将重点关注得益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对供给瓶颈的部分上游行业; 国家经济转型政策扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续增长力的消费领域;另外,我们也会积极关注大型国企的兼并重组机会,并从上市公司年报中发掘业绩优良、未来成长性较好的品种。

从债市来看,本基金认为,2010年上半年债券市场不容乐观。主要原因是:经济刺激政策短期内不会退出,通货膨胀预期始终是债券市场必须面对的问题,债券市场缺乏足够的主动投资资金。新股仍然会密度发行,对资金面有分流作用;经济刺激政策退出在开始阶段对债券市场也没有正面影响。

本基金仍将保持较短的组合久期,但将从提高持有期收益出发,投资一些期限适中、收益率较高的债券,并注意防范信用风险,提高资产流动性。

§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	权益投资	1,065,115,685.73	45.63
	其中:股票	1,065,115,685.73	45.63
2	固定收益投资	1,131,179,580.80	48.46
	其中:债券	1,131,179,580.80	48.46
	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	72,600,586.28	3.11
6	其他资产	65,132,461.41	2.79
7	合计	2,334,028,314.22	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	-	-
B	采掘业	51,300,000.00	2.31
C	制造业	556,375,445.63	25.01
C0	食品、饮料	64,016,072.61	2.88
C1	纺织、服装、皮毛	642,000.00	0.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,226,303.57	0.10
C4	石油、化学、塑胶、塑料	73,198,487.34	3.29
C5	电子	13,521,337.08	0.61
C6	金属、非金属	70,238,172.00	3.16
C7	机械、设备、仪表	135,208,447.44	6.08
C8	医药、生物制品	183,422,625.59	8.25
C99	其他制造业	13,902,000.00	0.63
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	31,295,190.88	1.41
F	交通运输、仓储业	36,258,146.00	1.63
G	信息技术业	32,071,582.15	1.44
H	批发和零售贸易	28,224,744.75	1.27
I	金融、保险业	222,130,000.00	9.99
J	房地产业	22,167,000.00	1.00
K	社会服务业	18,198,576.32	0.82
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	67,095,000.00	3.02
	合计	1,065,115,685.73	47.89

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	601939	建设银行	15,000,000	92,850,000.00	4.17
2	600415	小商品城	1,500,000	67,095,000.00	3.02
3	600583	海油工程	4,500,000	51,300,000.00	2.31
4	600135	乐凯胶片	3,794,209	45,226,971.28	2.03
5	601169	北京银行	2,300,000	44,482,000.00	2.00
6	601009	南京银行	2,200,000	42,570,000.00	1.91
7	600015	华夏银行	3,400,000	42,228,000.00	1.90
8	600765	中航重机	2,000,000	39,080,000.00	1.76
9	600812	华北制药	3,244,868	37,964,955.60	1.71
10	000729	燕京啤酒	1,999,953	37,539,117.81	1.69

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	102,305,180.00	4.60
2	央行票据	98,280,000.00	4.42
3	金融债券	222,634,000.00	10.01
	其中:政策性金融债	171,309,000.00	7.70
4	企业债券	208,220,400.80	9.36
5	企业短期融资券	499,740,000.00	22.47
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,131,179,580.80	50.86

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	0981096	09中广核CP01	2,000,000	199,880,000.00	8.99
2	0981118	09华谊CP01	2,000,000	199,840,000.00	8.98
3	080305	08进出05	1,700,000	171,309,000.00	7.70
4	010110	21国债00	1,000,000	102,290,000.00	4.60
5	0981207	09浦发CP01	1,000,000	100,020,000.00	4.50

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,221,509.35
2	应收证券清算款	50,502,294.54
3	应收股利	-
4	应收利息	12,361,071.32
5	应收申购款	47,586.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,132,461.41

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	600765	中航重机	39,080,000.00	1.76	非公开发行

§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	3,346,453,537.06
本报告期基金总申购份额	7,840,603.31
减:本报告期基金总赎回份额	204,786,412.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,149,507,728.33

§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11只开放式基金。截至2009年四季度末,海富通管理的公募基金资产规模近460亿元人民币。

作为首批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2009年四季度末,海富通为近50家企业超过100亿元的企业年金基金担任了投资管理人。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2009年四季度末,投资咨询业务规模超过230亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2009年,海富通旗下基金的业绩表现较为出色。根据晨星(Morning Star)排名,2009年全年,海富通风格优势股票基金净值增长率在股票型基金位列前1/4。

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,在2008年复评中海富通又被升级为"惠誉M2+(中国)"资产管理人优秀评级。

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学校、在沙化严重的内蒙古库伦旗捐建了公益林、向上海民工小学捐赠电脑、为安徽老区小学扶贫助学并捐赠物资等。

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《股市与幸福感》调研报告后,海富通四季度与东方财富网合作,推出了为期三个月的"幸福投资路、积分赢大奖"幸福投资主题游戏活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

2009年四季度内,海富通在《华西都市报》"榜样中国2009年度传媒大奖"评选中获年度最受投资者信赖基金公司奖项、海富通中国海外股票(QDII)基金获年度最佳QDII产品称号。海富通在《新闻晨报》"2009年度十大基金评选"中,获十大特色基金公司奖项、海富通中国海外股票(QDII)基金获十佳基金奖项。

§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
2010年1月21日

海富通精选证券投资基金

【2009】第四季度报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2010年1月21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2010年1月20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10月1日起至2009年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
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	9,870,314,426.42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(2009-10-01至2009-12-31)
1.本期已实现收益	359,710,912.43
2.本期利润	1,051,015,100.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.1031
4.期末基金资产净值	8,626,271,090.28
5.期末基金份额净值	0.8740

(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。

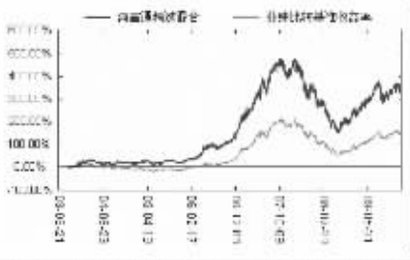
3.2 基金净值表现

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	13.01%	1.25%	12.41%	1.14%	0.60%	0.11%

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	基金经理(或基金经理小组)证券从业起始日期	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	1992年7月1日	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	2002年1月28日	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。

注:1.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管理人对投资均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13.01%、精选贰号基金11.76%,两者净值增长率之差的绝对值为1.25%,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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

随着宏观经济的进一步好转,A股市场在2009年第四季度稳步上升,深圳成份指数、中小板指数纷纷创出年内新高。创业板市场的推出,极大的活跃了中小企业板个股的活跃度,并使得市场形成了深强沪弱的格局。中央经济工作会议明确了明年将维持宏观经济政策的延续性,并在2009年的基础上继续大力促进内需。在宏观政策支持下,消费、电子、化工等行业的表现明显优于大盘。市场对于明年地产市场会受到政府调控的担忧使得地产及相关行业的表现明显弱于大盘。

报告期内,本基金认为基于基数效应经济增速依然具备上行动力,但A股市场的持续上涨已经部分包含了经济复苏的刺激,因此在资产配置上基本保持不变,加大了消费行业如医药、家电等的配置,同时增持了部分产能利用率迅速提高的价格敏感性中游行业。至于金融地产等权重行业则采取了相对低配的策略。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通精选混合基金净值增长率为13.01%,同期业绩比较基准收益率为12.41%,基金净值跑赢业绩比较基准0.60个百分点。

展望未来,二零一零年一季度中国宏观经济必将继续保持高速增长的势头。但二零零九年A股市场的持续上涨也在相当程度上反映了这一预期, 对于宏观刺激政策退出抑或转向的忧虑反而日渐增加,因此未来市场走势将取决于经济增长和宏观政策退出的力度和节奏,出口复苏程度和通货膨胀水平将成为关注的重要变量。

基于上述判断,在行业选择上,我们将重点关注得益于产能利用率提高而存在涨价预期的中游以及存在相对供给瓶颈的部分上游行业; 国家经济转型政策扶持的新兴行业以及受益于消费升级和农村消费而具备持续增长力的消费领域。

§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	5,994,063,492.83	69.25
	其中:股票	5,994,063,492.83	69.25
2	固定收益投资	1,824,333,773.70	21.08
	其中:债券	1,824,333,773.70	21.08
	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	657,617,331.41	7.60
6	其他资产	179,808,083.90	2.08
7	合计	8,655,822,681.84	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	-	-
B	采掘业	745,043,197.30	8.64
C	制造业	2,683,227,622.00	31.11
C0	食品、饮料	263,860,321.29	3.06
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,259,571.09	0.01
C4	石油、化学、塑胶、塑料	344,935,139.73	4.00
C5	电子	36,932,731.30	0.43
C6	金属、非金属	557,969,535.41	6.47
C7	机械、设备、仪表	706,716,288.73	8.19
C8	医药、生物制品	771,554,034.45	8.94
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	89,568,194.74	1.04
F	交通运输、仓储业	110,689,960.08	1.28
G	信息技术业	372,951,935.01	4.32
H	批发和零售贸易	289,678,052.87	3.36
I	金融、保险业	906,116,252.76	10.50
J	房地产业	73,830,000.00	0.86
K	社会服务业	263,781,722.34	3.06
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	459,176,555.73	5.32
	合计	5,994,063,492.83	69.49

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	268,380,000.00	3.11
2	601009	南京银行	10,000,000	193,500,000.00	2.24
3	601169	北京银行	10,000,077	193,401,489.18	2.24
4	600655	豫园商城	6,819,939	186,388,932.87	2.16
5	000063	中兴通讯	4,000,000	179,480,000.00	2.08
6	600583	海油工程	15,000,000	171,000,000.00	1.98
7	600519	贵州茅台	1,001,005	169,990,669.10	1.97
8	000527	美的电器	7,000,000	162,400,000.00	1.88
9	600547	山东黄金	2,000,663	160,653,238.90	1.86
10	601628	中国人寿	5,000,000	158,450,000.00	1.84

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	63,218,773.70	0.73
2	央行票据	803,415,000.00	9.31
3	金融债券	957,700,000.00	11.10
	其中:政策性金融债	957,700,000.00	11.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,824,333,773.70	21.15

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	353,430,000.00	4.10
2	0801023	08央票23	2,500,000	256,750,000.00	2.98
3	0701098	07央票98	2,000,000	202,740,000.00	2.35
4	070421	07农发21	2,000,000	201,700,000.00	2.34
5	070410	07农发10	2,000,000	201,080,000.00	2.33

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,266,237.47
2	应收证券清算款	143,564,803.96
3	应收股利	-
4	应收利息	30,860,140.96
5	应收申购款	116,901.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179,808,083.90

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	171,000,000.00	1.98	临时停牌

§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	10,476,679,309.56
本报告期基金总申购份额	144,499,510.07
减:本报告期基金总赎回份额	750,864,393.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,870,314,426.42

§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11只开放式基金。截至2009年四季度末,海富通管理的公募基金资产规模近460亿元人民币。

作为首批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2009年四季度末,海富通为近50家企业超过100亿元的企业年金基金担任了投资管理人。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2009年四季度末,投资咨询业务规模超过230亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2009年,海富通旗下基金的业绩表现较为出色。根据晨星(Morning Star)排名,2009年全年,海富通风格优势股票基金净值增长率在股票型基金位列前1/4。

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,在2008年复评中海富通又被升级为"惠誉M2+(中国)"资产管理人优秀评级。

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学校、在沙化严重的内蒙古库伦旗捐建了公益林、向上海民工小学捐赠电脑、为安徽老区小学扶贫助学并捐赠物资等。

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《股市与幸福感》调研报告后,海富通四季度与东方财富网合作,推出了为期三个月的"幸福投资路、积分赢大奖"幸福投资主题游戏活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

2009年四季度内,海富通在《华西都市报》"榜样中国2009年度传媒大奖"评选中获年度最受投资者信赖基金公司奖项、海富通中国海外股票(QDII)基金获年度最佳QDII产品称号。海富通在《新闻晨报》"2009年度十大基金评选"中,获十大特色基金公司奖项、海富通中国海外股票(QDII)基金获十佳基金奖项。

§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
2010年1月21日

海富通精选贰号混合型证券投资基金

【2009】第四季度报告

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:2010年1月21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2010年1月20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