

## 信息披露| Disclosure

## 海富通精选证券投资基金

## [2011] 第一季度报告

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:二〇一一年四月二十二日

重要提示

基金管理人的董事会及基金经理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，并对其中的真实性、准确性、完整性和及时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的约定，于2011年4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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告期基金财务数据未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2011年3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3月22日

报告期末基金份额总额:9,425,058,916.68份

本基金采取积极主动的精选证券和适度主动进行资产配置的投资策略，实现基金资产的长期最大化增值。

本基金的投资策略分为两个层次：第一层为适度主动的资产配置，以控制整体风险和实现基金资产的长期增值为目标，以分散风险、降低个券风险、提升主动配置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%

本基金属于股票型基金，其风险收益适中的品种。本基金力争通过适度主动的资产配置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1月1日-2011年3月31日)

1.本期已实现收益 230,220,238.77

2.本期利润 120,670,606.09

3.加权平均基金份额本期利润 0.0127

4.期末基金份额净值 9,053,148,939.71

0.9605

5.期末基金份额净值 9,053,148,939.71

0.9605

6.本期已实现收益/基金本期利润/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/本期已实现收益/本期公允价值变动收益。

3.2.1 报告期基金份额净值增长比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 业绩比较 率② 基准净值 增长率 ③ 基准收益率 基准差 值④

过去三个月 1.32% 0.89% -0.49% 0.28%

3.2.2 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基金净值增长与业绩比较基准收益历史走势对比图(2003年8月22日至2011年3月31日)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益历史走势对比图(2003年8月22日至2011年3月31日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期。本基金自2007年6月28日至2007年9月29日,为持续建仓期。建仓完成后至至今,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合同规定的比例范围。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 在任日期 离任日期 说明

陈晓 基金经理, 基金经理小组副经理, 技术总监 2003-8-22 -

18年

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.5 报告期内基金投资组合变动分析

4.6 报告期内基金投资策略和运作分析

4.7 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.8 公平交易专项说明

4.9 报告期内基金投资策略和运作分析

4.10 报告期内基金投资组合变动分析

4.11 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.12 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.13 公平交易专项说明

4.14 报告期内基金投资策略和运作分析

4.15 报告期内基金投资组合变动分析

4.16 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.17 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.18 公平交易专项说明

4.19 报告期内基金投资策略和运作分析

4.20 报告期内基金投资组合变动分析

4.21 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.22 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.23 公平交易专项说明

4.24 报告期内基金投资策略和运作分析

4.25 报告期内基金投资组合变动分析

4.26 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.27 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.28 公平交易专项说明

4.29 报告期内基金投资策略和运作分析

4.30 报告期内基金投资组合变动分析

4.31 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.32 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.33 公平交易专项说明

4.34 报告期内基金投资策略和运作分析

4.35 报告期内基金投资组合变动分析

4.36 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.37 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.38 公平交易专项说明

4.39 报告期内基金投资策略和运作分析

4.40 报告期内基金投资组合变动分析

4.41 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.42 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.43 公平交易专项说明

4.44 报告期内基金投资策略和运作分析

4.45 报告期内基金投资组合变动分析

4.46 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.47 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.48 公平交易专项说明

4.49 报告期内基金投资策略和运作分析

4.50 报告期内基金投资组合变动分析

4.51 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.52 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.53 公平交易专项说明

4.54 报告期内基金投资策略和运作分析

4.55 报告期内基金投资组合变动分析

4.56 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.57 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.58 公平交易专项说明

4.59 报告期内基金投资策略和运作分析

4.60 报告期内基金投资组合变动分析

4.61 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.62 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.63 公平交易专项说明

4.64 报告期内基金投资策略和运作分析

4.65 报告期内基金投资组合变动分析

4.66 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.67 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.68 公平交易专项说明

4.69 报告期内基金投资策略和运作分析

4.70 报告期内基金投资组合变动分析

4.71 市场表现与投资策略

注:对本基金的首任基金经理, 其任职日期即指基金合同生效日, 离任日期即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即指公司做出决定之日。

4.72 管理人对报告期内本基金运作的分析

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, 本着诚信经营、勤勉尽责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。

4.73 公平交易专项说明