海富通风格优势股票型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一一年四月二十二日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,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	海富通风格优势股票
基金主代码	519013
交易代码	519013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月19日
报告期末基金份额总额	6,657,313,518.56份
投资目标	在适度控制风险并保持资产良好流动性的前提下,通过积极选择不同风格优势的股票,力争为投资者提供长期稳定的超额回报。
投资策略	本基金将在适度的大类资产配置的基础上,运用"风格优选,积极轮换,精选个股"策略,把握不同风格优势策略在不同阶段的变动趋势和投资机会,并在策略内自下而上精选个股,实现基金资产的超额收益。本基金的投资策略主要包括资产配置策略、风格轮换策略和精选证券策略。
业绩比较基准	75%MSCI China A+25%上证国债
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	251,049,871.09
2.本期利润	-239,928,174.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0354
4.期末基金资产净值	6,854,126,408.02
5.期末基金份额净值	1.030

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。

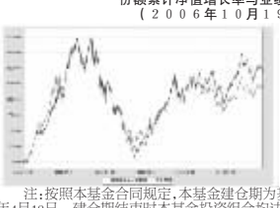
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-3.10%	1.27%	1.91%	1.02%	-5.01%	0.25%

3.2.2自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

海富通风格优势股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年10月19日至2011年3月31日)



注: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,即2006年10月19日至2007年4月18日。建仓期结束时本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(二)、(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		
康赛波	本基金的基金经理	2007-8-6	-	13年	中国国籍,金融学士,持有基金从业人员资格证书。1997年至1999年工作于湘财证券有限责任公司,主要从事投资管理业务;1999年至2000年工作于大成基金管理有限公司,从事研发及投资管理业务;2001年2月起加入湘财合丰基金管理公司筹备组,2003年4月至2005年4月任泰达荷银合丰稳定基金基金经理;2005年4月至2006年12月担任泰达荷银风险预算股票基金基金经理;2006年5月至2007年4月担任泰达荷银效率基金基金经理;2007年5月加入海富通基金管理有限公司,2007年8月起任海富通风格优势股票基金基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期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均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为:自参加证券行业的相关工作开始计算。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年一季度经济略有降温迹象,外围经济相对平稳,主要是由于政府调整经济结构所致。虽然近日发改委延后了包括成品油、日化企业的涨价,但是通胀压力仍然较大。央行在2月份出手加息,一季度3次上调准备金,均显示控物价仍是政府目前首要任务。一季度的资金市场可谓一波三折,年初资金利率一路追高,到了春节期间达到顶点,回购利率达到了8.5%的历史高位。春节过后资金市场缓慢恢复,3月份由于央票到期量大,资金面又宽松起来,资金利率下降到2.4%左右。债券在一月份由于资金成本的高企随即急速下跌,又随着资金面的宽松迎来了一波小行情。信用债在春节后的行情表现较好,主要由于当前的信用债收益率与信用利差均处于历史较高位置,即使考虑到通胀加息预期,信用债券也相对利率更加安全。

海富通货币基金本季度规模下降明显,特别在季度末大额赎回。本季度货币基金增加了信用债比例,维持较高的存款比例,没有主动增加利率债券仓位,回购比例高位之后进入2月份开始下降。适时的增加信用债比例增加了投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A级基金净值收益率为 0.8395%,同期业绩比较基准收益率为0.7054 %;B级基金净值收益率为0.8993 %,同期业绩比较基准收益率为 0.7054 %。

4.4.3 市场展望和投资策略

本基金认为二季度通胀仍将高位运行,个别月份CPI或破6%,加息和准备金市场均有预期。

但是由于下半年CPI会有所回落,所以本基金认为加息幅度不会过大。本基金将在下个季度适时增加利率债券久期和仓位。

§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	6,089,630,696.89	88.44
	其中:股票	6,089,630,696.89	88.44
2	固定收益投资	48,795,000.00	0.71
	其中:债券	48,795,000.00	0.71
	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	736,883,986.52	10.70
6	其他各项资产	10,554,798.10	0.15
7	合计	6,885,864,481.51	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	247,257,975.80	3.61
C	制造业	2,845,119,694.42	41.51
C0	食品、饮料	235,009,784.39	3.43
C1	纺织、服装、皮毛	57,550,000.00	0.84
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	11,541,605.40	0.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	183,483,575.89	2.68
C5	电子	185,146,977.69	2.70
C6	金属、非金属	506,009,989.54	7.38
C7	机械、设备、仪表	873,739,697.76	12.75
C8	医药、生物制品	792,638,063.75	11.56
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	85,101,335.25	1.24
E	建筑业	215,142,298.02	3.14
F	交通运输、仓储业	33,098,447.76	0.48
G	信息技术业	890,175,663.74	12.99
H	批发和零售贸易	335,244,650.77	4.89
I	金融、保险业	674,316,440.68	9.84
J	房地产业	190,135,784.60	2.77
K	社会服务业	237,521,513.04	3.47
L	传播与文化产业	111,601,398.32	1.63
M	综合类	224,915,494.49	3.28
	合计	6,089,630,696.89	88.85

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	600406	国电南瑞	10,001,126	332,837,473.28	4.86
2	600036	招商银行	22,999,944	324,069,210.96	4.73
3	600415	小商品城	7,101,847	224,915,494.49	3.28
4	600585	海螺水泥	5,411,329	219,267,051.08	3.20
5	000538	云南白药	2,902,103	161,937,347.40	2.36
6	000063	中兴通讯	5,009,782	150,293,460.00	2.19
7	600000	浦发银行	9,999,991	136,199,877.42	1.99
8	600195	中牧股份	5,676,755	134,482,325.95	1.96
9	600563	法拉电子	5,000,000	133,000,000.00	1.94
10	600068	葛洲坝	10,889,612	127,735,148.76	1.86

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	-	-
2	央行票据	48,795,000.00	0.71
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	-	-
8	合计	48,795,000.00	0.71

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	1001072	10央行票据72	500,000	48,795,000.00	0.71

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投资。

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,076,120.53
2	应收证券清算款	2,898,003.07
3	应收股利	-
4	应收利息	781,711.34
5	应收申购款	798,963.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,554,798.10

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

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

本报告期期初基金份额总额	6,947,867,978.89
本报告期基金总申购份额	376,728,462.82
减:本报告期基金总赎回份额	667,282,923.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,657,313,518.56

§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16只开放式基金。截至2011年3月31日,海富通管理的公募基金资产规模近417亿元人民币。

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2011年3月31日,海富通为50多家企业超过142亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2011年3月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过25亿元。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2011年3月31日,投资咨询业务规模达226亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2011年3月31日,海富通在由《证券时报》举办的2010年度"中国基金业明星奖"评选中,获"2010年度十大明星基金公司奖"。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划",针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了公益林。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通风格优势股票型证券投资基金的文件

(二)海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同

(三)海富通风格优势股票型证券投资基金招募说明书

(四)海富通风格优势股票型证券投资基金托管协议

(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)报告期内海富通风格优势股票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
二〇一一年四月二十二日

海富通货币市场证券投资基金

【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:中国银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一一年四月二十二日

§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	海富通货币	
基金主代码	519505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年1月4日	
报告期末基金份额总额	4,288,753,575.58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	585,174,293.22份	3,703,579,282.36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	报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)	
	海富通货币A	海富通货币B
1.本期已实现收益	5,512,023.04	48,163,680.45
2.本期利润	5,512,023.04	48,163,680.45
3.期末基金资产净值	585,174,293.22	3,703,579,282.36

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

1.海富通货币A

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
过去三个月	0.8395%	0.0020%	0.7054%	0.0003%	0.1341%	0.0017%

2.海富通货币B

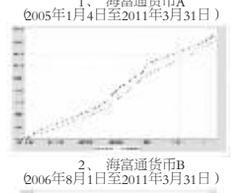
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8993%	0.0019%	0.7054%	0.0003%	0.1939%	0.0016%

注:本基金收益分配按月结转份额。

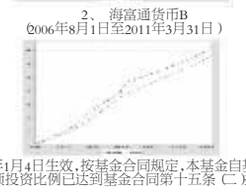
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通货币市场证券投资基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

1、海富通货币A
(2005年1月4日至2011年3月31日)



2、海富通货币B
(2006年8月1日至2011年3月31日)



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	2008-2-14	-	8年	经济学学士学位,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,现任海富通货币基金基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期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均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为:自参加证券行业的相关工作开始计算。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年一季度经济略有降温迹象,外围经济相对平稳,主要是由于政府调整经济结构所致。虽然近日发改委延后了包括成品油、日化企业的涨价,但是通胀压力仍然较大。央行在2月份出手加息,一季度3次上调准备金,均显示控物价仍是政府目前首要任务。一季度的资金市场可谓一波三折,年初资金利率一路追高,到了春节期间达到顶点,回购利率达到了8.5%的历史高位。春节过后资金市场缓慢恢复,3月份由于央票到期量大,资金面又宽松起来,资金利率下降到2.4%左右。债券在一月份由于资金成本的高企随即急速下跌,又随着资金面的宽松迎来了一波小行情。信用债在春节后的行情表现较好,主要由于当前的信用债收益率与信用利差均处于历史较高位置,即使考虑到通胀加息预期,信用债券也相对利率更加安全。

海富通货币基金本季度规模下降明显,特别在季度末大额赎回。本季度货币基金增加了信用债比例,维持较高的存款比例,没有主动增加利率债券仓位,回购比例高位之后进入2月份开始下降。适时的增加信用债比例增加了投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A级基金净值收益率为 0.8395%,同期业绩比较基准收益率为0.7054 %;B级基金净值收益率为0.8993 %,同期业绩比较基准收益率为 0.7054 %。

4.4.3 市场展望和投资策略

本基金认为二季度通胀仍将高位运行,个别月份CPI或破6%,加息和准备金市场均有预期。

但是由于下半年CPI会有所回落,所以本基金认为加息幅度不会过大。本基金将在下个季度适时增加利率债券久期和仓位。

§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	2,894,497,647.10	59.97
	其中:债券	2,894,497,647.10	59.97
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	584,001,226.00	12.10
	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	1,255,230,949.48	26.01
4	其他各项资产	92,672,750.45	1.92
5	合计	4,826,402,573.03	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.64
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	474,999,087.50	11.08
	其中:买断式回购融资	-	-

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	129
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	131
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

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	34.72	11.08
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.34	-
2	30天(含)—60天	9.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	10.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.73	-
4	90天(含)—180天	21.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.20	-
5	180天(含)—397天(含)	34.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.85	11.08

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	391,924,542.56	9.14
3	金融债券	868,948,093.73	20.26
	其中:政策性金融债	868,948,093.73	20.26
4	企业债券	542,030,677.41	12.64
5	企业短期融资券	1,091,594,333.40	25.45
6	其他	-	-
7	合计	2,894,497,647.10	67.49
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	612,001,209.48	14.27

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	1001095	10央行票据95	4,000,000	391,924,542.56	9.14
2	1181077	11长电CP01	2,600,000	260,561,958.97	6.08
3	090307	09进出07	2,500,000	248,629,022.48	5.80
4	060202	06国开02	2,000,000	200,023,234.60	4.66
5	100231	10国开31	2,000,000	199,877,710.71	4.66
6	058031	05中信债1	1,800,000	175,743,142.72	4.10
7	0980147	09中航工债浮	1,600,000	161,027,534.01	3.75
8	1181062	11沪电气CP01	1,400,000	140,106,880.12	3.27
9	068007	06首都机场债	1,400,000	137,260,887.89	3.20
10	1181078	11五矿CP01	1,000,000	100,209,396.45	2.34

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	8次
报告期内偏离度的最高值	0.3022%
报告期内偏离度的最低值	-0.0122%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1445%

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 基金计价方法说明

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	20,321,422.74
3	应收利息	30,032,740.74
4	应收申购款	42,318,586.97
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	92,672,750.45

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通货币A	海富通货币B
本报告期期初基金份额总额	814,445,461.42	5,684,604,758.46
本报告期基金总申购份额	1,709,897,538.59	7,113,503,268.43
减:本报告期基金总赎回份额	1,939,168,706.79	9,094,528,744.53
本报告期期末基金份额总额	585,174,293.22	3,703,579,282.36

§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16只开放式基金。截至2011年3月31日,海富通管理的公募基金资产规模近417亿元人民币。

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2011年3月31日,海富通为50多家企业超过142亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2011年3月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过25亿元。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2011年3月31日,投资咨询业务规模达226亿元人民币,海富通投资咨询业务成为其颇具特色的业务之一。

2011年3月31日,海富通在由《证券时报》举办的2010年度"中国基金业明星奖"评选中,获"2010年度十大明星基金公司奖"。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划",针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了公益林。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)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

(二)海富通货币市场证券投资基金基金合同

(三)海富通货币市场证券投资基金招募说明书

(四)海富通货币市场证券投资基金托管协议

(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)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
二〇一一年四月二十二日

海富通股票证券投资基金

【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:中国银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一一年四月二十二日

§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	海富通股票
基金主代码	519005
交易代码	519005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年7月29日
报告期末基金份额总额	6,238,668,013.17份
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。
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。
业绩比较基准	80%MSCI China A+20%上证国债
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.
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

§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	-8,837,616.09
2.本期利润	-220,444,749.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0348
4.期末基金资产净值	4,638,845,870.40
5.期末基金份额净值	0.744

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。

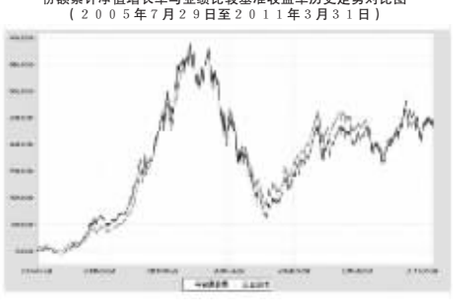
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-4.37%	1.42%	1.96%	1.09%	-6.33%	0.33%

3.2.2自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

海富通股票证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年7月29日至2011年3月31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,