

# 海富通精选贰号混合型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

2011 年 6 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：二〇一一年八月二十九日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
2	基金简介 .....	6
2.1	基金基本情况 .....	6
2.2	基金产品说明 .....	6
2.3	基金管理人和基金托管人.....	7
2.4	信息披露方式 .....	7
2.5	其他相关资料 .....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	8
3.1	主要会计数据和财务指标.....	8
3.2	基金净值表现 .....	8
4	管理人报告 .....	10
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告 .....	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6.1	资产负债表 .....	14
6.2	利润表 .....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4	报表附注 .....	19
7	投资组合报告 .....	37
7.1	期末基金资产组合情况.....	37
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6	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 .....	43
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	44
7.8	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 .....	44
7.9	投资组合报告附注.....	44

8	基金份额持有人信息.....	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	45
9	开放式基金份额变动.....	45
10	重大事件揭示 .....	46
10.1	基金份额持有人大会决议.....	46
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8	其他重大事件 .....	48
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	50
12	备查文件目录 .....	51
12.1	备查文件目录 .....	51
12.2	存放地点 .....	51
12.3	查阅方式 .....	51



## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通精选贰号混合型证券投资基金
基金简称	海富通精选贰号混合
基金主代码	519015
交易代码	519015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月9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
报告期末基金份额总额	2,920,954,155.25份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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度适中的品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	唐州徽
	联系电话	021-38650891	010-66594855
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		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	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		邵国有	肖钢

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	77,209,662.42
本期利润	-23,997,930.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0092
本期加权平均净值利润率	-1.26%
本期基金份额净值增长率	-0.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	-768,265,642.66
期末可供分配基金份额利润	-0.2630
期末基金资产净值	2,152,688,512.59
期末基金份额净值	0.737
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	22.03%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

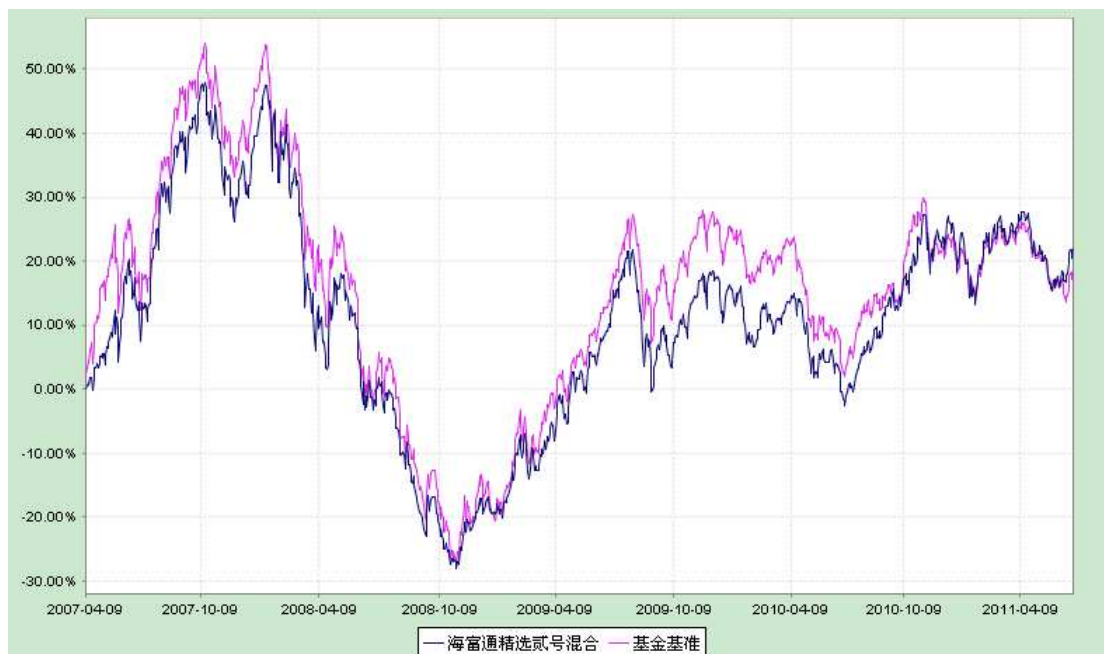
阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	-------	-------	-------	-----	-----



	增长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	4.39%	0.87%	1.32%	0.80%	3.07%	0.07%
过去三个月	-1.47%	0.85%	-3.61%	0.73%	2.14%	0.12%
过去六个月	-0.41%	1.01%	-1.86%	0.81%	1.45%	0.20%
过去一年	22.63%	1.08%	14.24%	0.92%	8.39%	0.16%
过去三年	23.51%	1.23%	18.59%	1.28%	4.92%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	22.03%	1.40%	18.28%	1.42%	3.75%	-0.02%

### 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

海富通精选贰号混合型证券投资基金  
 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  
 (2007年4月9日至2011年6月30日)



注：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，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。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎投资管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。本海富通精选贰号混合型证券投资基金是基金管理人管理的第七只开放式基金；除本基金外，基金管理人目前还管理着海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通中国海外精选股票型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘股票型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选股票型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金和海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金十七只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
丁俊	本基金的基金经理；海富通精选混合基金基金经理	2007-08-06	-	9 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 月起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、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：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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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-0.66%、精选贰号基金-0.41%，两者净值增长率之差的绝对值为 0.25%，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 管理人对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 年上半年，A 股总体呈现先涨后跌的震荡格局。一季度大盘股表现较好，带领市场走出一轮估值修复行情。但到了二季度，在国内通货膨胀加剧，欧美经济出现反复的背景下，A 股表现疲弱。由于投资者担心持续的紧缩政策以及严厉的房产调控将使经济增长放缓，上证指数五月份下跌幅度接近 6%，抹去了一季度的涨幅。化工、建材、家电板块走势较强，航空、医药、食品行业跌幅较大；大盘股表现相对优于小盘股。

报告期内本基金基本保持股票资产相对较高的配置比例，而结构上则依据宏观经济和通胀走势进行部分调整，即一季度继续增持周期性资产和金融资产、减持增速放缓的部分非周期性资产，相对提高了低估值资产在组合中的比例。进入 4 月份之后，考虑到二季度经济增速趋于下行和通胀趋于上行的不利格局，本基金小幅降低了股票配置比例，同时在结构上适度采取了防御策略，部分增持了消费类资产。随着市场对于通胀上行和经济下行的担心日趋加剧以及资金面紧张，指数出现明显下跌。对此，我们觉得系统性风险得到相对充分的释放，重新开始提高股票配置比例，同时增持有望受益于保障房建设投资的相关类资产。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-0.41%，同期业绩比较基准收益率为-1.86%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.45 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，海外经济和国内经济仍处于较为复杂的状态中。国际油价波动剧烈；欧债危机可能继续蔓延至周边国家，并演变成欧元危机；美国债务危机问题将会得到妥协，但其失业率可能依旧较高，经济增速或将有所放缓；新兴经济体增长动力相对较弱，全球经济复苏的道路上存在着诸多的不确定性。国内上半年通胀较高，下半年政策的腾挪空间可能较小。为了实现控通胀和保增长的双重目标，下半年的紧缩力度会有所缓和，央行加息和提准备金的动力都不是很大，资金面或将处于一个不紧也不松的状态。上半年受到紧缩环境的影响，保障房、水利建设和铁路建设等重点项目的投资都未大幅开展。下半年随着通胀压力的减缓和随之带来的资金面的略有放松，政府可能会加大在这些项目上的投资。此外，我国宏观经济依然处于调整结构的过程中，新兴产业发展与制造业升级是推动经济转型的两大突破方

向,下半年随着产业规划和产业政策的落实,相关板块也将会蕴含一些新的投资机会。总体而言,我们认为下半年市场可能依然处于一个震荡的格局中,期间会存在不少主题性的投资机会,但可能难有系统性的投资机会,指数创新高的可能性不大。

基于上述判断,下半年我们将继续密切关注国内外宏观经济形势和政策的变化,自上而下的深入挖掘受到国家宏观政策扶持,受益于经济转型的板块和公司。同时,也会根据半年报综合考虑股票估值的安全性和其未来的成长性,对投资组合进行优化调整,配置一些有一定安全边际且业绩增速具备一定爆发力的周期股和业绩优良成长性较好的成长股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会,委员会成员具有 3 年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能,并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议,并和相关托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告,以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意,并经本公司业务管理委员会批准后实施。

基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外,其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员,不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种,基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券,采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种,采用证券投资基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、本基金本报告期内无应分配的收益。

二、已实施的利润分配:无。

三、不存在应分配但尚未实施的利润。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对海富通精选贰号混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内, 本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督, 对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核, 未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注: 财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体: 海富通精选贰号混合型证券投资基金

报告截止日: 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产:			

银行存款	6.4.7.1	117,332,522.32	24,079,268.38
结算备付金		1,520,575.61	3,768,825.87
存出保证金		1,215,896.35	1,516,955.89
交易性金融资产	6.4.7.2	2,011,981,482.45	1,770,858,041.74
其中：股票投资		1,575,080,482.45	1,389,506,041.74
基金投资		-	-
债券投资		436,901,000.00	381,352,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		16,482,511.71	-
应收利息	6.4.7.5	10,040,450.16	8,806,257.56
应收股利		729,000.00	-
应收申购款		677,017.15	191,913.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,159,979,455.75	1,809,221,263.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		808,946.94	3,450,634.96
应付赎回款		1,489,625.05	1,073,391.33
应付管理人报酬		2,568,446.53	2,414,042.20
应付托管费		428,074.43	402,340.36

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,017,394.15	2,189,092.62
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	978,456.06	1,210,059.46
负债合计		7,290,943.16	10,739,560.93
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,920,954,155.25	2,430,391,368.32
未分配利润	6.4.7.10	-768,265,642.66	-631,909,666.03
所有者权益合计		2,152,688,512.59	1,798,481,702.29
负债和所有者权益总计		2,159,979,455.75	1,809,221,263.22

注：报告截止日 2011 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.737 元，基金份额总额 2,920,954,155.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通精选贰号混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-3,295,544.55</b>	<b>-341,749,566.76</b>
1.利息收入		8,359,486.56	10,414,858.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	406,621.96	1,021,674.52
债券利息收入		7,692,873.67	9,043,341.17
资产支持证券利息收		-	-



入			
买入返售金融资产收入		259,990.93	349,842.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		89,544,290.04	-1,648,528.03
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	78,823,304.75	-5,739,434.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-355,000.01	-1,871,500.00
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	11,075,985.30	5,962,406.48
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.16	-101,207,593.31	-350,580,986.93
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	6.4.7.17	8,272.16	65,090.15
<b>减: 二、费用</b>		<b>20,702,386.34</b>	<b>28,145,970.87</b>
1. 管理人报酬		14,126,090.75	17,942,823.35
2. 托管费		2,354,348.50	2,990,470.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,960,938.33	6,813,759.13
5. 利息支出		11,859.19	159,587.51
其中: 卖出回购金融资产支出		11,859.19	159,587.51
6. 其他费用	6.4.7.19	249,149.57	239,330.37
<b>三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)</b>		<b>-23,997,930.89</b>	<b>-369,895,537.63</b>
减: 所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,997,930.89	-369,895,537.63
-------------------	--	----------------	-----------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通精选贰号混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,430,391,368.32	-631,909,666.03	1,798,481,702.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-23,997,930.89	-23,997,930.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	490,562,786.93	-112,358,045.74	378,204,741.19
其中：1. 基金申购款	685,865,647.22	-161,599,814.86	524,265,832.36
2. 基金赎回款	-195,302,860.29	49,241,769.12	-146,061,091.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,920,954,155.25	-768,265,642.66	2,152,688,512.59
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,765,521,669.50	-1,119,037,855.50	2,646,483,814.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-369,895,537.63	-369,895,537.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-196,130,044.75	63,857,014.56	-132,273,030.19
其中：1. 基金申购款	10,876,838.27	-3,678,486.24	7,198,352.03
2. 基金赎回款	-207,006,883.02	67,535,500.80	-139,471,382.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,569,391,624.75	-1,425,076,378.57	2,144,315,246.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：田仁灿，主管会计工作负责人：阎小庆，会计机构负责人：高勇前

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通精选贰号混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 63 号《关于同意海富通精选贰号混合型证券投资基金募集的批复》核准,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 8,596,643,748.57

元,已经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 031 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》于 2007 年 4 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 8,599,641,740.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,997,991.43 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为: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。本基金的业绩比较基准为:MSCI China A 指数×65%+上证国债指数×35%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2011 年 8 月 29 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2011 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 差错更正的说明**

本基金本报告期内不存在重大会计差错。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题

的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末	
	2011年6月30日	
活期存款	117,332,522.32	
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	117,332,522.32	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末		
	2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,469,984,973.21	1,575,080,482.45	105,095,509.24
债券	交易所市场	-	-

	银行间市场	447,668,200.00	436,901,000.00	-10,767,200.00
	合计	447,668,200.00	436,901,000.00	-10,767,200.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,917,653,173.21	2,011,981,482.45	94,328,309.24

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	15,473.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	615.87
应收债券利息	10,024,360.87
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.21
其他	-

合计	10,040,450.16
----	---------------

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,011,938.52
银行间市场应付交易费用	5,455.63
合计	1,017,394.15

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	345.38
预提费用	228,110.68
合计	978,456.06

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,430,391,368.32	2,430,391,368.32

本期申购	685,865,647.22	685,865,647.22
本期赎回（以“-”号填列）	-195,302,860.29	-195,302,860.29
本期末	2,920,954,155.25	2,920,954,155.25

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-356,232,733.58	-275,676,932.45	-631,909,666.03
本期利润	77,209,662.42	-101,207,593.31	-23,997,930.89
本期基金份额交易产生的变动数	-58,553,101.84	-53,804,943.90	-112,358,045.74
其中：基金申购款	-84,156,247.85	-77,443,567.01	-161,599,814.86
基金赎回款	25,603,146.01	23,638,623.11	49,241,769.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-337,576,173.00	-430,689,469.66	-768,265,642.66

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	383,133.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,475.41
其他	4,013.03
合计	406,621.96

#### 6.4.7.12 股票投资收益



单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	1,250,748,639.91
减：卖出股票成本总额	1,171,925,335.16
买卖股票差价收入	78,823,304.75

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	360,260,634.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	348,895,350.01
减：应收利息总额	11,720,284.93
债券投资收益	-355,000.01

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,075,985.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,075,985.30

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-101,207,593.31
——股票投资	-99,044,693.32
——债券投资	-2,162,899.99
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-101,207,593.31

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	7,883.15
转换费收入	358.42
其他	30.59
合计	8,272.16

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日

交易所市场交易费用	3,958,563.33
银行间市场交易费用	2,375.00
合计	3,960,938.33

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	178,522.11
银行汇划费用	12,038.89
债券账户维护费	9,000.00
合计	249,149.57

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,126,090.75	17,942,823.35
其中：支付销售机构的客户维护费	2,288,945.54	2,523,876.08

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,354,348.50	2,990,470.51

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐

日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	15,000,000.00	9,005.45	-	-

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	117,332,522.32	383,133.52	151,102,954.74	998,796.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300240	飞力达	2011-06-29	2011-10-10	新股网下申购	20.00	20.00	540,000	10,800,000.00	10,800,000.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行

结束之日起 12 个月内不得转让。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的四层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 06 月 30 日,本基金未持有信用类债券(2010 年 12 月 31 日,同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金



份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	117,332,522.32	-	-	-	117,332,522.32
结算备付金	1,520,575.61	-	-	-	1,520,575.61
存出保证金	-	-	-	1,215,896.35	1,215,896.35
交易性金融资产	188,976,000.00	247,925,000.00	-	1,575,080,482.45	2,011,981,482.45
应收证券清算款	-	-	-	16,482,511.71	16,482,511.71
应收利息	-	-	-	10,040,450.16	10,040,450.16
应收股利	-	-	-	729,000.00	729,000.00
应收申购款	-	-	-	677,017.15	677,017.15
资产总计	307,829,097.93	247,925,000.00	-	1,604,225,357.82	2,159,979,455.75

负债					
应付证券清算款	-	-	-	808,946.94	808,946.94
应付赎回款	-	-	-	1,489,625.05	1,489,625.05
应付管理人报酬	-	-	-	2,568,446.53	2,568,446.53
应付托管费	-	-	-	428,074.43	428,074.43
应付交易费用	-	-	-	1,017,394.15	1,017,394.15
其他负债	-	-	-	978,456.06	978,456.06
负债总计	-	-	-	7,290,943.16	7,290,943.16
利率敏感度缺口	307,829,097.93	247,925,000.00	-	1,596,934,414.66	2,152,688,512.59
上年度末2010年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,079,268.38	-	-	-	24,079,268.38
结算备付金	3,768,825.87	-	-	-	3,768,825.87
存出保证金	-	-	-	1,516,955.89	1,516,955.89
交易性金融资产	180,702,000.00	200,650,000.00	-	1,389,506,041.74	1,770,858,041.74
应收利息	-	-	-	8,806,257.56	8,806,257.56
应收申购款	69,582.50	-	-	122,331.28	191,913.78
资产总计	208,619,676.75	200,650,000.00	-	1,399,951,586.47	1,809,221,263.22
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,450,634.96	3,450,634.96
应付赎回款	-	-	-	1,073,391.33	1,073,391.33
应付管理人报酬	-	-	-	2,414,042.20	2,414,042.20
应付托管费	-	-	-	402,340.36	402,340.36
应付交易费用	-	-	-	2,189,092.62	2,189,092.62
其他负债	-	-	-	1,210,059.46	1,210,059.46
负债总计	-	-	-	10,739,560.93	10,739,560.93

利率敏感度缺口	208,619,676.75	200,650,000.00	-	1,389,212,025.54	1,798,481,702.29
---------	----------------	----------------	---	------------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约135.00万元	减少约171.00万元
	市场利率下降25个基点	增加约136.00万元	增加约173.00万元

注：上述数值为约数，精确到万元。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为

50%-80%、债券投资 20%-50%、权证投资 0%-3%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,575,080,482.45	73.17	1,389,506,041.74	77.26
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,575,080,482.45	73.17	1,389,506,041.74	77.26

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币)	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约10,010.00万元	增加约8,273.00万元
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约10,010.00万元	减少约8,273.00万元

注:上述数值为约数,精确到万元。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,575,080,482.45	72.92
	其中：股票	1,575,080,482.45	72.92
2	固定收益投资	436,901,000.00	20.23
	其中：债券	436,901,000.00	20.23
	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	118,853,097.93	5.50
6	其他各项资产	29,144,875.37	1.35
7	合计	2,159,979,455.75	100.00

**7.2 期末按行业分类的股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	20,278,783.20	0.94

C	制造业	511,506,860.14	23.76
C0	食品、饮料	61,427,999.52	2.85
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	97,086,459.84	4.51
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	175,488,847.03	8.15
C7	机械、设备、仪表	134,904,000.00	6.27
C8	医药、生物制品	42,599,553.75	1.98
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	76,538,803.10	3.56
F	交通运输、仓储业	83,057,592.46	3.86
G	信息技术业	223,208,016.49	10.37
H	批发和零售贸易	173,080,067.64	8.04
I	金融、保险业	272,003,163.05	12.64
J	房地产业	171,994,101.37	7.99
K	社会服务业	31,151,420.00	1.45
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	12,261,675.00	0.57
	合计	1,575,080,482.45	73.17

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产 净值比例 （%）
----	------	------	-------	------	----------------------

1	600406	国电南瑞	4,350,666	157,929,175.80	7.34
2	601989	中国重工	9,000,000	124,110,000.00	5.77
3	600016	民生银行	17,999,947	103,139,696.31	4.79
4	600153	建发股份	10,750,261	95,677,322.90	4.44
5	600585	海螺水泥	3,299,913	91,605,584.88	4.26
6	000002	万科A	8,500,000	71,825,000.00	3.34
7	600309	烟台万华	3,809,975	71,284,632.25	3.31
8	600048	保利地产	6,259,799	68,795,191.01	3.20
9	000063	中兴通讯	2,099,948	59,386,529.44	2.76
10	601601	中国太保	2,199,950	49,256,880.50	2.29
11	600519	贵州茅台	219,988	46,776,048.44	2.17
12	600970	中材国际	1,560,000	42,634,800.00	1.98
13	601288	农业银行	15,000,000	42,000,000.00	1.95
14	601333	广深铁路	10,000,075	41,100,308.25	1.91
15	600581	八一钢铁	2,600,517	38,097,574.05	1.77
16	600068	葛洲坝	2,827,690	33,904,003.10	1.57
17	600631	百联股份	2,199,793	32,732,919.84	1.52
18	000402	金融街	4,199,988	31,373,910.36	1.46
19	600036	招商银行	2,100,000	27,342,000.00	1.27
20	600030	中信证券	2,000,000	26,160,000.00	1.22
21	000932	华菱钢铁	6,000,000	24,660,000.00	1.15
22	600015	华夏银行	2,100,000	22,827,000.00	1.06
23	000623	吉林敖东	720,125	22,187,051.25	1.03
24	600827	友谊股份	1,231,236	20,844,825.48	0.97
25	601117	中国化学	2,297,000	20,351,420.00	0.95
26	000937	冀中能源	799,952	20,278,783.20	0.94
27	601111	中国国航	1,999,995	19,179,952.05	0.89
28	000877	天山股份	501,815	17,834,505.10	0.83

29	600697	欧亚集团	599,969	16,679,138.20	0.77
30	600976	武汉健民	780,650	15,292,933.50	0.71
31	000858	五粮液	410,189	14,651,951.08	0.68
32	600221	海南航空	2,000,163	14,281,163.82	0.66
33	600805	悦达投资	817,445	12,261,675.00	0.57
34	300240	飞力达	540,000	10,800,000.00	0.50
35	002168	深圳惠程	600,000	10,794,000.00	0.50
36	002019	鑫富药业	400,410	7,747,933.50	0.36
37	000755	山西三维	692,667	7,653,970.35	0.36
38	600125	铁龙物流	632,471	6,666,244.34	0.31
39	300169	天晟新材	200,409	6,184,621.74	0.29
40	300096	易联众	190,875	5,892,311.25	0.27
41	000566	海南海药	230,300	5,119,569.00	0.24
42	000963	华东医药	200,000	4,854,000.00	0.23
43	002037	久联发展	172,900	4,215,302.00	0.20
44	000401	冀东水泥	131,700	3,291,183.00	0.15
45	600511	国药股份	150,979	2,291,861.22	0.11
46	600897	厦门空港	124,400	1,829,924.00	0.09
47	600000	浦发银行	129,836	1,277,586.24	0.06

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600153	建发股份	98,418,302.36	5.47
2	600016	民生银行	76,745,653.42	4.27



3	600309	烟台万华	72,961,263.56	4.06
4	000063	中兴通讯	62,603,507.98	3.48
5	600048	保利地产	51,424,394.66	2.86
6	600068	葛洲坝	51,310,337.43	2.85
7	600585	海螺水泥	46,832,722.06	2.60
8	601288	农业银行	44,541,774.00	2.48
9	600519	贵州茅台	43,980,860.93	2.45
10	601333	广深铁路	41,275,040.87	2.29
11	600406	国电南瑞	40,095,801.54	2.23
12	000932	华菱钢铁	39,949,576.12	2.22
13	600581	八一钢铁	38,797,820.84	2.16
14	600631	百联股份	34,084,414.78	1.90
15	600036	招商银行	32,102,106.25	1.78
16	000402	金融街	31,469,899.75	1.75
17	000983	西山煤电	28,111,906.20	1.56
18	600970	中材国际	27,632,407.83	1.54
19	600050	中国联通	23,163,877.84	1.29
20	601111	中国国航	23,138,217.43	1.29

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	78,183,182.57	4.35
2	600415	小商品城	73,314,985.57	4.08

3	000789	江西水泥	52,576,149.44	2.92
4	000858	五 粮 液	45,321,849.17	2.52
5	600518	康美药业	44,248,618.21	2.46
6	000998	隆平高科	32,393,296.18	1.80
7	000630	铜陵有色	31,265,802.85	1.74
8	002415	海康威视	29,657,472.09	1.65
9	600036	招商银行	29,588,966.43	1.65
10	002106	莱宝高科	28,186,466.18	1.57
11	600030	中信证券	27,582,208.16	1.53
12	600000	浦发银行	26,958,980.31	1.50
13	000983	西山煤电	25,493,340.98	1.42
14	600271	航天信息	25,002,826.72	1.39
15	601169	北京银行	24,939,375.02	1.39
16	601299	中国北车	24,472,547.18	1.36
17	600031	三一重工	23,353,231.93	1.30
18	600498	烽火通信	21,533,210.99	1.20
19	600068	葛洲坝	21,419,238.13	1.19
20	601607	上海医药	21,401,381.48	1.19

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,456,561,569.19
卖出股票的收入（成交）总额	1,250,748,639.91

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	245,545,000.00	11.41
3	金融债券	191,356,000.00	8.89
	其中：政策性金融债	191,356,000.00	8.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	436,901,000.00	20.30

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1001060	10 央票 60	1,500,000	146,295,000.00	6.80
2	080213	08 国开 13	1,000,000	101,630,000.00	4.72
3	1101021	11 央票 21	1,000,000	99,250,000.00	4.61
4	060416	06 农发 16	500,000	49,870,000.00	2.32
5	110222	11 国开 22	400,000	39,856,000.00	1.85

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

**7.8 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。

**7.9 投资组合报告附注**

**7.9.1** 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。

**7.9.2** 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。

**7.9.3 期末其他各项资产构成**

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,215,896.35
2	应收证券清算款	16,482,511.71
3	应收股利	729,000.00
4	应收利息	10,040,450.16
5	应收申购款	677,017.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,144,875.37

**7.9.4 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。

**7.9.5 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
85,677	34,092.63	680,540,502.77	23.30%	2,240,413,652.48	76.70%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	280.81	0.00%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年4月9日）基金份额总额	8,599,641,740.00
本报告期期初基金份额总额	2,430,391,368.32
本报告期基金总申购份额	685,865,647.22
减：本报告期基金总赎回份额	195,302,860.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,920,954,155.25

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	1	717,654,259.93	26.66%	583,100.53	26.51%	-
国元证券	2	631,125,803.67	23.44%	536,453.88	24.38%	-
德邦证券	1	347,635,995.62	12.91%	295,488.72	13.43%	-
国金证券	1	346,874,126.41	12.88%	294,842.75	13.40%	-
上海证券	1	268,222,061.15	9.96%	174,343.05	7.92%	-
中金公司	1	140,219,675.50	5.21%	113,929.05	5.18%	-
申银万国	1	111,328,663.50	4.14%	94,629.31	4.30%	-
中信证券	1	69,183,911.54	2.57%	56,212.71	2.56%	-
银河证券	1	59,932,343.78	2.23%	50,941.69	2.32%	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

#### 2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见。

#### (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择:

<1> 推荐。投资部业务人员推荐,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见,并报公司业务

管理委员会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的业务管理委员会核准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期回 购成交总 额的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例
平安证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司旗下开放式基金 2010年最后一个市场交易日基金资产净值和 基金份额净值公告	《中国证券报》、《上 海证券报》和《证券时 报》	2011-01-01
2	关于开通海富通稳固收益债券型证券投资基	《中国证券报》、《上	2011-01-05



	金与公司旗下部分基金之间转换业务的公告	海证券报》和《证券时报》	
3	关于海富通旗下部分基金增加日信证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-05
4	关于海富通旗下部分基金在日信证券有限责任公司开展网上基金交易申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-07
5	关于调整旗下部分基金在中国建设银行定期定额投资起点金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-18
6	关于海富通旗下部分基金增加红塔证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-01-26
7	关于旗下部分基金参加海通证券股份有限公司网上交易基金定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-02-22
8	关于旗下部分基金新增华夏银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-02-25
9	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销定期定额申购最低起点金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-03-02
10	关于海富通旗下部分基金参加光大证券股份有限公司定期定额申购费率优惠推广活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-03-25
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续在中国工商银行股份有限公司开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-03-31

	告		
12	海富通基金管理有限公司关于公司股东名称变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-04-07
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-05-11
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在中山证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-06-17
15	海富通基金管理有限公司关于在中国银行开立的直销账户银行账号变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-06-17
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2011-06-29

## 11 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 18 只开放式基金。截至 2011 年 6 月 30 日,海富通管理的公募基金资产规模超过 392 亿元人民币。

作为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 6 月 30 日,海富通为 50 多家企业超过 150 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 6 月 30 日,海富通旗下专户理财管理资产规模近 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 6 月 30 日,投资咨询及海外业务规模达 219 亿元人民币。

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。4 月 8 日，在《上海证券报》主办的第八届中国“金基金奖”评选中，海富通基金获得“2010 年度金基金公司奖——海外投资回报公司”奖。4 月 10 日，在《中国证券报》主办的“第八届中国基金业金牛奖”评选中，海富通基金获得“2010 年度金牛基金管理公司”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。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 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
- (二) 海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通精选贰号混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通精选贰号混合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

### 12.2 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 层基金管理人办公地址。

### 12.3 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

二〇一一年八月二十九日