

# 海富通精选证券投资基金 2009 年年度报告

2009 年 12 月 31 日

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

送出日期：2010 年 3 月 29 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 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。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§ 4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
§ 5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	13
§ 6 审计报告 .....	13
§ 7 年度财务报表 .....	14
7.1 资产负债表 .....	14
7.2 利润表 .....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
7.4 报表附注 .....	18
§ 8 投资组合报告 .....	39
8.1 期末基金资产组合情况 .....	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
8.3 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 .....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	43
8.6 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 .....	45
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	46
8.8 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 .....	46
8.9 投资组合报告附注 .....	46
§ 9 基金份额持有人信息 .....	47

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	47
§ 10 开放式基金份额变动.....	47
§ 11 重大事件揭示 .....	47
11.1 基金份额持有人大会决议.....	47
11.2 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.....	47
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
11.4 基金投资策略的改变.....	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
11.8 其他重大事件 .....	49
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§ 13 备查文件目录 .....	52
13.1 备查文件名称 .....	52
13.2 备查文件存放地点.....	52
13.3 备查文件查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通精选证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	9,870,314,426.42 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	65%MSCI China A+35%上证国债
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。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	张咏东
	联系电话	021-38650891	021-32169999
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
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	上海市浦东新区银城中路 188 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	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	邵国有	胡怀邦

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	1,755,247,295.77	-3,592,828,201.09	2,675,990,718.27
本期利润	3,528,605,819.32	-5,897,110,912.89	3,609,620,003.82
加权平均基金份额本期利润	0.3244	-0.4915	0.4869
本期加权平均净值利润率(%)	42.09	-64.73	41.30
本期基金份额净值增长率(%)	56.02	-46.61	96.45
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配利润	3,109,107,075.34	1,750,372,348.99	6,319,349,914.12
期末可供分配基金份额利润	0.3150	0.1531	0.4620
期末基金资产净值	8,626,271,090.28	6,403,280,635.77	14,351,773,552.23
期末基金份额净值	0.8740	0.5602	1.0493
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
基金份额累计净值增长率(%)	353.13	190.44	444.02

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

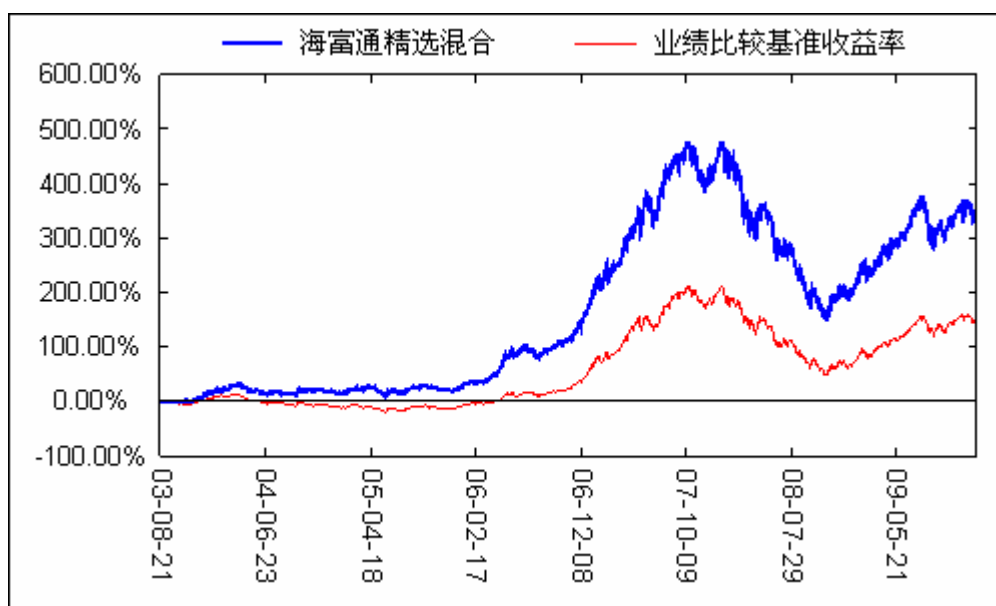
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	13.01%	1.25%	12.41%	1.14%	0.60%	0.11%
过去六个月	6.68%	1.48%	10.45%	1.35%	-3.77%	0.13%
过去一年	56.02%	1.43%	57.89%	1.32%	-1.87%	0.11%
过去三年	63.63%	1.71%	61.34%	1.62%	2.29%	0.09%
过去五年	287.09%	1.48%	181.88%	1.38%	105.21%	0.10%
自基金合同生效起至今	353.13%	1.37%	155.11%	1.28%	198.02%	0.09%

#### 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

海富通精选证券投资基金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

2003年8月22日至2009年12月31日



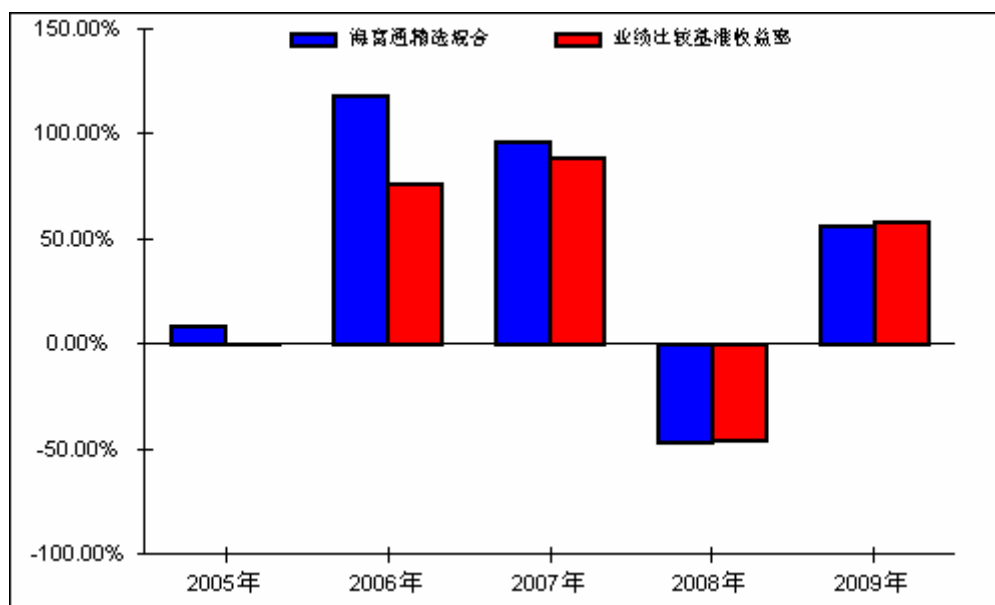
注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。本基金自2007年6月28日至2007年9月29日，为持续营销后建仓期。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十

八条（三）、（六）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

2、为了能更公允地体现基金投资业绩，海富通基金管理有限公司自 2007 年 1 月 1 日起调整海富通精选基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为 MSCI China A 指数，相应的基准权重不变。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通精选证券投资基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2009	-	-	-	-	-
2008	-	-	-	-	-
2007	0.507	809,268,513.47	385,498,271.27	1,194,766,784.74	-
合计	0.507	809,268,513.47	385,498,271.27	1,194,766,784.74	-

## § 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于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。本海富通精选证券投资基金是基金管理人管理的第一只开放式基金；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、海富通精选贰号混合型证券投资基金、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和海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）十只开放式基金。

#### 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		
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	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	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、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 56.02%、精选贰号基金 44.65%，两者净值增长率之差的绝对值为 11.37%，高于 5%。精选基金和精选贰号基金收益率差异较大的主要原因是：精选基金和精选贰号基金收益率差异主要发生在 2009 年一季度，精选贰号基金于 2008 年底进行了一次分红，资产配置上与精选基金存在较大差异，导致两只基金的收益率在一季度差异较大。

### 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的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

从股市看，2009 年，中国股市成为宏观经济回升向好的先行指标，一路震荡上行。上半年，股市在经济刺激计划、充裕流动性驱动下单边上涨，消费、金融、地产、基础建设等受益板块轮番表现。虽然下半年市场有所震荡，但整体依然维持强势。2009 年新股发行重启以及创业板开闸也使股市交投活跃。上证综指全年上涨近 80%，涨幅在全球市场位居前列。

报告期内，本基金在大类资产配置上保持了较高的股票仓位，且基于政府经济刺激计划的实施，年初行业配置上向投资拉动型的周期类倾斜，此后基于挖掘价值洼地的考虑大幅加仓银行等低估值板块。随着市场上涨日益反映宏观经济复苏，本基金对地产和周期类资产进行了减持，同时增加了医药等消费类资产的配置。但由于继续保持了金融行业的超配，且在四季度对部分新兴业务公司配置比例不足，对净值增长形成一定拖累。

从债市来看，经济的全面复苏和通货膨胀预期的增加，使得 2009 年初收益率曲线开始全面上行，全年出现几次小反弹，但是债券收益曲线整体随着央行票据发行利率的上行而上移。由于全年的资金面充裕，收益率曲线变陡峭化，短端上行不明显，投资性保护不足；长端由于调整到位，短期出现一定投资性价值机会。面对债券市场的下跌，本基金债券投资采取了谨慎投资的策略，缩短组合剩余期限，全年投资变动较小。

#### 4.4.2 报告期内基金业绩的表现

报告期内，本基金净值增长率为 56.02%，同期业绩比较基准收益率为 57.89%，基金净值落后业绩比较基准 1.87 个百分点，主要是因为第三季度本基金银行配置较重以及第四季度部分新兴业务公司配置比例相对不足。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从股市看，展望未来，我们在经济上即将面临两个矛盾的大概率事件，一个大概率事件是经济的复苏，中国前所未有的刺激政策已经使得我们基本走出金融危机的泥潭，另一个大概率事件是我国对流动性的控制，经济刺激政策退出的适当时机和方式是我们面对的选择。除了经济，我们还注意到金融市场本身制度变化所带来的机遇，融资融券和股指期货越走越近。

基于上述判断，在行业选择上，我们将尽量回避受到政策调控的行业，而偏向于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，我们也会积极关注金融制度变革创新所带来的机遇，以及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 年债券市场整体仍不容乐观，但市场机会应多于 2009 年。收益率曲线仍可能因为经济回暖、通胀兑现、加息预期等因素继续向上，但是 2010 年债券市场的资金面将相对乐观，同时中长期债券收益经 2009 年的调整已经基本具有投资价值，因此本基金会在 2010 年逐步拉长债券久期，积极投资。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2009 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过现场检查、系统监控、人员询问、重点抽查等一系列方式开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事长和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作的重点包括以下几个方面：

##### 一、持续完善公司的规章制度，健全内部控制体系，落实内控责任。

随着中国法律环境的变化以及公司业务多元化的快速发展，监察稽核部于本报告期内牵头制定了与新业务相关的跨部门业务流程，并不断地对现有部门规章制度和业务流程进行了更新与优化，以强化岗位职责，满足业务发展和相关法规要求，为基金持有人谋求最大利益提供有力的保障。

##### 二、加强对公司和基金日常运作的合规审核。

本报告期内，监察稽核部坚持以法律法规和公司管理制度为依据，对公司和基金日常运作的各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，确保了基金运作的诚信和合法合规性。本报告期内，公司监察稽核的范围涉及投资、销售、客服、IT、基金会计等各个方面。通过事前、事中、事后的全方位合规审核，公司对投资交易、基金募集、客户服务体系、信息安全控制、基金运营控制等方面的内部规章制度和各项业务流程予以了完善；同时强化了现有规章制度的执行力度，并很好的落实了相关建议。

##### 三、积极开展反洗钱的宣传和培训工作。

本报告期内，监察稽核部根据反洗钱相关法规要求，及时修订更新公司反洗钱相关的内部制度，同时对运作中的反洗钱系统进行相应的分析和调整，包括更新系统中客户风险分类的标准设置，设置划分客户

风险等级；每周登陆反洗钱系统，提取系统筛选的可疑交易，对提取的可疑交易进行人工识别和复核，向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据，并每季向人行上海分行反洗钱处发送报告。同时根据人民银行上海总部印发的《上海市金融机构反洗钱自评估实施意见（试行）》的规定，着手展开公司范围内反洗钱自评估实施方案的制定工作。

#### 四、加强投资者教育，培养投资者风险意识和投资理念

本报告期内，根据上海证监局在 2008 年发布的《关于深入落实上海辖区投资者教育工作“十个一工程”的通知》（沪证监机构[2008]230 号）和中国证券业协会《关于进一步做好投资者教育工作的通知》，监察稽核部会同相关部门从鼓励投资者进行长期投资的教育、持续不断和投资者进行沟通、坚持分发投资者教育宣传材料等三种方式通过多种渠道、多种媒介积极推进投资者教育工作，尤其在市场波动加大的环境中，努力倡导“理性选择、幸福投资”的投资理念，培养广大投资者的风险意识和投资理念、切实加强保护了广大基金持有人的合法权益。

#### 五、强化法规学习，开展内控培训，培养员工的风险防范意识。

本报告期内，监察稽核部及时将新颁布的各项法律法规进行解读，并提供给全体员工学习，同时定期对全体员工进行内控培训，剖析风险案例，并进行相关的考核测试。通过培训，员工的合规意识有所增强，主动控制业务风险的积极性也得到了提高。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

### 4.7 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。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 一 本报告期末可分配收益为：3,109,107,075.34 元。
- 二 本基金本期末进行利润分配。
- 三 存在可分配但尚未分配的利润，基金管理人将择机实施分配。

## § 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

2009 年度，基金托管人在海富通精选证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2009 年度，海富通基金管理有限公司在海富通精选证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2009 年度，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通精选证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20301 号

海富通精选证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的海富通精选证券投资基金(以下简称“海富通精选基金”)的财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

#### 一、 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是海富通精选基金的基金管理人海富通基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

#### 二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了海富通精选基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司

注册会计师

马 颖 旎

中国 · 上海市

注册会计师

徐 振 晨

2010 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：海富通精选证券投资基金

报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2009 年 12 月 31 日	2008 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	29,098,565.22	326,637,327.06
结算备付金		628,518,766.19	55,945,175.25
存出保证金		5,266,237.47	1,955,963.23
交易性金融资产	7.4.7.2	7,818,397,266.53	5,894,129,140.59
其中：股票投资		5,994,063,492.83	4,306,636,140.59
基金投资		-	-
债券投资		1,824,333,773.70	1,587,493,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		143,564,803.96	115,432,767.82
应收利息	7.4.7.5	30,860,140.96	31,402,329.90
应收股利		-	-
应收申购款		116,901.51	126,203.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,655,822,681.84	6,425,628,907.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2009 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2008 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		8,554,493.18	3,748,353.16
应付管理人报酬		11,097,535.69	8,395,030.20
应付托管费		1,849,589.25	1,399,171.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,802,729.78	7,198,754.13
应交税费		233,987.60	233,987.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,013,256.06	1,372,974.90
负债合计		29,551,591.56	22,348,271.70
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,995,146,299.29	3,468,437,591.59
未分配利润	7.4.7.10	5,631,124,790.99	2,934,843,044.18
所有者权益合计		8,626,271,090.28	6,403,280,635.77

负债和所有者权益总计		8,655,822,681.84	6,425,628,907.47
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8740 元，基金份额总额 9,870,314,426.42 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通精选证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		3,739,000,035.88	-5,607,398,005.69
1. 利息收入		66,265,874.80	95,467,837.29
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,085,584.04	6,242,989.01
债券利息收入		60,883,555.68	87,543,897.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		296,735.08	1,680,950.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		1,898,995,301.35	-3,400,581,573.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,844,009,018.49	-3,518,783,799.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	7,030,608.93	2,904,692.85
资产支持证券投资		-	-
投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	57,641,424.95
股利收益	7.4.7.15	47,955,673.93	57,656,107.80
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	1,773,358,523.55	-2,304,282,711.80
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	380,336.18	1,998,442.41
<b>减：二、费用</b>		210,394,216.56	289,712,907.20
1. 管理人报酬		124,918,761.48	137,617,592.55
2. 托管费		20,819,793.51	22,936,265.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	62,666,241.10	115,297,999.94
5. 利息支出		1,439,943.36	13,283,825.21
其中：卖出回购金融资产支出		1,439,943.36	13,283,825.21
6. 其他费用	7.4.7.19	549,477.11	577,224.04

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,528,605,819.32	-5,897,110,912.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,528,605,819.32	-5,897,110,912.89

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通精选证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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）	3,468,437,591.59	2,934,843,044.18	6,403,280,635.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,528,605,819.32	3,528,605,819.32
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）	-473,291,292.30	-832,324,072.51	-1,305,615,364.81
其中：1. 基金申购款	279,363,604.06	422,878,097.36	702,241,701.42
2. 基金赎回款	-752,654,896.36	-1,255,202,169.87	-2,007,857,066.23
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）	2,995,146,299.29	5,631,124,790.99	8,626,271,090.28
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 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）	4,150,565,466.98	10,201,208,085.25	14,351,773,552.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,897,110,912.89	-5,897,110,912.89
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）	-682,127,875.39	-1,369,254,128.18	-2,051,382,003.57
其中：1. 基金申购款	371,318,897.81	739,680,211.45	1,110,999,109.26

2. 基金赎回款	-1, 053, 446, 773. 20	-2, 108, 934, 339. 63	-3, 162, 381, 112. 83
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, 468, 437, 591. 59	2, 934, 843, 044. 18	6, 403, 280, 635. 77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>田仁灿</u>	<u>阎小庆</u>	<u>高勇前</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

海富通精选证券投资基金(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[2003]第 85 号《关于同意海富通精选证券投资基金设立的批复》核准,由海富通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《海富通精选证券投资基金基金契约》(后更名为《海富通精选证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 8 月 22 日募集成立。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 3,698,432,268.39 元,已经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 110 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通精选证券投资基金招募说明书》和《关于对海富通精选基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 7 月 4 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1: 3.295543296,并于 2007 年 7 月 5 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通精选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。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。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 X65%+上证国债指数 X35%。

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 2010 年 3 月 24 日批准报出。

### 7.4.2 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》、《海富通精选证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。
- (2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。
- (3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

## (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

报告期内不存在会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

报告期内不存在会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

报告期内不存在重大会计差错。

## 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	29,098,565.22	326,637,327.06
定期存款	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	29,098,565.22	326,637,327.06

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,934,260,608.02	5,994,063,492.83	1,059,802,884.81
债券	交易所市场	62,986,289.45	63,218,773.70	232,484.25
	银行间市场	1,759,075,950.00	1,761,115,000.00	2,039,050.00
	合计	1,822,062,239.45	1,824,333,773.70	2,271,534.25
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,756,322,847.47	7,818,397,266.53	1,062,074,419.06
项目		上年度末 2008 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,064,301,495.08	4,306,636,140.59	-757,665,354.49
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	1,541,111,750.00	1,587,493,000.00	46,381,250.00
	合计	1,541,111,750.00	1,587,493,000.00	46,381,250.00
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,605,413,245.08	5,894,129,140.59	-711,284,104.49

注：

1. 于 2009 年 12 月 31 日，股票投资余额中无按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票(2008 年 12 月 31 日：122,775,450.78 元，采用该估值技术的股票投资于 2008 年度利润表中确认的公允价值变动损失为 65,150,513.69 元)。
2. 债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动损失 44,342,200.00 元(2008 年度：公允价值变动收益 59,580,109.70 元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末买入返售金融资产余额为零。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,385.22	31,855.63
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	182,477.49	14,860.76
应收债券利息	30,669,238.80	31,355,567.28
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	3.15	0.63
其他	36.30	45.60
合计	30,860,140.96	31,402,329.90

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	6,801,159.78	7,195,879.13
银行间市场应付交易费用	1,570.00	2,875.00
合计	6,802,729.78	7,198,754.13

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	1,256.06	2,974.90
预提费用	512,000.00	870,000.00
合计	1,013,256.06	1,372,974.90

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,430,002,646.26	3,468,437,591.59
本期申购	920,615,541.63	279,363,604.06
本期赎回（以“-”填列）	-2,480,303,761.47	-752,654,896.36
本期末	9,870,314,426.42	2,995,146,299.29

#### 7.4.7.10 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	1,750,372,348.99	1,184,470,695.19	2,934,843,044.18
本期利润	1,755,247,295.77	1,773,358,523.55	3,528,605,819.32
本期基金份额交易产生的变动数	-396,512,569.42	-435,811,503.09	-832,324,072.51
其中：基金申购款	195,564,374.01	227,313,723.35	422,878,097.36
基金赎回款	-592,076,943.43	-663,125,226.44	-1,255,202,169.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,109,107,075.34	2,522,017,715.65	5,631,124,790.99

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,881,905.45	5,432,098.22
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	2,191,496.96	794,539.43
其他	12,181.63	16,351.36
合计	5,085,584.04	6,242,989.01

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	21,284,689,816.14	21,170,166,891.68
减：卖出股票成本总额	19,440,680,797.65	24,688,950,690.87
买卖股票差价收入	1,844,009,018.49	-3,518,783,799.19

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	1,205,593,543.25	7,237,601,381.27
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	1,172,672,877.95	7,109,736,995.39
减：应收利息总额	25,890,056.37	124,959,693.03
债券投资收益	7,030,608.93	2,904,692.85

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	-	284,715,096.13

减：卖出权证成本总额	-	227,073,671.18
买卖权证差价收入	-	57,641,424.95

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年 12月31日
股票投资产生的股利收益	47,955,673.93	57,656,107.80
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	47,955,673.93	57,656,107.80

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年1月1日至2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年 12月31日
1. 交易性金融资产		
——股票投资	1,817,468,239.30	-2,227,315,514.47
——债券投资	-44,109,715.75	59,737,015.87
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具		
——权证投资	-	-136,704,213.20
3. 其他	-	-
合计	1,773,358,523.55	-2,304,282,711.80

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12 月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12 月31日
基金赎回费收入	350,269.15	1,786,991.96
基金转换费收入	30,067.03	111,483.30
印花税手续费返还	-	99,767.15
其他	-	200.00
合计	380,336.18	1,998,442.41

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	62,660,516.10	115,254,489.94
银行间市场交易费用	5,725.00	43,510.00
合计	62,666,241.10	115,297,999.94

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
审计费用	152,000.00	170,000.00
信息披露费	360,000.00	360,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	19,477.11	29,224.04
合计	549,477.11	577,224.04

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
富通基金管理公司 (Fortis Investment Management S. A.)	基金管理人的股东

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间

	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
海通证券	6,025,147,157.59	14.89	8,381,348,455.68	20.29

#### 7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
海通证券	-	-	258,988,873.72	90.96

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	5,008,720.19	14.80	853,622.38	12.55
关联方名称	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
海通证券	7,257,868.33	20.75	2,235,447.82	31.07

注：

1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	124,918,761.48	137,617,592.55
其中：支付销售机构的客户维护费	25,522,432.10	27,764,477.71

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间
		2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,819,793.51	22,936,265.46

注：支付基金托管人交通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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 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						
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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
交通银行	-	211,682,060.27	-	-	-	-
上年度可比期间						
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 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
交通银行	1,050,241,216.12	607,692,454.14	-	-	596,530,000.00	677,228.98

## 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2003 年 8 月 22 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	30,195,269.25	30,195,269.25
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动的份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	30,195,269.25	30,195,269.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	0.31	0.26

注：1、期间申购/买入总份额含转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人于 2007 年 8 月 13 日运用自有资金申购本基金 3000 万元，申购费为 1000 元。

## 7.4.10.4.2 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

本期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

## 7.4.10.5 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	
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	29,098,565.22	2,881,905.45	326,637,327.06	5,432,098.22

注：

1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2009 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的结算备付金科目中单独列示(2008 年 12 月 31 日：同)。

## 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
海通证券	601788	光大证券	首次公开发行	2,000	42,160.00
上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
海通证券	601898	中煤能源	首次公开发行	2,393,725	40,286,391.75

#### 7.4.10.7 其它关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600122	宏图高科	2009-01-16	2010-01-14	非公开发行	7.14	16.97	5,000,000	35,700,000.00	84,850,000.00	-
300002	神州泰岳	2009-09-29	2010-02-01	新股网下申购	58.00	105.20	68,336	3,963,488.00	7,188,947.20	-
300003	乐普医	2009-09-29	2010-02-01	新股网	29.00	51.20	70,615	2,047,835.00	3,615,488.00	-

	疗			下 申 购						
300005	探 路 者	2009-09-29	2010-02-01	新 股 网 下 申 购	19.80	43.17	29,177	577,704.60	1,259,571.09	-
300007	汉 威 电 子	2009-09-29	2010-02-01	新 股 网 下 申 购	27.00	44.01	42,313	1,142,451.00	1,862,195.13	-
300009	安 科 生 物	2009-09-29	2010-02-01	新 股 网 下 申 购	17.00	42.67	54,427	925,259.00	2,322,400.09	-
300011	鼎 汉 技 术	2009-10-15	2010-02-01	新 股 网 下 申 购	37.00	70.00	31,325	1,159,025.00	2,192,750.00	-
300012	华 测 检 测	2009-10-15	2010-02-01	新 股 网 下 申 购	25.78	43.14	39,828	1,026,765.84	1,718,179.92	-
300013	新 宁 物 流	2009-10-15	2010-02-01	新 股 网 下 申 购	15.60	32.75	37,656	587,433.60	1,233,234.00	-
300014	亿 纬 锂 能	2009-10-15	2010-02-01	新 股 网 下 申 购	18.00	39.55	32,686	588,348.00	1,292,731.30	-

				购						
300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-02-01	新股网下申购	28.00	48.80	38,568	1,079,904.00	1,882,118.40	-
300024	机器人	2009-10-19	2010-02-01	新股网下申购	39.80	72.28	26,015	1,035,397.00	1,880,364.20	-
300026	红日药业	2009-10-19	2010-02-01	新股网下申购	60.00	91.20	12,059	723,540.00	1,099,780.80	-
300029	天龙光电	2009-12-18	2010-03-25	新股网下申购	18.18	29.10	15,997	290,825.46	465,512.70	-
300030	阳普医疗	2009-12-18	2010-03-26	新股网下申购	25.00	35.10	6,771	169,275.00	237,662.10	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注

000623	吉林敖东	2009-12-28	公告重大事项	49.19	2010-01-11	54.11	1,000,000	46,014,192.52	49,190,000.00	-
600102	莱钢股份	2009-11-09	资产重组	13.07	2010-2-24	11.88	10,000,948	93,430,182.07	130,712,390.36	-
600739	辽宁成大	2009-12-28	公告重大事项	38.09	2010-01-11	41.90	2,000,000	64,964,998.63	76,180,000.00	-

注：本基金截至 2009 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券，包括银行间市场债券正回购和交易所市场债券正回购。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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内。

#### 7.4.13.2 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交通银行，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 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2008 年 12 月 31 日：持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.63%）。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2009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	29,098,565.22	-	-	-	29,098,565.22
结算备付金	628,518,766.19	-	-	-	628,518,766.19
存出保证金	103,913.63	-	-	5,162,323.84	5,266,237.47
交易性金融资产	1,150,935,000.00	673,398,773.70	-	5,994,063,492.83	7,818,397,266.53
应收证券清算款	-	-	-	143,564,803.96	143,564,803.96
应收利息	-	-	-	30,860,140.96	30,860,140.96
应收申购款	-	-	-	116,901.51	116,901.51
资产总计	1,808,656,245.04	673,398,773.70	-	6,173,767,663.10	8,655,822,681.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,554,493.18	8,554,493.18
应付管理人报酬	-	-	-	11,097,535.69	11,097,535.69
应付托管费	-	-	-	1,849,589.25	1,849,589.25
应付交易费用	-	-	-	6,802,729.78	6,802,729.78
应交税费	-	-	-	233,987.60	233,987.60
其他负债	-	-	-	1,013,256.06	1,013,256.06
负债总计	-	-	-	29,551,591.56	29,551,591.56
利率敏感度缺口	1,808,656,245.04	673,398,773.70	-	6,144,216,071.54	8,626,271,090.28
上年度末 2008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	326,637,327.06	-	-	-	326,637,327.06
结算备付金	55,945,175.25	-	-	-	55,945,175.25
存出保证金	101,282.05	-	-	1,854,681.18	1,955,963.23
交易性金融资产	892,192,000.00	695,301,000.00	-	4,306,636,140.59	5,894,129,140.59
应收证券清算款	-	-	-	115,432,767.82	115,432,767.82
应收利息	-	-	-	31,402,329.90	31,402,329.90
应收申购款	1,761.86	-	-	124,441.76	126,203.62
资产总计	1,274,877,546.22	695,301,000.00	-	4,455,450,361.25	6,425,628,907.47

负债					
应付赎回款	-	-	-	3,748,353.16	3,748,353.16
应付管理人报酬	-	-	-	8,395,030.20	8,395,030.20
应付托管费	-	-	-	1,399,171.71	1,399,171.71
应付交易费用	-	-	-	7,198,754.13	7,198,754.13
应交税费	-	-	-	233,987.60	233,987.60
其他负债	-	-	-	1,372,974.90	1,372,974.90
负债总计	-	-	-	22,348,271.70	22,348,271.70
利率敏感度缺口	1,274,877,546.22	695,301,000.00	-	4,433,102,089.55	6,403,280,635.77

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

#### 7.4.13.4.1.2 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：人民币万元）	
		本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 616	增加约 662
市场利率上升 25 个基点	下降约 612	下降约 658	

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日		上年度末 2008 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	5,994,063,492.83	69.49	4,306,636,140.59	67.26
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,994,063,492.83	69.49	4,306,636,140.59	67.26

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 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：人民币万元)	
		本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 1)上升 5%	增加约 43,563	增加约 32,337
	2. 业绩比较基准(附注 1)下降 5%	下降约 43,563	下降约 32,337

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	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	其他各项资产	179,808,083.90	2.08
7	合计	8,655,822,681.84	100.00

## 8.2 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	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

## 8.3 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	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
11	000069	华侨城A	8,000,878	137,375,075.26	1.59
12	600102	莱钢股份	10,000,948	130,712,390.36	1.52
13	000800	一汽轿车	5,000,000	130,100,000.00	1.51
14	600036	招商银行	7,000,000	126,350,000.00	1.46
15	600015	华夏银行	10,002,799	124,234,763.58	1.44
16	600007	中国国贸	10,000,517	122,806,348.76	1.42
17	000538	云南白药	2,000,000	120,800,000.00	1.40
18	000983	西山煤电	3,000,000	119,670,000.00	1.39
19	000401	冀东水泥	6,000,000	115,800,000.00	1.34
20	000933	神火股份	3,000,000	110,640,000.00	1.28
21	600031	三一重工	3,000,000	110,430,000.00	1.28
22	601318	中国平安	2,000,000	110,180,000.00	1.28
23	000009	中国宝安	10,000,000	109,800,000.00	1.27
24	002023	海特高新	6,000,917	109,456,726.08	1.27
25	002254	烟台氨纶	3,000,187	107,256,685.25	1.24
26	600557	康缘药业	5,000,044	104,750,921.80	1.21
27	600409	三友化工	12,000,049	103,440,422.38	1.20
28	002064	华峰氨纶	5,000,630	95,412,020.40	1.11
29	002007	华兰生物	1,717,383	95,177,365.86	1.10
30	000729	燕京啤酒	5,001,047	93,869,652.19	1.09
31	600750	江中药业	4,000,382	92,728,854.76	1.07
32	600276	恒瑞医药	1,764,163	92,618,557.50	1.07
33	002110	三钢闽光	5,000,397	90,307,169.82	1.05
34	000961	中南建设	4,000,366	89,568,194.74	1.04
35	000919	金陵药业	7,000,000	85,400,000.00	0.99

36	600122	宏图高科	5,000,000	84,850,000.00	0.98
37	000937	金牛能源	1,999,999	83,199,958.40	0.96
38	600815	厦工股份	10,000,000	81,600,000.00	0.95
39	600479	千金药业	3,000,798	80,661,450.24	0.94
40	600739	辽宁成大	2,000,000	76,180,000.00	0.88
41	002149	西部材料	3,000,329	71,977,892.71	0.83
42	000338	潍柴动力	1,000,000	64,480,000.00	0.75
43	601958	金钼股份	3,000,000	57,180,000.00	0.66
44	000655	金岭矿业	3,000,000	56,640,000.00	0.66
45	000584	友利控股	5,000,685	56,457,733.65	0.65
46	002048	宁波华翔	4,000,000	56,320,000.00	0.65
47	600485	中创信测	3,000,480	51,878,299.20	0.60
48	600522	中天科技	2,000,593	49,554,688.61	0.57
49	000623	吉林敖东	1,000,000	49,190,000.00	0.57
50	600648	外高桥	3,000,000	48,600,000.00	0.56
51	600416	湘电股份	2,000,926	48,222,316.60	0.56
52	000656	ST 东源	3,000,769	47,412,150.20	0.55
53	600812	华北制药	4,000,402	46,804,703.40	0.54
54	600425	青松建化	1,999,997	45,119,932.32	0.52
55	601299	中国北车	7,000,000	42,910,000.00	0.50
56	000968	煤气化	2,000,000	42,700,000.00	0.49
57	600480	凌云股份	2,919,249	38,826,011.70	0.45
58	002156	通富微电	3,000,000	35,640,000.00	0.41
59	600511	国药股份	1,058,950	27,109,120.00	0.31
60	600736	苏州高新	3,000,000	25,230,000.00	0.29
61	600622	嘉宝集团	1,999,904	24,538,822.08	0.28
62	300002	神州泰岳	68,336	7,188,947.20	0.08
63	300003	乐普医疗	70,615	3,615,488.00	0.04
64	300009	安科生物	54,427	2,322,400.09	0.03
65	300011	鼎汉技术	31,325	2,192,750.00	0.03
66	300015	爱尔眼科	38,568	1,882,118.40	0.02
67	300024	机器人	26,015	1,880,364.20	0.02
68	300007	汉威电子	42,313	1,862,195.13	0.02
69	300012	华测检测	39,828	1,718,179.92	0.02
70	300014	亿纬锂能	32,686	1,292,731.30	0.01
71	300005	探路者	29,177	1,259,571.09	0.01
72	300013	新宁物流	37,656	1,233,234.00	0.01
73	300026	红日药业	12,059	1,099,780.80	0.01
74	300029	天龙光电	15,997	465,512.70	0.01
75	300030	阳普医疗	6,771	237,662.10	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000002	万 科A	510,975,264.27	7.98
2	600028	中国石化	438,519,134.67	6.85
3	600016	民生银行	432,405,175.58	6.75
4	600000	浦发银行	420,108,283.26	6.56
5	601628	中国人寿	406,170,736.61	6.34
6	600036	招商银行	398,993,571.82	6.23
7	000063	中兴通讯	320,019,778.47	5.00
8	600309	烟台万华	289,450,732.39	4.52
9	600519	贵州茅台	287,311,618.68	4.49
10	600031	三一重工	284,446,918.97	4.44
11	601168	西部矿业	261,322,579.04	4.08
12	600015	华夏银行	251,269,176.91	3.92
13	601166	兴业银行	245,969,865.10	3.84
14	600547	山东黄金	242,393,811.22	3.79
15	000527	美的电器	238,421,513.03	3.72
16	600432	吉恩镍业	215,886,244.66	3.37
17	601318	中国平安	215,077,810.24	3.36
18	601601	中国太保	210,459,927.10	3.29
19	000651	格力电器	196,575,412.81	3.07
20	601009	南京银行	176,164,860.92	2.75
21	600348	国阳新能	175,210,440.78	2.74
22	600383	金地集团	173,679,074.79	2.71
23	600655	豫园商城	173,390,813.45	2.71
24	000069	华侨城A	172,787,138.58	2.70
25	000009	中国宝安	170,723,785.28	2.67
26	600409	三友化工	161,239,178.75	2.52
27	000001	深发展A	159,514,079.90	2.49
28	000898	鞍钢股份	155,796,174.53	2.43
29	002202	金风科技	154,553,111.55	2.41
30	600675	中华企业	145,425,469.56	2.27
31	000983	西山煤电	142,570,510.24	2.23
32	000961	中南建设	141,232,550.78	2.21
33	601169	北京银行	137,329,567.34	2.14
34	000937	金牛能源	137,257,087.54	2.14
35	600729	重庆百货	131,070,257.78	2.05

36	600195	中牧股份	130,902,168.35	2.04
----	--------	------	----------------	------

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。

#### 8.4.2 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	600000	浦发银行	667,743,636.09	10.43
2	000002	万科A	500,366,542.52	7.81
3	600031	三一重工	488,148,652.98	7.62
4	600016	民生银行	473,982,303.40	7.40
5	000937	金牛能源	401,021,366.15	6.26
6	600028	中国石化	391,228,172.72	6.11
7	600030	中信证券	358,490,522.34	5.60
8	600383	金地集团	350,912,150.49	5.48
9	601318	中国平安	339,748,493.00	5.31
10	600036	招商银行	309,922,288.63	4.84
11	600015	华夏银行	306,592,011.22	4.79
12	600089	特变电工	305,631,184.69	4.77
13	601166	兴业银行	304,955,546.36	4.76
14	600309	烟台万华	288,136,932.89	4.50
15	601628	中国人寿	282,205,149.35	4.41
16	000768	西飞国际	274,218,023.95	4.28
17	000063	中兴通讯	255,046,472.89	3.98
18	601601	中国太保	245,987,582.83	3.84
19	601168	西部矿业	243,543,724.31	3.80
20	000816	江淮动力	240,362,723.73	3.75
21	000651	格力电器	236,036,745.70	3.69
22	600048	保利地产	234,256,223.57	3.66
23	601398	工商银行	216,160,512.78	3.38
24	000001	深发展A	212,813,693.66	3.32
25	600348	国阳新能	205,011,121.09	3.20
26	600664	哈药股份	200,565,179.99	3.13
27	600432	吉恩镍业	199,208,065.11	3.11
28	600675	中华企业	181,653,567.65	2.84
29	000527	美的电器	170,578,375.27	2.66
30	002202	金风科技	167,540,477.18	2.62
31	600849	上海医药	166,313,508.07	2.60
32	000898	鞍钢股份	161,353,288.88	2.52
33	601088	中国神华	160,284,623.66	2.50

34	600449	赛马实业	155,659,415.68	2.43
35	600729	重庆百货	154,889,182.76	2.42
36	000932	华菱钢铁	150,934,057.20	2.36
37	002091	江苏国泰	145,836,925.78	2.28
38	600550	天威保变	144,665,372.51	2.26
39	601186	中国铁建	142,047,696.91	2.22
40	600195	中牧股份	141,992,397.07	2.22
41	000839	中信国安	140,940,048.67	2.20
42	600660	福耀玻璃	128,939,936.73	2.01
43	601899	紫金矿业	128,848,126.56	2.01

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。

#### 8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	19,310,639,910.59
卖出股票收入（成交）总额	21,284,689,816.14

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。

#### 8.5 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	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

#### 8.6 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	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

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

### 8.8 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。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.9.2 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。

#### 8.9.3 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	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

#### 8.9.4 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。

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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(%)
388,753	25,389.68	1,187,935,606.11	12.04	8,682,378,820.31	87.96

### 9.2 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	1,007.01	0.00

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003年8月22日)基金份额总额	3,698,432,268.39
本报告期期初基金份额总额	11,430,002,646.26
本报告期基金总申购份额	920,615,541.63
减：本报告期基金总赎回份额	2,480,303,761.47
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

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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、基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。本年度应支付的审计费用是152,000元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是7年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 (%)	
海通证券	2	6,025,147,157.59	14.89	5,008,720.19	14.80	-
招商证券	1	2,487,860,095.22	6.15	2,021,403.05	5.97	-
申银万国	1	1,573,705,503.01	3.89	1,337,645.00	3.95	-
长江证券	1	1,526,815,973.62	3.77	1,297,786.16	3.84	-
中信建投	1	8,122,154,010.48	20.08	6,903,806.40	20.41	-
国泰君安	2	5,071,748,360.18	12.54	4,188,631.19	12.38	-
中金公司	1	607,750,995.08	1.50	516,591.91	1.53	-
闽发证券	2	-	-	-	-	-
联合证券	1	2,434,603,456.78	6.02	2,069,415.52	6.12	-
兴业证券	1	782,798,396.34	1.93	665,375.17	1.97	-
平安证券	1	308,232,923.55	0.76	261,995.97	0.77	-
光大证券	1	1,561,720,934.52	3.86	1,268,908.22	3.75	-
国元证券	1	5,477,774,050.11	13.54	4,656,102.18	13.76	-
广发证券	1	4,476,178,665.69	11.06	3,636,927.11	10.75	-

#### 11.7.2 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	债券回购		债券交易	
	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期债券成交

		总额的比例 (%)		总额的比例 (%)
海通证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	4,788,058.24	0.86
申银万国	-	-	-	-
长江证券	-	-	65,739,500.00	11.82
中信建投	1,518,900,000.00	100.00	355,402,134.80	63.88
国泰君安			43,683,963.00	7.85
中金公司	-	-	-	-
闽发证券	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-
兴业证券	-	-	60,702,912.90	10.91
平安证券	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-
国元证券	-	-	26,040,578.00	4.68
广发证券	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未新增交易单元。

(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。

## 11.8 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	关于旗下基金投资海油工程(600583)非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-01-06
2	关于旗下部分基金继续参加中国光大银行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》	2009-01-16
3	关于旗下基金投资宏图高科(600122)非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-01-20
4	关于旗下部分基金新增浙商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》	2009-02-24
5	关于调整海富通旗下部分基金在交通银行网上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》	2009-02-25
6	关于旗下部分基金在中国银行开展新版网上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》	2009-02-25
7	关于旗下部分基金参加中国银行定期定额	《中国证券报》、《上海证券报》	2009-02-25

	申购费率优惠活动的公告	报》和《证券时报》	
8	关于旗下部分基金参加中国工商银行“基智定投”申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-02-25
9	关于旗下部分基金在浙商银行开展定期定额及网上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》	2009-03-18
10	关于旗下基金增加齐鲁证券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》	2009-03-24
11	关于旗下基金增加德邦证券有限责任公司为“定期定额申购业务”代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-03-25
12	关于旗下基金增加齐鲁证券有限公司为“定期定额申购业务”代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-03-25
13	关于旗下基金在德邦证券有限责任公司开展网上交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-03-26
14	关于旗下基金在齐鲁证券有限公司开展网上交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-03-26
15	关于旗下部分开放式基金在中国工商银行股份有限公司开展个人网上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》	2009-03-30
16	关于旗下部分基金继续参加中国银行定期定额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》	2009-05-04
17	关于旗下部分基金在中国银行继续开展网上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》	2009-05-04
18	关于旗下部分基金参加联合证券有限责任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》	2009-05-12
19	关于旗下部分基金参加兴业银行定期定额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》	2009-06-10
20	关于旗下部分基金在上海浦东发展银行开展网上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》	2009-06-30
21	关于海富通旗下部分开放式基金在国元证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-07-23
22	关于海富通旗下基金增加中国民族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》	2009-07-30
23	关于海富通旗下基金增加华宝证券经纪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》	2009-07-30
24	海富通基金管理有限公司关于旗下基金申购光大证券的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-08-08
25	关于海富通旗下基金增加中国国际金融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》	2009-08-10
26	关于海富通旗下基金增加中国建银投资证券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》	2009-08-13
27	关于海富通旗下基金增加安信证券股份有	《中国证券报》、《上海证券	2009-08-21

	限公司为开放式基金代销机构的公告	报》和《证券时报》	
28	关于海富通旗下部分基金参加国信证券股份有限公司定期定额业务推广活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-08-26
29	关于海富通旗下基金增加湘财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》	2009-08-27
30	关于旗下部分基金新增宁波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》	2009-08-27
31	关于海富通旗下基金增加信达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》	2009-09-01
32	关于海富通旗下基金增加第一创业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》	2009-09-03
33	关于旗下基金在齐鲁证券有限公司开展网上交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-09-09
34	关于海富通旗下基金增加长城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》	2009-10-14
35	关于海富通旗下基金增加方正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》	2009-10-22
36	关于旗下部分基金在中国建银投资证券有限责任公司开展网上交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-11-25
37	关于旗下部分基金在广发银行开展网上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》	2009-12-22
38	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投定期定额申购优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-12-28
39	关于旗下部分基金在浙商银行开展网上银行及定期定额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》	2009-12-29
40	关于旗下部分基金继续参加交通银行网上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》	2009-12-31
41	关于旗下部分基金参加中国工商银行“2010 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2009-12-31

## § 12 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。海富通中方股东-海通证券股份有限公司(600837. SH)是目前国内综合实力最强的创新类上市券商之一。海富通外方股东-富通基金 (Fortis Investments) 是欧洲最大的资产管理公司之一，截至 2009 年 9 月 30 日，资产管理规模超过 1600 亿欧元。

业务多元

◆ 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 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模近 460 亿元人民币。

◆ 2005 年 8 月，海富通率先获得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资格。截至 2009 年 12 月 31 日，海富通已经成为近 50 家企业年金的投资管理人，合计管理资产规模超过 100 亿元人民币。

◆ 2007 年 8 月，海富通获得中国证监会核准的 QDII (合格境内机构投资者) 业务资格。

◆ 从 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 12 月 31 日，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。

专业为先

◆ 海富通投资团队共有 42 名成员，强调投资研究一体化和团队式投资管理，团队成员中持有注册金融分析师资格证书 (CFA) 8 人，一半有海外留学或工作经验。

◆ 海富通在 2009 年设立“富诚理财”专户理财品牌，提供“一对一”、“一对多”及 QDII 专户理财服务。截至 2009 年 12 月 31 日，已获批并募集 5 只“一对多”专户理财产品。

荣誉领先

◆ 2009 年，国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通货币基金“2008 年度开放式货币市场金牛基金”，授予海富通精选贰号混合基金“2008 年度同业领先开放式混合型基金”。

◆ 2009 年，亚洲权威专业资产管理杂志《亚洲资产管理》授予海富通“2008 年度最佳合资基金管理公司”和“2008 年度最佳 QDII 管理人”。

◆ 2009 年，国内权威财经媒体《21 世纪经济报道》授予海富通“2008 年中国基金公司综合实力大奖”和“2008 年中国基金管理公司最佳社会责任奖”。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件名称

- |  |
|--|
| <ul style="list-style-type: none"> <li>(一) 中国证券监督管理委员会批准设立海富通精选证券投资基金的文件</li> <li>(二) 海富通精选证券投资基金基金合同</li> <li>(三) 海富通精选证券投资基金招募说明书</li> <li>(四) 海富通精选证券投资基金托管协议</li> <li>(五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件</li> <li>(六) 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</li> </ul> |
|--|

### 13.2 备查文件存放地点

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。

### 13.3 备查文件查阅方式

投资者可于营业时间预约查阅，或登录基金管理人网站查阅。

海富通基金管理有限公司  
2010 年 3 月 29 日