

海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

2010 年年度报告摘要

2010 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十六日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通中证 100 指数 (LOF)
基金主代码	162307
交易代码	162307
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 10 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
报告期末基金份额总额	2,180,894,434.94 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 1 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式,通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段,控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度,实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证 100 指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
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。

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	wrxj@hftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

2.4 信息披露方式

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住所

§ 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	2010 年	2009 年 10 月 30 日(基金合同生效日) 至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-168,358,484.38	-3,789,029.11
本期利润	-408,609,301.68	52,584,670.30
加权平均基金份额本期利润	-0.1905	0.0252
本期基金份额净值增长率	-18.24%	2.50%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1620	-0.0018
期末基金资产净值	1,827,642,588.13	2,139,733,545.60
期末基金份额净值	0.838	1.025

注：1、本基金合同生效日为 2009 年 10 月 30 日。

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、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。

4、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。

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	4.75%	1.68%	5.28%	1.69%	-0.53%	-0.01%
过去六个月	14.64%	1.47%	15.04%	1.46%	-0.40%	0.01%
过去一年	-18.24%	1.51%	-18.23%	1.50%	-0.01%	0.01%
自基金合同生效起至今	-16.20%	1.51%	-11.06%	1.52%	-5.14%	-0.01%

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

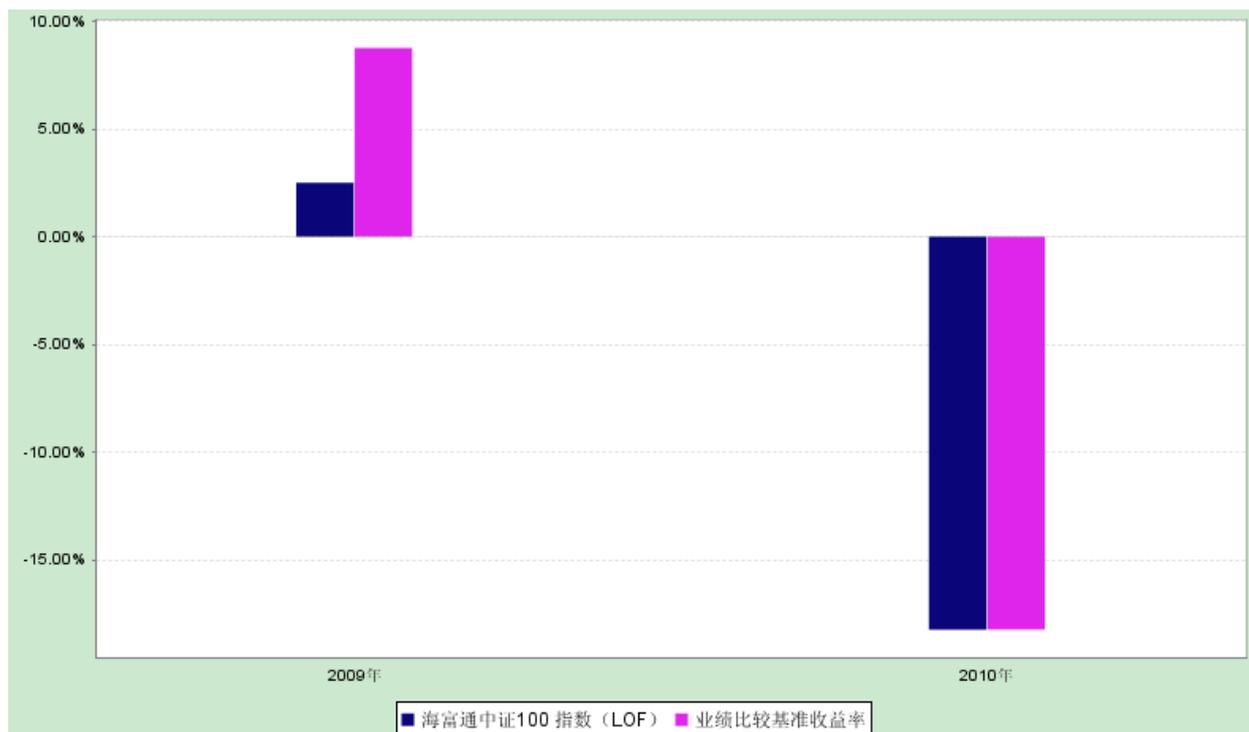
海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2009 年 10 月 30 日至 2010 年 12 月 31 日)



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。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十五条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3.2.3 自基金合同生效以来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

海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)
 基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注：图中列示的 2009 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 10 月 30 日 (基金合同生效日) 起至 12 月 31 日止计算。

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
2010	-	-	-	-	-
2009	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于 2009 年 10 月 30 日生效，未发生利润分配的情况。

§ 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”。与外方股东更名相关的变更程序目前正在办理之中）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。本海富通中证 100 指数证券投资基金

(LOF) 是基金管理人管理的第十一只开放式基金；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、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和海富通稳固收益债券型证券投资基金十四只开放式基金。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牟永宁	本基金的基金经理；海富通收益增长混合基金基金经理	2009-10-30	-	15 年	中国国籍，硕士，CFA。历任申银万国证券股份有限公司分析师，申万巴黎基金管理有限公司股票分析师，2004 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，任策略分析师、研究总监。2009 年 1 月起任海富通收益增长混合基金基金经理；2009 年 10 月起任海富通中证 100 指数(LOF)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 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 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

2010 年度，A 股市场呈现宽幅震荡态势。上半年，政府推出了一系列房地产调控政策，使得投资者对经济前景出现担忧，A 股市场大幅下跌。七月份在周期类板块的带动下，大盘走出了一波估值修复的反弹行情，成交量也伴随着投资者信心恢复而出现明显的放大。三季度末，随着美国二次量化宽松货币政策的推出，全球大宗商品市场价格和新兴市场股市出现大涨。上证指数也在 9 月底 10 月初大幅反弹，煤炭、有色金属板块引领本轮行情。在通胀压力和加息预期下，市场再度进入回调，截至年底，全年震幅高达 43%，全年跌幅高达 17%。行业方面，2010 年度，电子元器件、医药生物、机械设备、农林牧渔、食品饮料、有色金属、信息设备等行业涨幅领先。

作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制策略和数量化手段尽力降低交易成本和减少跟踪误差，总体上取得了比较好的指数跟踪效果。

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-18.24%，同期基金业绩比较基准收益率为-18.23%，日均跟踪偏离度的绝对值为 0.0000%，年化跟踪误差为 1.30%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为我国面临的外围环境比较复杂，欧债危机、美国经济增长的超预期等都对中国经济产生较大的影响。2011 年我国经济面临着较大的通胀压力，融资和大小非解禁压力都会对市场的资金面紧张带来进一步的影响。同时，我们国家也正处于经济发展的转型期。

本基金将继续严格按照基金合同的要求，秉承指数化投资策略，积极应对成份股调整和基金申赎等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争将基金跟踪误差控制在更低的水平。

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”)在对海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)(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 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	95,383,664.59	102,254,692.31
结算备付金		551,009.45	18,846,058.96
存出保证金		750,000.00	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,735,209,086.89	2,022,780,346.57
其中：股票投资		1,735,209,086.89	2,022,780,346.57
基金投资		-	-
债券投资		-	-

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		10,887.06	3,966,515.95
应收利息	7.4.7.5	19,709.22	24,816.36
应收股利		-	-
应收申购款		60,006.21	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,831,984,363.42	2,147,872,430.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
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		-	4,042,070.02
应付赎回款		645,475.53	-
应付管理人报酬		1,177,607.36	1,246,564.89
应付托管费		201,875.54	213,696.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,245,440.71	1,904,966.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,071,376.15	731,585.88
负债合计		4,341,775.29	8,138,884.55
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,180,894,434.94	2,087,148,875.30
未分配利润	7.4.7.10	-353,251,846.81	52,584,670.30
所有者权益合计		1,827,642,588.13	2,139,733,545.60
负债和所有者权益总计		1,831,984,363.42	2,147,872,430.15

注：1. 报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.838 元，基金份额总额 2,180,894,434.94 份。

2. 比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年10月30日(基金合同 生效日)至2009年12月31 日
一、收入		-387,761,445.95	58,231,230.19
1. 利息收入		815,788.04	514,765.32
其中：存款利息收入	7.4.7.11	815,323.09	514,765.32
债券利息收入		464.95	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-150,209,935.09	1,342,765.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-171,596,514.67	1,342,765.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	433,626.85	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	20,952,952.73	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-240,250,817.30	56,373,699.41
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	1,883,518.40	-
减：二、费用		20,847,855.73	5,646,559.89
1. 管理人报酬		12,778,574.86	2,505,505.82
2. 托管费		2,190,612.83	429,515.27
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	4,927,947.73	2,479,920.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	7. 4. 7. 19	950,720.31	231,618.38
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-408,609,301.68	52,584,670.30
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-408,609,301.68	52,584,670.30

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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)	2,087,148,875.30	52,584,670.30	2,139,733,545.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-408,609,301.68	-408,609,301.68
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)	93,745,559.64	2,772,784.57	96,518,344.21
其中: 1. 基金申购款	1,826,189,075.92	-199,416,955.69	1,626,772,120.23
2. 基金赎回款	-1,732,443,516.28	202,189,740.26	-1,530,253,776.02
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)	2,180,894,434.94	-353,251,846.81	1,827,642,588.13
项目	上年度可比期间 2009年10月30日(基金合同生效日)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)	2,087,148,875.30	-	2,087,148,875.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	52,584,670.30	52,584,670.30
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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	2,087,148,875.30	52,584,670.30	2,139,733,545.60

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;

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF) (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”)证监许可[2009]第 879 号《关于核准海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)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《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。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 2,086,432,233.85 元, 业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 (2009)第 226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 10 月 30 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,087,148,875.30 份基金份额, 其中认购资金利息折合 716,641.45 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 205 号文审核同意, 本基金 107,647,812.00 份基金份额于 2010 年 1 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括中证 100 指数成份股及备选成份股、新股(首次公开发行股票或增发)、固定收益产品、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%, 投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%, 现金、固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%, 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为: 中证 100 指数 \times 95%+活期存款利率(税后) \times 5%。

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 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》、《海富通中证100指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010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2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金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 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
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
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
法国巴黎投资管理 BE 控股公司 (BNP Paribas Investment Partners BE Holding) (原富通基金管理公司 Fortis Investment Management S.A.) (i)	基金管理人的股东

注：(i) 根据中国证监会 2010 年 12 月 28 日发布的证监许可[2010]1915 号《关于核准海富通基金管理有限公司修改章程的批复》，本公司原股东富通基金管理公司更名为法国巴黎投资管理 BE 控股公司。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年10月30日（基金合同生效 日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,778,574.86	2,505,505.82
其中：支付销售机构的客户维护费	1,475,287.05	333,136.18

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 0.7% 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 0.7% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年10月30日（基金合同生效 日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,190,612.83	429,515.27

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 0.12% 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 0.12% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内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。

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
海通证券	-	-	50,000,750.00	2.40%

7.4.8.5 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年10月30日(基金合同生效日) 至2009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
中国银行	95,383,664.59	752,458.41	102,254,692.31	495,391.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.9.2 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证券。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,735,209,086.89 元，无属于第二层级和第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 2,016,217,133.57 元，第二层级 6,563,213.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 会计期间：同)。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,735,209,086.89	94.72
	其中：股票	1,735,209,086.89	94.72
2	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	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	95,934,674.04	5.24
6	其他各项资产	840,602.49	0.05
7	合计	1,831,984,363.42	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资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	260,454,028.27	14.25
C	制造业	418,626,076.04	22.91
C0	食品、饮料	89,220,053.50	4.88
C1	纺织、服装、皮毛	6,172,213.32	0.34
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	28,741,434.21	1.57
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	104,249,105.19	5.70
C7	机械、设备、仪表	190,243,269.82	10.41
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	52,715,555.43	2.88
E	建筑业	52,981,032.38	2.90
F	交通运输、仓储业	76,037,385.02	4.16
G	信息技术业	45,562,203.40	2.49
H	批发和零售贸易	27,750,607.70	1.52
I	金融、保险业	715,258,145.81	39.14
J	房地产业	69,360,635.90	3.80
K	社会服务业	9,578,452.50	0.52
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,884,964.44	0.38
	合计	1,735,209,086.89	94.94

8.2.2 积极投资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	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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

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	601318	中国平安	1,737,868	97,598,666.88	5.34
2	600036	招商银行	6,795,847	87,054,800.07	4.76
3	601166	兴业银行	2,426,600	58,359,730.00	3.19
4	600016	民生银行	11,611,489	58,289,674.78	3.19

5	601328	交通银行	10,569,928	57,923,205.44	3.17
6	600000	浦发银行	3,681,444	45,613,091.16	2.50
7	600030	中信证券	3,596,666	45,282,024.94	2.48
8	601088	中国神华	1,681,934	41,560,589.14	2.27
9	000002	万科 A	4,984,545	40,972,959.90	2.24
10	601601	中国太保	1,643,706	37,640,867.40	2.06

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.hftfund.com 网站的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	601328	交通银行	103,077,560.98	4.82
2	601318	中国平安	89,599,841.28	4.19
3	600036	招商银行	81,074,487.63	3.79
4	601398	工商银行	72,318,784.97	3.38
5	600016	民生银行	53,640,350.29	2.51
6	601166	兴业银行	53,239,753.04	2.49
7	601601	中国太保	39,475,016.14	1.84
8	600000	浦发银行	37,732,089.18	1.76
9	601939	建设银行	37,298,453.01	1.74
10	601088	中国神华	35,974,462.21	1.68
11	601857	中国石油	34,563,693.75	1.62
12	600030	中信证券	33,687,706.83	1.57
13	600028	中国石化	30,636,229.13	1.43
14	000002	万科 A	30,146,024.56	1.41
15	600547	山东黄金	29,492,834.02	1.38
16	601169	北京银行	29,108,071.25	1.36
17	600519	贵州茅台	27,395,782.94	1.28
18	600015	华夏银行	26,553,256.25	1.24
19	002024	苏宁电器	25,751,966.14	1.20
20	600104	上海汽车	25,382,017.74	1.19

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	601328	交通银行	104,644,545.09	4.89
2	601318	中国平安	76,458,339.88	3.57
3	601398	工商银行	70,744,415.67	3.31
4	600036	招商银行	69,513,215.51	3.25
5	600016	民生银行	52,631,768.07	2.46
6	601166	兴业银行	47,704,903.49	2.23
7	600030	中信证券	47,702,115.70	2.23
8	601939	建设银行	36,812,262.94	1.72
9	601601	中国太保	36,584,759.13	1.71
10	601857	中国石油	35,568,254.47	1.66
11	600028	中国石化	35,283,554.64	1.65
12	000002	万科A	33,784,766.60	1.58
13	600000	浦发银行	33,429,288.98	1.56
14	601088	中国神华	33,018,063.92	1.54
15	600519	贵州茅台	32,374,461.52	1.51
16	601169	北京银行	30,062,955.30	1.40
17	002024	苏宁电器	28,218,562.67	1.32
18	000858	五粮液	25,109,430.05	1.17
19	600104	上海汽车	24,823,591.36	1.16
20	600019	宝钢股份	24,345,841.66	1.14

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

买入股票的成本（成交）总额	1,688,364,487.18
卖出股票的收入（成交）总额	1,564,088,414.89

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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,没有在接受编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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	750,000.00
2	应收证券清算款	10,887.06
3	应收股利	-
4	应收利息	19,709.22
5	应收申购款	60,006.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	840,602.49

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。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§ 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
20,823	104,734.88	1,129,446,866.11	51.79%	1,051,447,568.83	48.21%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	周忻	1,000,060.00	3.93%
2	上海金岳投资发展有限公司	1,000,060.00	3.93%
3	徐婷	1,000,030.00	3.93%
4	何小娥	999,130.00	3.92%
5	孙宁	800,056.00	3.14%
6	黄晟昊	793,678.00	3.12%
7	卞淑明	682,921.00	2.68%
8	齐齐哈尔中通公共交通有限责任 公司	500,030.00	1.96%
9	陈伟民	500,015.00	1.96%
10	乐玉屏	445,303.00	1.75%

注：持有人为场内持有人。

9.3 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	126,043.43	0.01%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年10月30日)基金份额总额	2,087,148,875.30
本报告期期初基金份额总额	2,087,148,875.30
本报告期基金总申购份额	1,826,189,075.92

减：本报告期基金总赎回份额	1,732,443,516.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,180,894,434.94

§ 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 80,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 2 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	
中信建投	2	1,513,805,870.31	46.88%	1,277,125.58	46.88%	-
中信证券	2	1,033,947,269.93	32.02%	876,785.95	32.19%	-
中金公司	2	681,499,785.51	21.10%	570,102.35	20.93%	-

注：本基金本报告期内未发生基金租用券商交易单元的变更。

(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。

11.7.2 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
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	4,291,091.80	100.00%	-	-	-	-

§ 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。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 15 只开放式基金。截至 2010 年末，海富通管理的公募基金资产规模近 472 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 2010 年末，海富通为 50

多家企业超过 136 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 2010 年末，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 2010 年末，投资咨询业务规模近 240 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。

2010 年 5 月，海富通在由中国证券报主办、银河证券、天相投顾、招商证券、海通证券等协办的“2009 年度中国基金业金牛奖”评选中荣获“海外投资金牛基金公司”奖项。

2010 年 11 月 25 日，海富通全资香港子公司——海富通资产管理（香港）有限公司正式开业，注册资本为 6000 万港元。经监管部门批复，海富通资产管理（香港）有限公司将开展第四类（就证券提供意见）、第九类（提供资产管理）业务。

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。

海富通基金管理有限公司

二〇一一年三月二十六日