海富通中证100指数证券投资基金（LOF）

更新招募说明书摘要

（2010年第2号）

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

重要提示

海富通中证100指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）经2009年8月31日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】879号文核准募集。本基金的基金合同于2009年10月30日正式生效。本基金类型为上市契约型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为2010年10月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年9月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司
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
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
法定代表人：邵国有
成立时间：2003年4月18日
电话：021-38650999
联系人：包瑾
注册资本：1.5亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理BE控股公司（原名“富通基金管理公司”。与外方股东更名相关的变更程序目前正在办理之中。下同）49%。

（二）主要人员情况

邵国有先生，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加（Stewart Edgar）先生，董事，英国籍，学士。历任英国Ivory & Sime公共有限公司基金经理，美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国HD国际有限公司高级基金经理、董事，美国F&C管理公司高级基金经理、董事。1997年至今任法国巴黎投资管理BE控股公司董事总经理。

田仁灿先生，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipement S.A.公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

董文标先生，独立董事，硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长，中国民生银行党委委员、副行长，中国民生银行党委书记、行长。现任中国民生银行董事长、党委书记。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长，现任商学院院长。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，EFAMA（欧洲基金和资产管理协会）和比利时基金公会名誉主席，INVESTPROTECT公司（布鲁塞尔）董事总经理、Pionner投资公司（米兰，都柏林，卢森堡）和Degroof资产管理（布鲁塞尔）独立董事、基金联合公会（哥本哈根）独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任上海大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用（集团）股份有限公司董事长。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省社联所属省新科技发展公司副总经理、海通证券计划财务部总经理、海通证券财务总监。

余毓繁先生，监事，英国籍，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理。现任富通银行香港分行行政总裁。

奚万荣先生，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理、监察稽核总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc公司高级财务经理、加拿大Future Electronics公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理兼投资总监，硕士。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经理，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金经理，2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金经理，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经理，2007年4月至2007年8月任海富通精选贰号混合基金经理，2008年6月起任海富通中国海外股票（QDII）基金经理。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部市场经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表，海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

牟永宁先生，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经理，2009年10月起任海富通中证100指数（LOF）基金经理。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理兼投资总监；蒋征，股票组合管理部总监；郭杰，股票组合管理部总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；戴德舜，研究总监；杜晓海，定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人的基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
法定代表人：肖 钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管及投资者服务部总经理：董杰
托管部门联系人：唐州徽
电话：（010）66594855
传真：（010）66594942

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

名称：海富通基金管理有限公司
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
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
法定代表人：邵国有
全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）
电话：021-38650797
传真：021-33830160

2、代销机构

（1）中国银行股份有限公司
地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

（2）中国工商银行股份有限公司
地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）
法定代表人：姜建清
客户服务中心电话：95588
电话：010-66107900
传真：010-66107914
联系人：刘业伟
网址：www.icbc.com.cn

（3）中国建设银行股份有限公司
地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：郭树清
客户服务电话：95533
联系人：张静
网址：www.ccb.com

（4）中国农业银行股份有限公司
地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：项俊波
客户服务电话：95599
传真：010-85109219
网址：www.abchina.com

（5）交通银行股份有限公司
地址：上海市银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com

（6）招商银行股份有限公司
地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
客户服务电话：95555
联系人：邓炯鹏
网址：www.cmbchina.com

（7）上海浦东发展银行股份有限公司
地址：上海市浦东新区浦东南路500号
法定代表人：吉晓辉
客户服务电话：95528
联系人：徐伟、汤嘉惠

（8）深圳发展银行股份有限公司
地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：肖遂宁
客户服务电话：95501
联系人：周勤
网址：www.sdb.com.cn

（9）中信银行股份有限公司
地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
客服电话：95558
联系人：王巍、李博
电话：010-65557013
传真：010-65550827
网址：bank.ecitic.com

（10）中国民生银行股份有限公司
地址：北京市东城区正义路4号
法定代表人：董文标
客户服务电话：95568
联系人：董云巍、吴海鹏
网址：www.cmbc.com.cn

（11）广东发展银行股份有限公司
地址：广州市农林下路83号
法定代表人：李若虹
客户服务电话：95508
联系人：詹全鑫 张大奕
网址：www.gdb.com.cn

（12）浙商银行股份有限公司
地址：中国杭州市庆春路288号
法定代表人：张达洋
客户服务电话：95527
联系人：吴军阳
网址：www.czbank.com

（13）海通证券股份有限公司
地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
客户服务电话：021-95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com

（14）中信证券股份有限公司
地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：王东明
电话：010-84588266
联系人：陈忠
网址：www.ecitic.com

（15）光大证券股份有限公司
地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
客户服务电话：400-8888-788
联系人：刘晨、李芳芳
网址：www.ebscn.com

（16）国泰君安证券股份有限公司
地址：上海市浦东新区商城路618号@法定代表人：祝幼一
客户服务电话：400-8888-666
联系人：韩星宇
网址：www.gtja.com

（17）中信建投证券有限责任公司
地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
客户服务电话：400-8888-108
联系人：权唐
网址：www.csc108.com

（18）招商证券股份有限公司
地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
客户服务电话：400-8888-111或95565
联系人：林生迎
网址：www.newone.com.cn

（19）兴业证券股份有限公司
地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人：兰荣
客户服务电话：400-8888-123
联系人：谢高得
网址：www.xyzq.com.cn

（20）华泰证券股份有限公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
客户服务电话：95597
联系人：万鸣
网址：www.htsc.com.cn

（21）华泰联合证券有限责任公司
地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层
法定代表人：马昭明
客户服务电话：400-8888-555、95513
联系人：盛宗凌
网址：www.lhzq.com

（22）广发证券股份有限公司
地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：王志伟
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
联系人：黄岚
网址：www.gf.com.cn

（23）长江证券股份有限公司
地址：武汉市新华下路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
客户服务电话：：4008-888-999或027-85808318
联系人：李良
长江证券客户服务网站：www.95579.com

（24）申银万国证券股份有限公司
地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
客户服务电话：962505
联系人：邓寒冰
网址：www.sywg.com.cn

（25）东方证券股份有限公司
地址：上海市浦东大道720号20楼
法定代表人：潘鑫军
客户服务电话：95503
联系人：吴宇
网址：www.dfzq.com.cn

（26）国信证券股份有限公司
地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人：何如
客户服务电话：95536
联系人：齐晓燕
网址：www.guosen.com.cn

（27）中国银河证券股份有限公司
地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：顾伟国
客户服务电话：4008-888-888
联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn

（28）平安证券有限责任公司
地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：杨宇翔
客户服务电话：95511
联系人：袁月
网址：www.pa18.com

（29）世纪证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人：卢长才
电话：0755-83199511
联系人：张婷
网址：www.csco.com.cn

（30）中信金通证券有限责任公司
地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人：刘军
客户服务电话：0571-96598
联系人：俞会亮
网址：www.bigsun.com.cn

（31）中信万通证券有限责任公司
地址：青岛市市南区东海路28号
法定代表人：史浩民
客户服务电话：电话：0532-96577
联系人：吴忠超
网址：www.zxwt.com.cn

（32）东北证券股份有限公司
地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
客户服务电话：0431-96688
联系人：潘锴
网址：www.nesc.cn

（33）瑞银证券有限责任公司
地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：刘弘
客户服务电话：400-887-8827
联系人：谢亚凡
网址：www.ubssecurities.com

（34）国元证券股份有限公司
地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
客户服务电话：0551-96888
联系人：陈琳琳
网址：www.gyzq.com.cn

（35）德邦证券有限责任公司
住所：上海市福山路500号城建大厦26层
法定代表人：方加春
客户服务电话：4008888128
联系人：罗芳
网址：www.tebon.com.cn

（36）宏源证券股份有限公司
公司注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号
住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源证券
法定代表人：冯戎
客户服务电话：4008000562
联系人：李巍
网址：www.hysec.com

（37）齐鲁证券有限公司
地址：山东省济南市经十路128号
法定代表人：李玮
客户服务电话：95538
联系人：孙豪志
网址：www.qlzq.com.cn

（38）第一创业证券有限责任公司
地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人：刘学民
客户服务电话：4008881888
联系人：魏颖
网址：www.firstcapital.com.cn

（39）湘财证券有限责任公司
地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
客户服务电话：400-888-1551
联系人：鲁雁先
网址：www.xcsc.com

（40）安信证券股份有限公司
地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
客户服务电话：400-800-1001
联系人：陈剑虹
网址：www.essence.com.cn

（41）中国建银投资证券有限责任公司
地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
法定代表人：杨小阳
客户服务电话：400-600-8008
联系人：刘权
网址：www.cjis.cn

（42）中国国际金融有限公司
地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：李剑阁
公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）
联系人：易建军
网址：www.cicc.com.cn

（43）中国民族证券有限责任公司
地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层
法定代表人：赵大建
客户服务电话：400-889-5618
联系人：李薇
网址：www.e5618.com

（44）华宝证券有限责任公司
地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
法定代表人：陈林
客户服务电话：4008209898
联系人：刘闻川
网址：www.cnhbstock.com

（45）信达证券股份有限公司
地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人：张志刚
客户服务电话：400-800-8899
联系人：唐静
网址：www.cindasc.com

（46）长城证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
客户服务电话：400666888
联系人：匡婷
网址：www.cgws.com

（47）方正证券有限责任公司
地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：张志刚
客户服务电话：95571
联系人：彭博
网址：www.foundersc.com

（48）广发华福证券有限责任公司
地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
客户服务电话：96326
联系人：张腾
网址：www.gfhfzq.com.cn

（49）渤海证券股份有限公司
地址：天津经济技术开发区第二大街42? 号写字楼101? 室
法定代表人：张志军
客户服务电话：400-651-5988
联系人：王兆权
网址：www.ewww.com.cn

（50）东莞证券有限责任公司
地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：游锦辉
客户服务电话：961130
联系人：梁建伟
网址：www.dgzq.com.cn

（51）广州证券有限责任公司
地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼
法定代表人：吴志明
客户服务电话：020-961303
联系人：林洁茹
网址：www.gzs.com.cn

（52）上海证券股份有限公司
地址：上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人：郁忠民
客户服务电话：4008 169 169
联系人：陈翔
网址：www.962518.com

（53）大通证券股份有限公司
地址：大连市沙河口区会展路129号
法定代表人：于宏民
客户服务电话：40089 18918，021-962518
联系人：谢立军
网址：www.daton.com.cn

（54）江海证券股份有限公司
地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
客户服务电话：400-666-2288
联系人：郭玲
网址：www.jhzq.com.cn

（55）山西证券股份有限公司
地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
客户服务电话：400-666-1618
联系人：张志国
网址：www.i618.com.cn

（56）国都证券有限责任公司
地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人：常喆
客户服务电话：400-818-8118
联系人：黄静
网址：www.guodu.com

（57）东兴证券有限责任公司
地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人：崔海涛
客户服务电话：4008-888-993
联系人：黄英
网址：www.dxzq.net

（58）财富证券有限责任公司
地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：周晖
电话：0731-84403360@ 传真：0731-84403330
联系人：朱友谊
网址：www.cfzq.com

（59）民生证券有限责任公司
地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A层
法定代表人：岳献春
客户服务电话：4006198888
联系人：赵明
网址：http://www.mszq.com/

（60）华龙证券有限责任公司
地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
客户服务电话：0931 4890208
联系人：李昕田
网址：http://www.hlzqgs.com

3、场内销售机构

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）进行。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人：金颖
电话：010-58598835
传真：010-58598907
联系人：任瑞新

（三）出具法律意见书的律师事务所

通力律师事务所
地址：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-3135 8600
联系人：吕红
联系电话：021-31358666-8776
经办律师：秦悦民、王利民

（四）审计基金财产的会计师事务所

普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦16楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：薛竞、徐振晨
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：徐振晨

四、基金的名称

本基金的名称：海富通中证100指数证券投资基金（LOF）

五、基金类型

基金类型：上市契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标为：本基金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。本基金管理人将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%。

七、投资方向和范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的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%。

如今后法律法规或监管机构允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

1.资产配置比例

本基金股票资产占基金资产的比例为90%-95%，本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。如果法律法规允许，本基金在履行适当程序后可以将股票投资比例提高到基金资产净值的100%，业绩比较基准同时相应变更，此事项无需召开基金份额持有人大会。

2.股票投资组合构建

（1）股票组合构建原则及方法

本基金股票资产投资采用完全复制标的指数的方法进行投资。通常情况下，本基金根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量。但在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：

1）法律法规的限制；

2）标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；

3）本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；

4）成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；

5）预期标的指数的成份股即将调整。

为了减小跟踪误差，本基金按照同行业，相近市值，相关性高及β值相近等原则来选择替代股票。

（2）股票组合调整

1）定期调整

本基金股票组合将根据标的指数的编制规则、备选股票的预期及调整公告，对股票投资组合及时进行调整。

2）不定期调整

a）标的指数成份股日常跟踪

当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他原因而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。

b）标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

c）申购赎回调整

本基金将根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）跟踪偏离的监控与管理

本基金管理人将每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金与标的指数表现的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化指数跟踪方案。

3.债券资产的配置策略

本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。

4.投资决策

1）决策依据

（1）投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；

（2）投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；

（3）投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

2）决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

（1）投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

（2）投资总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

（3）分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

（4）定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

（5）基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在股票分析师设定的股票池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

（6）基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

（7）定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

（8）定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

九、业绩比较基准

基金业绩比较基准=中证100指数×95%+活期存款利率（税后）×5%

中证100指数是从沪深300指数样本股中挑选规模最大的100只股票组成样本股，以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。在指数样本股选取方面，中证100指数以沪深300指数样本股作为样本空间。根据总市值对样本空间内股票进行排名，挑选排名前100名的股票组成样本，但经专家委员会认定不宜作为样本的股票除外。

如果中证100指数被停止编制及发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者的合法权益的原则，在履行适当程序以后变更基金的投资目标、投资范围、标的指数和业绩比较基准。

十、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。

十一、投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010年11月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止至2010年9月30日（“报告期末”）。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,588,967,599.79	94.83
	其中：股票	1,588,967,599.79	94.83
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	84,673,430.23	5.05
6	其他各项资产	2,020,630.96	0.12
7	合计	1,675,661,660.98	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	217,369,986.76	13.00
C	制造业	355,576,585.80	21.26
C0	食品、饮料	78,596,156.44	4.70
C1	纺织、服装、皮毛	6,624,442.38	0.40
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	25,749,226.96	1.54
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	87,517,921.48	5.23
C7	机械、设备、仪表	157,088,838.54	9.39
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	52,920,751.52	3.16
E	建筑业	55,182,622.66	3.30
F	交通运输、仓储业	62,140,587.58	3.72
G	信息技术业	40,229,695.59	2.41
H	批发和零售贸易	33,073,582.54	1.98
I	金融、保险业	683,301,763.01	40.85
J	房地产业	71,446,250.85	4.27
K	社会服务业	10,184,841.72	0.61
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	7,540,931.76	0.45
	合计	1,588,967,599.79	95.00

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	6,749,431	87,405,131.45	5.23
2	601318	中国平安	1,596,520	84,439,942.80	5.05
3	601328	交通银行	10,354,241	60,054,597.80	3.59
4	600016	民生银行	11,578,790	59,051,829.00	3.53
5	601166	兴业银行	2,349,048	54,309,989.76	3.25
6	600000	浦发银行	3,561,137	46,152,335.52	2.76
7	601398	工商银行	10,934,632	44,175,913.28	2.64
8	000002	万 科A	5,117,103	42,983,665.20	2.57
9	600030	中信证券	3,805,628	40,491,881.92	2.42
10	601088	中国神华	1,618,250	38,206,882.50	2.28

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4、报告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。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

（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。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,208,041.04
4	应收利息	15,310.51
5	应收申购款	31,861.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,418.40
8	其他	-
9	合计	2,020,630.96

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）-a 报告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。

（5）-b 报告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，不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2010年9月30日。

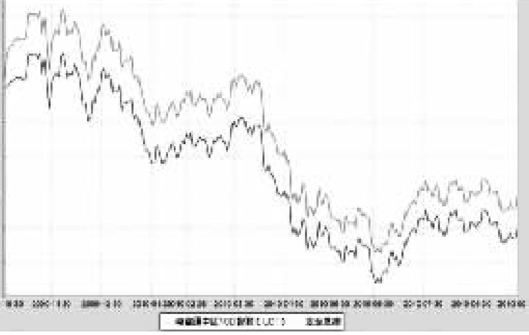
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率（1）	净值增长率标准差（2）	业绩比较基准收益率（3）	业绩比较基准标准差（4）	（1）-（3）	（2）-（4）
2009年10月30日（基金合同生效日）-2009年12月31日	2.50%	1.53%	8.76%	1.61%	-6.26%	-0.08%
2010年1月1日-2010年6月30日	-28.68%	1.53%	-28.91%	1.53%	0.23%	0.00%
2009年10月30日（基金合同生效日）-2010年9月30日	-20.00%	1.46%	-15.52%	1.47%	-4.48%	-0.01%

（二）本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

2009年10月30日至2010年9月30日



注：1、本基金合同于2009年10月30日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、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。

十三、基金的费用和税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金上市费用；

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

5、基金合同生效以后的信息披露费用；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

8、基金资产的资金汇划费用；

9、基金的指数使用费；

10、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金财产净值的0.7%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times0.7\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.12%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的0.12%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times0.12\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3. 基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，且收取下限为每季度（包括基金成立当季）人民币5万元。计算方法如下：

$H=E\times0.02\%/$当年天数

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季一个月内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

4、本条第（一）款第3至第9项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）与基金销售有关的费用

（六）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

海富通中证100指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

一、“三、基金管理人”部分：更新了艾德加（Stewart Edgar）先生、余毓繁先生的简历。

二、“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的基本情况及证券投资基金托管业务经营情况。

三、“五、相关服务机构”部分，新增广州证券、上海证券、大通证券、江海证券、山西证券、国都证券、东兴证券、财富证券、民生证券、华龙证券等代销机构，并对部分代销机构的相关信息进行了更新。

四、“十二、基金的投资”和“十三、基金的业绩”部分，根据2010年第三季度报告，更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容，相关数据截止期为2010年9月30日。

五、“二十四、对基金份额持有人的服务”部分，更新了基金间转换服务的相关内容。

海富通基金管理有限公司
2010年12月13日