海富通中小盘股票型证券投资基金

2010 第四季度报告

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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年一月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2010年10月1起至2010年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中小盘股票
基金主代码	519026
交易代码	519026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
报告期末基金份额总额	1，691，024，638.26份
投资目标	本基金通过投资于具有高成长潜力和良好基本面的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等，对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控，在投资范围内确定相应大类资产配置比例；其次通过对行业及个股进行定量与定性相结合的分析，精选具有良好基本面和成长潜力的中小盘上市公司进行投资。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=中证700指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。其预期收益、预期风险高于货币型基金和债券型基金。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2010年10月1日-2010年12月31日）
1.本期已实现收益	6，829，413.52
2.本期利润	-33，638，068.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0256
4.期末基金资产净值	2，121，229，030.87
5.期末基金份额净值	1.254

注：①）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

②）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.57%	2.07%	5.77%	1.53%	6.80%	0.54%

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

海富通中小盘股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2010年4月14日至2010年12月31日）

注：1、本基金合同于2010年4月14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十一条（二）、（五）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程崇	本基金的基金经理	2010-4-14	-	7年	中国国籍，硕士，特许金融分析师（CFA），持有基金从业人员资格证书。历任金信管理研究公司研究所研究员，国金证券研究所研究员，曾当选《新财富》2005年度最佳行业分析师，2006年7月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、非公募股票组合投资经理。2010年4月起任海富通中小盘股票基金基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司自成立以来，就建立了公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司根据该指导意见的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据本基金合同，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A股市场10月份在美国货币新一轮量化宽松的货币政策刺激下，周期类股票带领指数出现一波放量普涨。但在之后的两个月内，伴随着央行准备金上调和加息，对宏观紧缩的担忧给市场造成了一定影响，股指出现了明显的回落。行业方面，采掘、电子、有色金属涨幅靠前，金融、房地产、商业贸易表现不佳。

本基金在2010年第四季度略微增加了股票仓位，主要增持了煤炭有色等周期类股票以及中小盘和创业板股票。

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12.57%，同期基金业绩比较基准收益率为5.77%，基金净值跑赢业绩比较基准6.80个百分点。

4.4.3 市场展望和投资策略

展望未来，我们认为经济周期面临的波动比较剧烈，欧债危机、美国通胀预期加强以及全球库存周期等都对中国经济产生较大的影响。而我国的经济转型能否成功也取决于政策能否进一步发挥强有力的作用。从政府看重的GDP季调环比指标来看，我国经济已经出现偏热的现象。从资金面来看，公募基金、阳光私募和券商集合理财的资产规模变化并不大，而市场已经迎来了全流通时代。我们认为一季度股市面临的政策面依然趋于严厉。

基于上述判断，在行业选择上，我们将继续偏于选择受益于全球资金充裕的资源类行业，同时我们也继续在国家经济转型政策扶持的新兴行业中精选板块和个股，并希望从上市公司年报中发掘业绩优良未来成长性较好的品种。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1，983，155，366.52	90.87
	其中：股票	1，983，155，366.52	90.87
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	147，545，610.03	6.76
6	其他各项资产	51，609，107.28	2.36
7	合计	2，182，310，083.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	122，616，921.77	5.78
B	采掘业	182，784，529.07	8.62
C	制造业	1，093，519，477.93	51.55
C0	食品、饮料	26，305，969.40	1.24
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	24，398，950.80	1.15
C3	造纸、印刷	13，387，804.04	0.63
C4	石油、化学、塑胶、塑料	171，924，500.43	8.10
C5	电子	248，152，850.89	11.70
C6	金属、非金属	246，984，659.33	11.64
C7	机械、设备、仪表	301，474，875.04	14.21
C8	医药、生物制品	60，889，868.00	2.87
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	540，755，940.61	25.49
H	批发和零售贸易	43，478，497.14	2.05
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	1，983，155，366.52	93.49

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600406	国电南瑞	1，454，739	104，828，492.34	4.94
2	002153	石基信息	850，827	48，071，725.50	2.27
3	600354	敦煌种业	1，272，323	46，185，324.90	2.18
4	600143	金发科技	2，842，652	45，795，123.72	2.16
5	000630	铜陵有色	1，300，000	45，565，000.00	2.15
6	002106	莱宝高科	669，899	44，380，808.75	2.09
7	002237	恒邦股份	811，068	44，105，877.84	2.08
8	000998	隆平高科	1，347，503	43，888，172.71	2.07
9	600058	五矿发展	1，266，747	41，422，626.90	1.95
10	000039	中集集团	1，799，869	41，378，988.31	1.95

5.4 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。

5.5 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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1，497，106.57
2	应收证券清算款	46，287，073.73
3	应收股利	-
4	应收利息	33，474.10
5	应收申购款	3，791，452.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51，609，107.28

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	481，819，948.32
本报告期基金总申购份额	1，736，429，681.65
减：本报告期基金总赎回份额	527，224，991.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1，691，024，638.26

§7 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于2003年4月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从2003年8月开始，海富通先后募集成立了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，海富通管理的公募基金资产规模近25亿元。2004年末开始，海富通为QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准设立海富通中小盘股票型证券投资基金的文件

（二）海富通中小盘股票型证券投资基金基金合同

（三）海富通中小盘股票型证券投资基金招募说明书

（四）海富通中小盘股票型证券投资基金托管协议

（五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

（六）报告期内海富通中小盘股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层本基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇一一年一月二十一日

海富通中证100指数证券投资基金（LOF）

2010 第四季度报告

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：二〇一一年一月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2010年10月1日起至2010年12月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	2，180，894，434.94份
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。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2010年10月1日-2010年12月31日）
1.本期已实现收益	-51，386，286.98
2.本期利润	33，201，559.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0132
4.期末基金资产净值	1，827，642，588.13
5.期末基金份额净值	0.838

注：①）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.75%	1.68%	5.28%	1.69%	-0.53%	-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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司自成立以来，就建立了公平交易制度，并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司根据该指导意见的具体要求，已完善现有的业务流程，建立了公平交易监控系统，进行定期监控，以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据本基金合同，公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A股市场10月份在美国货币新一轮量化宽松的货币政策刺激下，周期类股票带领指数出现一波放量普涨。但在之后的两个月内，伴随着央行准备金上调和加息，对宏观紧缩的担忧给市场造成了一定影响，股指出现了明显的回落。行业方面，采掘、电子、有色金属涨幅靠前，金融、房地产、商业贸易表现不佳。

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降低交易成本和减少跟踪误差。

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4.75%，同期基金业绩比较基准收益率为5.28%，日均跟踪偏离度的绝对值为0.0085%，年化跟踪误差为1.36%，在合同规定的目标控制范围之内。本基金在本季度内遭遇了比较激烈的申赎变动，对基金净值造成了一定的负面影响。

4.4.3 市场展望和投资策略

展望未来，我们认为经济周期面临的波动比较剧烈，欧债危机、美国通胀预期加强以及全球库存周期等都对中国经济产生较大的影响。而我国的经济转型能否成功也取决于政策能否进一步发挥强有力的作用。从政府看重的GDP季调环比指标来看，我国经济已经出现偏热的现象。从资金面来看，公募基金、阳光私募和券商集合理财的资产规模变化并不大，而市场已经迎来了全流通时代。我们认为一季度股市面临的政策面依然趋于严厉。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	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

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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	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

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

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	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

5.3.2 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。

5.4 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。

5.5 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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	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

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5.1 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。

5.8.5.2 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	2，089，454，394.96
本报告期基金总申购份额	1，018，817，810.21
减：本报告期基金总赎回份额	927，377，770.23
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

§7 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于2003年4月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从2003年8月开始，海富通先后募集成立了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，海富通管理的公募基金资产规模近25亿元。2004年末开始，海富通为QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准设立海富通中证100指数证券投资基金（LOF）的文件

（二）海富通中证100指数证券投资基金（LOF）基金合同

（三）海富通中证100指数证券投资基金（LOF）招募说明书

（四）海富通中证100指数证券投资基金（LOF）托管协议

（五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

（六）报告期内海富通中证100指数证券投资基金（LOF）在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层本基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇一一年一月二十一日

海富通中国海外精选股票型证券投资基金

2010 第四季度报告

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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年一月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2010年10月1日起至2010年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中国海外股票（QDII）
基金主代码	519601
交易代码	519601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月27日
报告期末基金份额总额	206，180，487.33份
投资目标	本基金以在香港、美国等海外证券交易所上市的具有“中国概念”的上市公司为主要投资对象。本基金管理人将深入研究全球及内地经济状况以及政策导向，采取主动精选证券和适度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	根据对境内外证券市场投资经验的认识和对证券市场的实证分析，本基金管理人将基金的整体投资策略分为二个层次：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。主动精选证券是本基金投资策略的重点，本基金不积极谋求寻找市场的拐点，主要从控制系统性风险出发适度调整资产配置。
业绩比较基准	MSCI中国指数（以美元计价）
风险收益特征	本基金是股票型基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
境外投资顾问英文名称	BNP Paribas Investment Partners BE Holding
境外投资顾问中文名称	法国巴黎投资管理BE控股公司
境外资产托管人英文名称	The Bank of New York Mellon Corporation
境外资产托管人中文名称	纽约梅隆银行

注：本基金境外投资顾问法国巴黎投资管理BE控股公司原名为富通基金管理公司。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2010年10月1日-2010年12月31日）
1.本期已实现收益	21，235，717.93
2.本期利润	24，110，519.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.1112
4.期末基金资产净值	301，864，932.15
5.期末基金份额净值	1.464

注：①）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.63%	1.24%	-0.86%	1.17%	7.49%	0.07%

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

海富通中国海外精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2008年6月27日至2010年12月31日）

注：1、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，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条（二）投资范围、（八）投资限制中规定的各项比例；

2、本基金的业绩比较基准为MSCI中国指数（美元计价），在与同期业绩进行比较时，该基准已经转换为与本基金相同的计价货币（人民币）。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈洪	本基金的基金经理；海富通精选混合基金基金经理；副总经理；投资总监	2008-6-27	-	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。
杨铭	本基金的基金经理	2010-1-13	-	13年	中国籍，特许金融分析师（CFA），经济学学士，持有基金从业人员资格证书。先后任职于香港东亚银行上海分行、上海融监投资顾问有限公司，2004年4月加入海富通基金管理与限公司，任股票分析师，2008年6月至2010年1月任海富通中国海外股票（QDII）基金基金经理助理，2010年1月起任海富通中国海外股票（QDII）基金基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
William de Vijdeler	法国巴黎投资管理公司投资总监	23年	全球投资总监，拥有Ghent大学经济学位，经济学博士学位。曾在1987-1989