上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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7月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月22日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通上证非周期ETF
基金主代码	510120
交易代码	510120
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
报告期末基金份额总额	301,792,376份
投资目标	紧密跟踪上证非周期行业100指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数,按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,进行被动式指数化投资,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	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证非周期行业100指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,属于高风险、高预期收益的投资品种。本基金为指数型基金,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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(2011年4月22日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-14,690,716.66
2.本期利润	-26,607,831.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0738
4.期末基金资产净值	684,145,497.12
5.期末基金份额净值	2.267

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本基金合同生效日为2011年04月22日。

④本基金已于2011年05月18日进行了基金份额折算,折算比例为0.42126887。

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

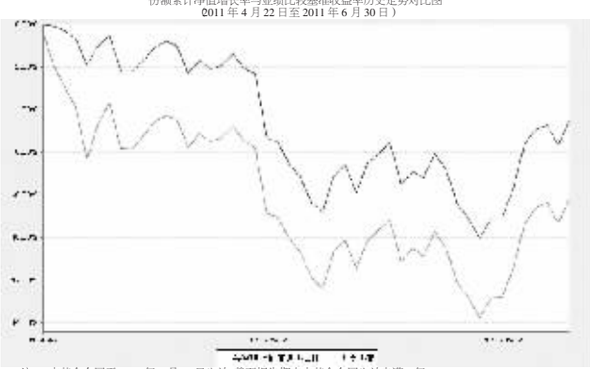
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日(2011年4月22日)起至6月30日	-4.50%	1.06%	-8.22%	1.24%	3.72%	-0.18%

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

上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年4月22日至2011年6月30日)



注:1.本基金合同于2011年4月22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三个月。自2011年4月22日合同生效日起至2011年6月30日,本基金运作时间未满3个月,仍处于建仓期中。

§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		
刘璎	本基金的基金经理;海富通上证非周期ETF联接基金基金经理;海富通上证周期ETF基金基金经理;海富通上证周期ETF联接基金基金经理	2011-4-22	-	10年	管理学硕士,持有基金从业人员资格证书。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司,曾任华安上证180ETF基金基金经理助理;2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金基金经理,2008年4月至2010年6月担任华安中国A股增强指数基金基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司。2010年11月起任海富通上证周期ETF基金及海富通上证周期ETF联接基金基金经理,2011年4月起任海富通上证非周期ETF基金及海富通上证非周期ETF联接基金基金经理。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度,A股总体呈现出弱市震荡的态势。由于担忧通胀压力持续导致货币政策进一步收紧、国内经济增长可能放缓,股市从4月中旬起步入下跌通道,上证综合指数一度下探至2600点附近。在允许地方政府发债建保障房,通货膨胀可能在6,7月份见顶以及国际市场原油价格大幅下跌等因素的影响下,股市企稳反弹。食品饮料、金融、房地产在二季度表现较好,电子、机械、金属行业表现相对较弱。

本基金二季度在进行结构调整的同时小幅增加了仓位,结构调整主要在于减持了机械化工等行业,增持了保障房建设受益以及估值比较便宜的小盘股等资产。但是由于整个季度都保持了较高的仓位,对4月中旬开始下跌的系统性风险预计不足,没有做好合适的防御措施,导致基金净值损失较大。季度末,我们认为系统性风险得到了相对充分的释放,因此依然保持了较高的仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-11.03%,同期业绩比较基准收益率为-6.05%,基金净值跑输业绩比较基准4.98个百分点。跑输的原因主要是因为二季度期间一直保持较高的仓位,未能减仓。

4.6 市场展望和投资策略

展望未来,美国就业低迷,地产疲软,经济增速或将短暂放缓;欧债危机可能依然悬而未决;新型经济体增长动力减弱;全球经济复苏的道路上存在着诸多的不确定性。

就国内而言,我们认为中国经济不会出现硬着陆。由于现阶段国内通胀依然较高,下半年政策的腾挪空间可能较小,如何在通胀不失控的前提下保持经济平稳较快发展将会是政府的首要目标。今年是“十二五”的开局之年,受到上半年紧缩环境的影响,保障房、水利建设和铁路建设等重点项目的投资都未大幅开展。下半年随着通胀压力的减缓和随之带来的资金面的略有放松,政府可能会加大在这些项目上的投资。此外,我国宏观经济依然处于调整结构的过程中,围绕着经济的转型,不少产业规划和产业政策可能会在下半年得到落实,鉴此节能环保、低碳等板块也将会蕴含一些新的投资机会。

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,提高组合与指数的拟合度。我们将密切关注国内外经济形势的变化,以既定的投资目标与投资策略,规范运作、勤勉尽责,力争为广大投资者创造长期、稳定的回报。

§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	656,713,112.64	95.83
	其中:股票	656,713,112.64	95.83
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	18,334,646.37	2.68
6	其他各项资产	10,274,731.69	1.50
7	合计	685,322,490.70	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	13,253,515.28	1.94
B	采掘业	-	-
C	制造业	376,042,228.78	54.97
C0	食品、饮料	61,881,871.94	9.05
C1	纺织、服装、皮毛	11,298,478.38	1.65
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,649,734.40	0.24
C4	石油、化学、塑胶、塑料	32,147,252.09	4.70
C5	电子	9,324,328.48	1.36
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	199,226,874.49	29.12
C8	医药、生物制品	57,631,109.00	8.42
C99	其他制造业	2,882,580.00	0.42
D	电力、煤气及水的生产和供应业	45,726,962.33	6.68
E	建筑业	76,856,347.87	11.23
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	58,605,177.98	8.57
H	批发和零售贸易	40,359,150.16	5.90
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	9,149,874.85	1.34
L	传播与文化产业	2,982,684.33	0.44
M	综合类	33,737,171.06	4.93
	合计	656,713,112.64	95.99

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	600519	贵州茅台	176,908	37,615,948.04	5.50
2	601668	中国建筑	6,995,100	28,190,253.00	4.12
3	600031	三一重工	1,423,008	25,671,064.32	3.75
4	600050	中国联通	3,879,714	20,368,498.50	2.98
5	601989	中国重工	1,279,571	17,645,284.09	2.58
6	600900	长江电力	2,271,412	16,376,880.52	2.39
7	600104	上海汽车	854,416	16,011,755.84	2.34
8	600089	特变电工	1,208,650	15,639,931.00	2.29
9	601766	中国南车	1,800,400	12,818,848.00	1.87
10	600068	葛洲坝	1,003,048	12,026,545.52	1.76

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	-
2	应收证券清算款	10,199,381.22
3	应收股利	37,245.49
4	应收利息	7,143.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,961.52
8	其他	-
9	合计	10,274,731.69

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

基金合同生效日基金份额总额	652,308,409
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	124,200,000
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	97,200,000
本报告期基金拆分变动份额	-377,516,033
本报告期期末基金份额总额	301,792,376

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

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人,截至2011年6月30日,海富通为50多家企业超过150亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2011年6月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近25亿元。2004年末开始,海富通为QFII(合格境外机构投资者)及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问,截至2011年6月30日,投资咨询及海外业务规模达219亿元人民币。

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

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动“绿色与希望-橄榄枝公益环保计划”,针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了公益林。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以“幸福投资”为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§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上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金的文件

(二)上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金基金合同

(三)上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

(四)上证非周期行业100交易型开放式指数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)报告期内上证非周期行业100交易型开放式指数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
二〇一一年七月二十日

海富通中小盘股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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7月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30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	1,302,379,088.69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(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-165,058,527.46
2.本期利润	-172,088,215.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1259
4.期末基金资产净值	1,343,895,244.49
5.期末基金份额净值	1.032

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	-11.03%	1.29%	-6.05%	1.05%	-4.98%	0.24%

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历史走势对比图

(2010年4月14日至2011年6月30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	-	8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运作分析

二季度,A股总体呈现出弱市震荡的态势。由于担忧通胀压力持续导致货币政策进一步收紧、国内经济增长可能放缓,股市从4月中旬起步入下跌通道,上证综合指数一度下探至2600点附近。在允许地方政府发债建保障房,通货膨胀可能在6,7月份见顶以及国际市场原油价格大幅下跌等因素的影响下,股市企稳反弹。食品饮料、金融、房地产在二季度表现较好,电子、机械、金属行业表现相对较弱。

本基金二季度在进行结构调整的同时小幅增加了仓位,结构调整主要在于减持了机械化工等行业,增持了保障房建设受益以及估值比较便宜的小盘股等资产。但是由于整个季度都保持了较高的仓位,对4月中旬开始下跌的系统性风险预计不足,没有做好合适的防御措施,导致基金净值损失较大。季度末,我们认为系统性风险得到了相对充分的释放,因此依然保持了较高的仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-11.03%,同期业绩比较基准收益率为-6.05%,基金净值跑输业绩比较基准4.98个百分点。跑输的原因主要是因为二季度期间一直保持较高的仓位,未能减仓。

4.6 市场展望和投资策略

展望未来,美国就业低迷,地产疲软,经济增速或将短暂放缓;欧债危机可能依然悬而未决;新型经济体增长动力减弱;全球经济复苏的道路上存在着诸多的不确定性。

就国内而言,我们认为中国经济不会出现硬着陆。由于现阶段国内通胀依然较高,下半年政策的腾挪空间可能较小,如何在通胀不失控的前提下保持经济平稳较快发展将会是政府的首要目标。今年是“十二五”的开局之年,受到上半年紧缩环境的影响,保障房、水利建设和铁路建设等重点项目的投资都未大幅开展。下半年随着通胀压力的减缓和随之带来的资金面的略有放松,政府可能会加大在这些项目上的投资。此外,我国宏观经济依然处于调整结构的过程中,围绕着经济的转型,不少产业规划和产业政策可能会在下半年得到落实,鉴于此节能环保、低碳等板块也将会蕴含一些新的投资机会。

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,提高组合与指数的拟合度。我们将密切关注国内外经济形势的变化,以既定的投资目标与投资策略,规范运作、勤勉尽责,力争为广大投资者创造长期、稳定的回报。

§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	1,224,212,583.44	90.64
	其中:股票	1,224,212,583.44	90.64
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	118,468,482.95	8.77
6	其他各项资产	8,015,702.16	0.59
7	合计	1,350,696,768.55	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	30,147,317.70	2.24
B	采掘业	36,560,000.00	2.72
C	制造业	665,536,946.43	49.52
C0	食品、饮料	30,632,952.46	2.28
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	158,074,963.70	11.76
C5	电子	19,185,034.40	1.43
C6	金属、非金属	223,021,867.15	16.60
C7	机械、设备、仪表	209,947,377.99	15.62
C8	医药、生物制品	24,674,750.73	1.84
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	54,940,230.03	4.09
E	建筑业	79,815,738.74	5.94
F	交通运输、仓储业	19,800,000.00	1.47
G	信息技术业	134,779,964.50	10.03
H	批发和零售贸易	129,462,361.88	9.63
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	32,073,445.56	2.39
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	41,096,578.60	3.06
	合计	1,224,212,583.44	91.09

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	2,550,000	92,565,000.00	6.89
2	600153	建发股份	7,500,000	66,750,000.00	4.97
3	600585	海螺水泥	1,539,761	42,743,765.36	3.18
4	600760	中航黑豹	3,203,340	41,226,985.80	3.07
5	000551	创元科技	2,743,400	39,806,734.00	2.96
6	002019	鑫富药业	1,846,049	35,721,048.15	2.66
7	600970	中材国际	1,200,000	32,796,000.00	2.44
8	601989	中国重工	2,200,000	30,338,000.00	2.26
9	002153	石基信息	837,105	29,214,964.50	2.17
10	600071	凤凰光学	2,586,846	27,963,805.26	2.08

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	4,724,620.02
2	应收证券清算款	2,829,817.82
3	应收股利	-
4	应收利息	26,450.77
5	应收申购款	434,813.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,015,702.16

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	1,538,201,154.58
本报告期基金总申购份额	32,580,739.46
减:本报告期基金总赎回份额	268,402,805.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,302,379,088.69

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

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人,截至2011年6月30日,海富通为50多家企业超过150亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2011年6月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模近25亿元。2004年末开始,海富通为QFII(合格境外机构投资者)及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问,截至2011年6月30日,投资咨询及海外业务规模达219亿元人民币。

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

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动“绿色与希望-橄榄枝公益环保计划”,针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了公益林。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以“幸福投资”为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§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
二〇一一年七月二十日

海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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7月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年4月27日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	海富通上证非周期ETF联接
基金主代码	519032
交易代码	519032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月27日
报告期末基金份额总额	323,879,234.46份
投资目标	通过投资于上证非周期行业100ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金通过主要投资于上证非周期行业100ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数的表现。建仓完成后,正常情况下投资于上证非周期行业100ETF的比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证非周期行业100指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金的联接基金,具有与上证非周期行业100指数相似的风险收益特征。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510120
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年6月8日
基金管理人名称	海富通基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

注:本表所列的基金主代码510120为目标基金的二级市场交易代码,目标基金的一级市场申购赎回代码为510121。

2.1.2 目标基金产品概况

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数,按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,进行被动式指数化投资,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	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证非周期行业100指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,属于高风险、高预期收益的投资品种。本基金为指数型基金,采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§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(2011年4月27日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-20,716,229.07
2.本期利润	-14,069,263.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0402
4.期末基金资产净值	312,777,655.24
5.期末基金份额净值	0.966

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本基金合同生效日为2011年04月27日。

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
自基金合同生效日(2011年4月27日)起至6月30日	-3.40%	0.97%	-5.16%	1.19%	1.76%