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:二〇一一年八月二十九日

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30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。本半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8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30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	1,920,800,441.55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	葛万荣	唐州徽
	联系电话	021-38650891	010-66594855
	电子邮箱	wrzi@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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-54,489,976.72
本期利润	12,634,264.34
加权平均基金份额本期利润	0.0061
本期基金份额净值增长率	0.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1601
期末基金资产净值	1,613,338,550.81
期末基金份额净值	0.840

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)。

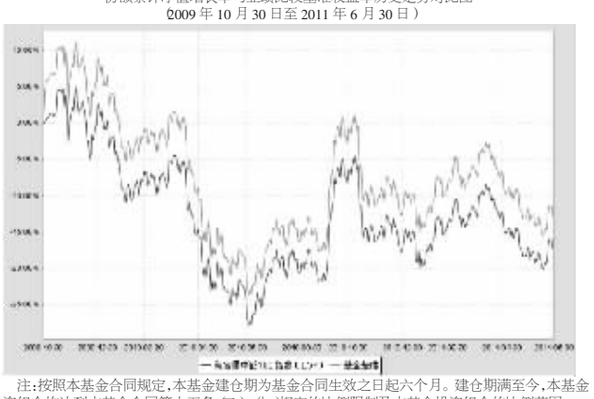
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	1.45%	1.10%	0.50%	1.09%	0.95%	0.01%
过去三个月	-3.56%	1.03%	-4.45%	1.02%	0.89%	0.01%
过去六个月	0.24%	1.14%	-0.44%	1.14%	0.68%	0.00%
过去一年	14.91%	1.32%	14.53%	1.31%	0.38%	0.01%
自基金合同生效起至今	-16.00%	1.41%	-11.45%	1.42%	-4.55%	-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投资公司")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、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选股票型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金和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十七只开放式基金。

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;海富通风格优势股票基金基金经理	2009-10-30	-	16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月至2011年4月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。2011年4月起兼任海富通风格优势股票基金基金经理。

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: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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年,A股总体呈现先涨后跌的震荡格局。一季度大盘股表现较好,带领市场走出一轮估值修复行情。但到了二季度,在国内通货膨胀加剧,欧美经济出现反复的背景下,A股表现疲弱。由于投资者担心持续的紧缩政策以及严厉的房产调控将使经济增长放缓,上证指数五月份下跌幅度接近6%,抹去了一季度的涨幅。化工、建材、家电板块走势较强,航空、医药、食品行业跌幅较大;大盘股表现相对优于小盘股。

作为指数基金,在操作上我们严格遵守基金合同,应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。

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0.24%,同期基金业绩比较基准收益率为-0.44%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0057%,年化跟踪误差为0.96%,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

展望下半年,海外经济和国内经济仍处于较为复杂的状态中。国际油价波动剧烈;欧债危机可能继续蔓延至周边国家,并演变成欧元危机;美国债务危机问题将会得到妥协,但其失业率可能依旧较高,经济增速或将有所放缓;新兴经济体增长动力相对较弱,全球经济复苏的道路上存在着诸多的不确定性。国内上半年通胀较高,下半年政策的腾挪空间可能较小。为了实现控通胀和保增长的双重目标,下半年的紧缩力度会有所缓和,央行加息和提准备金的动力都不是很大,资金面或将处于一个不紧也不松的状态。上半年受到紧缩环境的影响,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,新兴产业发展与制造业升级是推动经济转型的两大突破方向,下半年随着产业规划和产业政策的落实,相关板块也将会蕴含一些新的投资机会。总体而言,我们认为下半年市场可能依然处于震荡的格局,期间会存在不少主题性的投资机会,但可能难有系统性的上涨机会,指数创新高的可能性不大。

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。

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 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2011年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产:		
银行存款	82,934,557.75	95,383,664.59
结算备付金	924,496.45	551,009.45
存出保证金	750,000.00	750,000.00
交易性金融资产	1,528,438,551.15	1,735,209,086.89
其中:股票投资	1,528,438,551.15	1,735,209,086.89
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	481,440.70	10,887.06
应收利息	14,974.74	19,709.22
应收股利	3,117,076.57	-
应收申购款	43,385.82	60,006.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,616,704,483.18	1,831,984,363.42
负债和所有者权益	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	643,241.35	645,475.53
应付管理人报酬	903,331.92	1,177,607.36
应付托管费	154,856.87	201,875.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	860,483.09	1,245,440.71
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	804,019.14	1,071,376.15
负债合计	3,365,932.37	4,341,775.29
所有者权益:		
实收基金	1,920,800,441.55	2,180,894,434.94
未分配利润	-307,461,890.74	-353,251,846.81
所有者权益合计	1,613,338,550.81	1,827,642,588.13
负债和所有者权益总计	1,616,704,483.18	1,831,984,363.42

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.840元,基金份额总额1,920,800,441.55份。

6.2 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:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入	22,306,228.58	-581,045,589.33
1.利息收入	375,864.63	368,926.26
其中:存款利息收入	374,859.68	368,926.26
债券利息收入	1,004.95	-
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)	-45,942,970.21	-65,947,864.04
其中:股票投资收益	-63,748,530.40	-77,010,868.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	535,116.05	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	17,270,444.14	11,063,004.92
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	67,124,241.06	-516,160,462.89
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	749,093.10	693,811.34
减:二、费用	9,671,964.24	9,366,779.13
1.管理人报酬	6,118,125.31	5,935,083.69
2.托管费	1,048,821.49	1,017,442.90
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,094,313.22	1,934,461.93
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	410,704.22	479,790.61
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	12,634,264.34	-590,412,368.46
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	12,634,264.34	-590,412,368.46

6.3 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:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30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)	2,180,894,434.94	-353,251,846.81	1,827,642,588.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,634,264.34	12,634,264.34
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)	-260,093,993.39	33,155,691.73	-226,938,301.66
其中:1.基金申购款	568,795,821.00	-61,488,962.57	507,306,858.43
2.基金赎回款	-828,889,814.39	94,644,654.30	-734,245,160.09
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)	1,920,800,441.55	-307,461,890.74	1,613,338,550.81
	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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)	-	-590,412,368.46	-590,412,368.46
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)	45,557,877.42	-35,154,291.11	10,403,586.31
其中:1.基金申购款	648,455,958.15	-83,029,027.26	565,426,930.89
2.基金赎回款	-602,898,080.73	47,874,736.15	-555,023,344.58
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)	2,132,706,752.72	-572,981,989.27	1,559,724,763.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,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

6.4 报表附注

6.4.1 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×95%+活期存款利率(税后)×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8月29日批准报出。

6.4.2 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6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011上半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2011年6月30日的财务状况以及2011上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,118,125.31	5,935,083.69
其中:支付销售机构的客户维护费	614,653.99	803,294.48

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,048,821.49	1,017,442.90

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期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。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	82,934,557.75	354,849.84	84,870,567.02	348,396.15

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
601998	中信银行	2011-06-29	配股停牌	4.75	2011-07-07	4.59	1,050,326	6,415,523.89	4,989,048.50	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 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	1,528,438,551.15	94.54
	其中:股票	1,528,438,551.15	94.54
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	83,859,054.20	5.19
6	其他各项资产	4,406,877.83	0.27
7	合计	1,616,704,483.18	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	209,538,860.25	12.99
C	制造业	381,029,867.70	23.62
C0	食品、饮料	85,935,282.18	5.33
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	21,123,997.36	1.31
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	85,193,847.95	5.28
C7	机械、设备、仪表	186,197,183.23	11.54
C8	医药、生物制品	2,579,556.98	0.16
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	31,535,365.44	1.95
E	建筑业	45,704,865.23	2.83
F	交通运输、仓储业	57,301,931.38	3.55
G	信息技术业	37,235,654.96	2.31
H	批发和零售贸易	23,183,807.01	1.44
I	金融、保险业	618,937,762.61	38.36
J	房地产业	53,401,626.26	3.31
K	社会服务业	10,030,520.71	0.62
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,591,183.25	0.35
	合计	1,473,491,444.80	91.33

7.2.2 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	3,696,000.00	0.23
B	采掘业	-	-
C	制造业	40,616,442.29	2.52
C0	食品、饮料	7,924,105.45	0.49
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	1,964,500.00	0.12
C6	金属、非金属	9,997,271.37	0.62
C7	机械、设备、仪表	9,418,322.99	0.58
C8	医药、生物制品	11,312,242.48	0.70
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	1,600,000.00	0.10
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	9,034,664.06	0.56
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	54,947,106.35	3.41

7.3 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

7.3.1 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	600036	招商银行	5,676,309	73,905,543.18	4.58
2	601318	中国平安	1,457,613	70,358,979.51	4.36
3	600030	中信证券	4,551,931	59,539,257.48	3.69
4	600016	民生银行	9,858,477	56,489,073.21	3.50
5	601328	交通银行	9,165,005	50,774,127.70	3.15
6	600000	浦发银行	4,948,601	48,694,233.84	3.02
7	601166	兴业银行	3,556,646	47,943,588.08	2.97
8	601088	中国神华	1,470,439	44,319,031.46	2.75
9	000002	万科A	4,232,973	35,768,621.85	2.22
10	600519	贵州茅台	167,178	35,547,058.14	2.20

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网站的半年度报告正文。

7.3.2 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

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	600111	包钢稀土	139,959	9,997,271.37	0.62
2	600256	广汇股份	379,927	9,034,664.06	0.56
3	000895	双汇发展	119,935	7,924,105.45	0.49
4	000425	徐工机械	299,981	7,436,528.99	0.46
5	000538	云南白药	109,886	6,272,298.38	0.39

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网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600030	中信证券	28,626,092.66	1.57
2	600036	招商银行	20,795,306.42	1.14
3	600000	浦发银行	20,001,305.44	1.09
4	000338	潍柴动力	19,436,686.18	1.06
5	601318	中国平安	18,059,632.82	0.99
6	600016	民生银行	16,955,053.82	0.93
7	601166	兴业银行	13,896,084.61	0.76
8	601328	交通银行	13,756,197.88	0.75
9	601088	中国神华	11,525,048.57	0.63
10	600111	包钢稀土	9,525,660.97	0.52
11	600115	东方航空	9,514,761.80	0.52
12	600585	海螺水泥	9,441,142.24	0.52
13