

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:二〇一一年八月二十九日
1.1 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。

2.1 基金基本情况
基金名称: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
基金代码:510107
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2010年9月28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

2.2 基金产品说明
通过投资于上证周期行业SOFET紧密跟踪的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
本基金采用完全复制跟踪标的指数的指数投资策略,按照标的指数成份股及其权重构建基金投资组合,进行被动式指数化投资,并跟踪标的指数的构成及其权重的变动进行相应调整。

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
本期已实现收益 1,194,173.68
本期利润 1,350,183.97
加权平均基金份额本期利润 0.0036
本期基金份额净值增长率 0.23%

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 业绩比较基准收益率② ①-② ③-④
过去一个月 0.23% 1.09% -1.03% 1.12%

3.3 基金管理人及基金托管人
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
基金管理人姓名:陈万东
基金托管人姓名:王长勇

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同的有关规定,本着诚实信用、勤勉尽责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控制指导意见》,公司根据指导意见的具体要求,已完善现有的业务流程,建立了公平交易控制制度,进行定期监控,以确保维护投资者的合法权益。

4.4 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的专项说明
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2011年上半年,A股整体呈现先跌后涨的震荡格局。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。由于投资者对通胀政策以及严厉的房地产调控措施导致经济增速放缓,上证指数五月份跌幅一度接近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、食品行业表现较大;大盘股表现相对优于小盘股。

4.4.2 基金管理人对于报告期内本基金投资运作情况的专项说明
4.4.2.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2011年上半年,A股整体呈现先跌后涨的震荡格局。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。由于投资者对通胀政策以及严厉的房地产调控措施导致经济增速放缓,上证指数五月份跌幅一度接近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、食品行业表现较大;大盘股表现相对优于小盘股。

4.4.2.2 基金管理人对于报告期内本基金投资运作情况的专项说明
4.4.2.2.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2011年上半年,A股整体呈现先跌后涨的震荡格局。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。由于投资者对通胀政策以及严厉的房地产调控措施导致经济增速放缓,上证指数五月份跌幅一度接近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、食品行业表现较大;大盘股表现相对优于小盘股。

4.4.2.2.2 基金管理人对于报告期内本基金投资运作情况的专项说明
4.4.2.2.2.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2011年上半年,A股整体呈现先跌后涨的震荡格局。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。由于投资者对通胀政策以及严厉的房地产调控措施导致经济增速放缓,上证指数五月份跌幅一度接近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、食品行业表现较大;大盘股表现相对优于小盘股。

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

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。
4.4.2 报告期内本基金的业绩表现
报告期内,本基金净值增长率为0.23%,同期业绩比较基准收益率为-0.37%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0044%,年化跟踪误差为1.33%,在合同约定的目标控制范围之内。
4.5 管理人对于宏观经济、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,并演变成欧元区危机;美国债务危机问题将会得到缓解,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,下半年政策的调整空间可能较小。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,央行加息和提高准备金率的动力都不很大,资金面或将处于一个不紧不松的状态。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规模开展。下半年随着通胀压力的减轻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规划的过程中,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,下半年随着产业升级和产业政策落实,相关板块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仍然处于一个震荡格局中,期间会存在不少主动性的投资机会,但可能没有系统的投资机会,指数创新高可能性不大。

4.6 管理人对于报告期内本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、专业胜任能力和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意见,并会同托管人充分协商后,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。
估值政策由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。
基金管理人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。

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
2011年上半年,本基金托管人在对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的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。
5.2 托管人对报告期内本基金投资遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
2011年上半年,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的基金管理人—海富通基金管理有限公司在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的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回的价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全按照有关法律法规的规定严格执行。本报告期末,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未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人根据对海富通基金管理有限公司编制的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2011年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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
单位:人民币元
资产 2011年6月30日 2010年12月31日
银行存款 20,632,219.94 25,952,766.86
结算备付金 317,384.17 29,929.38

6.2 利润表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入 1,743,766.86
1.利息收入 84,527.42
其中:债券利息收入 84,527.42
债券投资收益 1,863,933.66
债券投资收益 1,863,933.66

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日
一、实收基金 366,783,535.19 -45,615,452.83
二、未分配利润 -47,452,043.98 -45,615,452.83
所有者权益合计 319,331,491.21 322,230,526.16

6.4 现金流量表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 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 55,119.37
其中:支付销售机构的客户维护费 269,235.65

6.5 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日
一、实收基金 366,783,535.19 -45,615,452.83
二、未分配利润 -47,452,043.98 -45,615,452.83
所有者权益合计 319,331,491.21 322,230,526.16

6.6 资产负债表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日
一、实收基金 366,783,535.19 -45,615,452.83
二、未分配利润 -47,452,043.98 -45,615,452.83
所有者权益合计 319,331,491.21 322,230,526.16

6.7 所有者权益变动表
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日
一、实收基金 366,783,535.19 -45,615,452.83
二、未分配利润 -47,452,043.98 -45,615,452.83
所有者权益合计 319,331,491.21 322,230,526.16

注:本基金合同生效于2010年9月28日,无上年度可比期间的数据。
本报告附注为财务报表的重要组成部分。
本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:
基金管理人:田仁灿;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(以下简称“本基金”)经中国证监会核准,由海富通基金管理有限公司(以下简称“中国证监”)证监许可[2010]985号《关于核准海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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732,380,732.89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[2010]第254号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,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基金合同于2010年9月28日正式生效,基金合同生效日的基金总额度为732,633,633.96份基金份额,其中认购资金利息折合252,901.07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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 基金的投资目标
本基金为上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)的联接基金,目标ETF是采用完全复制法实现对上证周期50指数紧密跟踪的被动指数基金,本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为:目标ETF、上证周期行业50指数成份股和备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金持有的目标ETF资产占基金资产净值的比例不低于90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金业绩比较基准:上证周期行业50指数收益率*95%+活期存款利率(税后)*5%。

6.4.3 基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准按照财政部于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相关规定及允许本基金业务操作编制。
6.4.4 本财务报表的编制基础
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相关规定及允许本基金业务操作编制。

6.4.5 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。
6.4.6 差错更正的说明
本基金本报告期不存在重大会计差错。
6.4.7 事项
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,主要列明如下:
(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收营业税和企业所得税。
(3) 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

6.4.8 关联方关系
6.4.8.1 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。
6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方
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
中国工商银行股份有限公司(中国工商银行) 基金托管人、基金代销机构
上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金(目标ETF) 本基金的基金管理人管理的其他基金

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
本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。
6.4.8.1.3 支付关联方佣金
本基金本报告期无应付关联方的佣金。
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 2011年1月1日至2011年6月30日 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 55,119.37
其中:支付销售机构的客户维护费 269,235.65

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费,支付基金托管人海富通基金管理有限公司的托管人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后余额的一定比例,按季计提,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=前一日本基金资产净值×基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值×0.5%÷当年天数。
6.4.8.2.2 基金托管费
单位:人民币元
项目 2011年1月1日至2011年6月30日 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 11,023.85

注:本基金的基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后余额的一定比例,按季计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日托管费=前一日本基金资产净值×基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值×0.1%÷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
本基金本报告期未与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以外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末除基金管理人以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 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日
中国工商银行 期初余额 当期利息收入 期末余额 当期利息收入

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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
本基金本报告期未通过关联方参与关联方承销的证券。
6.4.8.7 其他关联方交易事项的说明
于本报告期末,本基金持有133,695,985.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为59.57%。
6.4.9 期末持有133,695,985.00份目标ETF基金份额的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发股票而于期末持有的流通受限证券
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。
6.4.9.3 期末未流通的暂时停牌等流通受限股票
6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未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
本基金本报告期末未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
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 - -
其中:股票 - -
2 债券投资 321,538,843.93 93.88
3 固定收益投资 - -
其中:债券 - -
资产支持证券 - -
4 金融衍生品投资 - -
5 买入返售金融资产 - -
其中:买断式回购 - -
6 其他资产 20,949,604.11 6.01
7 其他项资产 20,999.70 0.02
8 合计 342,514,547.74 100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元
序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金 股票型 交易型开放式 海富通基金管理有限公司 321,538,843.93 94.03

7.3 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。
7.4 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
本基金本报告期末未持有股票。
7.5 报告期末股票投资组合的重大变动
7.5.1 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

Table with 5 columns: 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(%)

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。
7.5.2 累计卖出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

Table with 5 columns: 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(%)

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。
7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的成本总额
金额单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入股票的成本(成交总额), 卖出股票的成本(成交总额)

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。
7.6 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。
7.7 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。
7.8 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。
7.9 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。
7.10 投资组合报告附注
7.10.1 报告期内本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、处罚的情况。
7.10.2 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。
7.10.3 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 -
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 3,864.49
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 26,099.70

7.10.4 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。
7.10.5 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。
8 基金份额持有人信息
8.1 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 机构投资者 个人投资者
持有份额 持有比例 持有份额 持有比例
5,283 73,707.36 139,461,281.72 35.81% 249,934,708.21 64.19%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况
本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。
9 开放式基金份额变动
单位:份
基金份额变动 2010年9月28日 基金份额总额 732,633,633.96
本报告期基金总申购份额 366,783,535.19
本报告期基金总赎回份额 90,509,527.04
本报告期基金总申购份额 67,897,061.70
本报告期期末基金基金份额总额 389,395,989.93

10 重大事件揭示
10.1 基金份额持有人大会决议
本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。
10.2 基金管理人、基金托管人及基金销售机构的重大人事变动
报告期内,基金管理人、基金托管人、基金销售机构无重大人事变动。
10.3 涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼
本报告期无基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼事项。
10.4 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。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况
报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门稽查或处罚的情况
本基金的基金管理人、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。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1 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

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 权证交易, 债券交易, 佣金, 占当期佣金总额的比例

注:1.报告期内本基金租用券商交易单元无发生变更。
2. Q交易单元的选取标准
本基金的基金管理人按照以下程序选择交易单元的选择:
<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,从中进行筛选。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:由投资部全部业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评价,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。
10.7.2 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

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 股票交易, 权证交易, 基金交易, 佣金, 占当期佣金总额的比例

11 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,是中国首批批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。作为首批特定客户资产管理业务的基金管理公司,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织担任投资咨询顾问,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。
2011年3月31日,海富通在《证券时报》举办的2010年度“中国基金明星奖”评选中,获2010年度“十大明星基金公司”奖。4月8日,在《上海证券报》主办的第八届“金基金”评选中,海富通基金获得“2010年度基金公司奖—海外投资回报公司”奖。4月10日,在《中国证券报》主办的“第八届中国基金金牛奖”评选中,海富通基金获得“2010年度金牛基金资产管理公司”奖。
海富通同时还在不断履行社会责任。公司自2008年启动“绿色与希望—汶川公益环保计划”,针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽灾区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦县捐赠了公益林。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”为主题和特色开展的投资者教育活动,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
二〇一一年八月二十九日