海富通大中华精选股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011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：二〇一二年三月二十九日

§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2012年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2011年1月27日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通大中华股票（QDII）
基金主代码	519602
交易代码	519602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月27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	105,397,663.08份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于在海外证券市场交易的大中华公司的优质股票，追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对全球宏观经济和大中华地区区域经济的基本面分析，采用自上而下的策略对资产进行有效资产配置；对股票的选择采用自下而上的"三站式"精选策略，挖掘定价合理，具备竞争优势的上市公司股票进行投资，并有效控制下行风险。
业绩比较基准	MSCI金龙净总收益指数
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的投资品种。其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金。同时，本基金投资的目标市场是海外市场，除了需要承担市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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	奚万荣	唐州徽
	联系电话	021-38650891	010-66594855
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China （Hong Kong） Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日
本期已实现收益	-17,465,887.93
本期利润	-28,738,951.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1978
本期基金份额净值增长率	-29.40%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2944
期末基金资产净值	74,365,668.49
期末基金份额净值	0.706

注：1、本基金合同于2011 年1月27日生效，本期主要会计数据和财务指标的计算期间为2011 年1月27日至2011年12月31日。基金合同生效日至报告期末未满一年。

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、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。

4、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）。

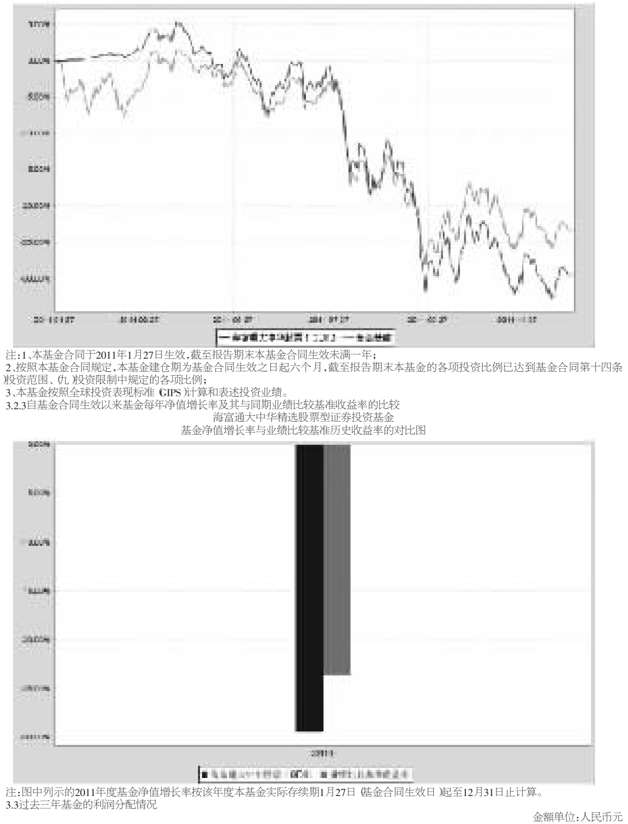
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	0.14%	2.11%	3.51%	1.85%	-3.37%	0.26%
过去六个月	-27.52%	2.14%	-20.23%	1.85%	-7.29%	0.29%
自基金合同生效起至今	-29.40%	1.66%	-23.56%	1.53%	-5.84%	0.13%

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

海富通大中华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历史走势对比图
（2011年1月27日至2011年12月31日）



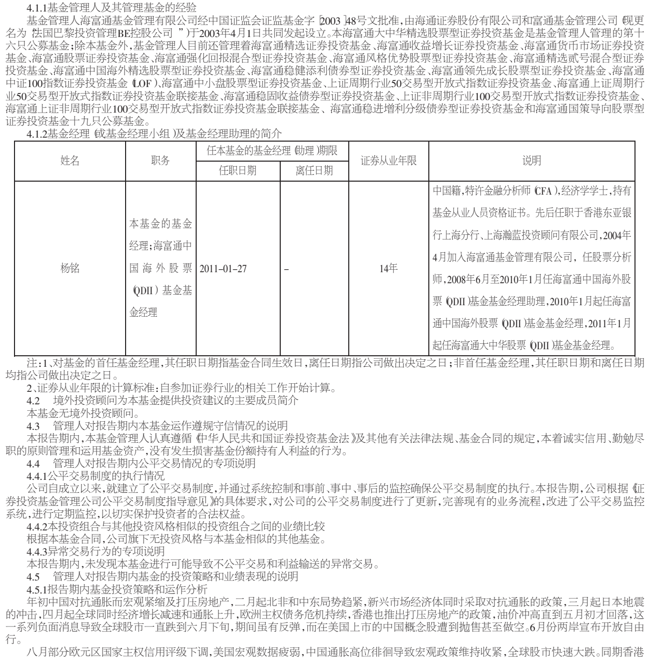
注：1、本基金合同于2011年1月27日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

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，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围、（九）投资限制中规定的各项比例；

3、本基金按照全球投资表现标准（GIPS）计算和表述投资业绩。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通大中华精选股票型证券投资基金
基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注：图中列示的2011年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期1月27日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于2011年1月27日生效，未发生利润分配的情况。

§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控股公司"）于2003年4月1日共同发起设立。本海富通大中华精选股票型证券投资基金是基金管理人管理的第十六只公募基金；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、海富通中证100指数证券投资基金（LOF）、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、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、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、海富通稳进增利分级债券型证券投资基金和海富通国策导向股票型证券投资基金十九只公募基金。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨铭	本基金的基金经理；海富通中国海外股票（QDII）基金基金经理	2011-01-27	-	14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、上海瀚蓝投资顾问有限公司，2004年4月加入海富通基金管理有限公司，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，2011年1月起任海富通大中华股票（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：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

本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1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。本报告期，公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，对公司的公平交易制度进行了更新，完善现有的业务流程，改进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。

4.4.2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。

4.4.3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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

年初中国对抗通胀而宏观紧缩及打压房地产，二月起北非和中东局势趋紧，新兴市场经济体同时采取对抗通胀的政策，三月起日本地震的冲击，四月起全球同时经济增长减速和通胀上升，欧洲主权债务危机持续，香港也推出打压房地产的政策，油价冲高直到五月初才回落，这一系列负面消息导致全球股市一直跌到六月下旬，期间虽有反弹，而在美国上市的中国概念股遭到抛售甚至做空。6月份两岸宣布开放自由行。

八月部分欧元区国家主权信用评级下调，美国宏观数据疲弱，中国通胀高位徘徊导致宏观政策维持收紧，全球股市快速大跌。同期香港房地产也面临跌价的风险，台湾开放自由行初期的大陆游客人数低于预期。九月欧洲主权债务危机久拖未决，外资大量流出导致新兴市场股市损失惨重。受欧元区解决主权债务危机的良好预期，十月初起全球股市大幅反弹到十一月初。但随着希腊全国公投的闹剧出现，导致峰会没有产生预期的解决方案，而欧洲和新兴市场的实体经济继续减速，全球股市回调到十二月才振荡企稳。

报告期内，本基金合同生效后谨慎地增加股票仓位，在三月中旬股市探底后才加快了建仓速度。但对于欧债危机和外资流出的估计不足，没有能避开三季度股市的大幅下跌，给基金净值带来较大的负面影响。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

自基金成立之日起，本基金净值增长率为-29.40%，同期业绩比较基准收益率为-23.56%，基金净值跑输业绩比较基准5.84个百分点。主要是九月和十月股市大幅波动中，基金的信息技术行业表现较差。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二零一二年，全球经济仍在再平衡之中，中国经济处于转型之中。美国经济继续复苏，欧元区面临的债务问题需要时间才能改善。伊朗局势的变化也可能带来一些新的不确定性。中国的宏观经济形势也较为复杂。受房地产投资回落和出口增速减缓影响，经济增速将继续放缓，企业盈利增速将出现明显的回落。但随着通胀压力的减缓和经济增速下滑风险的显现，财政政策会略微积极，总体稳健和定向宽松将成为货币政策的主基调，"稳中求进"的政策将成功实现经济软着陆。发达经济体的宽松货币政策将基本维持，新兴市场经济体已经开始采取放松的政策，全球流动性充裕的状态将持续。行业上，受益于中国宏观政策扶持的大消费、技术创新和节能环保行业，受益于几大软硬件厂商都推出新产品的信息技术行业，台湾地区选举之后两岸三地的经济和金融合作将加速深入都将提供相关的投资机会。

对于二零一二年的市场判断，我们持谨慎灵活的态度。如果欧债问题得到明确救援方案的支持，股市可有回暖的机会。股市估值在合理区间之内，股市会在波动中上行，回调提供介入机会。我们将继续密切关注国内外宏观经济形势和政策的变化。在投资上我们将灵活应对经济形势和市场的变化，坚持深入挖掘前期调整幅度较大、业绩增长较为确定的成长股，受益于中国政策扶持、内需拉动和经济转型、两岸三地经济加速融合的行业和公司，更强调结构性的机会和个股的基本面研究。

4.7 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，并经本公司总裁办公会批准后实施。

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。

本基金采用彭博（bloomberg）咨询系统提供的价格估值。

4.8 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"）在对海富通大中华精选股票型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守了《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 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通大中华精选股票型证券投资基金

报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	5,259,900.61
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	70,858,253.40
其中：股票投资		70,858,253.40
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	108.18
应收股利		87,555.60
应收申购款		7,497.88
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		76,213,315.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,219,786.76
应付赎回款		74,567.06
应付管理人报酬		114,010.58
应付托管费		19,001.77
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	420,281.01
负债合计		1,847,647.18
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	105,397,663.08
未分配利润	7.4.7.10	-31,031,994.59
所有者权益合计		74,365,668.49
负债和所有者权益总计		76,213,315.67

注：本基金合同于2011 年1月27日成立，本报告截止日2011年12月31日，基金份额净值0.706元，基金份额总额105,397,663.08份。本基金自2011年1月27日基金合同生效，无上年度可比数据。

7.2 利润表

会计主体：海富通大中华精选股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日
一、收入		-24,108,548.27
1.利息收入		2,191,496.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	698,584.67
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,492,911.46
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以"-"填列）		-15,279,376.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-16,883,148.91
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	1,603,772.89
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	7.4.7.16	-11,273,063.33
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-678,230.26
5.其他收入（损失以"-"号填列）	7.4.7.17	930,625.21
减：二、费用		4,630,402.99
1.管理人报酬		2,726,328.83
2.托管费		454,388.11
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.18	967,711.48
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.4.7.19	481,974.57
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		-28,738,951.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以"-"号填列		-28,738,951.26

注：本基金自2011年1月27日基金合同生效，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通大中华精选股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31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）	821,766,293.97	-	821,766,293.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,738,951.26	-28,738,951.26
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）	-716,368,630.89	-2,293,043.33	-718,661,674.22
其中：1.基金申购款	18,983,232.12	-557,205.41	18,426,026.71
2.基金赎回款	-735,351,863.01	-1,735,837.92	-737,087,700.93
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）	105,397,663.08	-31,031,994.59	74,365,668.49

注：本基金自2011年1月27日基金合同生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分

本报告7.1至7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

海富通大中华精选股票型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会证监许可［2010］1760号文核准，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《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》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821,474,865.11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（2011）第15号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》于2011年1月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为821,766,293.97份基金份额，其中认购资金利息折合291,428.86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。境外资产托管人为中国银行（香港）有限公司，无境外投资顾问。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金（ETF）等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以全球除内地股票市场以外的具有"大中华概念"上市公司为主要投资对象。"大中华概念"的股票需满足以下三个条件之一：1）上市公司注册在大中华区域（中国内地、香港、台湾、澳门）；2）上市公司中最少百分之三十股权（占总股本）由大中华区域的股东持有；3）公司最近一个会计年度至少百分之五十之营业额来自大中华区域。本基金的投资比例为：股票及其他权益类证券占基金资产的60%-95%；现金、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%~40%，其中基金保留的现金的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 金龙净总收益指数（MSCI Golden Dragon Net Total Return Index）。

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2012年3月20日批准报出。

7.4.2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》、《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间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12月31日的财务状况以及2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金报告期内不存在会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金报告期内不存在重大会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金报告期内不存在重大会计差错。

7.4.6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［2008］1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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）基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

（3）基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7关联方关系

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
中国银行（香港）有限公司（"中银香港"）	基金境外资产托管人
海通证券股份有限公司（"海通证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构
法国巴黎投资管理BE控股公司（BNP Paribas Investment Partners BE Holding）	基金管理人的股东

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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间没有应支付关联方的佣金。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,726,328.83
其中：支付销售机构的客户维护费	1,240,280.12

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1.8%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 1.8% / 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	454,388.11

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0.30%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 0.30% / 当年天数。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期未通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1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。

7.4.8.4.2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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5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27日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	413,086.65	673,187.60
中国银行（香港）	3,706,304.06	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和中国银行（香港）有限公司保管，按适用利率计息。

7.4.8.6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购买其承销的证券。

7.4.8.7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。

7.4.9期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌流通受限证券。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1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。

7.4.9.3.2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。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

（b）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

（ii）各层次金融工具公允价值

于2011年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为70,858,253.40元，无属于第二层级和第三层级的余额。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期（2011年1月27日（基金合同生效日）至2011年12月31日）持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

（iv）第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	70,858,253.40	92.97
	其中：普通股	68,900,091.20	90.40
	存托凭证	1,958,162.20	2.57
2	基金投资	-	-
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	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,259,900.61	6.90
8	其他各项资产	95,161.66	0.12
9	合计	76,213,315.67	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	49,647,065.33	66.76
中国台湾	19,253,025.87	25.89
美国	1,958,162.20	2.63
合计	70,858,253.40	95.28

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	12,795,356.59	17.21
原材料	3,460,067.60	4.65
非日常生活消费品	13,159,137.77	17.70
日常消费品	2,091,606.00	2.81
医疗保健	721,523.00	0.97
金融	23,995,465.05	32.27
信息技术	12,340,816.39	16.59
公共事业	2,294,281.00	3.09
合计	70,858,253.40	95.28

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Sands China Ltd.	金沙中国有限公司	1928 HK	香港证券交易所	中国香港	250,000	4,448,716.25	5.98
2	China Minsheng Banking Corp.,Ltd.	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港证券交易所	中国香港	800,000	4,364,808.80	5.87
3	China Merchants Bank Co.,Ltd.	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000	3,818,397.00	5.13
4	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	新普科技	6121 TT	台湾交易所	中国台湾	100,000	3,683,255.36	4.95
5	Great Wall Motor Company Limited	长城汽车股份有限公司	2333 HK	香港证券交易所	中国香港	400,000	3,677,335.20	4.94
6	FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	远东百货	2903 TT	台湾交易所	中国台湾	494,600	3,674,353.12	4.94
7	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	新鸿基地产发展有限公司	16 HK	香港证券交易所	中国香港	45,000	3,551,474.03	4.78
8	MSTAR SEMICONDUCTOR INC	F-晨星	3697 TT	台湾交易所	中国台湾	100,000	3,287,877.67	4.42
9	China Oilfield Services Limited	中海油田服务股份有限公司	2883 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000	2,981,754.60	4.01
10	China Petroleum and Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港证券交易所	中国香港	450,000	2,980,538.55	4.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细，应阅读登载于www.hftfund.com网站的年度报告正文。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	1398 HK	17,632,118.57	23.71
2	China National Building Material Company Limited	3323 HK	14,111,973.07	18.98
3	China Minsheng Banking Corp.,Ltd.	1988 HK	13,065,386.14	17.57
4	ZTE Corporation	763 HK	12,329,084.44	16.58
5	China Petroleum and Chemical Corporation	386 HK	11,301,816.34	15.20
6	Ping An Insurance （Group） Company Of China，Ltd.	2318 HK	8,923,974.56	12.00
7	SINA CORP	SINA UW	8,012,336.83	10.77
8	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	16 HK	8,009,663.61	10.77
9	HTC CORP	2498 TT	7,308,559.32	9.83
10	China Southern Airlines Company Limited	1055 HK	7,086,791.91	9.53
11	Bank Of Communications Co.,Ltd.	3328 HK	6,934,332.83	9.32
12	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	6,788,383.13	9.13
13	WINTEK CORP	2384 TT	6,103,162.63	8.21
14	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	6,065,750.87	8.16
15	AIA Group Limited	1299 HK	6,048,307.04	8.13
16	Maanshan Iron and Steel Company Limited	323 HK	5,725,537.74	7.70
17	Great Wall Motor Company Limited	2333 HK	5,393,736.77	7.25
18	FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	2903 TT	5,315,573.75	7.15
19	CHIMEI INNOLUX CORP	3481 TT	5,188,737.13	6.98
20	Picc Property And Casualty Company Limited.	2328 HK	5,172,899.22	6.96
21	Sinopec Shanghai Petrochemical Company Limited	338 HK	4,784,684.40	6.43
22	China Merchants Bank Co.，Ltd.	3968 HK	4,757,186.30	6.40
23	Sands China Ltd.	1928 HK	4,466,683.55	6.01
24	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	6121 TT	4,401,872.30	5.92
25	Cheung Kong （Holdings） Limited	1 HK	4,317,289.90	5.81
26	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2474 TT	4,127,261.82	5.55
27	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	2882 TT	4,114,484.87	5.53
28	Tencent Holdings Limited	700 HK	3,913,447.93	5.26
29	China Unicom （Hong Kong） Limited	762 HK	3,769,565.90	5.07
30	Air China Limited	753 HK	3,755,134.37	5.05
31	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	3,715,495.95	5.00
32	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO.	2885 TT	3,679,001.27	4.95
33	Lonking Holdings Limited	3339 HK	3,561,746.94	4.79
34	WISTRON CORP	3231 TT	3,467,938.69	4.66
35	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	3,449,485.30	4.64
36	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	3037 TT	3,435,344.10	4.62
37	China Oilfield Services Limited	2883 HK	3,396,705.78	4.57
38	MSTAR SEMICONDUCTOR INC	3697 TT	3,360,005.97	4.52
39	TPK HOLDING CO LTD	3673 TT	3,341,561.86	4.49
40	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	3,266,508.67	4.39
41	Dongfang Electric Corporation Limited	1072 HK	2,489,962.12	3.35
42	Evergrande Real Estate Group Limited	3333 HK	2,482,950.05	3.34
43	PetroChina Company Limited	857 HK	2,403,521.98	3.23
44	China Coal Energy Company Limited	1898 HK	2,221,647.06	2.99
45	Agile Property Holdings Limited	3383 HK	2,106,061.06	2.83
46	Guangzhou R and F Properties Co.Ltd.	2777 HK	2,103,034.10	2.83
47	PETROCHINA CO LTD -A	PTR US	2,099,860.48	2.82
48	Intime Department Store （Group） Company Limited	1833 HK	2,099,079.76	2.82
49	China Pacific Insurance （Group） Co.，Ltd.	2601 HK	1,913,820.96	2.57
50	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	388 HK	1,909,188.28	2.57
51	Lijun International Pharmaceutical （Holding） Co.,Ltd.	2005 HK	1,813,407.54	2.44
52	Huaneng Power International Inc.	902 HK	1,673,317.19	2.25
53	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2892 TT	1,669,761.10	2.25

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。

8.5.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	China National Building Material Company Limited	3323 HK	17,259,159.02	23.21
2	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	1398 HK	12,501,685.22	16.81
3	ZTE Corporation	763 HK	11,508,239.29	15.48
4	Ping An Insurance （Group） Company Of China，Ltd.	2318 HK	8,187,053.06	11.01
5	China Minsheng Banking Corp.,Ltd.	1988 HK	8,155,203.82	10.97
6	China Petroleum and Chemical Corporation	386 HK	7,738,715.32	10.41
7	China Southern Airlines Company Limited	1055 HK	7,403,409.99	9.96
8	Bank Of Communications Co.,Ltd.	3328 HK	7,169,025.26	9.64
9	SINA CORP	SINA UW	6,986,027.40	9.39
10	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	6,705,133.05	9.02
11	AIA Group Limited	1299 HK	6,261,445.45	8.42
12	HTC CORP	2498 TT	5,768,245.47	7.76
13	Picc Property And Casualty Company Limited.	2328 HK	4,059,517.39	5.46
14	CHIMEI INNOLUX CORP	3481 TT	3,859,223.60	5.19
15	WINTEK CORP	2384 TT	3,718,690.47	5.00
16	China Unicom （Hong Kong） Limited	762 HK	3,703,824.77	4.98
17	Tencent Holdings Limited	700 HK	3,692,723.74	4.97
18	Air China Limited	753 HK	3,659,850.48	4.92
19	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	16 HK	3,604,196.40	4.85
20	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	3,560,634.81	4.79
21	Cheung Kong （Holdings） Limited	1 HK	3,486,118.40	4.69
22	WISTRON CORP	3231 TT	3,442,829.83	4.63
23	Maanshan Iron and Steel Company Limited	323 HK	3,187,071.27	4.29
24	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	2,573,557.93	3.46
25	Lonking Holdings Limited	3339 HK	2,482,806.78	3.34
26	Evergrande Real Estate Group Limited	3333 HK	2,425,909.68	3.26
27	Dongfang Electric Corporation Limited	1072 HK	2,256,950.31	3.03
28	PetroChina Company Limited	857 HK	2,213,820.51	2.98
29	Intime Department Store （Group） Company Limited	1833 HK	2,079,514.12	2.80
30	Great Wall Motor Company Limited	2333 HK	1,929,662.95	2.59
31	Agile Property Holdings Limited	3383 HK	1,919,510.52	2.58
32	TPK HOLDING CO LTD	3673 TT	1,905,543.61	2.56
33	Guangzhou R and F Properties Co.Ltd.	2777 HK	1,888,603.30	2.54
34	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2885 TT	1,620,535.89	2.18
35	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	1,507,499.10	2.03
36	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2892 TT	1,501,703.79	2.02

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位：人民币元

买入成本（成交）总额	275,148,667.49
卖出收入（成交）总额	176,134,201.85

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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 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。

8.11.3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	87,555.60
4	应收利息	108.18
5	应收申购款	7,497.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,161.66

8.11.4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。

8.11.5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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,113	33,857.26	692,929.96	0.66%	104,704,733.12	99.34%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	246,500.07	0.23%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年1月27日）基金份额总额	821,766,293.97
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	18,983,232.12
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	735,351,863.01
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	105,397,663.08

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2011年8月19日，董文标先生因工作原因辞去本公司独立董事职务，公司聘请王明权先生继任本公司独立董事。

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金聘请普华永道中天会计师事务所有限公司提供审计服务，报告期内应付审计费金额为60,000 元，目前是事务所为本基金提供审计服务的第一年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS （ASIA） SECURITIES LIMITED	-	94,724,781.99	20.99%	114,222.04	22.23%	-
YUANTA SECURITIES （HONG KONG） COMPANY LIMITED	-	59,881,617.28	13.27%	89,265.01	17.37%	-
CCB International Securities Limited	-	58,691,434.55	13.01%	88,037.17	17.13%	-
Credit Suisse HK Ltd	-	40,581,487.61	8.99%	13,110.17	2.55%	-
UBS Securities Asia Limited	-	36,060,601.19	7.99%	36,060.60	7.02%	-
China Merchants Sec （HK） Ltd	-	29,960,727.79	6.64%	29,960.73	5.83%	-
Nomura International （HongKong） Limited	-	29,507,047.20	6.54%	11,802.81	2.30%	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	28,465,858.17	6.31%	23,612.00	4.59%	-
MORGAN STANLEY &amp; CO. INTERNATIONAL PLC	-	21,018,230.96	4.66%	40,054.06	7.79%	-
CICC HK SEC. LTD.	-	14,314,724.08	3.17%	17,893.41	3.48%	-
CITIC Securities Brokerage （HK） Limited	-	12,800,885.73	2.84%	15,361.06	2.99%	-
Shenyin Wanguo Securities （H.K.） Limited	-	12,648,900.01	2.80%	18,973.36	3.69%	-
BOCOM International Securities Limited	-	9,183,742.83	2.04%	12,080.15	2.35%	-
Fubon Bank （HK） Ltd.	-	3,442,829.84	0.76%	3,442.94	0.67%	-
BNP Paribas Securities （Asia） Ltd	-	-	-	-	-	-
BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities （Hong Kong） Limited	-	-	-	-	-	-
Hai Tong Sec （HK） Brokerage LTD	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities （Asia Pacific） Limited	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Orient Securities （Hong Kong） Limited	-	-	-	-	-	-

注：报告期内本基金租用证券公司专用交易单元新增23个，分别是中信证券、GOLDMAN SACHS （ASIA） SECURITIES LIMITED、YUANTA SECURITIES （HONG KONG）COMPANY LIMITED、CCB International Securities Limited、Credit Suisse HK Ltd、UBS Securities Asia Limited、China Merchants Sec （HK） Ltd、Nomura International （HongKong） Limited、Deutsche Securities Asia Limited、MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC、CICC HK SEC. LTD.、CITIC Securities Brokerage （HK） Limited、Shenyin Wanguo Securities （H.K.） Limited、BOCOM International Securities Limited、Fubon Bank （HK） Ltd.、BNP Paribas Securities （Asia） Ltd、BOCI Security Ltd、First Shanghai Securities Limited、Guodu Securities （Hong Kong） Limited、Hai Tong Sec （HK） Brokerage LTD、J.P. Morgan Securities （Asia Pacific） Limited、KGI Asia Limited、Orient Securities （Hong Kong） Limited。

（1）交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

（2）交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<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，从中进行甄选。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。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总裁办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总裁办公会核准。

11.7.2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

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	-	-	3,080,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS （ASIA）SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIES （HONG KONG）COMPANY LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse HK Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Sec （HK） Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International （HongKong） Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY &amp; CO. INTERNATIONAL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC HK SEC. LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage （HK） Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities （H.K.） Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubon Bank （HK） Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities （Asia） Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities （Hong Kong） Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Hai Tong Sec （HK） Brokerage LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities （Asia Pacific） Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Orient Securities （Hong Kong） Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

§12 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20只公募基金。截至2011年12月31日，海富通管理的公募基金资产规模近325亿元人民币。

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12月31日，海富通为50多家企业近160亿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12月31日，海富通旗下专户理财管理资产规模达28亿元。2010年12月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。

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12月31日，投资咨询及海外业务规模近200亿元人民币。

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。

2011年12月，海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，准许在香港筹集人民币资金投资境内证券市场，并首批获得国家外汇管理局批准的11亿元人民币RQFII（人民币合格境外机构投资者）投资额度。

2011年4月，海富通在由中国证券报社主办、银河证券、天相投顾、招商证券、海通证券等协办的"2010年度中国基金业金牛奖"评选中荣获"2010年十大金牛基金管理公司"，在上海证券报社主办的第八届中国"金基金奖"评选中荣获"金基金——海外投资回报公司"奖；2011年3月31日，海富通在证券时报社主办的"中国基金业明星奖"评选中荣获"2010年度十大明星基金公司"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环保公益林。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。

海富通基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日