# 海富通中证100指数证券投资基金（LOF）

## 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1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 | 1,449,243,709.08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 | 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 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 | 2010年 | 2009年10月30日（基金合同生效日）至2009年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | -146,202,022.07 | -168,358,484.38 | -3,789,029.11 |
| 本期利润 | -268,605,776.26 | -408,609,301.68 | 52,584,670.30 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1408 | -0.1905 | 0.0252 |
| 本期基金份额净值增长率 | -19.33% | -18.24% | 2.50% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011年末 | 2010年末 | 2009年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3237 | -0.1620 | -0.0018 |
| 期末基金资产净值 | 980,129,571.84 | 1,827,642,588.13 | 2,139,733,545.60 |
| 期末基金份额净值 | 0.676 | 0.838 | 1.025 |

注：1、本基金合同生效日为2009年10月30日。

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。

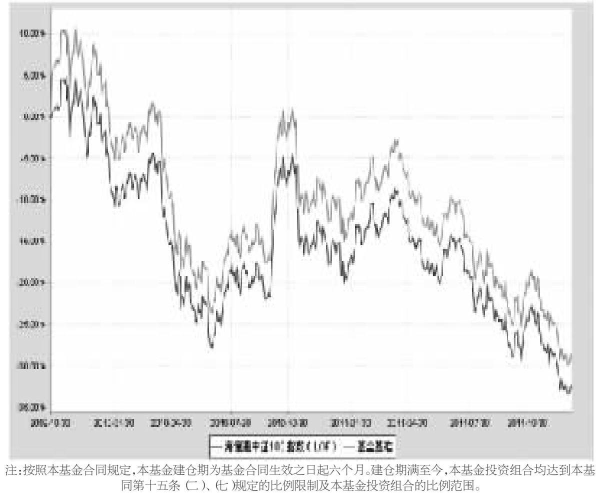
3.2 基金净值表现

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 | -5.98% | 1.30% | -5.89% | 1.28% | -0.09% | 0.02% |
| 过去六个月 | -19.52% | 1.27% | -19.52% | 1.26% | 0.00% | 0.01% |
| 过去一年 | -19.33% | 1.21% | -19.87% | 1.20% | 0.54% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -32.40% | 1.38% | -28.74% | 1.38% | -3.66% | 0.00% |

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

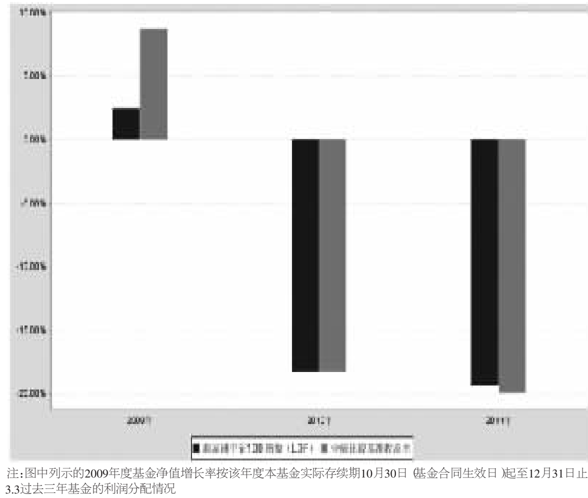
海富通中证100 指数证券投资基金（LOF）
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2009年10月30日至2011年12月31日）



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。

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

海富通中证100 指数证券投资基金（LOF）
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2009年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期10月30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 | - | - | - | - | - |
| 2010 | - | - | - | - | - |
| 2009 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - |

注：本基金合同于2009年10月30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、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 | | |
| 牟永宁 | 本基金的基金经理；海富通风格优势股票基金经理；海富通国策导向股票基金经理 | 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经理；2009年10月起任海富通中证100指数（LOF）基金经理。2011年4月起兼任海富通风格优势股票基金经理。2011年11月起兼任海富通国策导向股票基金经理。 |

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。

3、本基金管理人于2012年1月30日发布公告，自2012年1月20日起由刘璎女士担任海富通中证100指数证券投资基金（LOF）基金经理，牟永宁先生不再担任该基金基金经理。

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。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。

4.3.2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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

尽管年初我们对2011年的宏观经济和市场走势作出了谨慎的判断，但A股市场走势之差仍超出预期。虽然第一季度大盘曾出现过一轮估值修复的行情，但之后由于通胀压力较大、政策紧缩等因素，股市调头向下。到了第四季度，通胀压力趋于缓和，股市反弹却并未如期而至，投资者担心经济可能“硬着陆”而政策无大幅放松的空间。上证指数全年累计下跌超过20%，继2010年后在全球主要市场中再度垫底。板块方面，金属、制造业、电子等跌幅较大，而金融服务和食品饮料行业表现较好。

报告期内，本基金完成了年中和年末的指数成分股调整。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-19.33%，同期业绩比较基准收益率为-19.87%。日均跟踪偏离度的绝对值为0.0029%，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2012年，我们认为国际市场仍将较为动荡，一方面欧债将在4月前迎来新一轮偿付高峰期，欧元区何去何从依然悬而未决。另一方面，美国经济虽已开始复苏，但其并未完全摆脱衰退的阴影，伊朗局势的变化也可能给国际市场带来一些新的不确定性。

国内也同样面临着诸多的问题，受房地产投资增速下降和出口增速减缓影响，中国经济增速可能将继续放缓，企业盈利增速也将出现明显的回落。此外，进入2012年通胀压力虽然将有所减轻，但受制于全球范围内重现的货币放松和人力成本的上升，通胀形势也并非高枕无忧。在如今中国经济转型的关键时期，国家如何演绎“稳中求进”的经济政策，使我国宏观经济成功实现软着陆并获得新的向上的动力是我们最关心的问题。就股票市场而言，A股市场在经历了前期连续调整后，整体估值已逐步趋于合理，市场恐慌情绪在一定程度上也得到了释放，但在实体经济缺乏新的增长点，融资压力依然较大，货币政策也难有大幅放松的情况下可能依旧难现系统性机会。行业上我们认为受益于宏观政策扶持以及一些与民生相关的行业获取超额收益的概率相对较大。

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。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。

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。

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：海富通中证100 指数证券投资基金（LOF）
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<br>2011年12月31日 | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 52,364,955.78 | 95,383,664.59 |
| 结算备付金 | | 41,866.07 | 551,009.45 |
| 存出保证金 | | 750,000.00 | 750,000.00 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 930,528,367.12 | 1,735,209,086.89 |
| 其中：股票投资 | | 930,528,367.12 | 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 746,712.22 | 10,887.06 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 10,521.17 | 19,709.22 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 11,170.52 | 60,006.21 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 984,453,592.88 | 1,831,984,363.42 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2011年12月31日 | 上年度末<br>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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 2,363,254.17 | 645,475.53 |
| 应付管理人报酬 | | 603,383.98 | 1,177,607.36 |
| 应付托管费 | | 103,437.26 | 201,875.54 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 303,366.90 | 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 | 7.4.7.8 | 950,578.73 | 1,071,376.15 |
| 负债合计 | | 4,324,021.04 | 4,341,775.29 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,449,243,709.08 | 2,180,894,434.94 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -469,114,137.24 | -353,251,846.81 |
| 所有者权益合计 | | 980,129,571.84 | 1,827,642,588.13 |
| 负债和所有者权益总计 | | 984,453,592.88 | 1,831,984,363.42 |

注：报告截止日2011年12月31日，基金份额净值0.676元，基金份额总额1,449,243,709.08份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2011年1月1日至2011年12月31日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -251,934,458.07 | -387,761,445.95 |
| 1.利息收入 | | 654,753.62 | 815,788.04 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 653,560.78 | 815,323.09 |
| 债券利息收入 | | 1,192.84 | 464.95 |
| 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） | | -131,415,926.01 | -150,209,935.09 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -153,468,252.13 | -171,596,514.67 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 556,759.46 | 433,626.85 |
| 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 | 21,495,566.66 | 20,952,952.73 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -122,403,754.19 | -240,250,817.30 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 1,230,468.51 | 1,883,518.40 |
| 减：二、费用 | | 16,671,318.19 | 20,847,855.73 |
| 1.管理人报酬 | | 10,851,149.20 | 12,778,574.86 |
| 2.托管费 | | 1,860,196.94 | 2,190,612.83 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 7.4.7.18 | 3,166,119.21 | 4,927,947.73 |
| 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 | 793,852.84 | 950,720.31 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -268,605,776.26 | -408,609,301.68 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列 | | -268,605,776.26 | -408,609,301.68 |

7.3 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12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2011年1月1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） | 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） | - | -268,605,776.26 | -268,605,776.26 |
| 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） | -731,650,725.86 | 152,743,485.83 | -578,907,240.03 |
| 其中：1.基金申购款 | 663,561,464.24 | -85,698,234.42 | 577,863,229.82 |
| 2.基金赎回款 | -1,395,212,190.10 | 238,441,720.25 | -1,156,770,469.85 |
| 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） | 1,449,243,709.08 | -469,114,137.24 | 980,129,571.84 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010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） | 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） | - | -408,609,301.68 | -408,609,301.68 |
| 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） | 93,745,559.64 | 2,772,784.57 | 96,518,344.21 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,826,189,075.92 | -199,416,955.69 | 1,626,772,120.23 |
| 2.基金赎回款 | -1,732,443,516.28 | 202,189,740.26 | -1,530,253,776.02 |
| 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） | 2,180,894,434.94 | -353,251,846.81 | 1,827,642,588.13 |

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》、《海富通中证100 指数证券投资基金（LOF）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12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4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。

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［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。

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 |
| 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无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<br>2011年1月1日至2011年12月31日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 10,851,149.20 | 12,778,574.86 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,131,096.98 | 1,475,287.05 |

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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2011年1月1日至2011年12月31日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,860,196.94 | 2,190,612.83 |

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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与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

本报告期内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。

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。

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<br>2011年1月1日至2011年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年12月31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 | 52,364,955.78 | 629,207.86 | 95,383,664.59 | 752,458.41 |

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。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

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930,528,367.12元，无属于第二和第三层级的余额（2010年12月31日：第一层级1,735,209,086.89元，无属于第二和第三层级的余额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

（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 | 930,528,367.12 | 94.52 |
| | 其中：股票 | 930,528,367.12 | 94.52 |
| 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 | 52,406,821.85 | 5.32 |
| 6 | 其他各项资产 | 1,518,403.91 | 0.15 |
| 7 | 合计 | 984,453,592.88 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1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 | 1,582,679.60 | 0.16 |
| B | 采掘业 | 112,593,834.48 | 11.49 |
| C | 制造业 | 239,542,958.76 | 24.44 |
| C0 | 食品、饮料 | 71,966,214.39 | 7.34 |
| 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 | 10,518,531.56 | 1.07 |
| C5 | 电子 | 1,351,791.00 | 0.14 |
| C6 | 金属、非金属 | 47,472,582.69 | 4.84 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 98,988,248.88 | 10.10 |
| C8 | 医药、生物制品 | 9,245,590.24 | 0.94 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 18,819,050.74 | 1.92 |
| E | 建筑业 | 25,679,766.26 | 2.62 |
| F | 交通运输、仓储业 | 30,337,980.71 | 3.10 |
| G | 信息技术业 | 22,915,110.36 | 2.34 |
| H | 批发和零售贸易 | 10,974,928.68 | 1.12 |
| I | 金融、保险业 | 409,976,879.14 | 41.83 |
| J | 房地产业 | 42,773,162.97 | 4.36 |
| K | 社会服务业 | 6,355,335.42 | 0.65 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 921,551,687.12 | 94.02 |

8.2.2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 | - | - |
| B | 采掘业 | 2,866,200.00 | 0.29 |
| C | 制造业 | 4,160,000.00 | 0.42 |
| C0 | 食品、饮料 | - | - |
| 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 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | 4,160,000.00 | 0.42 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | - | - |
| 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 | 1,950,480.00 | 0.20 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| 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 | - | - |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 8,976,680.00 | 0.92 |

8.3 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

8.3.1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 | 4,205,597 | 49,920,436.39 | 5.09 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 7,244,853 | 42,672,184.17 | 4.35 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 4,133,887 | 40,140,042.77 | 4.10 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 1,058,116 | 36,441,515.04 | 3.72 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 2,672,914 | 33,464,883.28 | 3.41 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 7,258,622 | 32,518,626.56 | 3.32 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 3,592,534 | 30,500,613.66 | 3.11 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 1,043,610 | 26,434,641.30 | 2.70 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 133,295 | 25,765,923.50 | 2.63 |
| 10 | 000002 | 万 科A | 3,150,121 | 23,531,403.87 | 2.40 |

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网站的年度报告正文。

8.3.2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 | 000937 | 冀中能源 | 170,000 | 2,866,200.00 | 0.29 |
| 2 | 000629 | 攀钢钒钛 | 400,000 | 2,512,000.00 | 0.26 |
| 3 | 601991 | 大唐发电 | 378,000 | 1,950,480.00 | 0.20 |
| 4 | 600010 | 包钢股份 | 400,000 | 1,648,000.00 | 0.17 |

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网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1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 | 41,295,032.98 | 2.26 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 22,892,319.38 | 1.25 |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 21,344,906.24 | 1.17 |
| 4 | 000338 | 潍柴动力 | 20,951,111.18 | 1.15 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 20,380,717.43 | 1.12 |
| 6 | 600111 | 包钢稀土 | 19,654,403.02 | 1.08 |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 19,540,141.82 | 1.07 |
| 8 | 000776 | 广发证券 | 19,051,386.95 | 1.04 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 15,965,234.45 | 0.87 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 15,173,382.30 | 0.83 |
| 11 | 601088 | 中国神华 | 12,648,744.57 | 0.69 |
| 12 | 600256 | 广汇股份 | 11,101,281.67 | 0.61 |
| 13 | 002304 | 洋河股份 | 10,606,738.08 | 0.58 |
| 14 | 600585 | 海螺水泥 | 9,939,878.27 | 0.54 |
| 15 | 600115 | 东方航空 | 9,665,050.80 | 0.53 |
| 16 | 000002 | 万 科A | 9,644,032.72 | 0.53 |
| 17 | 000157 | 中联重科 | 9,366,548.93 | 0.51 |
| 18 | 601668 | 中国建筑 | 9,160,413.00 | 0.50 |
| 19 | 601601 | 中国太保 | 8,601,039.44 | 0.47 |
| 20 | 600999 | 招商证券 | 8,364,289.45 | 0.46 |

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。

8.4.2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

| 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（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 56,145,288.89 | 3.07 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 51,106,906.55 | 2.80 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 44,876,250.29 | 2.46 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 40,339,812.30 | 2.21 |
| 5 | 601328 | 交通银行 | 36,734,974.44 | 2.01 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 34,977,537.99 | 1.91 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 32,604,541.89 | 1.78 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 30,252,074.81 | 1.66 |
| 9 | 000002 | 万 科A | 24,571,909.67 | 1.34 |
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 23,842,369.84 | 1.30 |
| 11 | 601601 | 中国太保 | 22,321,784.83 | 1.22 |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 20,967,439.92 | 1.15 |
| 13 | 000858 | 五 粮 液 | 20,654,362.53 | 1.13 |
| 14 | 000783 | 长江证券 | 20,532,808.14 | 1.12 |
| 15 | 000728 | 国元证券 | 17,792,748.35 | 0.97 |
| 16 | 600900 | 长江电力 | 17,702,340.06 | 0.97 |
| 17 | 002024 | 苏宁电器 | 16,781,241.41 | 0.92 |
| 18 | 000001 | 深发展A | 16,401,371.08 | 0.90 |
| 19 | 600031 | 三一重工 | 16,249,677.11 | 0.89 |
| 20 | 601006 | 大秦铁路 | 16,214,185.65 | 0.89 |

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。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 679,406,820.12 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,208,215,533.57 |

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1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。

8.9.2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。

8.9.3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 | 750,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 746,712.22 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,521.17 |
| 5 | 应收申购款 | 11,170.52 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,518,403.91 |

8.9.4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。

8.9.5.1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。

8.9.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 |
| 20,809 | 69,645.04 | 539,500,648.08 | 37.23% | 909,743,061.00 | 62.77% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 徐婷 | 1,000,030.00 | 4.65% |
| 2 | 何小娥 | 999,130.00 | 4.65% |
| 3 | 孙宁 | 800,056.00 | 3.72% |
| 4 | 黄晟昊 | 793,678.00 | 3.69% |
| 5 | 卞淑明 | 676,100.00 | 3.15% |
| 6 | 齐齐哈尔中通公共交通有限责任公司 | 500,030.00 | 2.33% |
| 7 | 陈伟民 | 500,015.00 | 2.33% |
| 8 | 梁玉会 | 494,200.00 | 2.30% |
| 9 | 乐玉屏 | 445,303.00 | 2.07% |
| 10 | 王炜 | 400,012.00 | 1.86% |

注：持有人为场内持有人。

9.3 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 | 844.02 | 0.00% |

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2009年10月30日）基金份额总额 | 2,087,148,875.30 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,180,894,434.94 |
| 本报告期基金总申购份额 | 663,561,464.24 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,395,212,190.10 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,449,243,709.08 |

### §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，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是90,000.00元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是3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 | 2 | 1,171,176,830.66 | 62.15% | 986,297.26 | 62.24% | - |
| 中金公司 | 2 | 378,226,570.93 | 20.07% | 314,862.79 | 19.87% | - |
| 国金证券 | 1 | 175,903,113.70 | 9.33% | 149,517.51 | 9.44% | - |
| 中信建投 | 2 | 159,217,716.95 | 8.45% | 133,897.64 | 8.45% | - |

注：1、本基金本报告期新增国金证券一个交易单元。

2、（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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 7,590,121.00 | 86.70% | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1,164,831.30 | 13.30% | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |

### §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**