

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:二〇一二年八月二十七日
重要提示
1.1 重要提示
基金管理人承诺,要确保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法律责任。

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

对于在交易所上市的证券,采用交易所发布的行情信息估值。对于固定收益品种,采用证券基金估值工作小组开发的固定收益品种的估值交易标准。

4.7 报告期内基金内基金利润分配情况的说明
1. 本基金报告期内无基金份额持有人。
2. 本基金报告期内无基金份额持有人。
3. 本基金报告期内无基金份额持有人。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况
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的利益的行为,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法、净值计算、利润分配等情况的说明
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约定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的增长、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 托管人对关联方交易涉及内容真实、准确和完整披露的意见
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(含财务会计报告中“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
单位:人民币元
资产 2012年6月30日 上年度末12月31日
银行存款 59,441,200.26 52,364,955.78
结算备付金 34,434.26 41,866.07
存出保证金 750,000.00 750,000.00
交易性金融资产 998,942,704.63 930,528,367.12
其中:股票投资 998,942,704.63 930,528,367.12
基金投资 - -
债券投资 - -
资产支持证券 - -
买入返售金融资产 - -
应收证券清算款 - -
其他应收款 - -
预付款项 - -
应收利息 12,292.75 10,521.17
应收股利 2,473,501.60 -
应收申购款 577,749.33 -
递延所得税资产 - -
其他资产 - -
资产总计 1,062,232,282.83 984,453,992.88

6.2 利润表
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入 70,443,348.37 22,306,228.58
1.利息收入 234,828.06 375,864.63
其中:存款利息收入 234,442.42 374,859.68
债券利息收入 385.64 1,004.95
资产支持证券利息收入 - -
买入返售金融资产收入 - -
其他收入 - -
2.投资收益(含损失) 34,711,440.14 -45,942,970.21
其中:股票投资收益 -48,730,999.12 -63,748,530.40
基金投资收益 - -
债券投资收益 163,834.36 535,116.05
资产支持证券投资收益 - -
衍生工具损益 - -
3.公允价值变动收益(损失) 13,855,724.62 17,270,444.14
4.汇兑收益(损失) 104,903,434.79 67,124,241.06
5.其他收益(损失) 16,225.66 7,491,093.10
减:二、费用 5,182,742.96 9,671,964.24
1.管理人报酬 3,647,954.17 6,118,125.31
2.托管费 625,363.55 1,048,821.49
3.销售服务费 - -
4.交易费用 567,345.45 2,094,315.22
5.利息支出 - -
其中:卖出回购金融资产支出 - -
6.其他费用 342,679.79 410,702.22
三、利润总额(亏损总额) 65,260,605.41 12,634,264.34
减:所得税费用 - -
四、净利润(净亏损) 65,260,605.41 12,634,264.34

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值) 1,449,243,709.08 -469,114,137.24 980,129,571.84
二、本期经营投资产生的基金净值变动数(基金份额变动) 65,260,605.41 65,260,605.41
三、本期基金份额减少(基金份额减少) 28,541,870.72 -13,821,310.51 14,720,560.41
其中:1.基金份额申购 227,560,110.31 -64,743,561.21 162,816,469.90
2.基金份额赎回 -199,018,031.39 50,922,250.92 -148,095,909.49
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少) - -
五、期末所有者权益(基金净值) 1,477,785,579.80 -417,674,842.14 1,060,110,737.66

6.4 本报告期末及上年度末资产负债表的所有者权益(基金净值)
项目 2012年6月30日 2011年12月31日
所有者权益(基金净值) 1,477,785,579.80 1,449,243,709.08
未分配利润 -417,674,842.14 -469,114,137.24
所有者权益合计 1,060,110,737.66 980,129,571.84
负债和所有者权益总计 1,062,232,282.83 984,453,992.88

6.5 现金流量表
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
一、经营活动产生的现金流量:
收到申购款 1,060,110,737.66 -
支付赎回款 -1,060,110,737.66 -
支付交易费用 - -
支付利息 - -
支付其他 - -
收到利息 12,292.75 -
收到股利 2,473,501.60 -
收到其他 - -
支付其他 - -
经营活动产生的现金流量净额 12,292.75 -
二、投资活动产生的现金流量:
购买股票 -998,942,704.63 -
出售股票 930,528,367.12 -
购买债券 - -
出售债券 - -
购买基金 - -
出售基金 - -
购买其他 - -
出售其他 - -
收到利息 12,292.75 -
收到股利 2,473,501.60 -
收到其他 - -
支付其他 - -
投资活动产生的现金流量净额 34,434.26 41,866.07
三、筹资活动产生的现金流量:
发行股票 - -
发行债券 - -
发行其他 - -
收到利息 - -
收到股利 - -
收到其他 - -
支付其他 - -
筹资活动产生的现金流量净额 - -
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 - -
五、现金及现金等价物净增加额 12,292.75 41,866.07
六、期初现金及现金等价物余额 52,364,955.78 -
七、期末现金及现金等价物余额 64,657,252.53 94,231,821.85

6.6 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.7 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.8 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.9 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.10 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.11 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.12 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.13 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.14 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.15 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.16 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.17 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.18 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.19 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.20 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.21 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.22 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.23 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.24 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.25 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.26 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.27 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.28 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.29 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.30 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.31 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.32 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.33 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.34 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.35 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.36 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.37 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.38 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

6.39 净资产收益率
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年1月1日至2011年6月30日
净资产收益率 0.45% 0.43%

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读登录于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 买入卖出金额超出期初股票资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初股票资产净值的比例. Lists top 20 stocks bought and sold.

注:“买入金额”/“卖出金额”或“卖出金额”/“买入金额”均以成交金额(成交金额)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 卖出金额超出期初股票资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初股票资产净值的比例. Lists top 20 stocks sold.

注:“买入金额”/“卖出金额”或“卖出金额”/“买入金额”均以成交金额(成交金额)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及成交金额

7.5 期末按市值占基金净资产比例大小排名前五名的股票投资组合

7.6 期末按公允价值占基金净资产比例大小排名前五名的债券投资组合

7.7 期末按公允价值占基金净资产比例大小排名前十名的资产支持证券投资组合

7.8 期末按公允价值占基金净资产比例大小排名前五名的权证投资组合

7.9 报告期末持有的前十名证券中是否存在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

7.10 报告期末持有的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.11 报告期末其他各项资产构成

7.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.13 报告期末持有的前十名股票中是否存在流通受限情况的说明

7.14 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.15 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.16 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.17 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.18 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.19 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.20 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.21 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.22 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.23 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.24 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.25 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.26 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.27 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.28 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.29 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.30 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.31 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.32 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.33 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.34 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.35 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.36 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.37 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.38 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.39 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.40 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.41 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.42 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.43 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.44 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.45 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.46 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.47 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.48 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.49 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.50 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.51 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.52 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.53 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.54 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.55 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.56 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.57 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.58 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.59 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.60 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.61 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.62 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.63 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.64 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.65 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

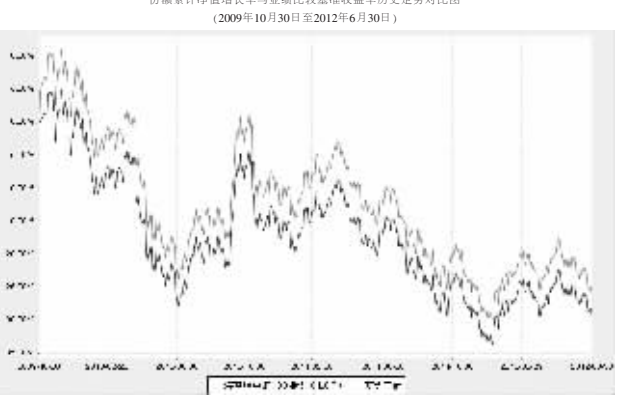
7.66 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.67 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.68 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.69 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

7.70 报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况的说明



注:按照本基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起六个月,建仓期满后,本基金投资组合均达到本基金合同第十五条(二)、(七)规定的比例限制及基金投资组合的比例范围。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
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

4.1.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况
基金管理人高级管理人员:
董事长:李琦
副董事长:李琦
总经理:李琦
副总经理:李琦
督察长:李琦

4.1.3 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.4 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.5 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.6 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.7 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.8 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.9 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.10 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.11 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.12 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.13 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.14 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.15 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.16 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.17 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.18 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.19 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.20 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.21 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.22 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.23 基金管理人及基金托管人的其他主要人员情况
基金管理人其他高级管理人员:
基金经理:李琦
基金经理助理:李琦
基金销售:李琦
基金运营:李琦
基金清算:李琦

4.1.2