海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年三月三十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月27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。

本报告期自2013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	海富通中证内地低碳指数
基金主代码	519034
交易代码	519034
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月25日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	83,777,277.69份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数。在正常市场情况下,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金将采取完全复制策略,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	中证内地低碳经济主题指数×95%+人民币税后活期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的投资品种,风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动投资的指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	田青
	联系电话	021-38650891	010-67595096
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		40088-40099	010-67595096
传真		021-33830166	010-66275853

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	2013年	2012年5月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	3,802,901.27	-15,236,129.80
本期利润	25,444,962.22	-28,623,669.93
加权平均基金份额本期利润	0.2741	-0.1038
本期基金份额净值增长率	26.35%	-7.40%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0184	-0.0829
期末基金资产净值	97,984,198.73	136,627,114.87
期末基金份额净值	1.170	0.926

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)。

4、本基金合同于2012年5月25日生效,合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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

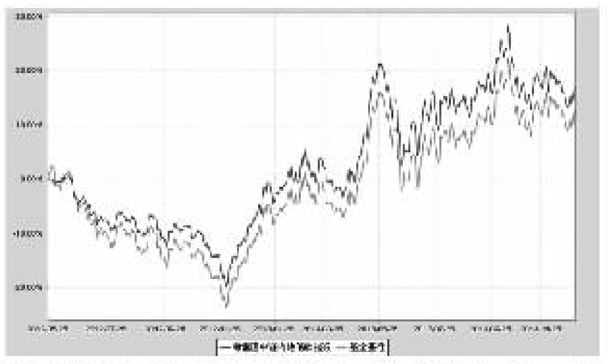
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.43%	1.42%	0.87%	1.42%	-1.30%	0.00%
过去六个月	11.32%	1.46%	12.74%	1.45%	-1.42%	0.01%
过去一年	26.35%	1.48%	27.12%	1.47%	-0.77%	0.01%
自基金合同生效起至今	17.00%	1.30%	12.74%	1.37%	4.26%	-0.07%

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

海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

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

(2012年5月25日至2013年12月31日)

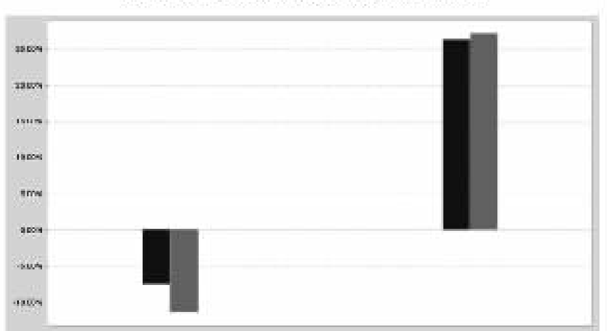


注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月,截至建仓期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分(二)投资范围、(六)投资限制中规定的各项比例。

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

海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

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2012年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期5月25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
2013	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金合同于2012年5月25日生效,未实施利润分配。

§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。本海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金是基金管理人管理的第二十一只公募基金;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、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、海富通国策导向股票型证券投资基金、海富通现金管理货币市场基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双利分级债券型证券投资基金和海富通内需热点股票型证券投资基金二十五只公募基金。

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		
刘璎	本基金的基金经理;海富通上证周期ETF基金经理;海富通上证周期ETF联接基金经理;海富通上证非周期ETF联接基金经理;海富通上证非周期ETF基金经理;海富通中证100指数(LOF)基金经理;指数投资部指数投资负责人	2012-05-25	-	12年	管理学硕士,持有基金从业人员资格证书。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司,曾任华安上证180ETF基金经理助理;2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金经理,2008年4月至2010年6月担任华安中国A股增强指数基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司。2010年11月起任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理。2011年4月起任海富通上证非周期ETF及海富通上证非周期ETF联接基金经理。2012年1月起兼任海富通中证100指数(LOF)基金经理。2012年5月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。2013年10月起任指数投资部指数投资负责人。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据证监会2011年发布的《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,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时,公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证公平交易制度的执行和实现。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明,报告期内公司对旗下各投资组合公平对待,不存在利益输送的行为。

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,未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

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

回顾2013年,年初股市表现不错,主要指数均迎来两位数以上的涨幅。然而,政府随后对房市的大力抑制("国五条")再度带来悲观气氛,自此,股市开始呈现随消息面起伏的走势。从"新型城镇化"、6月"钱荒"、自贸区、通信和传媒板块的活跃、优先股试点消息发布,再到年底的十八届三中全会、中央经济会议、中央农村工作会议及新股发行制度改革和重启时点的公布,可谓以"你未唱罢我便登场"的态势持续牵动着2013年市场的神经;美联储QE退出进程更全年主导着市场的预期心理。在改革预期和资金面的影响下,股市债市均维持震荡格局,而各板块及个股在热点纷呈的主题带领下,演绎出分化的行情,创业板指数表现异军突起。

整年度来看,股市表现纠结分化,整年度上证综指以下跌6.75%收官,而自2012年下半年开始起涨的创业板指仍保持强劲势头,整年度涨幅高达82.73%。债市则是在流动性持续紧张的压力下,表现仍旧疲弱,整年度中债主要指数的跌幅为4%~6%。

整年度行业表现,若观察中信一级行业,当中有15个行业整年度表现超过10%,表现最好的是传媒(+102.56%)、其次是计算机(+75.72%)和通信(+45.25%)。另外,跌幅超过10%有四个行业,均为周期股,如煤炭(-40.30%)、有色金属(-29.75%)、钢铁(-16.49%)和房地产(-11.69%)。

报告期间,本基金完成了年中、年末的指数成份股调整。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26.35%,同期业绩比较基准收益率为27.12%。年跟踪误差为1.21%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0027%,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2014年,2013年对美国经济拖累最大的财政悬崖问题将基本消除,美国经济复苏有望逐步加速。而欧洲方面,欧元区经济内部增长动力主要来源于融资条件改善,外部动力主要来源于美国、中国经济改善。2014年欧洲经济在欧央行宽松政策护航和美国经济复苏的带动下有望继续温和复苏。

国内投资方面,受房地产投资增速下行拖累,2014年固定资产投资增速将略有下行;制造业投资受制于整体过剩的产能和高企的资金成本也将有所下降。而出口在美国和欧洲复苏的带动下有望继续回暖。消费受制于反腐影响,2014年可能依旧保持低位平稳。总体而言进入2014年,国内的经济将保持平稳,向下的风险不大,但向上也缺乏弹性。

流动性方面,受制于高企的政府债务再融资需求、海外资金价格上升、央行偏紧的货币政策倾向以及利率市场化推进等因素,2014年整体的流动性仍将偏紧。估值方面,随着前期市场的下跌,目前沪深300指数的市盈率已接近历史低位,继续向下的空间可能不大。中国股市目前所处的大的背景仍是改革和转型,股市的价值体系正在重塑,结构性仍是市场的重点。因此,寻找那些符合经济转型方向的领域和个股机会或将成为投资的关键。

未来,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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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:海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	9,244,677.20	9,848,822.42
结算备付金	21,869.84	100,766.51
存出保证金	24,314.23	-
交易性金融资产	89,468,893.95	128,284,106.20
其中:股票投资	89,468,893.95	128,284,106.20
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,046.47	2,240.24
应收股利	-	-
应收申购款	24,148.88	790.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	98,785,950.57	138,236,725.88
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	-	541,412.31
应付赎回款	245,564.27	487,446.88
应付管理人报酬	82,610.11	117,700.74
应付托管费	16,522.01	23,540.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	46,199.38	67,673.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	410,856.07	371,837.09
负债合计	801,751.84	1,609,611.01
所有者权益:		
实收基金	83,777,277.69	147,532,815.64
未分配利润	14,206,921.04	-10,905,700.77
所有者权益合计	97,984,198.73	136,627,114.87
负债和所有者权益总计	98,785,950.57	138,236,725.88

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.170元,基金份额总额83,777,277.69份。

7.2 利润表

会计主体:海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年5月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	27,557,679.89	-25,893,404.28
1.利息收入	56,249.99	749,342.11
其中:存款利息收入	56,249.99	452,351.34
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	-	296,990.77
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	5,661,028.54	-13,995,216.07
其中:股票投资收益	4,649,719.58	-15,794,387.53
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,011,308.96	1,799,171.46
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	21,642,060.95	-13,387,540.13
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	198,340.41	740,009.81
减:二、费用	2,112,717.67	2,730,265.65
1.管理人报酬	1,005,299.97	1,538,940.26
2.托管费	201,059.99	307,788.03
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	342,163.87	448,345.30
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	564,193.84	435,192.06
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	25,444,962.22	-28,623,669.93
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	25,444,962.22	-28,623,669.93

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	147,532,815.64	-10,905,700.77	136,627,114.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,444,962.22	25,444,962.22
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)	-63,755,537.95	-332,340.41	-64,087,878.36
其中:1.基金申购款	98,202,325.58	16,039,620.73	114,241,946.31
2.基金赎回款	-161,957,863.53	-16,371,961.14	-178,329,824.67
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)	83,777,277.69	14,206,921.04	97,984,198.73
项目	上年度可比期间 2012年5月25日(基金合同生效日)至2012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)	756,241,204.93	-	756,241,204.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-28,623,669.93	-28,623,669.93
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)	-608,708,389.29	17,717,969.16	-590,990,420.13
其中:1.基金申购款	1,098,787.18	-84,547.79	1,014,239.39
2.基金赎回款	-609,807,176.47	17,802,516.95	-592,004,659.52
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)	147,532,815.64	-10,905,700.77	136,627,114.87

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

海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]1801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《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》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756,109,208.17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(2012)第154号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》于2012年5月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为756,241,204.93份基金份额,其中认购资金利息折合131,996.76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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股(包括中小板、创业板股票及其它经中国证监会核准上市的股票)、新股(含首次公开发行和增发)、债券、债券回购、权证、股指期货、现金、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的90%;投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:中证内地低碳经济主题指数×95%+人民币税后活期存款利率×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2014年3月25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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通中证内地低碳经济主题指数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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013年度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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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("海富通")	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年5月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	8,724,967.49	4.21%	30,182,385.44	8.70%

7.4.8.1.2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。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	7,943.14	4.40%	7,943.14	17.19%
关联方名称	上年度可比期间 2012年5月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	26,426.24	8.93%	11,737.09	17.34%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年5月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,005,299.97	1,538,940.26
其中:支付销售机构的客户维护费	480,371.54	978,096.34

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1.0%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 1.0% / 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年5月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	201,059.99	307,788.03

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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 0.2% / 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。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1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。

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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年5月25日(基金合同生效日)至2012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
中国建设银行	9,244,677.20	54,475.42	9,848,822.42	438,523.33

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9期末(2013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

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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002573	国电清新	2013-12-23	重大事项	22.17	2014-03-25	20.80	65,580	1,269,676.67	1,453,908.60	-
002266	浙富股份	2013-12-06	重大事项	9.25	2014-01-16	10.18	156,756	1,026,232.10	1,449,993.00	-
002665	首航节能	2013-10-24	重大资产重组	26.77	2014-03-18	29.45	32,099	739,278.67	859,290.23	-
601012	隆基股份	2013-12-16	重大事项	15.41	2014-01-13	14.78	41,995	413,635.75	647,142.95	-

注:本基金截至2013年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为85,058,559.17元,属于第二层级的余额为4,410,334.78元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级125,138,914.11元,第二层级3,145,192.09元,无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

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,本基金不会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还是第三层级。

(iv)第三层级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	89,468,893.95	90.57
	其中:股票	89,468,893.95	90.57
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	9,266,547.04	9.38
7	其他各项资产	50,509.58	0.05
8	合计	98,785,950.57	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	50,987,922.64	52.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,472,135.11	17.83
E	建筑业	1,184,886.40	1.21
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,955,612.53	8.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,868,337.27	12.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	89,468,893.95	91.31

8.2.2积极投资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积极投资股票。

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	600900	长江电力	1,162,904	7,349,553.28	7.50
2	600089	特变电工	611,314	6,553,286.08	6.69
3	300070	碧水源	153,937	6,309,877.63	6.44
4	600406	国电南瑞	382,553	5,688,563.11	5.81
5	002594	比亚迪	126,038	4,749,111.84	4.85
6	600703	三安光电	183,573	4,550,774.67	4.64
7	600388	龙净环保	117,473	3,937,694.96	4.02
8	000826	桑德环境	94,522	3,289,365.60	3.36
9	002202	金风科技	383,910	3,236,361.30	3.30
10	000400	许继电气	97,474	3,030,466.66	3.09

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300070	碧水源	4,996,533.87	3.66
2	600900	长江电力	4,854,837.05	3.55
3	600089	特变电工	4,342,436.25	3.18
4	002594	比亚迪	3,898,818.86	2.85
5	600406	国电南瑞	3,306,303.62	2.42
6	600703	三安光电	2,663,702.49	1.95
7	000826	桑德环境	2,569,588.10	1.88
8	600478	科力远	2,327,215.28	1.70
9	600674	川投能源	1,965,349.35	1.44
10	002573	国电清新	1,939,849.00	1.42
11	300072	三聚环保	1,911,001.05	1.40
12	002202	金风科技	1,750,296.00	1.28
13	600388	龙净环保	1,722,457.80	1.26
14	600187	国中水务	1,668,884.00	1.22
15	300055	万邦达	1,532,899.38	1.12
16	000400	许继电气	1,489,287.70	1.09
17	600008	首创股份	1,376,510.50	1.01
18	600875	东方电气	1,355,002.52	0.99
19	002266	浙富股份	1,187,021.79	0.87
20	002638	勤上光电	1,024,500.00	0.75

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	600900	长江电力	15,604,907.31	11.42
2	600089	特变电工	9,402,332.33	6.88
3	600406	国电南瑞	7,541,783.67	5.52
4	300070	碧水源	6,980,822.61	5.11
5	000826	桑德环境	5,926,151.45	4.34
6	600703	三安光电	5,736,825.47	4.20
7	600674	川投能源	4,411,006.35	3.23
8	000400	许继电气	4,322,312.03	3.16
9	002594	比亚迪	4,015,583.01	2.94
10	600875	东方电气	3,847,269.97	2.82
11	002202	金风科技	3,779,290.42	2.77
12	600008	首创股份	3,368,729.70	2.47
13	601727	上海电气	2,901,208.86	2.12
14	600388	龙净环保	2,886,373.71	2.11
15	600478	科力远	2,778,311.99	2.03
16	000690	宝新能源	2,759,062.13	2.02
17	600550	天威保变	2,742,841.11	2.01
18	601158	重庆水务	2,609,718.58	1.91
19	601179	中国西电	2,607,635.22	1.91
20	601558	华锐风电	2,600,244.28	1.90

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	71,070,964.93
卖出股票的收入(成交)总额	136,177,957.71

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的,并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	24,314.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,046.47
5	应收申购款	24,148.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,509.58

8.12.4 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。

8.12.5.1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。

8.12.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§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
2,382	35,170.98	18,051,164.78	21.55%	65,726,112.91	78.45%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	1,070.60	0.0013%

注:1、本基金本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金本报告期末,本基金的基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年5月25日)基金份额总额	756,241,204.93
本报告期期初基金份额总额	147,532,815.64
本报告期基金总申购份额	98,202,325.58
减:本报告期基金总赎回份额	161,957,863.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	83,777,277.69

§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

2013年3月21日,海富通基金管理有限公司发布公告,公司股东会增聘高勇前先生担任本公司职工监事。

2013年4月10日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司第四届董事会审议通过,聘请陶网雄先生担任公司副总经理。

2013年5月9日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司2013年第一次股东会及第四届董事会第一次会议审议并通过,并向中国证券监督管理委员会报告,经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】628号文核准批复,公司聘请张文伟先生担任公司董事长,邵国有先生因退休转任本公司董事。

2013年9月24日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司2013年第二次临时股东会审议通过,同意艾德加(Stewart Edgar)先生辞去本公司董事职务,并由陶乐斯(Ligia Torres)女士继任本公司董事。

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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60,000.00元。目前事务所已提供审计服务的年限是2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	
中投证券	1	64,861,467.11	31.30%	59,050.18	32.68%	-
红塔证券	1	47,229,771.26	22.79%	41,793.90	23.13%	-
银河证券	1	29,402,393.10	14.19%	20,137.82	11.14%	-
国都证券	1	18,625,198.76	8.99%	16,956.41	9.38%	-
中信证券	2	16,458,583.52	7.94%	14,921.08	8.26%	-
海通证券	2	8,724,967.49	4.21%	7,943.14	4.40%	-
安信证券	2	7,026,546.47	3.39%	6,396.96	3.54%	-
国元证券	1	6,795,588.91	3.28%	6,186.73	3.42%	-
瑞银证券	1	4,761,015.81	2.30%	4,334.81	2.40%	-
德邦证券	1	3,363,390.21	1.62%	2,976.31	1.65%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注:1、本报告期内,本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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		其它交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§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26只公募基金。截至2013年12月31日,海富通管理的公募基金资产规模超过235亿元人民币。

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2013年12月31日,海富通为80多家企业近291亿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2013年12月31日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过40亿元。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。2012年9月,中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。

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2013年12月31日,投资咨询及海外业务规模近212亿元人民币。2011年12月,海富通全资子公司——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,能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012年2月,海富通资产管理(香港)有限公司已募集发行了首只RQFII产品。

2012年3月,国内权威财经媒体《中国证券报》等授予海富通基金管理有限公司"中国基金业金牛基金管理公司"大奖,《证券时报》授予海富通精选混合基金"2011年中国基金业明星奖—五年持续回报平衡混合型明星基金"荣誉。2013年4月,《上海证券报》授予海富通精选混合基金2012年"金基金"奖——分红基金奖。

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。几年来,海富通的公益行动进一步升级,持续为上海民工小学学生捐献生活物资,并向安徽农村小学捐献图书室。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
二〇一四年三月三十一日