海富通中国海外精选股票型证券投资基金

2011 第四季度 报告

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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2012年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中国海外股票(QDII)
基金主代码	519601
交易代码	519601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月27日
报告期末基金份额总额	197,235,348.21份
投资目标	本基金以在香港、美国等海外证券交易所上市的具有"中国概念"的上市公司为主要投资对象。本基金管理人将深入研究全球及内地经济状况以及政策导向,采取主动精选证券和适度资产配置的投资策略,实施全程风险管理,在保证资产良好流动性的前提下,在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	根据对境内外证券市场投资经验的认识和对证券市场的实证分析,本基金管理人将基金的整体投资策略分为二个层次:第一层次为适度主动的资产配置,以控制或规避市场系统性风险;第二层次为积极主动的精选证券,以分散或规避个券风险。主动精选证券是本基金投资策略的重点,本基金不积极谋求寻找市场的拐点,主要从控制系统性风险出发适度调整资产配置。
业绩比较基准	MSCI中国指数(以美元计价)
风险收益特征	本基金是股票型基金,其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。
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
境外资产托管人英文名称	The Bank of New York Mellon Corporation
境外资产托管人中文名称	纽约梅隆银行

注:本基金管理人于2011年2月14日发布公告,自2011年2月14日起解除与法国巴黎投资管理BE控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding)签署的投资顾问协议,自该日起法国巴黎投资管理BE控股公司不再担任本基金的投资顾问。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-17,715,196.66
2.本期利润	9,761,244.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0490
4.期末基金资产净值	223,846,342.14
5.期末基金份额净值	1.135

注:①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。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

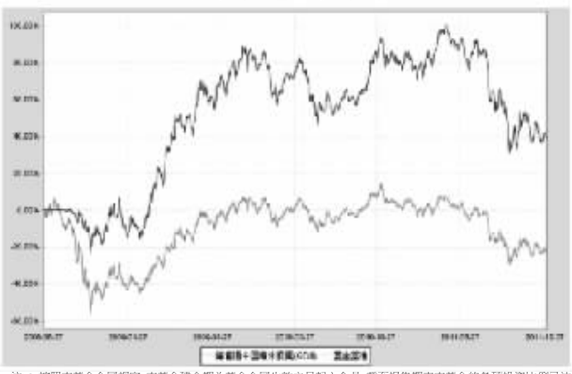
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.51%	2.19%	6.49%	2.21%	-1.98%	-0.02%

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

海富通中国海外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

(2008年6月27日至2011年12月31日)



注:1.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十二条(二)投资范围、(八)投资限制中规定的各项比例;

2.本基金的业绩比较基准为MSCI中国指数(美元计价),在与同期业绩进行比较时,该基准已经转换为与本基金相同的计价货币(人民币)。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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;海富通大中华股票(QDII)基金基金经理	2010-1-13	-	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与限公司,任投票分析师,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为: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

本基金管理人于2011年2月14日发布公告,自2011年2月14日起解除与法国巴黎投资管理BE控股公司(BNP Paribas Investment Partners BE Holding)签署的投资顾问协议,自该日起法国巴黎投资管理BE控股公司不再担任本基金的投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

自10月初起,市场受到法国和德国推进欧元区解决主权债务危机的努力和对11月初20国峰会成果的良好预期,全球股市大幅反弹到11月初。但随着希腊要举行全国公投的阐明出现,导致峰会没有产生预期的解决方案,市欧洲和新兴市场经济体的实体经济继续减速,全球股市随后又跌开回调,直到12月才恢涨企稳。整个第四季度,发达市场股市表现好于新兴市场股市,海外中国股票表现又略好于新兴市场股市。

报告期内,本基金逐低增加了股票仓位,增持了金融、能源和公用事业行业的配置,减持了信息技术、消费品、原材料和医疗保健行业的配置,灵活的个股调整规避了一些风险。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为4.51%,同期业绩比较基准收益率为6.49%,基金净值跑输业绩比较基准1.98个百分点。主要是10月份股市的大幅回升中,基金的资产配置进攻性不够使得表现进于基准。

4.5.3 市场展望和投资策略

展望二零一二年第一季度,我们认为美国经济将继续复苏企稳,而欧元区由于高企的债务负担率和一些难以迅速扭转的结构性因素,其面临的债务问题难以在中短期内彻底解决,前景仍不容乐观。同时,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。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仍将成为货币政策的主基调。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。就市场而言,海外中国股票在经历了前期连续调整后,整体估值已处于较低水平,市场恐慌情绪在一定程度上也得到了释放,但是我们仍然需要耐心等待政策给出的积极信号。行业上,受益于宏观政策扶持的大消费、技术创新和节能环保等或将值得关注。

对于二零一二年第一季度的市场判断,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。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的行业和公司,更强调结构性的机会和个股的基本面研究。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	196,724,987.76	87.28
	其中:普通股	184,976,014.56	82.06
	存托凭证	11,748,973.20	5.21
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	20,772,222.77	9.22
8	其他各项资产	7,904,888.40	3.51
9	合计	225,402,098.93	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	180,612,641.30	80.69
美国纽约	11,748,973.20	5.25
新加坡	4,363,373.26	1.95
合计	196,724,987.76	87.88

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。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
10能源	59,700,278.03	26.67
15原材料	17,432,551.49	7.79
25非日常生活消费品	24,974,513.54	11.16
30日常消费品	6,977,213.41	3.12
35医疗保健	6,529,554.63	2.92
40金融	66,247,789.48	29.60
45信息技术	8,012,437.18	3.58
55公共事业	6,850,650.00	3.06
合计	196,724,987.76	87.88

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	证券代码	公司名称(英文)	公司名称(中文)	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	1988 HK	China Minsheng Banking Corp.,Ltd.	中国民生银行股份有限公司	香港证券交易所	中国香港	4,000,000	21,840,300.59	9.76
2	2318 HK	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	香港证券交易所	中国香港	400,000	16,615,503.57	7.42
3	386 HK	China Petroleum and Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	香港证券交易所	中国香港	2,000,000	13,256,705.48	5.92
4	PTR US	PETROCHINA CO LTD -A	中国石油天然气股份有限公司	纽约证券交易所	美国	15,000	11,748,973.20	5.25
5	883 HK	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	香港证券交易所	中国香港	1,050,000	11,568,382.10	5.17
6	1898 HK	China Coal Energy Company Limited	中国中煤能源股份有限公司	香港证券交易所	中国香港	1,500,000	10,198,089.84	4.56
7	2333 HK	Great Wall Motor Company Limited	长城汽车股份有限公司	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	9,200,186.06	4.11
8	3968 HK	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	香港证券交易所	中国香港	600,000	7,642,482.60	3.41
9	2883 HK	China Oilfield Services Limited	中海油田服务股份有限公司	香港证券交易所	中国香港	750,000	7,459,939.22	3.33
10	168 HK	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒股份有限公司	香港证券交易所	中国香港	200,000	6,977,213.41	3.12

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告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。

5.9 报告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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	7,633,401.78
3	应收股利	-
4	应收利息	827.77
5	应收申购款	126,033.60
6	其他应收款	144,625.25
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,904,888.40

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	199,762,539.86
本报告期基金总申购份额	7,578,302.03
减:本报告期基金总赎回份额	10,105,493.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	197,235,348.21

§7 影响投资者决策的其他重要信息

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。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,准许在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。

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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通中证100指数证券投资基金(LOF)的文件

(二)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)基金合同

(三)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)招募说明书

(四)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)托管协议

(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)报告期内海富通中证100指数证券投资基金(LOF)在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层本基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一二年一月二十日

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)

2011 第四季度 报告

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:二〇一二年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中证100指数(LOF)
基金场内简称	海富100
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
报告期末基金份额总额	1,449,243,709.08份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-72,838,462.42
2.本期利润	-57,522,172.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0349
4.期末基金资产净值	980,129,571.84
5.期末基金份额净值	0.676

注:①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。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

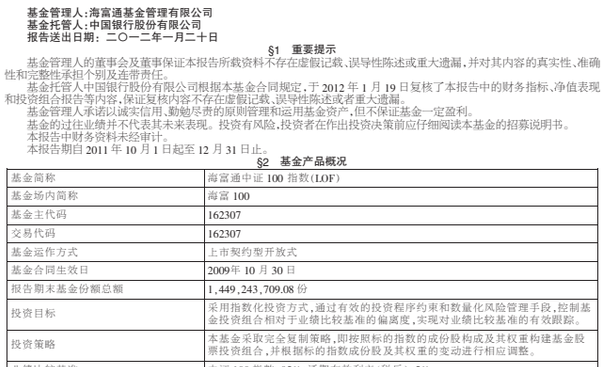
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.98%	1.30%	-5.89%	1.28%	-0.09%	0.02%

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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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基金经理;2009年10月起任海富通中证100指数(LOF)基金基金经理。2011年4月起兼任海富通风格优势股票基金基金经理。

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 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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入2011年第四季度,在汇金增持四大行等利好作用下,A股市场在十月底迎来了一波反弹,但之后却出现了近两个月的下跌。国内经济转型艰难、欧债危机不断升级、金融体系流动性下降、宏观政策缺乏实质性放松,造成了市场逐级下探的走势。行业方面,有色金属、化工、采掘等跌幅居前,而金融、食品饮料等表现相好。风格方面,大盘股表现优于小盘股。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通中证100指数(LOF)基金净值增长率为-5.98%,同期基金业绩比较基准收益率为-5.89%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0013%,年化跟踪误差为1.14%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 市场展望和投资策略

展望未来,我们认为美国经济将继续复苏企稳,而欧元区由于高企的债务负担率和一些难以迅速扭转的结构性因素,其面临的债务问题难以在中短期内彻底解决,前景仍不容乐观。与此同时,国内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。但随着通胀压力的减缓和经济增速下滑风险的显现,财政政策可能会略微积极,总体稳健和定向宽松仍将成为货币政策的主基调。就市场而言,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,但是我们仍然需要耐心等待政策给出的积极信号。行业上,受益于宏观政策扶持的农业、水利、大消费、技术创新和节能环保等或将值得关注。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	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

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	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

5.3 报告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

5.3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	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

5.3.2 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	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

5.4 报告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。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
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

5.8.4 报告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。

5.8.5.1 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。

5.8.5.2 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,787,816,017.28
本报告期基金总申购份额	74,770,909.46
减:本报告期基金总赎回份额	413,343,217.66
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

§7 影响投资者决策的其他重要信息

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。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,准许在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。

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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通中证100指数证券投资基金(LOF)的文件

(二)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)基金合同

(三)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)招募说明书

(四)海富通中证100指数证券投资基金(LOF)托管协议

(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)报告期内海富通中证100指数证券投资基金(LOF)在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层本基金管理人办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一二年一月二十日

海富通中小盘股票型证券投资基金

2011 第四季度 报告

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中小盘股票
基金主代码	519026
交易代码	519026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
报告期末基金份额总额	1,320,525,533.97份
投资目标	本基金通过投资于具有高成长潜力和良好基本面的中小盘股票,在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的持续增值。