海富通精选证券投资基金

2012 年度报告摘要

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年三月二十七日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月26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2012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	海富通精选混合
基金主代码	519011
交易代码	519011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月22日
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,374,486,283.50份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行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	本基金的投资策略分两个层次：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。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。
业绩比较基准	MSCI China A指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中风险程度适中的品种。本基金力争通过适度主动的资产配置和积极主动的精选证券，识别和控制风险，实现风险限度内的超额回报。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	裴学敏
	联系电话	021-38650891	021-32169999
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701262

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办公场所

§ 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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-389,305,672.44	-330,432,487.41	683,393,359.60
本期利润	26,086,944.12	-1,905,790,007.80	692,880,984.50
加权平均基金份额本期利润	0.0019	-0.1570	0.0716
本期基金份额净值增长率	-0.38%	-17.82%	8.72%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0025	0.2212	0.3872
期末基金资产净值	7,566,399,621.79	8,898,453,606.67	9,060,775,611.82
期末基金份额净值	0.4621	0.6603	0.9480

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）。

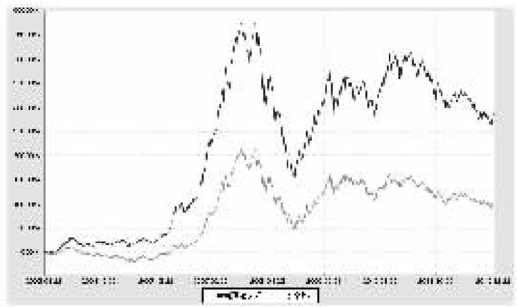
3.2 基金净值表现

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	4.54%	0.85%	6.29%	0.84%	-1.75%	0.01%
过去六个月	-3.43%	0.88%	1.67%	0.82%	-5.10%	0.06%
过去一年	-0.38%	0.88%	6.14%	0.85%	-6.52%	0.03%
过去三年	-10.99%	0.99%	-15.45%	0.91%	4.46%	0.08%
过去五年	-25.86%	1.34%	-27.60%	1.26%	1.74%	0.08%
自基金合同生效起至今	303.31%	1.26%	115.68%	1.17%	187.63%	0.09%

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

海富通精选证券投资基金
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
（2003年8月22日至2012年12月31日）

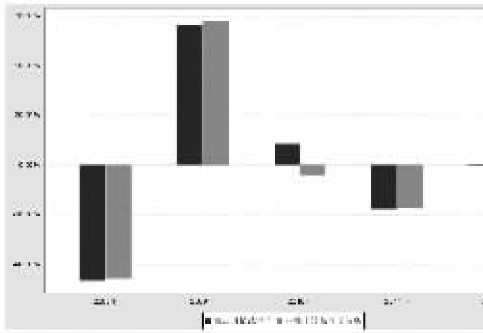


注：1、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。本基金自2007年6月28日至2007年9月29日，为持续营销后建仓期。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十八条（三）、（六）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

2、为了能更公允地体现基金投资业绩，海富通基金管理有限公司自2007年1月1日起调整海富通精选基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为MSCI China A指数，相应的基准权重不变。

3.2.3 过去五年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

海富通精选证券投资基金
基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



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
2012	1.950	2,172,674,493.21	761,343,736.89	2,934,018,230.10	-
2011	1.500	1,294,888,527.11	459,861,778.65	1,754,750,305.76	-
2010	0.020	11,423,135.36	7,095,025.16	18,518,160.52	-
合计	3.470	3,478,986,155.68	1,228,300,540.70	4,707,286,696.38	-

§ 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。本海富通精选证券投资基金是基金管理人管理的第一只公募基金；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和海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金二十只公募基金。

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		
丁俊	本基金的基金经理；海富通精选贰号混合基金经理	2007-08-06	2012-01-20	10年	中国国籍，硕士，持有基金从业人员资格证书。2002年7月至2006年4月就职于平安资产管理公司，曾任权益投资部研究主管，2006年4月加入海富通基金管理有限公司，任海富通精选混合和海富通风格优势股票基金经理助理，2007年8月至2012年1月任海富通精选混合和海富通精选贰号混合基金经理。2012年1月起任海富通基金管理有限公司研究总监。
陈洪	本基金的基金经理；副总经理	2003-08-22	-	20年	中国国籍，硕士，持有基金从业人员资格证书。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通精选混合基金经理，2003年4月至2012年9月任海富通基金管理有限公司投资总监，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金经理，2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金经理，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金经理，2007年4月至2007年8月任海富通精选贰号混合基金经理，2008年6月至2011年2月任海富通中国海外股票(QDII)基金经理。
蒋征	本基金的基金经理；海富通强化回报混合基金经理；海富通精选贰号混合基金经理；投资副总监	2012-01-20	-	15年	工商管理硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中国保险信托投资公司业务经理，嘉实基金管理有限公司丰和基金经理助理，2003年1月至2004年4月任泰和基金经理，2004年8月至2006年5月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选基金经理，2005年12月至2006年5月任基金兴安基金经理。2006年6月加入海富通基金管理有限公司。2006年9月起任海富通强化回报混合基金经理，2007年1月至2009年1月兼任海富通股票基金经理，2007年10月至2013年1月任股票组合管理部总监（2012年1月更名为股票相对收益组合部总监），2009年1月至2012年1月兼任海富通收益增长混合基金经理，2010年9月至2012年1月任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理。2012年1月起任海富通精选混合及海富通精选贰号混合基金经理。2013年1月起任投资副总监。

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

2012年股票市场呈现触底反弹的走势，虽然年初宏观经济、欧债危机和通胀形势均不容乐观，但市场对货币、财政政策放松有一定预期，指数在1-4月大幅上涨。进入5月后，政策放松预期部分落空，加上整体经济形势和上市公司业绩持续走低，市场一路下跌。进入12月后，经过连续几个月的观察，部分经济先行指标如PMI、发电量等数据反映国内经济已进入企稳复苏阶段；新一届政府领导班子上台后对于新型城镇化的发言，更指明了未来一段时期中国经济增长的方向，加上外资借助QFII等通道进入国内市场推高指数，市场连续大幅上涨。上证指数全年累计上涨3.17%，板块方面，房地产、建筑行业、金融服务涨幅领先，而信息技术、纺织服装、文化传播等行业表现较差。

本基金在2012年一月份仓位基本没有发生变化，二月到三月中旬，本基金逐步降低了股票仓位，减持了部分受宏观及经济下滑影响比较大的中小企业股票。三月下旬随着大盘的回调，本基金逐步提高了股票的仓位，并增加了在地产和食品饮料行业上的投资比例。而在二季度本基金则继续大幅度增加了股票资产配置比例，结构上主要增持了非银金融板块个股的配置，并减少了银行股的配置。下半年本基金小幅降低了股票仓位，结构上增加了医药生物、石油化工和交运仓储行业的投资比例，减少了房地产、信息技术和机械设备等行业的投资比例。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为-0.38%，同期基金业绩比较基准收益率为6.14%，基金净值跑输业绩比较基准6.52个百分点，跑输基准的主要原因是：三季度股票仓位过高且四季度银行股配置比例偏低。

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2013年，国际经济形势或将继续有所好转。美国经济稳定复苏，欧元区的最坏时间也已过去，欧债相关市场的情绪将继续缓和、欧元区银行信心也开始恢复，外需好转和金融体系的稳定将给欧元区国家带来经济边际的改善。

而国内方面，中国经济仍然处于复苏的过程中，但经济增长的步伐将渡过一条相对平稳的道路。从经济三驾马车来看，消费在2012年对GDP的贡献近6年来首次超过了投资，我们预计2013年也将稳步提升。此外，进出口或将随着国际经济得转暖继续有所好转，但考虑到目前中国出口占全球的比重已超过10%，进一步上升的空间有限。投资方面，由于地产销售的或超预期和城镇化的不断推进将有超预期的可能。但随着经济的企稳，下半年通胀的压力可能将开始逐渐显现。

从市场表现上看，A股的估值无论是横向比较还是纵向比较均属于相对较低的水平。短期看A股预期修复的行情还在进行之中。但随后市场能否继续转好，则需关注后续的经济复苏力度、通胀水平、企业盈利的改善幅度、经济的结构调整、IPO开闸和大小非减持等情况。

基于上述判断，2013年我们将紧抓经济复苏，紧密跟踪经济复苏的力度和过程中各行业景气情况，重点关注未来一到两个季度环比或同比复苏的周期性行业和公司；我们将基于中长期民生改善的逻辑，开始布局中低端可选消费。同时，顺应新政府的政策走向，深挖政策红利，把握投资机会，不断优化投资组合，力争为投资者带来更好回报。

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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成。

本基金报告期内共进行过二次利润分配，第一次以截止2011年12月31日本基金的可供分配利润为基准，本次分红于2012年3月5日完成权益登记，单位分红金额为0.085元，合计利润分配金额1,231,704,622.51元。第二次以截止2012年10月24日本基金的可供分配利润为基准，本次分红于2012年11月8日完成权益登记，单位分红金额为0.11元，合计利润分配金额1,702,313,607.59元。符合基金合同规定。

§ 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

2012年度，基金托管人在海富通精选证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2012年度，海富通基金管理有限公司在海富通精选证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。个别工作日，托管人发现海富通精选证券投资基金个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。

本报告期内本基金进行了2次收益分配，分配金额为2,934,018,230.10元。

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

2012年度，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通精选证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：海富通精选证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	30,908,694.18	17,432,562.34
结算备付金	748,016,563.14	192,260,946.32
存出保证金	2,250,000.00	2,353,913.63
交易性金融资产	6,567,253,935.09	8,088,695,208.09
其中：股票投资	4,918,855,740.59	5,917,521,716.09
基金投资	-	-
债券投资	1,648,398,194.50	2,171,173,492.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	748,000,177.00	553,191,669.80
应收证券清算款	-	27,286,651.38
应收利息	32,161,465.20	37,971,089.19
应收股利	-	-
应收申购款	174,336,690.92	22,153,262.10
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,302,927,525.53	8,941,345,302.85
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	718,827,832.93	20,964,262.57
应付赎回款	1,318,101.95	1,372,241.32
应付管理人报酬	8,800,136.79	11,555,458.21
应付托管费	1,466,689.47	1,925,909.71
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,945,543.11	4,572,476.33
应交税费	233,987.60	233,987.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,935,611.89	2,267,360.44
负债合计	736,527,903.74	42,891,696.18
所有者权益：		
实收基金	4,968,904,934.27	4,089,499,233.21
未分配利润	2,597,494,687.52	4,808,954,373.46
所有者权益合计	7,566,399,621.79	8,898,453,606.67
负债和所有者权益总计	8,302,927,525.53	8,941,345,302.85

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.4621元，基金份额总额16,374,486,283.50份。

7.2 利润表

会计主体：海富通精选证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	197,373,696.62	-1,701,406,722.37
1.利息收入	74,502,648.72	75,905,442.99
其中：存款利息收入	6,974,171.42	5,718,637.60
债券利息收入	63,627,664.19	61,841,316.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,900,813.11	8,345,488.50
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-293,548,306.78	-202,287,023.26
其中：股票投资收益	-379,569,843.69	-271,242,937.33
基金投资收益	-	-
债券投资收益	14,004,928.45	-3,450,974.67
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	72,016,608.46	72,406,888.74
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	415,392,616.56	-1,575,357,520.39
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,026,738.12	332,378.29
减：二、费用	171,286,752.50	204,383,285.43
1.管理人报酬	119,551,905.40	144,699,914.15
2.托管费	19,925,317.58	24,116,652.29
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	30,884,180.41	34,982,065.48
5.利息支出	450,180.61	19,636.94
其中：卖出回购金融资产支出	450,180.61	19,636.94
6.其他费用	475,168.50	565,016.57
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	26,086,944.12	-1,905,790,007.80
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列	26,086,944.12	-1,905,790,007.80

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通精选证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1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)	4,089,499,233.21	4,808,954,373.46	8,898,453,606.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,086,944.12	26,086,944.12
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)	879,405,701.06	696,471,600.04	1,575,877,301.10
其中：1.基金申购款	2,518,858,614.77	2,081,691,103.06	4,600,549,717.83
2.基金赎回款	-1,639,452,913.71	-1,385,219,503.02	-3,024,672,416.73
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)	-	-2,934,018,230.10	-2,934,018,230.10
五、期末所有者权益(基金净值)	4,968,904,934.27	2,597,494,687.52	7,566,399,621.79
项目	上年度可比期间 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)	2,900,342,682.00	6,160,432,929.82	9,060,775,611.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,905,790,007.80	-1,905,790,007.80
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)	1,189,156,551.21	2,309,061,757.20	3,498,218,308.41
其中：1.基金申购款	1,609,082,299.62	3,063,726,367.71	4,672,808,667.33
2.基金赎回款	-419,925,748.41	-754,664,610.51	-1,174,590,358.92
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)	-	-1,754,750,305.76	-1,754,750,305.76
五、期末所有者权益(基金净值)	4,089,499,233.21	4,808,954,373.46	8,898,453,606.67

报告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

海富通精选证券投资基金（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”）证监基金字〔2003〕第85号《关于同意海富通精选证券投资基金设立的批复》核准，由海富通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《海富通精选证券投资基金基金契约》（后更名为《海富通精选证券投资基金基金合同》）发起，并于2003年8月22日募集成立。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3,698,432,268.39元，已经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字（2003）第110号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通精选证券投资基金招募说明书》和《关于对海富通精选基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定，本基金于2007年7月4日进行了基金份额拆分，拆分比例为1:3.295543296，并于2007年7月5日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通精选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，包括国内依法上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：股票投资50%-80%，债券投资20%-50%，权证投资0%-3%，并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：MSCI China A指数X65%+上证国债指数X35%。

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2013年3月22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》、《海富通精选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2012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2012年12月31日的财务状况以及2012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

本基金报告期内无会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金报告期内无会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金报告期内无重大会计差错。

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〔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)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，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。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。

(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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	4,739,091,400.32	23.82%	3,002,476,566.44	13.01%

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 2012年1月1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	4,023,113.45	24.04%	105,162.63	2.68%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	2,512,013.67	13.02%	222,890.05	4.89%

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	119,551,905.40	144,699,914.15
其中：支付销售机构的客户维护费	15,292,461.98	20,982,826.43

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1.5%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 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	19,925,317.58	24,116,652.29

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 0.25% / 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	424,869,760.24	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	-	-	-	30,400,000.00	11,859.19

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

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
期初持有的基金份额	30,195,269.25	30,195,269.25
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	30,195,269.25	30,195,269.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%	0.22%

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
交通银行	30,908,694.18	2,480,971.44	17,432,562.34	2,849,919.82

注：1.本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2012年12月31日的相关余额在资产负债表中的结算备付金科目中单独列示（2011年12月31日：同）。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
				基金在承销期内买入	
				数量(单位：股/张)	总金额
海通证券	113003	重工转债	老股东配债	1,278,650	127,865,000.00
海通证券	113003	重工转债	首次公开发行	183,720	18,372,000.00
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
				基金在承销期内买入	
				数量(单位：股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

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（2012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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600863	内蒙华电	2012-03-21	2013-03-21	非公开发行	7.76	7.50	24,000,000	186,240,000.00	180,000,000.00	-
002029	七匹狼	2012-06-26	2013-06-27	非公开发行	23.00	18.88	3,500,000	80,500,000.00	66,080,000.00	-
002014	永新股份	2012-07-11	2013-07-12	非公开发行	13.89	9.66	5,050,000	70,144,500.00	48,783,000.00	-
002014	永新股份	-	2013-07-12	非公开发行转增	-	9.66	2,525,000	-	24,391,500.00	-

注：基金作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2012-12-26	重大事项	10.12	2013-01-21	11.13	5,140,765	41,898,471.18	52,024,541.80	-
600780	通宝能源	2012-01-18	重大事项	6.70	-	-	1,362,131	9,045,473.59	9,126,277.70	-

注：本基金截至2012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2012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4,799,127,615.59元，属于第二层级的余额为1,768,126,319.50元，无属于第三层级的余额（2011年12月31日：第一层级6,029,845,208.09元，第二层级2,058,850,000.00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

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具（2011年12月31日：同）。本基金本期无第三层次公允价值变动（2011年度：净转入/（转出）第三层级的金额为零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动的金额为零元，涉及河南双汇投资发展股份有限公司发行的股票）。

(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	4,918,855,740.59	59.24
	其中：股票	4,918,855,740.59	59.24
2	固定收益投资	1,648,398,194.50	19.85
	其中：债券	1,648,398,194.50	19.85
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	748,000,177.00	9.01
	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	778,925,257.32	9.38
6	其他各项资产	208,748,156.12	2.51
7	合计	8,302,927,525.53	100.00

8.2 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	76,845,491.76	1.02
B	采掘业	194,714,923.04	2.57
C	制造业	1,657,946,127.45	21.91
C0	食品、饮料	237,753,183.80	3.14
C1	纺织、服装、皮毛	66,080,000.00	0.87
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,664,961.30	0.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	507,127,133.70	6.70
C5	电子	80,740,011.96	1.07
C6	金属、非金属	32,253,412.32	0.43
C7	机械、设备、仪表	473,365,848.13	6.26
C8	医药、生物制品	256,961,576.24	3.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	345,156,933.68	4.56
E	建筑业	250,466,135.36	3.31
F	交通运输、仓储业	337,563,054.02	4.46
G	信息技术业	359,063,822.52	4.75
H	批发和零售贸易	650,499,644.71	8.60
I	金融、保险业	710,769,968.57	9.39
J	房地产业	167,026,724.06	2.21
K	社会服务业	167,735,395.42	2.22
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,067,520.00	0.01
	合计	4,918,855,740.59	65.01

8.3 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	600153	建发股份	68,340,901	480,436,534.03	6.35
2	600519	贵州茅台	952,715	199,136,489.30	2.63
3	600028	中国石化	28,049,212	194,100,547.04	2.57
4	600863	内蒙华电	24,000,000	180,000,000.00	2.38
5	600030	中信证券	12,980,381	173,417,890.16	2.29
6	601318	中国平安	3,671,056	166,262,126.24	2.20
7	000525	红太阳	13,187,235	154,950,011.25	2.05
8	601333	广深铁路	50,751,519	148,194,435.48	1.96
9	601989	中国重工	26,130,873	124,644,264.21	1.65
10	300079	数码视讯	7,408,123	121,937,704.58	1.61

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	369,060,184.24	4.15
2	601318	中国平安	353,642,502.35	3.97
3	002024	苏宁电器	309,358,369.08	3.48
4	600153	建发股份	267,954,355.22	3.01
5	600519	贵州茅台	235,786,540.67	2.65
6	601668	中国建筑	188,925,140.98	2.12
7	600863	内蒙华电	186,240,000.00	2.09
8	600000	浦发银行	180,909,620.58	2.03
9	002029	七匹狼	164,172,832.14	1.84
10	000581	威孚高科	152,047,575.13	1.71
11	600011	华能国际	131,094,988.72	1.47
12	600028	中国石化	113,641,672.90	1.28
13	600036	招商银行	110,204,284.94	1.24
14	600271	航天信息	109,620,465.44	1.23
15	600104	上汽集团	108,099,166.64	1.21
16	601628	中国人寿	102,247,155.76	1.15
17	601669	中国水电	98,555,411.39	1.11
18	600048	保利地产	97,055,199.12	1.09
19	600015	华夏银行	92,153,709.03	1.04
20	000528	柳工	91,288,811.35	1.03

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	600016	民生银行	598,021,582.92	6.72
2	600048	保利地产	468,691,439.63	5.27
3	000002	万科A	430,476,680.40	4.84
4	600406	国电南瑞	374,803,316.36	4.21
5	600519	贵州茅台	323,030,523.15	3.63
6	601989	中国重工	250,854,856.94	2.82
7	600153	建发股份	186,776,624.84	2.10
8	600030	中信证券	184,534,017.37	2.07
9	002236	大华股份	183,087,382.61	2.06
10	601318	中国平安	181,073,604.14	2.03
11	600827	友谊股份	158,664,123.31	1.78
12	002024	苏宁电器	152,177,784.87	1.71
13	600015	华夏银行	138,881,074.66	1.56
14	601117	中国化学	129,442,691.17	1.45
15	000568	泸州老窖	126,917,869.98	1.43
16	600027	华电国际	126,541,950.68	1.42
17	002025	航天电器	119,576,654.51	1.34
18	002261	拓维信息	119,239,036.40	1.34
19	300101	国腾电子	111,830,238.45	1.26
20	600000	浦发银行	107,078,964.23	1.20

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	9,611,540,121.96
卖出股票的收入(成交)总额	10,649,656,922.55

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	188,697,000.00	2.49
2	央行票据	99,960,000.00	1.32
3	金融债券	1,287,761,000.00	17.02
	其中：政策性金融债	1,287,761,000.00	17.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	71,980,194.50	0.95
8	其他	-	-
9	合计	1,648,398,194.50	21.79

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	030201	03国开01	3,500,000	349,965,000.00	4.63
2	110257	11国开57	2,000,000	201,420,000.00	2.66
3	110224	11国开24	2,000,000	200,520,000.00	2.65
4	120409	12农发09	2,000,000	199,020,000.00	2.63
5	020052	12贴债02	1,900,000	186,200,000.00	2.46

1.7 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。

1.8 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。

1.9 投资组合报告附注

8.9.1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。

8.9.2 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	2,250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,161,465.20
5	应收申购款	174,336,690.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	208,748,156.12

8.9.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	71,980,194.50	0.95

8.9.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600863	内蒙华电	180,000,000.00	2.38	非公开发行

§ 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
303,167	54,011.44	8,144,767,125.30	49.74%	8,229,719,158.20	50.26%

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	124,641.39	0.0008%

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(2003年8月22日)基金份额总额	3,698,432,268.39
本报告期期初基金份额总额	13,476,623,864.16
本报告期基金总申购份额	8,300,622,520.86
减：本报告期基金总赎回份额	5,402,760,101.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	16,374,486,283.50

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

2012年9月10日，余毓繁先生因工作调动辞去监事职务，公司股东会聘请谷若鸿（Mr. Laurent couraudon）先生继任监事职务。

报告期内，基金托管人交通银行于2012年5月28日公布了《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》，交通银行资产托管部原总经理谷娜莎同志不再担任资产托管部总经理职务。资产托管部总经理职务由刘树军同志担任。具体内容请参阅在2012年5月30日《上海证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》。

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135,000元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是10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、托管人的托管业务部门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	
海通证券	2	4,739,091,400.32	23.82%	4,023,113.45	24.04%	-
中信建投	1	2,201,806,009.45	11.07%	1,952,918.56	11.67%	-
国元证券	2	1,833,850,465.32	9.22%	1,608,488.76	9.61%	-
东方证券	2	1,842,733,521.59	9.26%	1,529,808.99	9.14%	-
江海证券	1	1,676,351,626.94	8.43%	1,167,173.24	6.98%	-
华创证券	1	1,531,605,725.61	7.70%	1,278,199.65	7.64%	-
国泰君安	2	1,500,753,927.49	7.54%	1,269,919.63	7.59%	-
申银万国	1	569,322,252.21	2.86%	487,430.67	2.91%	-
中信证券	1	1,194,297,708.16	6.00%	1,010,712.53	6.04%	-
华泰证券	1	1,032,049,572.64	5.19%	879,993.61	5.26%	-
长江证券	1	734,666,276.23	3.69%	650,259.19	3.89%	-
兴业证券	1	448,524,616.17	2.25%	383,634.70	2.29%	-
光大证券	1	338,477,748.93	1.70%	278,455.04	1.66%	-
招商证券	1	209,738,360.65	1.05%	178,104.31	1.06%	-
国金证券	1	42,927,819.16	0.22%	34,878.88	0.21%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增江海证券一个交易单元，退租广发证券1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
海通证券	709,032,476.82	31.04%	2,300,000,000.00	41.46%	-	-
中信建投	942,744,275.50	41.28%	2,537,600,000.00	45.74%	-	-
国元证券	154,778,714.90	6.78%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	119,990,000.00	5.25%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	120,144,000.00	5.26%	710,000,000.00	12.80%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	137,928,618.90	6.04%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	99,430,000.00	4.35%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

§ 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21只公募基金。截至2012年12月31日，海富通管理的公募基金资产规模近343亿元人民币。

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2012年12月31日，海富通为70多家企业超过207亿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2012年12月31日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过37亿元。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2012年12月31日，投资咨询及海外业务规模超过218亿元人民币。

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。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。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。

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，并与“壹基金”合作参与救助孤儿公益项目。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
二〇一三年三月二十七日