

2011 年度報告摘要

票型证券投资基金

度 报 告 摘 要

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			
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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、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、基金代销机构			

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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	4,793,718,120.65	16.46%	3,978,828,503.99	9.44%

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 应付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	4,004,089.52	16.50%	772,784.97	16.91%

关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	3,301,456.86	9.34%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费和经手费后的净额列示。

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		单位:人民币元	
7.4.8.2.1基金管理费			
项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 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	78,153,457.61	120,024,147.22	
注:支付给基金管理人的管理费	8,308,906.62	10,645,502.85	
其中:支付基金管理人海富通基金管理有限公司的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: 日管理费=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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 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	13,025,576.22	20,004,024.60	
注:支付给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0.25%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	
本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
银行间市场交易对手	债券交易金额	基金回购额	基金应回购

关联方名称	基金买入	基金卖出	未实现损益	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间						
2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 关联方名称	债券买入	债券卖出	债券回购	未实现损益	基金正回购	基金正回购
中国建设银行	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
			250,000,000.00	18,659.11		
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						
本基金本报告期未运用固有资金投资本基金。						
7.4.8.4.2报告期内除基金管理人以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以外的其他关联方未投资本基金。						
7.4.8.4.3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			上年度可比期间		
	2011年1月1日至2011年12月31日	2011年12月31日		2010年1月1日至2010年12月31日	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	
中国建设银行	181,980,386.94	3,422,423.39		309,167,610.00	5,107,466.24	
注：本基金的银行存款由参与关联方中国建设银行保管，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						
金额单位：人民币元						

本期 2011年1月1日至2011年12月31日									
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入					
				数量(单位、股/张)	总金额				
海通证券	002595	豪迈科技	首次公开发行	3,500,000	84,000,000.00				
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日									
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入					
				数量(单位、股/张)	总金额				
海通证券	115001	中行转债	首次公开发行	945,575	94,575,000.00				
7.4.8因其他关联交易事项而买入 本基金本报告期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因认购新增发行证券而期末未售出的流通受限证券						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	买入日期	可流通 日期	限售原因 或锁定期	认购价 值(元)	期末 公允价值 (单位、股)	期末 估值总额	期末 公允价值	备注
001336	华信股份	2011-12-20	2012-01-01	非限售股 自愿锁定	23.25	27.87	40,596.00	487,390.56	
注：基金可使用以基金名义开户的股票融资融券账户进行证券交易，选择不约定购回方式进行的融券交易，融券期间									

为一般法人或机构投资者购入的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市日的约定期前或上市当日,基金作为个人投资者参与网上认购协议的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自售转让。

7.4.9 因申购赎回的暂时停牌等流通受限股票

7.4.9.1 基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票

7.4.9.2 基金本报告期末无停牌期间作为市场价值公允价值为抵押的债券

7.4.9.3 银行间市场债券正回购

7.4.9.3.1 基金本报告期末无在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

7.4.9.3.2.1 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债权,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

(c)金融工具公允价值计量方法

根据在公允价值计量中计量属性具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级划分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场中的未经调整的报价。

第二层级:直接(比如敞口或间接)比如根据价格折扣的)可观察到的、除第一层级的市场报价之外。

(五)第三层次：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）

6. 本期末公允价值计量，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为2,926,798,558.12元，第二层次余额为96,060,000.00元，第三层次余额为0元；2010年12月31日：第一层次余额6,524,200,035.55元，第二层次481,830,539.24元，无属于第三层次的余额。

6. 公允价值所属层级的重大的变动

对于证券交易所上市的交易品种而言，若出现重大事件停牌、交易不活跃、包括活跃期间的交易不活跃、停牌期间交易不活跃等情形，本基金于停牌日将股票公允价值调整为停牌前最后一个交易日收盘价格，并将公允价值计入公允价值第二层次；非活跃期间交易中采用的不可观察参数对于公允价值的影响程度，确定相关金融资产和债券公允价值应归属第二层级或第三层级。

6. 第三层次公允价值金额和重大变动原因

截至本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 2010年12月31日：同无。本基金本期净亏损 2,342,000,000.00元，其中公允价值变动损益 2010年度：同无，涉及海内投资发展股份有限公司“旭光发展”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披露的其他重要事项

S 级投资组合报告

8.1 本期权益类资产组合情况

金额单位：人民币元
占基金总资产的比例

序号	项目	金额	比例(%)
----	----	----	-------

1	权益投资	2,846,879,067.81	78.52
	其中：股票	2,846,879,067.81	78.52
2	固定收益投资	176,790,490.40	4.88
	其中：债券	176,790,490.40	4.88
	资产支持证券	-	-
	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	403,201,004.80	11.12
	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	191,859,309.51	5.29
6	其他各项资产	7,139,397.89	0.20
7	合计	3,625,869,270.41	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	97,352,801.74	2.77
B	采矿业	24,491,250.00	0.70
C	制造业	901,669,582.08	25.70
D	食品、饮料	335,383,341.27	9.71

C1	纺织、服装、皮毛	52,757,403.20	1.50
C2	木材、家具	--	--
C3	造纸、印刷	--	--
C4	石油、化学、塑胶、塑料	139,382,224.69	3.97
C5	电子	107,081,156.45	3.05
C6	金属、非金属	68,109,444.38	1.94
C7	机械、设备、仪表	225,177,214.47	6.42
C8	医药、生物制品	37,728,495.02	1.08
C99	其他制造业	36,050,302.33	1.03
D	电力、燃气及水的生产和供应业	161,101,112.17	4.59
E	建筑业	--	--
F	交通运输、仓储业	169,884,971.88	4.84
G	信息技术业	471,951,687.60	13.45
H	批发和零售贸易	256,342,319.77	7.31
I	金融、保险业	362,855,647.47	10.34
J	房地产业	289,922,263.86	8.26
K	社会服务业	111,307,431.24	3.17

L	传播与文化产业			-
M	综合类			-
	合计		2,846,879,067.81	81.14
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	600406	国南瑞	7,851,435	244,964,772.00
2	600016	民生银行	30,416,234	179,151,618.26
3	600153	建安股份	27,885,079	177,906,804.02
4	601333	广深铁路	43,122,273	151,790,400.96
5	600015	华夏银行	9,991,763	112,207,498.49
6	601989	中国重工	21,913,085	111,975,864.35
7	000002	万科A	9,953,514	74,352,749.58
8	600019	贵州茅台	370,023	71,521,000.00
9	600109	南京银行	7,651,847	71,009,149.40
10	000568	泸州老窖	1,672,778	65,751,616.46

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				金额单位：人民币元
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				占期初基金资产净值比例(%)
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	
1	600036	招商银行	325,079,860.75	4.40
2	600016	民生银行	266,699,063.48	3.61
3	600153	建发股份	261,979,458.78	3.55
4	600028	中国石化	231,197,114.50	3.13
5	600309	烟台万华	213,754,790.57	2.89
6	600068	岳阳兴化	91,880,627.40	1.26
7	600160	中国太保	176,722,218.08	2.39
8	600048	浦发银行	175,885,627.64	2.38
9	601333	广深铁路	167,148,950.16	2.26
10	000041	粤东水泥	164,863,022.50	2.23
11	600058	康美药业	159,949,692.76	2.17
12	000012	万科A	148,007,419.62	2.00
13	600519	贵州茅台	147,952,182.20	2.00
14	601009	南京银行	142,755,607.10	1.93

15	000937	冀中能源	133,331,111.33	1.80
16	601989	中国重工	128,340,749.71	1.74
17	600770	综艺股份	127,665,900.95	1.73
18	000402	金 融 街	126,825,959.62	1.72
19	600058	五矿发展	123,851,885.03	1.68
20	000932	华菱钢铁	123,350,768.10	1.67

注：卖出金额=卖出成交金额-成交价款以成交数量×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			13,251,153,336.76
卖出股票的收入(成交)总额			16,029,091,652.45
注：买入股票成本、“卖出股票收入”均按买卖成交金额-成交价款以成交数量×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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	96,680,000.00	2.76
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	80,110,490.40	2.28
8	其他	-	-

2	应收证券清算款			
3	应收股利			
4	应收利息			2,212,767.09
5	应收申购款			163,736.73
6	其他应收款			
7	待摊费用			
8	其他			
9	合计			7,139,397.89
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	110015	石化转债	80,110,490.40	2.28
8.9.5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。				
§ 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	
			持有人结构	
持有人户数(户)	户均持有的基金份额	个人投资者		
		机构投资者		
		持有份额	占总份额比例	持有份额
				占总份额

2017年8月19日，董文钊因工作原因自本公司独立承担职务，聘任李明为可明科技主任会计师。

■ 本基金管理人2011年2月29日发布公告，经中国建设银行股份有限公司、聘任杨新主为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会核准注册。证监许可[2011]115号，聘任李树军为中国建设银行投资托管服务部总经理职务。中国证监会于2011年3月31日发布任免通知，聘任李树军为中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人2011年6月24日发布任命通知聘任张红军为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

11.3及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼
报告期无基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4基金投资策略的变化
报告期内本基金投资策略未发生变化。

11.5基金支付给审计的会计师事务所情况
报告期内，本基金未聘请为其审计的会计师事务所，本年度应支付的审计费用是127,000.00元。目前事务所已提前将审计费的年度标准报过。

11.6管理人、托管人及其他高级管理人员受调查或处罚等情况
没有基金管理人的、托管人及其高级管理人员报告期内不受监管部门稽查或处罚的情况。

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和佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交量比例	占当期股票成交金额比例
			佣金	佣金

郑海霞	444,748,721.03	1.87%	643,033.62	1.91%
栾建伟	538,912,971.77	1.85%	37,869.36	1.80%
曹国君安	402,692,520.16	1.38%	34,288.45	1.41%
申银万国	388,725,437.30	1.33%	430,414.64	1.36%
上海证券	362,623,010.44	1.24%	38,226.89	1.27%
国信证券	227,184,437.23	0.78%	193,105.91	0.80%
海通证券	215,320,015.80	0.74%	131,884.05	0.54%
东海证券				

注：本基金本报告期间新增和调减了上述证券共 1 个和组合券 2 个。交易单元的选择不按本基金的管理人对于证券公司的综合实力及声誉评价、研究水平及综合服务及投资者评价三个部分进行打分，进行主观性评价，仅就证券的评分，形成证券公司排名及交易单元和组合券使用。

（四）交易单元的选举和评价。本基金的资产管理部门根据《基金资产管理部门证券交易单元的选择和评价办法》的规定，进行客观性的选择。

① 推荐。投资部负责人推荐，经投资交易部门会议讨论，形成证券评价的备选池，从中进行选择。原则上，各备选池的证券公司不得超过 3 个最后择定不超过 200%。

② 甄选。由投资部全体业务人员投票（回避 利益冲突）根据《基金资产管理部门证券交易单元选择系统》的规定，进行主观性、独立的评价，形成候选证券排名及交易单元和组合券使用。并报公司总裁或副总裁审批。

③ 核准。在完成对证券公司的初步评价、甄选和审核后，由基金管理人总裁或副总裁核准。

11.7.2 基金使用证券公司交易单元用于其他非基金投资的情况

金额单位：人民币元

招商证券	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-
招商证券	65,590,625.50	8.14%	-	-
国泰君安	-	-	-	-
银华基金	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-

§ 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2008年1月开始,海富通先后募集成立120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接近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

工作的需要,胡清涛先生已向中国建设银行股份有限公司(“本行”)董事会(“董事会”)提出辞呈,请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定,胡清涛先生的辞任自董事会议决通过之日起生效。

2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

海富通基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日

19	000038	华资控股	123,551,585.05	1.68
20	600932	华夏银行	123,350,768.10	1.67

海富通基金管理有限公司
二〇一三年三月二十九日