

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：二〇一四年八月二十九日  
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。本基金半年度报告已经三分之二以上独立董事签署同意，并由董事长签发。

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2014年8月29日复核了本报吿中的财务指标、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，保证复核后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，基金过往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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

## 2基金简介

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 基金名称       | 海富通中证100指数证券投资基金(LOF) |
| 场内简称       | 海富100                 |
| 基金代码       | 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9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            |
| 报告期末基金份额总额 | 679,976,024.48份       |
| 基金份额净值     | 不定价                   |
| 基金上市的证券交易所 | 深圳证券交易所               |
| 上市日期       | 2010年8月8日             |

## 2.1基本情况

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 采用指数化投资方法，通过有效的投资操作和数量化风险管理手段，力争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   | 本基金将投资于股票市场，按照行业配置比例，投资于中证100指数成分股，同时适当配置于其他股票，以期在有效控制风险的前提下，获得超越业绩比较基准的收益。 |
| 业绩基准   | 中证100指数*95%+活期存款利率(税后)*5%   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高收益的证券投资品种。   |

## 2.2基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 采用指数化投资方法，通过有效的投资操作和数量化风险管理手段，力争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   | 本基金将投资于股票市场，按照行业配置比例，投资于中证100指数成分股，同时适当配置于其他股票，以期在有效控制风险的前提下，获得超越业绩比较基准的收益。 |
| 业绩基准   | 中证100指数*95%+活期存款利率(税后)*5%   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高收益的证券投资品种。   |

## 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      | 中国银行股份有限公司           |
| 法定代表人   | 奚东来              | 王永庆                  |
| 信息披露负责人 | 奚东来              | 王永庆                  |
| 联系电话    | 021-38650981     | 010-65948986         |
| 电子邮箱    | wxsl@hfzfund.com | fxsl@bankofchina.com |
| 客户服务电话  | 40088-40999      | 95566                |
| 传真      | 021-33830166     | 010-65949442         |

## 2.4费用披露方式

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 基金管理人年度报告正式的管理人互联网网址 | http://www.hffund.com |
| 基金管理人报告备查地点          | 基金管理人及基金托管人的住所        |

## 3主要财务指标和基金净值表现

| 金额单位：人民币元                 |                 |
|---------------------------|-----------------|
| 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日) |                 |
| 本期已实现收益                   | -22,981,454.93  |
| 减：本期利润                    | -32,132,037.42  |
| 加权平均基金份额本期利润              | -0.0445         |
| 本期末基金资产净值增长率              | -6.20%          |
| 3.1.2期末净资产和基金份额           | 报告期(2014年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润              | -0.0351         |
| 期末基金资产净值                  | 431,363,403.40  |
| 期末基金资产净值                  | 0.635           |

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公允价值变动收益。

2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算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，不是当年发生数)。

3.2基金净值表现

## 3.2.1基金份额净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段               | 份额净值增长<br>率(%) | 份额净值增长<br>率标准差(%) | 业绩比较基<br>准收益率(%) | 业绩比较基<br>准收益率标准差(%) | ①-③    | ②-④    |
|------------------|----------------|-------------------|------------------|---------------------|--------|--------|
| 过去一个月            | 0.79%          | 0.75%             | -0.21%           | 0.73%               | 1.00%  | 0.02%  |
| 过去三个月            | 1.93%          | 0.87%             | 0.86%            | 1.18%               | 0.01%  |        |
| 过去六个月            | -6.20%         | 0.99%             | -1.13%           | 0.93%               | 0.00%  |        |
| 过去一年             | -3.01%         | 1.13%             | -4.22%           | 1.15%               | 2.21%  | -0.02% |
| 过去三年             | -24.46%        | 1.22%             | -27.72%          | 1.23%               | 3.32%  | -0.01% |
| 自基金合同生<br>效之日起至今 | -35.50%        | 1.29%             | -36.00%          | 1.30%               | -0.50% | -0.01% |

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公允价值变动收益。

2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算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，不是当年发生数)。

3.2.2基金净值表现

## 3.2.1基金份额净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段               | 份额净值增长<br>率(%) | 份额净值增长<br>率标准差(%) | 业绩比较基<br>准收益率(%) | 业绩比较基<br>准收益率标准差(%) | ①-③    | ②-④    |
|------------------|----------------|-------------------|------------------|---------------------|--------|--------|
| 过去一个月            | 0.79%          | 0.75%             | -0.21%           | 0.73%               | 1.00%  | 0.02%  |
| 过去三个月            | 1.93%          | 0.87%             | 0.86%            | 1.18%               | 0.01%  |        |
| 过去六个月            | -6.20%         | 0.99%             | -1.13%           | 0.93%               | 0.00%  |        |
| 过去一年             | -3.01%         | 1.13%             | -4.22%           | 1.15%               | 2.21%  | -0.02% |
| 过去三年             | -24.46%        | 1.22%             | -27.72%          | 1.23%               | 3.32%  | -0.01% |
| 自基金合同生<br>效之日起至今 | -35.50%        | 1.29%             | -36.00%          | 1.30%               | -0.50% | -0.01% |

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公允价值变动收益。

2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算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，不是当年发生数)。

3.2.3基金净值表现

## 3.2.1基金份额净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段               | 份额净值增长<br>率(%) | 份额净值增长<br>率标准差(%) | 业绩比较基<br>准收益率(%) | 业绩比较基<br>准收益率标准差(%) | ①-③    | ②-④    |
|------------------|----------------|-------------------|------------------|---------------------|--------|--------|
| 过去一个月            | 0.79%          | 0.75%             | -0.21%           | 0.73%               | 1.00%  | 0.02%  |
| 过去三个月            | 1.93%          | 0.87%             | 0.86%            | 1.18%               | 0.01%  |        |
| 过去六个月            | -6.20%         | 0.99%             | -1.13%           | 0.93%               | 0.00%  |        |
| 过去一年             | -3.01%         | 1.13%             | -4.22%           | 1.15%               | 2.21%  | -0.02% |
| 过去三年             | -24.46%        | 1.22%             | -27.72%          | 1.23%               | 3.32%  | -0.01% |
| 自基金合同生<br>效之日起至今 | -35.50%        | 1.29%             | -36.00%          | 1.30%               | -0.50% | -0.01% |

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公允价值变动收益。

2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计算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，不是当年发生数)。

3.2.4基金净值表现

## 3.2.1基金份额净值增长率为及与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 份额净值增长<br>率(%) | 份额净值增长<br>率标准差(%) | 业绩比较基<br>准收益率(%) | 业绩比较基<br>准收益率标准差(%) | ①-③   | ②-④    |
|-------|----------------|-------------------|------------------|---------------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.79%          | 0.75%             | -0.21%           | 0.73%               | 1.00% | 0.02%  |
| 过去三个月 | 1.93%          | 0.87%             | 0.86%            | 1.18%               | 0.01% |        |
| 过去六个月 | -6.20%         | 0.99%             | -1.13%           | 0.93%               | 0.00% |        |
| 过去一年  | -3.01%         | 1.13%             | -4.22%           | 1.15%               | 2.21% | -0.02% |
| 过去三年  | -24.46%        | 1.22%             | -27.72%          | 1.23                |       |        |