

# 海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

## 2011 年第 3 季度报告

2011 年 9 月 30 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：二〇一一年十月二十四日

## § 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 2011 年 10 月 21 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	海富通中证100 指数 (LOF)
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	1,787,816,017.28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7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-18,873,582.93
2.本期利润	-223,717,868.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1199
4.期末基金资产净值	1,284,844,851.14
5.期末基金份额净值	0.719

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

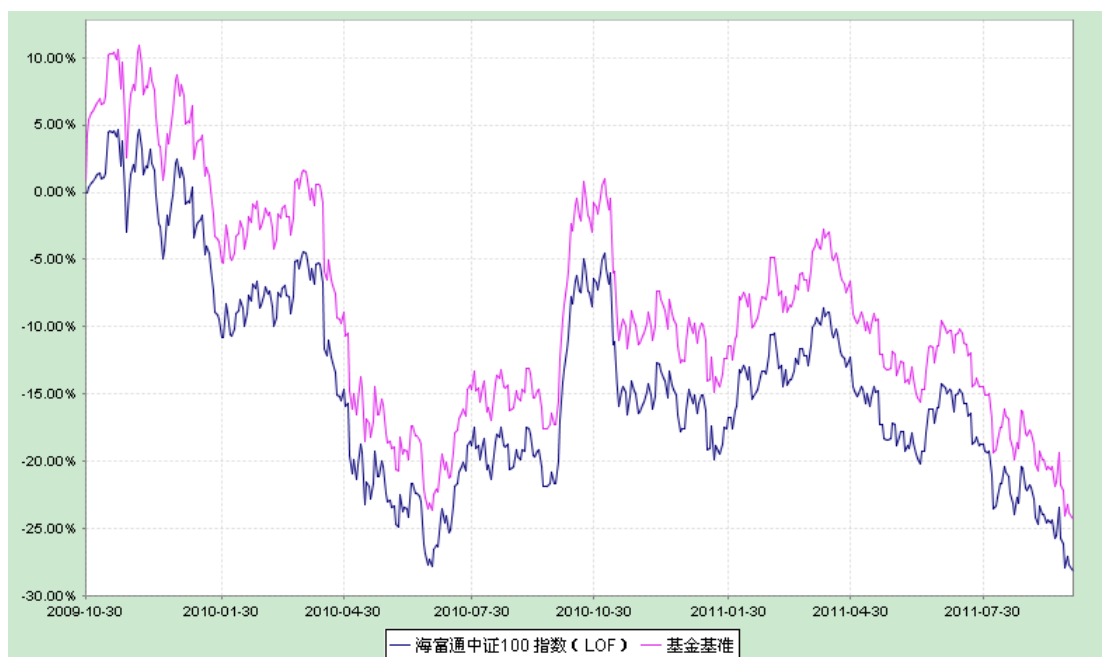
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.40%	1.25%	-14.48%	1.24%	0.08%	0.01%

### 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 9 月 30 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	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

	格优势股票基金基金经理			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合规守信情况的说明

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。中国证监会于 2008 年 3 月 20 日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司根据该指导意见的具体要求，已完善现有的业务流程，建立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

2011 年第三季度在内外不利因素的共同作用下，A 股市场的表现令投资者失望。欧

债危机进一步恶化,以及美国经济增长放缓,使得欧美股市出现了大幅波动,而国内通胀居高不下,紧缩调控政策并没有如期放松,存款准备金基数扩大等打击了投资者的热情。在外需减弱,投资放缓,成本上升等各种严峻挑战下,企业盈利也出现了下降。从行业板块表现来看,房地产、钢铁、有色、金融等周期性行业跌幅居前,消费等防御类行业表现略好。

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-14.40%,同期基金业绩比较基准收益率为-14.48%,日均跟踪偏离度的绝对值为 0.0015%,年化跟踪误差为 0.78%,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

展望四季度,美国经济在经过数月回落后开始企稳。欧债的风险救助框架正在形成,但其进展较缓,仍有较大不确定性存在。希腊违约问题仍将是短期内扰动市场的重要变量。就国内而言,欧债危机对中国出口的打击可能会和房地产投资滞后性回落出现叠加,导致中国经济在四季度继续下滑。与此同时,由于通胀压力的慢慢减缓,四季度的信贷规模可能会稍有放松。但鉴于 CPI 仍处高位,政策转向的可能性很小,大幅度的放松概率较低。对于行业而言,由于通胀的缓慢回落,可能会出现量价齐跌的情况,从而促使上市公司盈利预期下滑的担忧继续演绎。因此,四季度股市将依然面临着宏观环境和资金环境偏紧的问题,系统性的投资机会可能不大,但结构性的投资机会依然存在。在板块上我们认为,四季度国家产业政策支持领域依然有望成为市场的热点,与民生消费相关的行业领域也可能会受到市场的青睐。

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	1,217,666,912.21	94.61
	其中: 股票	1,217,666,912.21	94.61
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	68,417,150.52	5.32
6	其他各项资产	1,007,690.13	0.08
7	合计	1,287,091,752.86	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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	2,459,109.80	0.19
B	采掘业	161,696,427.45	12.58
C	制造业	340,421,316.89	26.50
C0	食品、饮料	89,503,653.84	6.97
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	17,407,980.96	1.35
C5	电子	1,915,507.74	0.15
C6	金属、非金属	76,486,070.22	5.95
C7	机械、设备、仪表	142,799,068.43	11.11
C8	医药、生物制品	12,309,035.70	0.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	22,572,938.83	1.76
E	建筑业	37,071,111.72	2.89
F	交通运输、仓储业	43,831,036.78	3.41
G	信息技术业	28,772,354.14	2.24
H	批发和零售贸易	17,012,917.26	1.32
I	金融、保险业	503,597,078.72	39.20
J	房地产业	49,418,344.01	3.85
K	社会服务业	6,760,326.06	0.53
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,053,950.55	0.32
	合计	1,217,666,912.21	94.77

### 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	5,099,690	56,402,571.40	4.39
2	600030	中信证券	4,861,088	54,687,240.00	4.26



3	600016	民生银行	8,631,935	47,648,281.20	3.71
4	601318	中国平安	1,297,821	43,567,850.97	3.39
5	601328	交通银行	8,877,363	39,770,586.24	3.10
6	601166	兴业银行	3,187,424	39,492,183.36	3.07
7	600000	浦发银行	4,377,231	37,381,552.74	2.91
8	601088	中国神华	1,276,291	32,341,213.94	2.52
9	600519	贵州茅台	158,456	30,200,129.04	2.35
10	000858	五 粮 液	750,300	27,235,890.00	2.12

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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 报告期内中国证监会于2011年4月29日发布《中国证监会行政处罚决定书（五粮液、唐桥等8名责任人员）》，五粮液（000858）因其信息披露违法问题被中国证监会给予警告并处以60万元罚款。

对该股票投资决策程序的说明：该股票根据股票池审批流程后进入本基金备选库，根据核心股票池审批流程后进入本基金管理人核心股票池，由研究员定期跟踪并分析。《中国证监会行政处罚决定书（五粮液、唐桥等8名责任人员）》公布后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和析，认为此事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此，没有改变本基金管理人对该上市公司的投资判断。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	-
3	应收股利	219,336.70
4	应收利息	13,819.58
5	应收申购款	9,409.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.14
8	其他	-
9	合计	1,007,690.13

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## § 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	1,920,800,441.55
本报告期基金总申购份额	19,994,733.78
减：本报告期基金总赎回份额	152,979,158.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,787,816,017.28

## § 7 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 19 只公募基金。截至 2011 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 351 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 9 月 30 日，海富通为 50 多家企业超过 150 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 9 月 30 日，海富通旗下专户理财管理资产规模近 28 亿元。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 9 月 30 日，投资咨询及海外业务规模达 206 亿元人民币。

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

二〇一一年十月二十四日