

**海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)**  
**2015 年半年度报告**  
**2015 年 6 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：二〇一五年八月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告 (未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.3.1 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所有股票投资明细	35
7.3.2 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所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	45
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
10.2 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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>50</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	海富通中证 100 指数 (LOF)
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
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	221,279,676.88 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 1 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

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 $\times 95\%$ + 活期存款利率 (税后) $\times 5\%$
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。

### 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
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566

传真	021-33830166	010-66594942
注册地址	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	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址	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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	张文伟	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	124,761,640.07
本期利润	71,017,071.75
加权平均基金份额本期利润	0.1996
本期加权平均净值利润率	17.02%
本期基金份额净值增长率	16.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	16,186,020.06
期末可供分配基金份额利润	0.0731
期末基金资产净值	280,846,641.72
期末基金份额净值	1.269
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	26.90%

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。

## 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
过去一个月	-6.76%	3.20%	-6.06%	3.22%	-0.70%	-0.02%
过去三个月	8.46%	2.44%	8.02%	2.45%	0.44%	-0.01%
过去六个月	16.64%	2.21%	16.54%	2.22%	0.10%	-0.01%
过去一年	99.84%	1.87%	96.22%	1.86%	3.62%	0.01%
过去三年	76.99%	1.48%	67.28%	1.48%	9.71%	0.00%
自基金合同生效起至今	26.90%	1.42%	25.58%	1.42%	1.32%	0.00%

### 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 2015 年 6 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。截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 32 只公募基金：海富通精选证券投资基金、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、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、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、海富通大中华精选混合型证券投资基金、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、海富通稳进增利债券型证券投资基金 (LOF)、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通现金管理货币市场基



金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双利分级债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
刘瓊	本基金的基金经理；海富通上证周期 ETF 基金经理；海富通上证周期 ETF 联接基金经理；海富通上证非周期 ETF 基金经理；海富通上证非周期 ETF 联接基金经理；海富通中证内地低碳指数基金经理；指数投资部指数投资负责人	2012-01-20	-	14 年	管理学硕士，持有基金从业人员资格证书。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司，曾任华安上证 180ETF 基金经理助理；2007 年 3 月至 2010 年 6 月担任华安上证 180ETF 基金经理，2008 年 4 月至 2010 年 6 月担任华安中国 A 股增强指数基金经理。2010 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2010 年 11 月起任海富通上证周期 ETF 及海富通上证周期 ETF 联接基金经理。2011 年 4 月起任海富通上证非周期 ETF 及海富通上证非周期 ETF 联接基金经理。2012 年 1 月起兼任海富通中证 100 指数 (LOF) 基金经理。2012 年 5 月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。2013 年 10 月起任指数投资部指数投资负责人。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

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。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、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)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,检验结果表明,在 T 日、T+3 日和 T+5 日不同循环期内,不管是买入或是卖出,公司各组合间买卖价差并不显著,表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待,不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

#### 4.3.2 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 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

对于 2015 年上半年市场走势,可以用一句话概括:辛辛苦苦大半年,一月回到半年前。

今年始,大盘从 3258.63 点起步,经过两个多月的横盘整理后,从 3 月中旬开始发力,并于 6 月 12 日拿下 5178.19 高点,创 7 年多新高。期间经历了“5·28”一天 300 多点的跌幅。大盘创下新高后旋即掉头往下,在 6 月份余下的 11 个交易日里跌去 900 点,跌幅近 20%。投资者预设的反弹点位一再被击破,千股跌停局面频现。

政策方面,在暴跌之前,一带一路、自贸区、互联网+、中国制造 2015、京津冀、军工改革、国企改革等题材概念,在国家政策扶持下你方唱罢我登场;资金面上,今年上半年,央行分别进行了 3 次降准和降息,尤其是 6 月 27 日,在市场跌跌不休的情况下,央行送出降息降准双礼包,但市场表现差强人意。

指数方面,虽然经历了 6 月中下旬的暴跌,四大指数涨幅还是喜人。创业板指涨幅

远超主板，为 94.23%，紧随其后的是中小板指，涨幅 69.06%，上证综指和深证成指涨幅与前两个相比相对较小，分别为 32.23% 和 30.17%。创业板、中小板涨幅较好与国家鼓励企业创新转型不无关系。从具体行业里面也可以看出端倪，就中信证券一级行业指数而言，今年上半年，计算机、通信、轻工制造和餐饮旅游等行业翻了一倍，而银行、券商和保险以及传统的煤炭、有色、钢铁等涨幅殿后。

报告期间，本基金完成了年中的指数成份股调整。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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 16.64%，同期业绩比较基准收益率为 16.54%。日均跟踪偏离度的绝对值为 0.0077%，年化跟踪误差为 2.10%，在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，政府预计将延续既有的货币政策和财政政策，一系列已出台的稳增长政策有望在三四季度对经济起到拉动作用，宏观经济将触底企稳。至于 A 股市场，鉴于资金杠杆效应导致了指数的暴涨暴跌，引发市场参与者的深刻反思，也降低了参与者的热情。随着资金杠杆的下降，市场对下半年资金面的乐观判断开始动摇，对市场走势构成制约，同时投资者对于估值和业绩的重新考量也可能触发投资风格的转变。

基于此，下半年 A 股市场预计将出现宽幅振荡格局。但在牛市格局下，类似振荡有望夯实市场基础，为今后上行创造条件，与此同时结构性机会预计将层出不穷。

未来，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。

#### 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

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配:无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体:海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)

第 12 页共 51 页

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	19,702,046.21	49,299,933.55
结算备付金		25,001.76	19,812.00
存出保证金		315,744.70	103,769.53
交易性金融资产	6.4.7.2	263,393,954.37	524,628,802.46
其中：股票投资		263,393,954.37	524,628,802.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,762,773.78	-
应收利息	6.4.7.5	4,010.86	9,446.40
应收股利		-	-
应收申购款		789,358.55	3,764,644.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>285,992,890.23</b>	<b>577,826,408.60</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,521,266.56	18,284,700.53
应付管理人报酬		183,790.98	282,124.41
应付托管费		31,507.02	48,364.20

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	114,966.72	120,994.29
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	294,717.23	390,568.67
负债合计		5,146,248.51	19,126,752.10
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	221,279,676.88	513,595,119.50
未分配利润	6.4.7.10	59,566,964.84	45,104,537.00
所有者权益合计		280,846,641.72	558,699,656.50
负债和所有者权益总计		285,992,890.23	577,826,408.60

注: 报告截止日 2015 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.269 元, 基金份额总额 221,279,676.88 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>73,692,539.99</b>	<b>-29,807,295.57</b>
1.利息收入		105,631.25	123,189.77
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	105,606.72	123,189.77
债券利息收入		24.53	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益 (损失以“-”填列)		127,169,218.99	-20,792,620.08
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	124,456,663.11	-26,359,801.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	119,335.47	-

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,593,220.41	5,567,181.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-53,744,568.32	-9,150,618.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	162,258.07	12,753.23
<b>减：二、费用</b>		<b>2,675,468.24</b>	<b>2,324,777.85</b>
1. 管理人报酬		1,456,096.58	1,592,234.23
2. 托管费		249,616.53	272,954.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	643,529.78	125,976.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	326,225.35	333,612.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>71,017,071.75</b>	<b>-32,132,073.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>71,017,071.75</b>	<b>-32,132,073.42</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	513,595,119.50	45,104,537.00	558,699,656.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	71,017,071.75	71,017,071.75

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)	-292,315,442.62	-56,554,643.91	-348,870,086.53
其中：1.基金申购款	74,552,696.32	12,205,405.48	86,758,101.80
2.基金赎回款	-366,868,138.94	-68,760,049.39	-435,628,188.33
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	221,279,676.88	59,566,964.84	280,846,641.72
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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)	769,199,226.80	-248,245,209.99	520,954,016.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,132,073.42	-32,132,073.42
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)	-89,817,602.32	32,359,062.33	-57,458,539.99
其中：1.基金申购款	13,394,688.86	-4,853,439.12	8,541,249.74
2.基金赎回款	-103,212,291.18	37,212,501.45	-65,999,789.73
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	679,381,624.48	-248,018,221.08	431,363,403.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘颂，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF) (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”)证监许可[2009]第 879 号《关于核准海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准, 由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。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 2,086,432,233.85 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字 (2009)第 226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 10 月 30 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,087,148,875.30 份基金份额, 其中认购资金利息折合 716,641.45 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 205 号文审核同意, 本基金 107,647,812.00 份基金份额于 2010 年 1 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括中证 100 指数成份股及备选成份股、新股(首次公开发行股票或增发)、固定收益产品、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%, 投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%, 现金、固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%, 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为: 中证 100 指数 $\times$ 95%+活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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 2015 年 8 月 27 日批准报出。

### 6.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》和(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》、《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 上半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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 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与最近一期年度报告相一致，本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金报告期内无重大会计差错。

### 6.4.6 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，应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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2015 年 6 月 30 日
活期存款	19,702,046.21
定期存款	-
其他存款	-
合计	19,702,046.21

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	178,812,883.08	263,393,954.37	84,581,071.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	178,812,883.08	263,393,954.37	84,581,071.29

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,871.99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	10.17
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.81
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	127.89
合计	4,010.86

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末其他资产无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	114,966.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	114,966.72

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,445.96
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	238,271.27
合计	294,717.23

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	513,595,119.50	513,595,119.50
本期申购	74,552,696.32	74,552,696.32
本期赎回 (以“-”号填列)	-366,868,138.94	-366,868,138.94
本期末	221,279,676.88	221,279,676.88

注：申购含转换入份额,赎回含转换出份额。截至 2015 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 3,732,629.00 份 (2014 年 12 月 31 日：11,279,653.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 217,547,047.88 份 (2014 年 12 月 31 日：502,315,466.50 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-166,929,771.33	212,034,308.33	45,104,537.00
本期利润	124,761,640.07	-53,744,568.32	71,017,071.75
本期基金份额交易产生的变动数	58,354,151.32	-114,908,795.23	-56,554,643.91
其中：基金申购款	-17,486,469.89	29,691,875.37	12,205,405.48
基金赎回款	75,840,621.21	-144,600,670.60	-68,760,049.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,186,020.06	43,380,944.78	59,566,964.84

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	865.55
其他	1,941.73
合计	105,606.72

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	371,979,343.11
减：卖出股票成本总额	247,522,680.00
买卖股票差价收入	124,456,663.11

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	492,360.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	373,000.00
减：应收利息总额	24.53
买卖债券差价收入	119,335.47

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,593,220.41

基金投资产生的股利收益	-
合计	2,593,220.41

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-53,744,568.32
——股票投资	-53,744,568.32
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-53,744,568.32

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	156,377.88
基金转换费收入	5,880.19
合计	162,258.07

注：1. 本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	643,529.78
银行间市场交易费用	-
合计	643,529.78

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	9,000.00
其他	200.00
上市费	29,752.78
银行划款手续费	8,754.08
指数使用费	100,000.00
合计	326,225.35

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构



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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,456,096.58	1,592,234.23
其中：支付销售机构的客户维护 费	247,115.96	319,486.60

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 0.7% 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 0.7% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	249,616.53	272,954.47

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12% 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 0.12% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年6月30 日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	19,702,046.21	102,799.44	30,665,802.28	122,017.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未通过关联方购买其承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金在本报告期内未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

### 6.4.12.2 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
600886	国投电力	2015-06-24	重大事项	14.87	-	-	126,972	1,533,457.40	1,888,073.64	-
601111	中国国航	2015-06-30	筹划非公开发行股票事项	15.36	2015-07-29	13.78	76,464	649,791.02	1,174,487.04	-
601633	长城汽车	2015-06-19	重大事项	42.76	2015-07-13	38.50	12,756	445,173.47	545,446.56	-
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项	44.35	-	-	16,300	740,874.44	722,905.00	-
600900	长江电力	2015-06-15	资产重组	12.37	-	-	200,062	1,743,798.27	2,474,766.94	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是采用指数化操作的股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制

的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的四层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能

力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	19,702,046.21	-	-	-	19,702,046.21
结算备付金	25,001.76	-	-	-	25,001.76
存出保证金	315,744.70	-	-	-	315,744.70
交易性金融资产	-	-	-	263,393,954.37	263,393,954.37
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,762,773.78	1,762,773.78
应收利息	-	-	-	4,010.86	4,010.86
应收申购款	518,701.30	-	-	270,657.25	789,358.55

<b>资产总计</b>	20,561,493.97	-	-	265,431,396.26	285,992,890.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,521,266.56	4,521,266.56
应付管理人报酬	-	-	-	183,790.98	183,790.98
应付托管费	-	-	-	31,507.02	31,507.02
应付交易费用	-	-	-	114,966.72	114,966.72
其他负债	-	-	-	294,717.23	294,717.23
<b>负债总计</b>				5,146,248.51	5,146,248.51
利率敏感度缺口	20,561,493.97	-	-	260,285,147.75	280,846,641.72
<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1 至 5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	49,299,933.55	-	-	-	49,299,933.55
结算备付金	19,812.00	-	-	-	19,812.00
存出保证金	103,769.53	-	-	-	103,769.53
交易性金融资产	-	-	-	524,628,802.46	524,628,802.46
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,446.40	9,446.40
应收申购款	745.53	-	-	3,763,899.13	3,764,644.66
<b>资产总计</b>	49,424,260.61	-	-	528,402,147.99	577,826,408.60
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	18,284,700.53	18,284,700.53
应付管理人报酬	-	-	-	282,124.41	282,124.41
应付托管费	-	-	-	48,364.20	48,364.20
应付交易费用	-	-	-	120,994.29	120,994.29
其他负债	-	-	-	390,568.67	390,568.67

负债总计	-	-	-	19,126,752.10	19,126,752.10
利率敏感度缺口	49,424,260.61	-	-	509,275,395.89	558,699,656.50

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2014 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。本基金以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	263,393,954.37	93.79	524,628,802.46	93.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	263,393,954.37	93.79	524,628,802.46	93.90

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 1,341	增加约 2,790
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 1,341	减少约 2,790

注：金额为约数,精确到万元。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。



## §7 投资组合报告

## 7.1 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	263,393,954.37	92.10
	其中：股票	263,393,954.37	92.10
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	19,727,047.97	6.90
7	其他各项资产	2,871,887.89	1.00
8	合计	285,992,890.23	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 指数投资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	-	-
B	采矿业	12,437,103.65	4.43
C	制造业	73,766,244.76	26.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,353,092.52	3.69
E	建筑业	13,197,178.71	4.70
F	批发和零售业	2,737,108.80	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	6,497,733.95	2.31

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,572,371.84	1.63
J	金融业	128,855,343.07	45.88
K	房地产业	8,411,984.65	3.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,842,887.42	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	262,671,049.37	93.53

### 7.2.2 积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	722,905.00	0.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	722,905.00	0.26

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

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	601318	中国平安	218,379	17,893,975.26	6.37
2	600030	中信证券	555,895	14,959,134.45	5.33
3	600036	招商银行	727,435	13,617,583.20	4.85
4	601166	兴业银行	569,065	9,816,371.25	3.50
5	600016	民生银行	925,356	9,198,038.64	3.28
6	600000	浦发银行	438,379	7,434,907.84	2.65
7	000651	格力电器	95,156	6,080,468.40	2.17
8	601766	中国中车	296,772	5,448,733.92	1.94
9	601989	中国重工	352,956	5,223,748.80	1.86
10	000002	万科A	338,176	4,910,315.52	1.75
11	601328	交通银行	588,548	4,849,635.52	1.73
12	601668	中国建筑	546,553	4,541,855.43	1.62
13	600519	贵州茅台	17,232	4,439,824.80	1.58
14	601818	光大银行	811,000	4,346,960.00	1.55
15	600887	伊利股份	226,881	4,288,050.90	1.53

16	601398	工商银行	791,908	4,181,274.24	1.49
17	601169	北京银行	285,854	3,807,575.28	1.36
18	601288	农业银行	1,014,413	3,763,472.23	1.34
19	601601	中国太保	122,995	3,711,989.10	1.32
20	601390	中国中铁	246,071	3,368,711.99	1.20
21	601006	大秦铁路	229,959	3,228,624.36	1.15
22	000001	平安银行	213,499	3,104,275.46	1.11
23	601688	华泰证券	121,871	2,818,876.23	1.00
24	000333	美的集团	74,196	2,766,026.88	0.98
25	000166	申万宏源	169,197	2,749,451.25	0.98
26	002024	苏宁云商	178,896	2,737,108.80	0.97
27	600795	国电电力	376,689	2,625,522.33	0.93
28	600015	华夏银行	169,822	2,582,992.62	0.92
29	600104	上汽集团	112,975	2,553,235.00	0.91
30	600048	保利地产	220,359	2,516,499.78	0.90
31	601939	建设银行	351,879	2,508,897.27	0.89
32	000776	广发证券	110,408	2,500,741.20	0.89
33	600900	长江电力	200,062	2,474,766.94	0.88
34	600999	招商证券	90,921	2,405,769.66	0.86
35	600050	中国联通	316,562	2,320,399.46	0.83
36	000858	五粮液	71,975	2,281,607.50	0.81
37	600028	中国石化	322,483	2,276,729.98	0.81
38	600011	华能国际	162,035	2,273,351.05	0.81
39	600518	康美药业	127,120	2,253,837.60	0.80
40	601336	新华保险	36,522	2,230,033.32	0.79
41	002415	海康威视	47,290	2,118,592.00	0.75

42	601628	中国人寿	64,527	2,020,985.64	0.72
43	000725	京东方 A	386,715	2,007,050.85	0.71
44	601857	中国石油	176,887	2,004,129.71	0.71
45	600705	中航资本	82,300	1,905,245.00	0.68
46	600886	国投电力	126,972	1,888,073.64	0.67
47	601901	方正证券	158,545	1,885,100.05	0.67
48	600276	恒瑞医药	41,619	1,853,710.26	0.66
49	000069	华侨城 A	141,979	1,842,887.42	0.66
50	600010	包钢股份	351,536	1,824,471.84	0.65
51	601899	紫金矿业	345,715	1,770,060.80	0.63
52	600690	青岛海尔	57,917	1,756,622.61	0.63
53	000538	云南白药	20,029	1,727,901.83	0.62
54	601186	中国铁建	110,097	1,720,816.11	0.61
55	000063	中兴通讯	71,514	1,702,748.34	0.61
56	000625	长安汽车	79,288	1,676,941.20	0.60
57	600703	三安光电	52,864	1,654,643.20	0.59
58	601088	中国神华	78,570	1,638,184.50	0.58
59	600019	宝钢股份	178,126	1,556,821.24	0.55
60	601600	中国铝业	163,377	1,524,307.41	0.54
61	600585	海螺水泥	70,814	1,518,960.30	0.54
62	600111	北方稀土	81,587	1,479,988.18	0.53
63	600150	中国船舶	27,248	1,403,272.00	0.50
64	600583	海油工程	82,442	1,373,483.72	0.49
65	601788	光大证券	50,200	1,352,890.00	0.48
66	601018	宁波港	150,102	1,326,901.68	0.47
67	601727	上海电气	86,450	1,290,698.50	0.46

68	601669	中国电建	113,592	1,288,133.28	0.46
69	601618	中国中冶	177,782	1,285,363.86	0.46
70	600256	广汇能源	122,955	1,278,732.00	0.46
71	600196	复星医药	43,402	1,256,053.88	0.45
72	002304	洋河股份	18,075	1,253,682.00	0.45
73	600535	天士力	24,758	1,231,958.08	0.44
74	600031	三一重工	124,009	1,201,647.21	0.43
75	600406	国电南瑞	57,054	1,180,447.26	0.42
76	601111	中国国航	76,464	1,174,487.04	0.42
77	600893	中航动力	21,500	1,142,725.00	0.41
78	002736	国信证券	45,200	1,134,068.00	0.40
79	002594	比亚迪	20,182	1,114,651.86	0.40
80	600958	东方证券	38,800	1,110,456.00	0.40
81	600023	浙能电力	110,018	1,091,378.56	0.39
82	600637	百视通	25,464	1,071,525.12	0.38
83	002241	歌尔声学	29,442	1,056,967.80	0.38
84	601800	中国交建	56,509	992,298.04	0.35
85	600383	金地集团	77,879	985,169.35	0.35
86	601998	中信银行	125,116	964,644.36	0.34
87	600398	海澜之家	49,500	897,435.00	0.32
88	600309	万华化学	36,021	870,987.78	0.31
89	601898	中煤能源	73,501	839,381.42	0.30
90	600372	中航电子	22,499	785,890.07	0.28
91	600018	上港集团	97,057	767,720.87	0.27
92	000895	双汇发展	34,919	744,822.27	0.27
93	002353	杰瑞股份	16,300	722,905.00	0.26

94	002252	上海莱士	10,100	660,944.00	0.24
95	601808	中海油服	22,592	631,220.48	0.22
96	601225	陕西煤业	76,428	625,181.04	0.22
97	601633	长城汽车	12,756	545,446.56	0.19
98	603288	海天味业	10,583	338,021.02	0.12
99	600485	信威集团	5,303	232,748.67	0.08

注：于 2015 年 1 月 26 日，[申万宏源][000166]换股吸收合并[宏源证券][000562]。于 2015 年 5 月 28 日，[中国南车][601766]吸收合并股票[中国北车][601299]，更名为[中国中车][601766]。

### 7.3.2 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所有股票投资明细

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	002353	杰瑞股份	16,300	722,905.00	0.26

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	601766	中国中车	8,213,971.60	1.47
2	000166	申万宏源	5,871,821.76	1.05
3	600705	中航资本	2,591,557.00	0.46
4	601788	光大证券	1,772,060.00	0.32
5	600886	国投电力	1,689,776.23	0.30
6	600958	东方证券	1,538,447.90	0.28
7	600893	中航动力	1,517,537.00	0.27

8	002736	国信证券	1,494,434.20	0.27
9	601398	工商银行	1,255,336.00	0.22
10	600028	中国石化	1,069,528.00	0.19
11	601166	兴业银行	1,029,145.00	0.18
12	601857	中国石油	885,818.00	0.16
13	600023	浙能电力	865,180.00	0.15
14	600398	海澜之家	853,964.43	0.15
15	601225	陕西煤业	646,250.00	0.12
16	002252	上海莱士	642,945.00	0.12
17	002241	歌尔声学	573,386.00	0.10
18	600016	民生银行	497,500.00	0.09
19	601628	中国人寿	486,880.00	0.09
20	000625	长安汽车	443,116.00	0.08

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。于 2015 年 1 月 26 日, [申万宏源][000166]换股吸收合并[宏源证券][000562]。于 2015 年 5 月 28 日, [中国南车][601766]吸收合并股票[中国北车][601299], 更名为[中国中车][601766]。

#### 7.4.2 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	600030	中信证券	24,891,449.83	4.46
2	601318	中国平安	19,421,500.78	3.48
3	600016	民生银行	16,942,435.91	3.03
4	601299	中国北车	13,081,659.99	2.34
5	600036	招商银行	12,718,705.17	2.28



6	601166	兴业银行	11,657,548.59	2.09
7	600000	浦发银行	9,951,046.25	1.78
8	601766	中国中车	9,836,315.76	1.76
9	000002	万科 A	8,344,791.76	1.49
10	601668	中国建筑	7,061,086.58	1.26
11	000651	格力电器	6,361,985.66	1.14
12	000001	平安银行	6,137,978.42	1.10
13	601601	中国太保	6,043,866.27	1.08
14	601328	交通银行	5,842,391.39	1.05
15	601390	中国中铁	5,757,957.53	1.03
16	601818	光大银行	5,351,577.68	0.96
17	601288	农业银行	5,324,226.27	0.95
18	601398	工商银行	5,071,574.10	0.91
19	000562	宏源证券	5,051,045.76	0.90
20	600887	伊利股份	5,037,617.33	0.90

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。于 2015 年 1 月 26 日, [申万宏源][000166]换股吸收合并[宏源证券][000562]。于 2015 年 5 月 28 日, [中国南车][601766]吸收合并股票[中国北车][601299], 更名为[中国中车][601766]。

#### 7.4.3 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	40,032,400.23
卖出股票的收入（成交）总额	371,979,343.11

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。

#### 7.5 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。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的中信证券 (600030) 于 2015 年 1 月 19 日公告称，因存在为到期融资融券合约展期的问题 (根据相关规定，融资融券合约期限最长为 6 个月)，公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金系指数型基金，对该股票的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	315,744.70
2	应收证券清算款	1,762,773.78
3	应收股利	-
4	应收利息	4,010.86
5	应收申购款	789,358.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,871,887.89

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600886	国投电力	1,888,073.64	0.67	重大事项
2	601111	中国国航	1,174,487.04	0.42	筹划非公开发行股票事项
3	601633	长城汽车	545,446.56	0.19	重大事项

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002353	杰瑞股份	722,905.00	0.26	重大事项

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
5,752	38,470.04	86,404,938.41	39.05%	134,874,738.47	60.95%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	齐齐哈尔中通公共交通有限责任公司	500,030.00	13.40%
2	何小娥	489,511.00	13.11%
3	乐玉屏	222,703.00	5.97%
4	黄晟昊	200,000.00	5.36%
5	孙宁	196,750.00	5.27%
6	姜卫平	190,000.00	5.09%
7	北京鸿愿非凡装饰材料有限公司	130,000.00	3.48%
8	邢桂芝	122,473.00	3.28%
9	单世扬	100,003.00	2.68%

10	章海峰	100,000.00	2.68%
----	-----	------------	-------

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,130.20	0.0046%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 10 月 30 日) 基金份额总额	2,087,148,875.30
本报告期期初基金份额总额	513,595,119.50
本报告期基金总申购份额	74,552,696.32
减：本报告期基金总赎回份额	366,868,138.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	221,279,676.88

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

## 10.2 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

2015 年 1 月 17 日, 海富通基金管理有限公司发布公告, 经公司股东会审议通过, 聘请俞涛先生担任本公司职工监事, 高勇前先生不再担任本公司职工监事。

2015 年 2 月 14 日, 海富通基金管理有限公司发布公告, 经公司第四届董事会第三十六次临时会议审议通过, 同意田仁灿先生辞去公司总经理职务, 并决定由公司董事长张文伟先生代为履行总经理职务。

2015 年 4 月 8 日, 海富通基金管理有限公司发布公告, 经公司 2015 年第四次临时股东大会审议通过, 同意田仁灿先生辞去本公司董事职务, 由简伟信 (Vincent Camerlynck) 先生继任本公司董事。

2015 年 5 月 4 日, 海富通基金管理有限公司发布公告, 经公司第四届董事会第三十六次临时会议审议通过, 并向中国证券监督管理委员会报告, 经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】753 号文核准批复。公司聘请刘颂先生任总经理, 同时公司董事长张文伟先生不再代行总经理职务。

2015 年 7 月 14 日, 海富通基金管理有限公司发布公告, 经公司第四届董事会第四十二次临时会议审议通过, 聘任奚万荣先生担任公司督察长, 原公司督察长章明女士转任公司副总经理。

2015 年 4 月, 李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 10.3 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。

## 10.4 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。

## 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内, 本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

海富通基金管理有限公司 (以下简称“公司”) 于 2015 年 2 月 10 日收到上海证监局《关于对海富通基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》, 责令公司进行为期 6 个月的整改, 上海证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视, 对公司内部控制和风险管理工作进行了全面梳理, 彻底排查业务中存在的风险隐患, 针对性的制定、实施整改措施, 进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。目前, 公司已经完

成相关整改工作并通过了监管部门的检查验收。除上述情况外,本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
国金证券	1	55,349,626.47	14.36%	28,250.18	11.70%	-
申万宏源证券	2	59,629,953.76	15.47%	24,472.60	10.14%	-
华创证券	1	42,558,014.78	11.04%	16,380.52	6.79%	-
银河证券	1	9,669,453.12	2.51%	4,688.93	1.94%	-
中金公司	2	64,124,892.46	16.64%	58,204.93	24.11%	-
中信建投	2	102,057,764.27	26.48%	61,979.80	25.67%	-
中信证券	2	52,092,003.76	13.51%	47,425.68	19.65%	-

注: 1、注: 报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

#### 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。

### 10.7.2 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
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	492,360.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司旗下基金 2014 年最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在一路财富(北京)信息科技有限公司开展网上交易申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-05
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增一路财富(北京)信息科技有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-05
4	海富通基金管理有限公司关于监事会成员变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-17
5	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-17
6	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-01-31
7	海富通基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通基金网上直销业务并实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-02-07
8	海富通基金管理有限公司关于总经理变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-02-14
9	海富通基金管理有限公司关于从业人员	《中国证券报》、《上海	2015-02-17



	在子公司兼职情况变更的公告	《证券报》和《证券时报》	
10	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-02-27
11	海富通基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-05
12	海富通基金管理有限公司关于旗下基金在官方京东店开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-06
13	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-21
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金在本公司网上直销平台对支付宝用户实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-30
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续在中国工商银行股份有限公司开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-03-31
16	海富通基金管理有限公司关于变更公司董事的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-08
17	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-11
18	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-18
19	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-04-27
20	海富通基金管理有限公司关于新任公司总经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-04
21	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-09
22	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台暂停通过银联支付渠道下的富滇银行、长沙银行办理基金开户及基金申购等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-14
23	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-16
24	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-23
25	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富(北京)信息科技有限公司网上申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-28
26	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国农业银行开展网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-29

	公告		
27	海富通基金管理有限公司关于部分基金开展网上直销转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-29
28	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-05-30
29	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-06
30	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财达证券有限责任公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-12
31	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增太平洋证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-12
32	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-13
33	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-23
34	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-27
35	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2015-06-30

## §11 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 32 只公募基金。截至 2015 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 451 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 2015 年 6 月 30 日，海富通为 80 多家企业超过 391 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 2015 年 6 月 30 日，海富通旗下专户理财管理资产规模超过 124 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。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。

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 2015 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 144 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，能够在香港筹集人民

币资金投资境内证券市场。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。

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。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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 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 层基金管理人办公地址。

### 12.3 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  
二〇一五年八月二十八日