华富竞争力优选混合型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年 6 月 30 日

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2009 年 8 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富竞争力优选混合
交易代码	410001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年 03 月 02 日
报告期末基金份额总额	2,406,704,758.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略,对基金投资风险的控制遵循"事前防范、事中控制、事后评估"的风险控制程序,运用华富 PMC 选股系统,力求实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在资产配置方面,采用自上而下的方法,确定各类资产的权重;在行业及股票选择方面,利用自身开发的"华富 PMC 选股系统"进行行业及股票综合筛选;在债券选择方面,通过研究宏观经济、国家政策及收益率曲线,积极调整债券组合的久期结构。
业绩比较基准	60%×中信标普 300 指数+35%×中信全债指数+5% ×同业存款利率
风险收益特征	本基金属于中等风险的混合型基金,其风险收益特征从长期平均来看,介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间。基金管理人通过适度主动的资产配置与积极主动的精选证券,实现风险限度内的合理回报。

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		华富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	尹东
	联系电话	021-68886996	010-67595003
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金半年度报告备置地点	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(2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	136,585,576.18
本期利润	481,607,331.82
加权平均基金份额本期利润	0.1866
本期基金份额净值增长率	32.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.1027
期末基金资产净值	1,793,619,436.57
期末基金份额净值	0.7453

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)以上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(例如,开放式基金的申购赎回费等),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,表中的"期末"均指报告期最后一日,即 6 月 30 日。

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	5.81%	0.95%	8.28%	0.71%	-2.47%	0.24%
过去三个月	8.64%	1.07%	14.75%	0.92%	-6.11%	0.15%
过去六个月	32.95%	1.38%	39.22%	1.16%	-6.27%	0.22%
过去一年	-2.26%	2.08%	12.65%	1.52%	-14.91%	0.56%
过去三年	70.29%	2.04%	79.80%	1.45%	-9.51%	0.59%
自基金合同生效起至今	155.94%	1.84%	124.42%	1.29%	31.52%	0.55%

注:业绩比较基准收益率=60%×中信标普 300 指数+35%×中信全债指数+5% ×同业存款利率,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

注:根据《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票 30%~90%、债券 5%~65%、现金不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2005 年 3 月 2 日至 9 月 2 日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业,4 月 19 日在上海正式注册成立,注册资本 1.2 亿元,由华安证券有限责任公司、安徽省创新投资有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司共同出资设立。基金管理人于 2005 年 3 月 02 日发起成立并管理其第一只开放式基金——华富竞争力优选混合型证券投资基金。2006 年 6 月 21 日发起成立并管理其第二只开放式基金——华富货币市场基金。2007 年 3 月 19 日发起成立并管理其第三只开放式基金——华富成长趋势股票型证券投资基金。2008 年 5 月 28 日发起成立并管理其第四只开放式基金——华富收益增强债券型证券投资基金。2008 年 12 月 24 日发起成立并管理其第五只开放式基金——华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金。2009 年 7 月 15 日发起成立并管理其第六只开放式基金——华富价值增长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		
鞠柏辉	本基金基金经理、策略精选基金基金经理、公司投资部副总监	2007年 10 月 25 日	-	八年	浙江大学工商管理硕士,曾任天相投资顾问公司高级分析师、华夏基金管理有限公司高级研究员。2006 年 7 月加入华富基金管理有限公司,历任研究主管、华富竞争力基金基金经理助理。

注:任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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》及相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,基金运作合法合规,不存在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

本基金管理人在报告期内严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》以及本公司公平交易制度的相关规定,在日常交易中公平对待所管理的不同投资组合。

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

按照华富竞争力基金和华富策略精选基金的基金合同,华富竞争力基金和华富策略精选基金都属于混合型基金,但由于华富策略精选基金的建仓期刚于 2009 年 6 月 24 日结束,所以其业绩与华富竞争力基金没有可比性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为发生。

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 业绩表现

本基金于 2005 年 3 月 2 日正式成立。截至 2009 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 0.7453 元,累计基金份额净值为 2.1058 元。报告期,本基金本报告期份额净值增长率为 32.95%,低于同期业绩比较基准收益率 6.27 个百分点。

4.4.2 投资策略说明

2009 年上半年,在流动性充裕、宏观经济触底回升和上市公司业绩恢复性增长等因素的共同作用下,A 股市场呈现单边上涨的格局,煤炭、有色金属等资产和资源类行业涨幅居前。期内,本基金首先采取了均衡配置策略,业绩适中;后期本基金采取了防御的投资策略,增持了较多抗周期类公司,这种过于保守的策略影响了基金业绩表现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观面看,下半年的经济处于复苏的过程中,经济数据将较上半年继续好转;从微观层面看,上市公司盈利能力也会继续逐渐恢复。基于以上判断,本基金将积极调整持仓结构,优化投资组合。继续挖掘并持有具有核心竞争力并长期稳定增长的公司。在行业的配置上,重点关注资产、资源和消费等相关行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定,成立了估值委员会,并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司运作保障部总监,成员包括总经理、督察长、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本报告 3.1.1 华富竞争力优选基金本期利润为 481,607,331.82,期末可供分配利润为 247,151,187.46。本报告期内未进行利润分配。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:华富竞争力优选混合型证券投资基金
报告截止日:2009 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2009年 6 月 30 日	上年度末 2008年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	123,285,308.07	224,806,809.67
结算备付金	9,422,190.96	7,697,305.84
存出保证金	2,497,291.24	1,883,413.91
交易性金融资产	1,683,881,569.32	1,270,845,614.06
其中:股票投资	1,540,302,627.63	1,136,269,236.71
债券投资	143,578,941.69	134,576,377.35
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	456,378.97	2,247,795.45
应收股利	-	-
应收申购款	675,920.32	192,324.96
其他资产	-	-
资产总计	1,820,218,658.88	1,507,673,263.89
负债和所有者权益	本期末 2009年 6 月 30 日	上年度末 2008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	13,236,469.08	-
应付赎回款	3,721,701.34	566,604.63
应付管理人报酬	2,195,461.80	2,019,526.52
应付托管费	365,910.28	336,587.73
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,481,543.76	3,360,146.89
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
其他负债	1,598,136.05	1,421,143.14
负债合计	26,599,222.31	7,704,008.91
所有者权益:		
实收基金	1,313,332,025.93	1,460,164,208.10
未分配利润	480,287,410.64	39,805,046.88
所有者权益合计	1,793,619,436.57	1,499,969,254.98
负债和所有者权益总计	1,820,218,658.88	1,507,673,263.89

注:报告截止日 2009 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.7453 元,基金份额总额 2,406,704,758.01 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:华富竞争力优选混合型证券投资基金
本报告期:2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
一、收入	515,029,456.85	-1,384,746,252.55
1.利息收入	1,854,645.25	4,359,099.29
其中:存款利息收入	1,176,972.86	1,521,913.55
债券利息收入	676,700.95	1,869,297.35
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	971.44	967,888.39
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	167,982,468.89	10,326,126.18
其中:股票投资收益	147,270,679.30	-4,334,888.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	14,935,484.34	1,377,322.22
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	2,872,631.07
股利收益	5,776,305.25	10,411,060.92
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	345,021,755.64	-1,400,482,168.82
4.其他收入(损失以"-"号填列)	170,587.07	1,050,690.80
二、费用(以"-"号填列)	-33,422,125.03	-57,635,439.09
1.管理人报酬	-12,917,392.14	-22,847,235.86
2.托管费	-2,152,898.70	-3,807,872.67
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-18,112,954.28	-30,730,819.14
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	-238,879.91	-249,511.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	481,607,331.82	-1,442,381,691.64
所得税费用(以"-"号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	481,607,331.82	-1,442,381,691.64

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富竞争力优选混合型证券投资基金
本报告期: 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2009年 1 月 1 日至 2009 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)	1,460,164,208.10	39,805,046.88	1,499,969,254.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	481,607,331.82	481,607,331.82
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)	-146,832,182.17	-41,124,968.06	-187,957,150.23
其中:1.基金申购款	17,934,756.99	4,237,529.93	22,172,286.92
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-164,766,939.16	-45,362,497.99	-210,129,437.15
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)	1,313,332,025.93	480,287,410.64	1,793,619,436.57
项目	上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 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)	1,327,333,239.54	1,682,874,193.52	3,010,207,433.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,442,381,691.64	-1,442,381,691.64
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)	186,733,170.37	361,067,591.40	547,800,761.77
其中:1.基金申购款	602,892,088.98	800,184,437.29	1,403,076,526.27
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-416,158,918.61	-439,116,845.89	-855,275,764.50
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)	1,514,066,409.91	601,560,093.28	2,115,626,503.19

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富竞争力优选混合型证券投资基金由华富基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》发起,经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004]199 号文核准募集设立。本基金自 2005 年 1 月 4 日起公开向社会发行,至 2005 年 2 月 25 日募集结束。经安永大华会计师事务所有限责任公司验资并出具安永大华业字(2005)第 0015 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。本次募集资金总额 600,803,457.07 元;募集资金的银行存款利息 303,413.67 元,折成基金份额,归投资人所有;设立募集期共募集 601,106,870.74 份基金单位。本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为华富基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司;有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于 2005 年 3 月 2 日生效,该日的基金份额为 601,106,870.74 份基金单位。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 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、会计估计与最近一期年度报告相一致

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策问题的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项如下:

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 基金买卖股票、债券的差价收入,从 2004 年 1 月 1 日起,继续免征收营业税。

6.4.6.3 对基金买卖股票、债券的差价收入,从 2004 年 1 月 1 日起,继续免征收企业所得税;对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20.00%的个人所得税。(注:自 2005 年 6 月 13 日起,基金从上市公司取得的股息红利所得减按 50.00%计算应纳税所得额。)

6.4.6.4 基金买卖股票,经国务院批准,从 2008 年 4 月 24 日起证券(股票)交易印花税税率由 3‰调整为 1‰。经国务院批准,从 2008 年 9 月 19 日起,对证券交易印花税政策进行调整,由双边征收改为向卖方单边征收,税率保持 1‰。

6.4.6.5 基金作为流通股股东,在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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没有发生变化

6.4.7.2 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
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券有限责任公司("华安证券")	基金管理人的股东、代销机构
合肥兴泰控股集团有限公司	基金管理人的股东

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 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
华安证券	2,293,054,144.69	19.61%	1,231,651,975.97	14.41%

6.4.8.1.2 债券交易 金额单位:人民币元

联方名称	本期 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华安证券	58,902,312.80	15.40%	46,373,534.93	61.44%

6.4.8.1.3 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华安证券	-	-	-	-

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 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
华安证券	1,929,776.43	19.58%	514,116.20	9.38%
关联方名称	上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 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
华安证券	1,000,725.46	14.01%	-	-

注: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管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	12,917,392.14	22,847,235.86
其中:当期已支付	10,721,930.34	19,973,196.45
期末未支付	2,195,461.80	2,874,039.41

注:基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法 H=E×年管理费率÷当年天数(H 为每日应计提的基金管理费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	2,152,898.70	3,807,872.67
其中:当期已支付	1,786,988.42	3,328,866.10
期末未支付	365,910.28	479,006.57

注:基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法 H=E×年托管费率÷当年天数(H 为每日应计提的基金托管费,E 为前一日基金资产净值)。

6.4.8.3 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 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	78,246,274.45	78,246,274.45
期间认购总份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分增加的份额	0.00	0.00
期间赎回/卖出总份额	41,873,483.92	0.00
期末持有的基金份额	36,372,790.53	78,246,274.45
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.51%	2.82%

注:关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定,符合公允性要求。

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2009年 6 月 30 日		上年度末 2008年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴泰控股集团有限公司	9,162,317.04	0.38%	9,162,317.04	0.34%

注:关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定,符合公允性要求。

6.4.8.5 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 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国建设银行	123,285,308.07	1,118,816.48	189,223,959.62	1,347,831.25

注:本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 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 2009年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 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:)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 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:)	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.9 期末(2009 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金期末未持有暂时停牌股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§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	1,540,302,627.63	84.62
	其中:股票	1,540,302,627.63	84.62
2	固定收益投资	143,578,941.69	7.89
	其中:债券	143,578,941.69	7.89
	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	132,707,499.03	7.29
6	其他资产	3,629,590.53	0.20
7	合计	1,820,218,658.88	100.00

注:本表列示的其他资产详见 7.9.3 其他资产构成。

7.2 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	-	-
B	采掘业	4,188,600.00	0.23
C	制造业	890,243,805.43	49.63
C0	食品、饮料	76,913,608.97	4.29
C1	纺织、服装、皮毛	90,229,953.60	5.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	196,256,147.34	10.94
C5	电子	34,274,206.4	1.91
C6	金属、非金属	358,299,961.77	19.98
C7	机械、设备、仪表	134,269,927.35	7.49
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	209,075,037.84	11.66
E	建筑业	3,966,840.00	0.22
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	307,410,353.4	17.14
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	60,237,298.54	3.36
J	房地产业	864,000.00	0.05
K	社会服务业	59,081,445.52	3.29
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,235,246.90	0.29
	合计	1,540,302,627.63	85.88

7.3 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	600050	中国联通	25,600,000	175,616,000.00	9.79
2	600019	宝钢股份	12,200,000	85,888,000.00	4.79
3	002010	传化股份	10,123,863	85,445,403.72	4.76
4	600001	邯郸钢铁	15,300,000	85,221,000.00	4.75
5	600309	烟台万华	5,000,000	78,850,000.00	4.40
6	600011	华能国际	9,899,903	78,803,227.88	4.39
7	000729	燕京啤酒	4,041,778	61,232,936.70	3.41
8	002183	怡 亚 通	4,341,032	59,081,445.52	3.29
9	600569	安阳钢铁	12,799,856	56,831,360.64	3.17
10	600795	国电电力	8,068,588	56,238,058.36	3.14

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于华富基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

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	600019	宝钢股份	371,083,090.95	24.74
2	600005	武钢股份	247,184,796.50	16.48
3	600050	中国联通	240,550,308.38	16.04
4	000157	中联重科	206,825,078.39	13.79
5	600219	南山铝业	199,729,989.10	13.32
6	601628	中国人寿	195,107,134.73	13.01
7	000729	燕京啤酒	184,355,225.72	12.29
8	000002	万 科 A	178,171,241.48	11.88
9	600588	用友软件	170,497,053.15	11.37
10	600036	招商银行	158,433,938.30	10.56
11	600795	国电电力	158,350,085.85	10.56
12	600583	海油工程	151,337,454.33	10.09
13	000001	深发展 A	145,871,824.93	9.72
14	600271	航天信息	144,226,194.45	9.62
15	600009	上海机场	136,022,456.36	9.07
16	600011	华能国际	133,083,991.34	8.87
17	002183	怡 亚 通	125,795,881.63	8.39
18	600010	包钢股份	115,976,687.42	7.73
19	600361	华联综超	104,852,219.66	6.99
20	600880	博瑞传播	102,609,322.45	6.84
21	600227	赤天化	96,073,210.79	6.41
22	600001	邯郸钢铁	95,747,586.02	6.38
23	600309	烟台万华	93,298,841.42	6.22
24	600644	乐山电力	92,364,357.05	6.16
25	600511	国药股份	87,895,742.40	5.86
26	000811	烟台冰轮	77,534,686.21	5.17
27	600030	中信证券	74,259,647.04	4.95
28	600000	浦发银行	69,425,853.16	4.63
29	600966	博汇纸业	63,674,020.85	4.25
30	600031	三一重工	63,409,731.20	4.23
31	600569	安阳钢铁	62,953,961.61	4.20
32	600550	天威保变	62,804,287.20	4.19
33	601088	中国神华	62,339,362.49	4.16
34	000858	五 粮 液	61,923,037.67	4.13
35	600517	置信电气	60,045,784.60	4.00
36	002038	双鹭药业	58,425,284.97	3.90
37	002154	报 喜 鸟	57,535,456.42	3.84
38	600016	民生银行	55,328,998.04	3.69
39	600600	青岛啤酒	54,740,220.82	3.65
40	601333	广深铁路	52,152,172.27	3.48
41	601390	中国中铁	50,982,276.86	3.40
42	002215	诺 普 信	46,922,840.24	3.13
43	601328	交通银行	45,365,786.00	3.02
44	000527	美的电器	41,925,220.36	2.80
45	600021	上海电力	40,414,590.88	2.69
46	600987	航民股份	40,249,468.87	2.68
47	600383	金地集团	40,236,968.00	2.68
48	600102	莱钢股份	40,113,971.58	2.67
49	600897	厦门空港	38,802,694.34	2.59
50	600028	中国石化	38,127,289.54	2.54
51	600688	S上石化	37,464,267.00	2.50
52	601898	中煤能源	36,698,004.51	2.45
53	600048	保利地产	36,154,410.85	2.41
54	601699	潞安环能	35,196,456.63	2.35
55	000839	中信国安	34,975,041.19	2.33
56	000651	格力电器	31,870,122.45	2.12
57	600236	桂冠电力	31,188,241.60	2.08
58	600973	宝胜股份	30,649,592.32	2.04

注:本表列示"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

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	600019	宝钢股份	360,942,649.87	24.06
2	600005	武钢股份	290,152,747.70	19.34
3	601628	中国人寿	259,064,190.98	17.27
4	000002	万 科 A	229,440,731.54	15.30
5	600036	招商银行	221,690,282.99	14.78
6	000157	中联重科	212,864,393.23	14.19
7	600583	海油工程	181,615,390.65	12.11
8	000729	燕京啤酒	174,547,121.24	11.64
9	600219	南山铝业	167,299,126.51	11.15
10	600030	中信证券	157,846,385.35	10.52
11	000001	深发展 A	150,649,517.94	10.04
12	600009	上海机场	142,728,271.70	9.52
13	600271	航天信息	140,030,146.30	9.34
14	600795	国电电力	139,530,879.51	9.30
15	600588	用友软件	125,681,066.89	8.38
16	600361	华联综超	121,741,032.20	8.12
17	600880	博瑞传播	117,042,825.72	7.80
18	600000	浦发银行	114,376,252.39	7.63
19	600048	保利地产	111,727,355.89	7.45
20	002183	怡 亚 通	106,962,142.40	7.13
21	600011	华能国际	105,350,823.58	7.02
22	600227	赤天化	98,615,438.82	6.57
23	601390	中国中铁	97,217,248.70	6.48
24	600511	国药股份	89,756,134.58	5.98
25	600016	民生银行	83,089,388.84	5.54
26	600050	中国联通	79,700,271.83	5.31
27	600644	乐山电力	74,812,229.35	4.99
28	600010	包钢股份	70,235,965.60	4.68
29	002154	报 喜 鸟	69,861,833.88	4.66
30	600966	博汇纸业	65,856,363.84	4.39
31	000858	五 粮 液	64,507,491.01	4.30
32	600031	三一重工	64,103,329.84	4.27
33	600717	天津港	59,588,666.13	3.97
34	601333	广深铁路	56,301,931.28	3.75
35	002038	双鹭药业	55,486,135.28	3.70
36	600636	三爱富	52,870,693.92	3.52
37	601088	中国神华	52,559,069.30	3.50
38	601166	兴业银行	47,826,424.64	3.19
39	000527	美的电器	47,639,136.85	3.18
40	600383	金地集团	46,590,374.57	3.11
41	600897	厦门空港	45,674,399.32	3.05
42	000811	烟台冰轮	44,588,227.70	2.97
43	600102	莱钢股份	43,119,784.40	2.87
44	600028	中国石化	41,977,866.02	2.80
45	600600	青岛啤酒	41,782,040.36	2.79
46	600418	江淮汽车	41,479,037.01	2.77
47	600688	S上石化	40,840,691.04	2.72
48	000937	金牛能源	39,006,394.62	2.60
49	000651	格力电器	37,941,530.59	2.53
50	601898	中煤能源	37,465,749.04	2.50
51	601699	潞安环能	36,391,380.76	2.43
52	000528	柳 工	33,482,564.73	2.23
53	600236	桂冠电力	33,029,047.08	2.20
54	601919	中国远洋	30,806,312.99	2.05
55	601328	交通银行	30,247,269.70	2.02

注:本表列示"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

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	5,827,953,746.50
卖出股票的收入(成交)总额	5,907,014,720.20

注:本表列示"买入股票的成本(成交)总额"及"卖出股票的收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	60,402,456.29	3.37%
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	83,176,485.40	4.64%
7	其他	-	-
8	合计	143,578,941.69	8.01%

7.6 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	110002	南山转债	593,200	83,024,272.00	4.63
2	126012	08上港债	271,820	26,219,757.20	1.46
3	115002	国安债 1	245,931	21,000,048.09	1.17
4	126008	08上汽债	66,920	5,711,622.00	0.32
5	126013	08青啤债	47,470	3,925,769.00	0.22

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。
7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,497,291.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	456,378.97
5	应收申购款	675,920.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,629,590.53

7.9.4 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	110002	南山转债	83,024,272.00	4.63
2	110598	大荒转债	152,213.40	0.01

7.9.5 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。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
121348	19,833.08	69,013,764.69	2.87%	2,337,690,993.32	97.13%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	299,141.24	0.0124%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(05 年 3 月 2 日)基金份额总额	601,106,870.74
报告期期初基金份额总额	2,675,776,938.29
报告期期间基金总申购份额	32,865,675.39
报告期期间基金总赎回份额	-301,937,855.67
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00
报告期期末基金份额总额	2,406,704,758.01

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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

经华富基金管理有限公司第二届四次董事会审议通过,聘任邹牧先生担任公司副总经理。邹牧先生的任职资格已经中国证监会证监许可[2009]207 号文件核准。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		权证交易		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	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	3	2,293,054,144.69	19.61%	58,902,312.80	15.40%	-	-	1,929,776.43	19.58%	-
联合证券	1	934,707,034.29	7.99%	-	-	-	-	794,501.09	8.06%	-
国泰君安	1	1,509,155,542.32	12.91%	18,340,782.00	4.79%	-	-	1,284,425.23	13.03%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	1	596,585,641.78	5.10%	25,683,679.30	6.71%	-	-	509,407.51	5.17%	-
国金证券	2	844,404,336.20	7.22%	127,849,763.30	33.42%	-	-	692,257.68	7.03%	-
中信证券	2	765,583,425.66	6.55%	10,008,726.20	2.62%	-	-	634,254.15	6.44%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	1	430,756,030.32	3.68%	-	-	-	-	349,993.37	3.55%	-
中信建投证券	1	23,411,753.75	0.20%	-	-	-	-	19,022.22	0.19%	-
高华证券	1	104,872,335.98	0.90%	-	-	-	-	89,143.16	0.90%	-
安信证券	2	608,503,153.20	5.20%	-	-	-	-	517,223.52	5.25%	-
中投证券	3	1,701,268,975.50	14.55%	114,567,226.90	29.94%	-	-	1,436,208.56	14.57%	-
国信证券	1	1,448,913,865.63	12.39%	-	-	-	-	1,231,565.25	12.50%	-
长江证券	1	397,674,002.61	3.40%	-	-	-	-	338,022.72	3.43%	-
广发证券	1	33,141,451.24	0.28%	27,249,083.30	7.12%	-	-	28,169.96	0.29%	-
广发华福证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注:根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48 号),我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序,比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。本报告期本基金新增交易单元的情况分别是:国金证券 1 个、中信证券 1 个、安信证券 1 个、长江证券 1 个、广发证券 1 个、东北证券 1 个、齐鲁证券 1 个。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

1、2009年 1 月 16 日,本基金托管人公告中国建设银行股份有限公司(以下简称建行)聘请胡哲一先生担任建行副行长;
2、2009 年 5 月 14 日,美国银行公告关于建行股权变动报告书;
3、2009 年 5 月 26 日,中国建银投资有限责任公司公告关于建行股权变动报告书;
4、2009 年 5 月 26 日,中央汇金投资有限责任公司公告关于建行股权变动报告书;
5、2009 年 8 月 2 日,本基金托管人公告,自 2009 年 7 月 24 日起陈佐夫先生就任建行执行董事。