

华富中证100指数证券投资基金 2010|第一季度报告

2010年3月31日

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2010年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年4月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等內容,保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告期期间为2010年1月1日至2010年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证100指数
交易代码	410008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月30日
报告期末基金份额总额	304,445,629.13份

§3 主要财务指标

单位:人民币元	
报告期 2010年1月1日-2010年3月31日	
1.本期已实现收益	-4,897,849.99
2.本期利润	-26,016,936.98
3.期末平均基金份额利润	-0.0815
4.期末基金份额净值	282,289,284.27
5.期末基金份额净值	0.9272

注:1.本期已实现收益为本基金本期初收入、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.所列基金利润指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本基金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	-7.25%	1.26%	-7.80%	1.27%	0.55%	-0.01%

3.2.2 本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

3.3.1 指数投资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	1,049,457	17,083,159.96	6.05
2	600016	民生银行	1,664,400	12,799,236.00	4.53
3	601166	兴业银行	311,200	11,489,504.00	4.07
4	600000	浦发银行	490,417	11,171,699.26	3.96
5	601318	中国平安	210,625	10,615,300.00	3.76
6	600030	中信证券	340,450	9,675,899.00	3.43
7	601398	工商银行	1,503,600	7,487,928.00	2.65
8	601008	中国银行	241,971	6,992,961.90	2.48
9	000002	万科A	710,100	6,745,950.00	2.39
10	601601	中国太保	230,600	6,226,200.00	2.21

4. 报告期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

5.4.1 报告期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组合

5.4.2 报告期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

5.4.3 报告期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

5.4.4 报告期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

5.4.5 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.6 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.7 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.8 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.9 报告期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

5.4.10 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.11 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.12 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.13 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.14 报告期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

5.4.15 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.16 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.17 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.18 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.19 报告期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

5.4.20 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.21 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.22 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.23 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.24 报告期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

5.4.25 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.26 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.27 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.28 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.29 报告期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

5.4.30 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.31 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.32 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.33 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.34 报告期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

5.4.35 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.36 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.37 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.38 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.39 报告期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

5.4.40 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.41 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.42 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.43 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.44 报告期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

5.4.45 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.46 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.47 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.48 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.49 报告期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

5.4.50 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.51 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.52 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.53 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.54 报告期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

5.4.55 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.56 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.57 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.58 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.59 报告期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

5.4.60 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.61 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.62 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.63 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.64 报告期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

5.4.65 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.66 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.67 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.68 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.4.69 报告期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

5.4.70 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及结构性产

5.4.71 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

5.4.72 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债投资明细

5.4.73 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细