华富竞争力优选混合型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010年 12 月 31 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
报告送出日期：2011 年 3 月 28 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 2011 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2010 年 01 月 01 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富竞争力优选混合型证券投资基金
基金简称	华富竞争力优选混合
基金主代码	410001
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 3 月 2 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
报告期末基金份额总额	1,883,229,090.66 份
基金合同存续期	不定期

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%×中信标普全债指数+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。

注：鉴于“中信全债指数”的编制人中信标普指数信息服务（北京）有限公司已将“中信全债指数”更名为“中信标普全债指数”，编制方法未发生改变，本基金管理人将华富竞争力优选混合基金的原有的业绩比较基准“60%×中信标普 300 指数+35%×中信全债指数+5% ×同业存款利率”更改为“60%×中信标普 300 指数+35%×中信标普全债指数+5% ×同业存款利率”。

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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	-145,835,592.78	290,842,931.85	-1,236,750,932.92
本期利润	-106,057,452.08	671,149,672.07	-2,009,254,007.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0520	0.2781	-0.7136
本期基金份额净值增长率	-5.75%	47.79%	-54.70%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1033	0.1704	0.0149
期末基金资产净值	1,470,520,616.75	1,780,484,316.59	1,499,969,254.98
期末基金份额净值	0.7809	0.8285	0.5606

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 12 月 31 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
过去三个月	10.84%	1.85%	3.50%	1.05%	7.34%	0.80%
过去六个月	25.06%	1.55%	12.98%	0.92%	12.08%	0.63%
过去一年	-5.75%	1.46%	-5.45%	0.94%	-0.30%	0.52%
过去三年	-36.90%	1.95%	-18.61%	1.38%	-18.29%	0.57%
过去五年	173.64%	1.85%	140.24%	1.29%	33.40%	0.56%
自基金合同生效起至今	168.17%	1.76%	130.66%	1.23%	37.51%	0.53%

注：业绩比较基准收益率=60%×中信标普 300 指数+35%×中信标普全债指数+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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	-	-	-	-	-
2009年	-	-	-	-	-
2008年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§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，公司股东为华安证券有限责任公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司。截止 2010 年 12 月 31 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金和华富强化回报债券型证券投资基金八只基金。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张琦	华富竞争力优选基金基金经理	2010年 6 月 2 日	-	六年	英国里丁大学投资银行专业硕士，六年证券从业经验，2004 年 8 月至 2006 年 8 月在光大证券有限公司从事证券研究工作，2006 年 8 月至 2010 年 3 月在银华基金管理有限公司从事证券研究及专户投资工作，2010 年 4 月加入我公司。
鞠柏辉	华富竞争力优选基金基金经理、华富策略精选基金基金经理、公司投资部副总监	2007年 10 月 25 日	2010年 9 月 6 日	九年	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、华富策略精选和华富价值增长的基金合同，华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长都属于混合型基金，2010 年，华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长的净值增长率分别为-5.75%、5.93%与-7.33%。三只基金的差异主要由资产配置和行业配置的差异造成。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

伴随着 2010 年最后一个交易日的红盘上证综指报收 2808.08 点，全年下跌 14.31%。A 股在 2010 年里几经波折，房地产新政的推出、流动性的充裕、通胀、央行两度加息、美国量化宽松政策的出台，国内外经济形势风起云涌。

2010 年的股市表现可以说是一个“结构性牛市”，沪深 300 下跌了 12.5%，中小板指数涨幅较大。本基金在 2010 年下半年及时抓住了中小板的上涨机会，取得了较好的回报。

7 月份美国推出了二次量化宽松政策，大盘强劲反弹，强周期品种尤其表现强劲。8 月、9 月大盘震荡整理，我们坚持了高仓位，选择资源性的强势板块，10 月份在行业配置上继续选择国家控制的稀缺资源、受益于流动性的有色、农业，长远来看贸易关系需要改善的新经济，及受益于周边局势紧张的军工板块等。11 月是我们业绩突出的一个月，基于创业板受制于减持预期的下跌将提供价值投资机会的判断，我们增仓了创业板。12 月中小市值股票出现了调整，我们及时降低了仓位，还是遭受到了较大的打击，同时也减持了医药，但是减仓操作不够坚决，影响了 12 月的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为 0.7809 元，累计份额净值为 2.1710 元；本报告期份额净值增长率为-5.75%，同期业绩比较基准收益率为-5.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

影响大盘的因素主要有三个：流动性、经济基本面、政策。三者不同时期所起作用的综合，决定了大盘的走向。

预计 2011 年管理层将采取加息、收紧信贷规模等方式抑制通货膨胀，通货膨胀的高点远未到来，全年信贷和货币增速均可能较低，因此，2011 年的流动性整体不足，所以不支持大涨；经济基本面方面，因为有政府主导的投资支撑，部分行业还是会维持增长，大跌的可能性也不大。整体而言，2011 年会是一个震荡的、结构性的市场，大体上跟 2010 年的情况类似，但重心不断下移。

同样地，2011 年的投资和 2010 年相比也不会有太大的变化，主要的机会仍在产业结构调整受益的新兴产业，尤其是政府主导的投资方面。同时，周期性股票的阶段性机会也要把握，这块除了要看美国经济的恢复程度，另一个是关注点是估值跌得足够便宜，这样的机会估计年中会出现几次，即在大小盘之间反复多次。

起主导方向的是政策。国家经济转型，投资方向也应该转型，新兴产业中的新能源、新科技、新材料等非常值得关注。装备制造业作为“十二五”规划重点发展产业，可中长期把握，高端装备制造业包括五大重点领域：航空产业、卫星及其应用产业、轨道交通装备、海洋工程装备、智能制造装备。产业结构调整里面，如果可以容纳较大规模资金，该板块的持续性就有保障，然后在板块中再选择业绩高增长的、弹性大的标的。

我们也会保持部分的抗通胀配置，农产品本来库存就较少，加上极端天气影响，配置通胀首选农业产业链。如果一旦通胀被压住，且房价得到有效控制，则房地产链条将获得超额收益，这块可以作为农产品的对冲。医药和大消费，基于人口结构这样的长期因素，具备长期投资价值，在其他板块没有明显机会的时候，我们会去挖掘板块里面的机会，估计它们的机会更多是在下半年。

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。报告期内相关基金估值政策由天健正信会计师事务所进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、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

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-106,057,452.08，期末可供分配利润为 194,574,977.53。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 审计报告

本报告期内本基金由天健正信会计师事务所出具无保留意见审计报告。投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 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：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	325,695,971.38	143,699,231.13
结算备付金	10,237,149.46	4,779,301.22
存出保证金	6,362,425.13	3,807,608.23
交易性金融资产	1,192,758,588.85	1,625,315,087.50
其中：股票投资	1,109,499,361.55	1,524,455,480.38
基金投资	-	-
债券投资	83,259,227.30	100,859,607.12
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	-	36,511,673.24
应收利息	444,422.81	472,942.15
应收股利	-	-
应收申购款	516,501.37	247,238.88
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,536,015,059.00	1,814,833,082.35
负债和所有者权益	本期期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009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	55,824,719.81	25,123,390.64
应付赎回款	391,590.53	2,813,588.85
应付管理人报酬	1,940,374.21	2,242,806.56
应付托管费	323,395.66	373,801.07
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,955,403.43	2,309,410.36
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,058,958.61	1,485,768.28
负债合计	65,494,442.25	34,348,765.76
所有者权益：		
实收基金	1,027,672,985.79	1,172,765,915.67
未分配利润	442,847,630.96	607,718,400.92
所有者权益合计	1,470,520,616.75	1,780,484,316.59
负债和所有者权益总计	1,536,015,059.00	1,814,833,082.35

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7809 元，基金份额总额 1,883,229,090.66 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.2 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：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入	-48,063,069.65	733,319,417.28
1.利息收入	2,421,696.34	3,171,798.70
其中：存款利息收入	1,376,658.58	2,013,173.33
债券利息收入	992,306.45	1,145,624.22
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	52,731.31	13,001.15
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-90,364,020.43	349,513,105.57
其中：股票投资收益	-108,771,657.27	300,228,556.05
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,968,947.72	38,347,646.12
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	297,818.57
股利收益	9,438,689.12	10,639,084.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	39,778,140.70	380,306,740.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	101,113.74	327,772.79
减：二、费用	57,994,382.43	62,169,745.21
1.管理人报酬	22,508,677.20	26,093,647.21
2.托管费	3,751,446.14	4,348,941.15
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	31,244,975.88	31,243,377.07
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	489,283.21	483,779.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-106,057,452.08	671,149,672.07
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-106,057,452.08	671,149,672.07

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.3 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：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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）	1,172,765,915.67	607,718,400.92	1,780,484,316.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-106,057,452.08	-106,057,452.08
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）	-145,092,929.88	-58,813,317.88	-203,906,247.76
其中：1.基金申购款	30,650,000.19	10,677,115.94	41,327,116.13
2.基金赎回款	-175,742,930.07	-69,490,433.82	-245,233,363.89
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）	1,027,672,985.79	442,847,630.96	1,470,520,616.75

项目	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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）	-	671,149,672.07	671,149,672.07
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）	-287,398,292.43	-103,236,318.03	-390,634,610.46
其中：1.基金申购款	36,453,742.46	12,936,359.83	49,390,102.29
2.基金赎回款	-323,852,034.89	-116,172,677.86	-440,024,712.75
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）	1,172,765,915.67	607,718,400.92	1,780,484,316.59

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

______章宏韬______　　______姚怀然______　　____陈大毅____
基金管理公司负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

7.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 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：

7.4.6.1 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。

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

7.4.6.3 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。）

7.4.6.4 基金买卖股票，经国务院批准，从 2008 年 4 月 24 日起证券（股票）交易印花税税率由现行的 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，由现行双边征收改为向卖方单边征收，税率保持 1‰。

7.4.6.5 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。

7.4.7 关联方关系

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
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰控股集团有限公司	基金管理人的股东

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	651,130,209.49	3.20	3,682,383,240.58	18.24

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	10.38

7.4.8.1.3 债券回购交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的债券回购交易

7.4.8.1.4 权证交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的权证交易

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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	529,046.59	3.12	94,031.59	1.90
关联方名称	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 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	3,060,751.13	18.03	130,856.89	5.67

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	22,508,677.20	26,093,647.21
其中：支付给销售机构的客户维护费	3,447,958.77	3,932,470.58

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）。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,751,446.14	4,348,941.15

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）。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内和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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2005 年 3 月 2 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	36,372,790.53	78,246,274.45
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	36,372,790.53	41,873,483.92
期末持有的基金份额	0.00	36,372,790.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.69%

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，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

7.4.8.4.2 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 2010年 12 月 31 日		上年度末 2009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（%）
合肥兴泰控股集团有限公司	9,162,317.04	0.49	9,162,317.04	0.43

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。

7.4.8.5 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 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	325,695,971.38	1,270,514.35	143,699,231.13	1,906,055.44

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
300113	顺网科技	2010年12月13日	筹划重大资产重组事项	69.40	2011年1月31日	75.98	436,381	30,262,202.51	30,284,841.40	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据《财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好 2010 年年报工作的通知（财会［2010］25 号）》（以下简称“通知”）要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

类别	2010 年 12 月 31 日公允价值	2009 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	1,162,473,747.45	1,625,239,067.50
第二层次	30,284,841.40	76,020.00
第三层次	-	-
合计	1,192,758,588.85	1,625,315,087.50

§8 投资组合报告

8.1 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	1,109,499,361.55	72.23
	其中：股票	1,109,499,361.55	72.23
2	固定收益投资	83,259,227.30	5.42
	其中：债券	83,259,227.30	5.42
	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	335,933,120.84	21.87
6	其他各项资产	7,323,349.31	0.48
7	合计	1,536,015,059.00	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.9.3 其他各项资产构成。

8.2 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	57,979,126.05	3.94
B	采掘业	35,665,000.00	2.43
C	制造业	448,084,357.40	30.47
C0	食品、饮料	-	-
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	55,226,111.98	3.76
C5	电子	63,166,277.99	4.30
C6	金属、非金属	148,314,270.63	10.09
C7	机械、设备、仪表	121,955,150.10	8.29
C8	医药、生物制品	31,394,000.00	2.13
C99	其他制造业	28,028,546.70	1.91
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,400,000.00	1.12
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	334,390,461.19	22.74
H	批发和零售贸易	98,325,168.40	6.69
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	13,232,191.56	0.90
K	社会服务业	90,556,706.50	6.16
L	传播与文化产业	14,866,350.45	1.01
M	综合类	-	-
	合计	1,109,499,361.55	75.45

8.3 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	300055	万邦达	668,705	90,475,786.50	6.15
2	002277	友阿股份	2,499,802	59,495,287.60	4.05
3	600406	国电南瑞	712,912	51,372,438.72	3.49
4	600498	烽火通信	1,075,873	44,498,107.28	3.03
5	600511	国药股份	1,565,721	38,829,880.80	2.64
6	002041	登海种业	526,901	34,728,044.91	2.36
7	002313	日海通讯	558,942	32,250,953.40	2.19
8	601808	中海油服	1,250,000	31,925,000.00	2.17
9	300132	青松股份	885,708	31,584,347.28	2.15
10	000050	深天马 A	2,084,931	31,190,567.76	2.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600050	中国联通	176,452,037.38	9.91
2	600900	长江电力	165,213,389.98	9.28
3	600030	中信证券	142,569,208.57	8.01
4	601766	中国南车	136,805,233.67	7.68
5	600048	保利地产	126,514,573.78	7.11
6	000527	美的电器	120,990,982.06	6.80
7	600837	海通证券	118,594,761.97	6.66
8	600406	国电南瑞	107,078,656.98	6.01
9	600028	中国石化	101,197,619.42	5.68
10	000983	西山煤电	95,484,097.28	5.36
11	601390	中国中铁	87,085,112.36	4.89
12	600598	北大荒	86,812,491.48	4.88
13	002041	登海种业	85,027,500.86	4.78
14	601299	中国北车	84,813,876.03	4.76
15	600267	海正药业	83,867,297.28	4.71
16	600418	江淮汽车	81,762,863.44	4.59
17	600362	江西铜业	81,687,790.44	4.59
18	000651	格力电器	81,578,674.19	4.58
19	002146	荣盛发展	80,110,609.75	4.50
20	000060	中金岭南	79,093,873.65	4.44
21	600636	三爱富	78,779,480.85	4.42
22	000012	南 玻 A	78,619,094.78	4.42
23	600500	中化国际	78,538,117.14	4.41
24	000718	苏宁环球	78,402,244.57	4.40
25	600019	宝钢股份	74,909,556.36	4.21
26	601666	平煤股份	74,319,267.61	4.17
27	002179	中航光电	74,167,132.12	4.17
28	600000	浦发银行	72,346,481.00	4.06
29	601288	农业银行	68,502,140.00	3.85
30	000998	隆平高科	67,763,816.59	3.81
31	000792	盐湖钾肥	67,465,035.22	3.79
32	002200	绿 大 地	67,052,137.81	3.77
33	600038	哈飞股份	66,966,183.79	3.76
34	601958	金钼股份	66,718,845.10	3.75
35	600498	烽火通信	65,984,551.13	3.71
36	601186	中国铁建	65,114,324.37	3.66
37	601668	中国建筑	64,247,389.96	3.61
38	600104	上海汽车	63,855,218.00	3.59
39	002233	塔牌集团	63,791,445.52	3.58
40	300055	万邦达	63,207,559.76	3.55
41	000338	潍柴动力	62,849,641.20	3.53
42	000960	锡业股份	62,678,255.65	3.52
43	000937	冀中能源	62,460,680.27	3.51
44	600366	宁波韵升	61,830,823.99	3.47
45	000598	兴蓉投资	61,740,300.40	3.47
46	002277	友阿股份	61,594,931.48	3.46
47	601688	华泰证券	61,134,235.50	3.43
48	601601	中国太保	59,778,808.03	3.36
49	000933	神火股份	58,845,838.07	3.31
50	000927	一汽夏利	57,676,942.06	3.24
51	601699	潞安环能	56,977,534.39	3.20
52	000063	中兴通讯	56,512,358.63	3.17
53	002313	日海通讯	56,200,629.05	3.16
54	600354	敦煌种业	56,053,070.24	3.15
55	002407	多氟多	55,492,838.11	3.12
56	600765	中航重机	55,184,717.23	3.10
57	601166	兴业银行	54,484,325.70	3.06
58	600690	青岛海尔	53,929,422.86	3.03
59	601919	中国远洋	53,685,319.37	3.02
60	002244	滨江集团	52,153,419.16	2.93
61	000404	华意压缩	52,140,620.37	2.93
62	000762	西藏矿业	51,130,457.29	2.87
63	000559	万向钱潮	50,133,360.22	2.82
64	000878	云南铜业	48,982,415.94	2.75
65	600036	招商银行	48,257,526.46	2.71
66	002237	恒邦股份	48,177,422.44	2.71
67	002285	世联地产	47,980,828.85	2.69
68	300018	中元华电	47,980,667.90	2.69
69	600079	人福医药	47,037,585.11	2.64
70	000001	深发展 A	45,002,741.46	2.53
71	600005	武钢股份	44,495,635.87	2.50
72	300002	神州泰岳	44,045,776.92	2.47
73	002089	新 海 宜	43,856,026.22	2.46
74	600141	兴发集团	43,655,275.42	2.45
75	600522	中天科技	43,497,816.40	2.44
76	000708	大冶特钢	43,487,853.48	2.44
77	600467	好当家	43,288,012.14	2.43
78	600999	招商证券	43,271,013.34	2.43
79	601369	陕鼓动力	43,122,569.06	2.42
80	600594	益佰制药	42,875,742.16	2.41
81	300039	上海凯宝	42,367,245.45	2.38
82	601179	中国西电	42,242,043.92	2.37
83	000039	中集集团	41,988,217.52	2.36
84	000401	冀东水泥	41,857,770.57	2.35
85	600801	华新水泥	41,838,475.57	2.35
86	600376	首开股份	41,779,908.01	2.35
87	601628	中国人寿	41,469,324.40	2.33
88	000926	福星股份	41,406,514.04	2.33
89	600029	南方航空	41,323,554.96	2.32
90	600893	航空动力	41,303,128.56	2.32
91	002086	东方海洋	41,140,966.77	2.31
92	600511	国药股份	39,571,595.21	2.22
93	000528	柳 工	39,479,646.10	2.22
94	600195	中牧股份	39,460,930.98	2.22
95	000578	盐湖集团	39,379,414.55	2.21
96	600549	厦门钨业	39,078,254.52	2.19
97	002254	烟台氨纶	38,813,072.68	2.18
98	002253	川大智胜	38,808,430.45	2.18
99	600990	四创电子	38,419,897.02	2.16
100	000537	广宇发展	37,457,287.30	2.10
101	600105	永鼎股份	37,154,058.39	2.09
102	000151	中成股份	36,380,984.14	2.04
103	002064	华峰氨纶	36,009,612.55	2.02
104	300020	银江股份	35,962,203.85	2.02
105	600067	冠城大通	35,650,943.70	2.00

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。

8.4.2 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	600900	长江电力	248,938,585.95	13.98
2	600030	中信证券	212,640,098.53	11.94
3	600267	海正药业	199,351,328.66	11.20
4	601668	中国建筑	156,594,763.27	8.80
5	600000	浦发银行	140,460,242.06	7.89
6	600048	保利地产	138,763,764.92	7.79
7	600050	中国联通	130,723,950.00	7.34
8	601766	中国南车	126,957,077.26	7.13
9	000527	美的电器	123,448,901.79	6.93
10	600036	招商银行	119,398,190.94	6.71
11	600028	中国石化	114,103,876.30	6.41
12	601628	中国人寿	97,080,571.92	5.45
13	000983	西山煤电	97,061,796.49	5.45
14	600418	江淮汽车	95,280,453.22	5.35
15	601398	工商银行	92,172,520.04	5.18
16	000960	锡业股份	91,942,438.67	5.16
17	000012	南 玻 A	90,476,039.02	5.08
18	000792	盐湖钾肥	90,207,719.45	5.07
19	600598	北大荒	88,729,427.36	4.98
20	600837	海通证券	87,980,330.05	4.94
21	601857	中国石油	87,633,027.50	4.92
22	600362	江西铜业	85,931,782.99	4.83
23	601318	中国平安	83,894,269.74	4.71
24	601958	金钼股份	83,370,976.63	4.68
25	600383	金地集团	83,155,229.71	4.67
26	002179	中航光电	82,673,184.79	4.64
27	601299	中国北车	82,385,618.44	4.63
28	002146	荣盛发展	80,533,417.14	4.52
29	000651	格力电器	80,419,028.36	4.52
30	000001	深发展 A	78,123,803.81	4.39
31	600636	三爱富	77,869,630.64	4.37
32	000060	中金岭南	75,714,197.57	4.25
33	600019	宝钢股份	75,019,095.85	4.21
34	600104	上海汽车	74,939,479.94	4.21
35	000718	苏宁环球	74,651,005.63	4.19
36	002200	绿 大 地	73,627,421.68	4.14
37	600038	哈飞股份	73,404,535.45	4.12
38	600765	中航重机	69,830,818.16	3.92
39	600500	中化国际	69,745,997.75	3.92
40	000338	潍柴动力	67,953,183.18	3.82
41	000998	隆平高科	66,640,575.81	3.74
42	000937	冀中能源	66,610,716.74	3.74
43	601186	中国铁建	65,823,697.12	3.70
44	601390	中国中铁	65,442,986.00	3.68
45	601988	中国银行	65,324,218.96	3.67
46	601666	平煤股份	65,162,580.02	3.66
47	601288	农业银行	64,937,827.58	3.65
48	002407	多氟多	63,313,778.47	3.56
49	000002	万 科 A	63,039,225.76	3.54
50	600354	敦煌种业	62,787,139.62	3.53
51	000927	一汽夏利	60,802,096.16	3.41
52	000933	神火股份	60,760,717.29	3.41
53	601699	潞安环能	60,112,790.38	3.38
54	600406	国电南瑞	59,139,870.70	3.32
55	002233	塔牌集团	58,283,305.77	3.27
56	601601	中国太保	57,925,198.15	3.25
57	002041	登海种业	56,793,629.28	3.19
58	000598	兴蓉投资	56,332,080.09	3.16
59	601919	中国远洋	54,876,567.01	3.08
60	600690	青岛海尔	53,377,075.59	3.00
61	000559	万向钱潮	52,438,041.52	2.95
62	600366	宁波韵升	52,383,201.36	2.94
63	601166	兴业银行	52,214,625.17	2.93
64	000762	西藏矿业	51,242,873.14	2.88
65	002237	恒邦股份	50,459,846.73	2.83
66	000404	华意压缩	50,137,019.39	2.82
67	000578	盐湖集团	49,298,291.44	2.77
68	000878	云南铜业	48,975,428.72	2.75
69	002244	滨江集团	47,975,463.50	2.69
70	600079	人福医药	47,926,027.01	2.69
71	600893	航空动力	47,121,956.85	2.65
72	000069	华侨城 A	46,502,887.49	2.61
73	002285	世联地产	46,478,372.28	2.61
74	600522	中天科技	45,337,120.93	2.55
75	601369	陕鼓动力	45,227,053.45	2.54
76	002086	东方海洋	45,154,633.24	2.54
77	002168	深圳惠程	44,884,044.78	2.52
78	600016	民生银行	43,986,958.02	2.47
79	002253	川大智胜	43,905,353.74	2.47
80	601688	华泰证券	43,860,072.62	2.46
81	000039	中集集团	43,593,378.73	2.45
82	600467	好当家	43,065,011.28	2.42
83	000708	大冶特钢	42,769,908.52	2.40
84	600027	华电国际	42,765,967.03	2.40
85	601179	中国西电	42,714,279.55	2.40
86	601328	交通银行	42,176,282.12	2.37
87	600029	南方航空	41,965,837.92	2.36
88	000009	中国宝安	41,763,960.65	2.35
89	600195	中牧股份	41,468,924.76	2.33
90	002089	新 海 宜	41,252,657.01	2.32
91	000401	冀东水泥	41,178,231.74	2.31
92	600801	华新水泥	40,848,937.08	2.29
93	600005	武钢股份	40,693,982.61	2.29
94	000063	中兴通讯	40,422,385.60	2.27
95	000528	柳 工	40,166,864.20	2.26
96	600376	首开股份	40,015,189.16	2.25
97	000926	福星股份	39,605,443.53	2.22
98	600594	益佰制药	39,018,007.80	2.19
99	002064	华峰氨纶	38,758,668.43	2.18
100	600990	四创电子	38,561,653.96	2.17
101	600999	招商证券	38,014,959.55	2.14
102	002254	烟台氨纶	37,646,176.81	2.11
103	000537	广宇发展	37,056,599.06	2.08
104	600425	青松建化	36,785,239.80	2.07
105	600105	永鼎股份	36,690,204.51	2.06
106	600096	云天化	36,679,482.39	2.06
107	601169	北京银行	36,323,450.35	2.04
108	600166	福田汽车	36,046,175.36	2.02
109	300024	机器人	36,005,933.10	2.02
110	601866	中海集运	35,622,849.47	2.00

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。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	10,012,457,371.27
卖出股票收入（成交）总额	10,364,109,216.97

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（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。买入包括新股、债转股及行权等获得的股票。

8.5 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	26,674,530.00	1.81
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	56,584,697.30	3.85
7	其他	-	-
8	合计	83,259,227.30	5.66

8.6 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	110003	新钢转债	330,000	38,025,900.00	2.59
2	113001	中行转债	130,000	14,281,800.00	0.97
3	115002	国安债 1	150,000	13,486,500.00	0.92
4	126008	08上汽债	66,920	6,058,936.80	0.41
5	110078	澄星转债	23,680	2,870,963.20	0.20

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	6,362,425.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	444,422.81
5	应收申购款	516,501.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,323,349.31

8.9.4 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	110003	新钢转债	38,025,900.00	2.59
2	113001	中行转债	14,281,800.00	0.97
3	110078	澄星转债	2,870,963.20	0.20
4	110007	博汇转债	247,121.60	0.02

8.9.5 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未存在流通受限情况。

8.9.6 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

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
101,929	18,475.89	15,049,821.61	0.80%	1,868,179,269.05	99.20%

9.2 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	0.0159%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 3 月 2 日）基金份额总额	601,106,870.74
本报告期期初基金份额总额	2,149,113,815.80
本报告期基金总申购份额	56,166,835.12
减：本报告期基金总赎回份额	322,051,560.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,883,229,090.66

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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

1、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，曾刚先生不再担任华富货币市场基金基金经理的职务。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘张琦先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金的基金经理。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘崔健先生为华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，鞠柏辉先生因个人原因不再担任华富竞争力优选混合型证券投资基金和华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

5、经华富基金管理有限公司第三届董事会第一次会议审议通过，同意姚怀然先生辞去公司董事长职务，谢庆阳先生辞去公司总经理职务，不再聘任刘庆年先生担任公司督察长职务，并决定由章宏韬先生担任公司董事长职务，姚怀然先生担任公司总经理职务，满志弘女士担任公司督察长职务。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郭锋先生为华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，增聘郭晨先生为华富中证 100 指数证券投资基金的基金经理。

7、本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可［2011］115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

8、本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金原会计师事务所天健光华会计师事务所被吸收合并为天健正信会计师事务所，为保证基金审计的连续性，本基金聘用天健正信会计师事务所为本基金的审计机构。华富竞争力基金本年度支付给审计机构天健正信会计师事务所审计报酬为 10 万元人民币。天健正信会计师事务所从 2010 年起为本公司提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
广发华福证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	2,439,132,239.78	11.98%	2,028,007.08	11.94%	-
光大证券	2	2,350,194,484.29	11.54%	1,983,926.94	11.68%	-
中投证券	3	2,343,719,953.08	11.51%	1,926,897.36	11.35%	-
安信证券	2	2,187,186,355.90	10.74%	1,786,349.69	10.52%	-
国联证券	1	1,349,194,972.11	6.63%	1,150,034.62	6.77%	-
长城证券	1	1,131,866,541.33	5.56%	919,649.11	5.42%	-
国金证券	2	970,445,677.39	4.77%	788,494.45	4.64%	-
世纪证券	1	833,377,324.85	4.09%	708,368.53	4.17%	-
中信建投证券	1	818,186,343.79	4.02%	664,784.02	3.91%	-
新时代证券	1	765,044,944.50	3.76%	650,284.64	3.83%	-
华安证券	3	651,130,209.49	3.20%	529,046.59	3.12%	-
长江证券	1	618,979,419.87	3.04%	526,126.49	3.10%	-
申银万国	1	530,137,323.22	2.60%	450,615.36	2.65%	-
国信证券	1	510,526,650.81	2.51%	434,914.50	2.56%	-
南京证券	1	474,258,125.15	2.33%	403,119.26	2.37%	-
平安证券	1	421,378,325.19	2.07%	358,167.80	2.11%	-
华宝证券	1	387,153,813.44	1.90%	329,081.38	1.94%	-
民生证券	1	371,246,417.08	1.82%	315,559.17	1.86%	-
齐鲁证券	1	363,467,662.29	1.79%	308,942.97	1.82%	-
东北证券	1	312,986,072.27	1.54%	266,040.55	1.57%	-
国泰君安	1	280,187,043.63	1.38%	238,158.22	1.40%	-
华泰联合证券	1	252,103,196.43	1.24%	214,286.70	1.26%	-

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
广发华福证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	19,447,790.95	13.63%	-	-	-	-
光大证券	1,527,302.96	1.07%	-	-	-	-
中投证券	13,317,013.03	9.33%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	65,255,764.32	45.72%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	13,765,359.10	9.64%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国信证券	28,305,787.24	19.83%	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1,108,734.10	0.78%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-

注：1）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：第一创业证券、民族证券、东兴证券、华创证券、光大证券、宏源证券、中山证券、首创证券、华宝证券、民生证券、新时代证券各新增 1 个席位。本报告期本基金注销交易单元的情况是：广发证券注销 1 个席位。

2）债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

2010年 1 月 29 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010 年 5 月 13 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010 年 6 月 21 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010 年 7 月 1 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告，每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元（含税）。

2010 年 9 月 15 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010 年 11 月 2 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。