基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2011 年 8 月 24 日

华富成长趋势股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 月 30 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 8 月 23 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 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富成长趋势股票
基金主代码	410003
交易代码	410003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年 3 月 19 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,059,262,537.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选符合中国经济增长新趋势、能持续为股东创造价值的公司,采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略,在风险限度内,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的。在行业及股票选择方面,本基金"自下而上"地以可持续增值企业为目标进行三次股票筛选来寻找价值被低估的优势企业,结合"自上而下"精选最优行业,动态寻找优势企业与景气行业的最佳结合,构建投资组合,以追求基金资产的中长期稳定增值。
业绩比较基准	80%×中信标普 300 指数+20%×中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	张燕
	联系电话	021-68886996	0755-83199084
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-8001	95555
传真		021-68887997	0755-83195201

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(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-231,630,093.87
本期利润	-278,775,922.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1317
本期加权平均净值利润率	-18.05%
本期基金份额净值增长率	-16.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-698,739,793.76
期末可供分配基金份额利润	-0.3393
期末基金资产净值	1,360,522,743.59
期末基金份额净值	0.6607
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-15.56%

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)对采用份额净值计算或计算公式中含有 N 的财务指标,均使用对外披露的净值数据及相应的时点(N 为报告期内所含的交易天数)。

4)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	1.93%	1.17%	1.07%	0.96%	0.86%	0.21%
过去三个月	-11.81%	1.15%	-4.41%	0.88%	-7.40%	0.27%
过去六个月	-16.86%	1.27%	-2.45%	0.98%	-14.41%	0.29%
过去一年	11.89%	1.47%	14.77%	1.11%	-2.88%	0.36%
过去三年	-4.40%	1.73%	12.97%	1.60%	-17.37%	0.13%
自基金合同生效起至今	-15.56%	1.83%	21.46%	1.75%	-37.02%	0.08%

注:业绩比较基准收益率=80%×中信标普 300 指数+20%×中信标普全债指数,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《华富成长趋势股票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 60%-95%,债券资产的配置比例为 0-35%,权证的配置比例为 0-3%,现金或者到期日在 1 年以内的政府债券的配置比例不低于基金资产净值的 5%,本基金建仓期为 2007 年 3 月 19 日至 9 月 19 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《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》的规定。

§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,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 2011 年 6 月 30 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、华富强化回报债券型证券投资基金和华富量子生命力股票型证券投资基金九只基金。

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		
陈德义	华富成长趋势基金基金经理	2009年 9 月 8 日	-	七年	清华大学工商管理硕士。历任中金东方资产管理公司研究员、上海丰润投资顾问公司投资咨询经理、国元证券股份有限公司投资研究中心高级研究员、国联安基金管理有限公司高级研究员、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

按照华富成长趋势和华富量子生命力的基金合同,华富成长趋势和华富量子生命力都属于混合型基金,华富量子生命力于 2011 年 4 月 1 日正式成立,目前仍在建仓期内,其基金业绩与华富成长趋势不具可比性。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年 A 股震荡走低。一季度低估值大盘股反弹,带动沪深 300 指数小幅上涨 3%。二季度,统计局报出的 CPI 由 3 月份的 5.4%上升到 6 月份的 6.4%,超出市场预期,沪深 300 指数开始一路走低,二季度下跌 5.6%。以猪肉为核心的食品价格大幅度上涨,是推升 CPI 的主要因素,但上半年政策应对通胀的重点放在货币政策,央行持续上调存款准备金率,大型商业银行的存款准备金率达到 21.5%,导致商业银行对中小企业的借贷利率大幅度上浮。中小盘股上半年调整幅度较大,中小板指数和创业板指数年初至今跌幅分别超过 15%和 20%。反观经济增长数据,则基本保持平稳的势头。上半年发电量增长 13.5%,统计局报出的二季度 GDP 增长 9.5%也比较理想。但 A 股投资者难以形成稳定的经济预期,导致心理波动远大于经济本身的波动。

本基金以成长型股票为投资重点,一季度中小盘股和消费类股调整幅度较大。二季度操作有失误,在 4 月中旬对调整幅度看得不深,未及早降低仓位,因此净值损失较大,甚为遗憾。以后的操作中我们将提高时机选择能力。上半年本基金配置了医药、农业、食品等行业,取得了一定效果,但在机械、化工、建材行业的选股受益不多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 0.6607 元,累计基金份额净值为 0.9507 元。在本报告期内,本基金本报告期份额净值增长率为-16.86%,同期业绩比较基准收益率为-2.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,房地产、汽车市场的销售低迷对相关行业的投资影响比较大。欧美经济处于缓慢、反复的复苏过程中,出口难有大的起色。中国物流与采购协会公布的 7 月份 PMI 为 50.7%,连续 4 个月回落,警示经济有降速风险。及时"调结构、保增长"的必要性值得重视。6 月份 M1、M2 增速分别为 13.1%和 15.9%,控制通胀的货币条件已经基本到位。近年来暴露的食品安全问题不容忽视,生猪等农产品的生产周期波动剧烈,需要通过产业政策和财政补贴来改善农业产出的数量和质量,这将有助于对食品价格和通胀率的有效控制。6 月下旬之后,由于决策层对市场状况有所重视,流动性开始改善,加上市场预期通货膨胀率下半年将逐月回落,A 股开始见底回升,但基础并不稳固。在政策重点从"抗通胀"转向"保增长"之前,指数还将在底部徘徊。

我们判断下半年通胀压力减轻,但货币政策仍可能偏紧,有小幅加息的可能。A 股市场处于趋势性行情的酝酿期,不必过分悲观。我们判断下半年主题投资和调整充分的中小市值成长股有轮番表现的结构性机会。相对看好资源股、成长股,受益于通胀回落的中游制造业和受益于民生投资主题的保障房、水利建设相关行业。

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《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本期利润为-278,775,922.26,期末可供分配利润为-698,739,793.76。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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《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,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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,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:华富成长趋势股票型证券投资基金

报告截止日:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	20,729,229.62	69,387,863.06
结算备付金		10,725,614.00	9,586,466.27
存出保证金		6,679,708.90	3,151,154.53
交易性金融资产	6.4.7.2	1,332,905,392.80	1,652,256,202.30
其中:股票投资		1,263,430,392.80	1,622,148,202.30
基金投资		-	-
债券投资		69,475,000.00	30,108,000.00
资产支持证券投资		-	-
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		-	29,412,256.02
应收利息	6.4.7.5	435,129.12	988,406.63
应收股利		-	-
应收申购款		31,771.08	511,300.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,371,506,845.52	1,765,293,649.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010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		-	37,556,623.98
应付赎回款		963,489.61	844,279.13
应付管理人报酬		1,653,259.92	2,213,904.06
应付托管费		275,543.34	368,984.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,363,254.30	4,158,238.34
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	2,728,554.76	2,960,050.01
负债合计		10,984,101.93	48,102,079.53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,059,262,537.35	2,160,670,586.00
未分配利润	6.4.7.10	-698,739,793.76	-443,479,016.28
所有者权益合计		1,360,522,743.59	1,717,191,569.72
负债和所有者权益总计		1,371,506,845.52	1,765,293,649.25

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.6607 元,基金份额总额 2,059,262,537.35 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:华富成长趋势股票型证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-243,793,384.59	-331,140,306.49
1.利息收入		1,231,408.58	1,283,374.49
其中:存款利息收入	6.4.7.11	229,486.12	535,159.78
债券利息收入		1,001,922.46	613,717.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	134,496.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-197,898,243.14	-116,649,149.27
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-204,401,386.16	-121,305,069.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-152,708.73	-644,778.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	6,655,851.75	5,300,698.93
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-47,145,828.39	-215,793,146.86
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	19,278.36	18,615.15
减:二、费用		34,982,537.67	26,626,300.93
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	11,517,236.77	12,321,527.17
2.托管费	6.4.10.2.2	1,919,539.52	2,053,587.87
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	21,302,687.34	12,010,381.14
5.利息支出		1,155.97	-
其中:卖出回购金融资产支出		1,155.97	-
6.其他费用	6.4.7.20	241,918.07	240,804.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-278,775,922.26	-357,766,607.42
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-278,775,922.26	-357,766,607.42

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:华富成长趋势股票型证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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)	2,160,670,586.00	-443,479,016.28	1,717,191,569.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-278,775,922.26	-278,775,922.26
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)	-101,408,048.65	23,515,144.78	-77,892,903.87
其中:1.基金申购款	52,211,111.07	-14,274,393.25	37,936,717.82
2.基金赎回款	-153,619,159.72	37,789,538.03	-115,829,621.69
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)	2,059,262,537.35	-698,739,793.76	1,360,522,743.59

项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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)	2,478,090,971.36	-646,457,758.04	1,831,633,213.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-357,766,607.42	-357,766,607.42
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)	-102,255,226.00	31,219,187.57	-71,036,038.43
其中:1.基金申购款	29,787,407.67	-9,386,186.96	20,401,220.71
2.基金赎回款	-132,042,633.67	40,605,374.53	-91,437,259.14
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)	2,375,835,745.36	-973,005,177.89	1,402,830,567.47

注:后附报表附注为本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:

_____章宏韬_____ _____姚怀然_____ _____陈大毅____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富成长趋势股票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《华富成长趋势股票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【2007】50 号文核准募集设立。本基金自 2007 年 3 月 12 日起公开向社会发行,至 2007 年 3 月 14 日募集结束。经天健华证中洲(北京)会计师事务所(现已合并为天健正信会计师事务所)验资并出具天健华证中洲验(2007)JR 字第 070001 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 6,777,158,977.43 元;募集资金的银行存款利息 564,607.35 元,折成基金份额,归投资人所有;设立募集期共募集 6,777,723,584.78 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,基金托管人为招商银行股份有限公司;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 2007 年 3 月 19 日生效,该日的基金份额为 6,777,723,584.78 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》、《华富成长趋势股票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会计报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 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:

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,从 2004 年 1 月 1 日起,继续免征收营业所得税;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。)

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‰。

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
招商银行股份有限公司	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

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	522,121,898.78	3.73%	803,930,834.51	10.37%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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	443,801.84	3.81%	443,801.84	8.28%

关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	683,343.75	10.55%	434,667.88	12.96%

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,517,236.77	12,321,527.17
其中,支付销售机构的客户维护费	2,890,814.57	3,118,367.30

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,919,539.52	2,053,587.87

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

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

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2007 年 3 月 19 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	0.00	-
期间申购/买入总份额	27,842,127.24	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	27,842,127.24	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.35%	-

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。

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

本基金本报告期末和上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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
招商银行股份有限公司	20,729,229.62	143,654.52	323,170,409.94	492,618.87

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2011 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
000876	新希望	2011年 6 月 29 日	重大事项停牌	19.95	2011年 7 月 5 日	21.95	1,271,977	24,465,774.15	25,375,941.15	-
000558	莱茵置业	2011年 6 月 29 日	重大事项停牌	7.89	2011年 7 月 5 日	8.68	2,703,291	20,927,491.64	21,328,965.99	-
600315	上海家化	2010年 12 月 3 日	重大事项停牌	36.88	-	-	193,068	5,894,923.95	7,120,347.84	-
002180	万力达	2011年 6 月 30 日	临时停牌	26.55	2011年 7 月 1 日	26.80	238,600	7,091,715.68	6,334,830.00	-

6.4.9.3 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。

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	1,263,430,392.80	92.12
	其中:股票	1,263,430,392.80	92.12
2	固定收益投资	69,475,000.00	5.07
	其中:债券	69,475,000.00	5.07
	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	31,454,843.62	2.29
6	其他各项资产	7,146,609.10	0.52
7	合计	1,371,506,845.52	100.00

注:本表列示的其他各项资产详见 7.9.3 期末其他各项资产构成。

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	61,094,904.64	4.49
B	采掘业	89,161,290.42	6.55
C	制造业	793,573,998.21	58.33
C0	食品、饮料	196,165,068.65	14.42
C1	纺织、服装、皮毛	41,936,121.03	3.08
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	125,159,480.18	9.20
C5	电子	1,377,372.60	0.10
C6	金属、非金属	149,221,151.42	10.97
C7	机械、设备、仪表	185,748,296.88	13.65
C8	医药、生物制品	77,686,881.89	5.71
C99	其他制造业	16,279,625.56	1.20
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,704,104.68	0.35
E	建筑业	13,785,787.73	1.01
F	交通运输、仓储业	10,688,552.31	0.79
G	信息技术业	19,538,431.62	1.44
H	批发和零售贸易	57,367,102.71	4.22
I	金融、保险业	47,185,271.72	3.47
J	房地产业	79,370,199.71	5.83
K	社会服务业	86,960,749.05	6.39
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,263,430,392.80	92.86

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	002140	东华科技	3,167,969	86,960,749.05	6.39
2	000568	泸州老窖	1,287,437	58,089,157.44	4.27
3	600587	新华医疗	1,633,345	52,806,043.85	3.88
4	600111	包钢稀土	676,065	48,291,322