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
送出日期:2011 年 8 月 24 日

华富中证 100 指数证券投资基金

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。

基金托管人交通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	华富中证 100 指数
基金主代码	410008
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
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
报告期末基金份额总额	198,205,969.04 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争控制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%和年跟踪误差不超过 4%,以实现对中证 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,本基金的标的指数为中证 100 指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略,即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	张咏东
	联系电话	021-68886996	021-32169999
	电子邮箱	manzh@hffund.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400-700-8001	95559
传真		021-68887997	021-62701216

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	-9,051,769.26
本期利润	402,293.23
加权平均基金份额本期利润	0.0019
本期加权平均净值利润率	0.23%
本期基金份额净值增长率	-0.17%
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	-34,094,482.99
期末可供分配基金份额利润	-0.1720
期末基金资产净值	164,111,486.05
期末基金份额净值	0.8280
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	-17.20%

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)期末可供分配利润指标的计算方法为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期末余额的孰低数,表中的"期末"均指报告期最后一日,即 6 月 30 日。

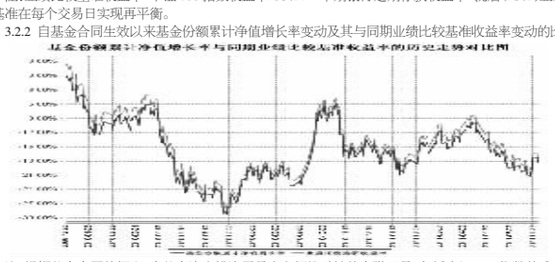
3.2 基金净值表现

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	1.31%	1.09%	0.52%	1.09%	0.79%	0.00%
过去三个月	-3.77%	1.02%	-4.41%	1.02%	0.64%	0.00%
过去六个月	-0.17%	1.14%	-0.35%	1.14%	0.18%	0.00%
过去一年	15.47%	1.32%	14.66%	1.31%	0.81%	0.01%
自基金合同生效起至今	-17.20%	1.39%	-16.33%	1.39%	-0.87%	0.00%

注:业绩比较基准收益率=中证 100 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%,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:根据基金合同的规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的 90%~95%,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 12 月 30 日至 2010 年 6 月 30 日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
郭晨	华富中证 100 指数基金基金经理	2010年 12 月 27 日	-	四年	四川大学管理学硕士。历任平安资产管理公司运营管理部绩效分析师,东吴基金管理有限公司研究部、产品策略部金融工程研究员。2009 年 11 月加入华富基金管理有限公司,任投资部华富中证 100 指数基金基金经理助理。
韩玮	华富中证 100 指数基金基金经理、华富价值增长基金基金经理、公司投资部总监	2009年 12 月 30 日	2011年 1 月 24 日	十一年	清华大学工商管理硕士。历任五洋期货经纪有限公司交易部经理、总经理助理、中国银河证券股份有限公司资产管理总部研究员、研究开发部副经理、投资管理部经理、投资副总监、总监。

注:郭晨的任职日期为公司作出决定之日,韩玮的任职日期为该基金成立之日,离任日期为公司作出决定之日。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

本基金为被动型指数基金,与本基金管理人旗下的其他基金没有可比性。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年大盘持续震荡,整个市场一直处于结构性的行情之中,一季度大盘监筹股表现优于中小盘股票,低估值价值型股票表现优于高估值成长型股票,中证 100 指数表现优于小市值指数。二季度市场整体疲弱,主要体现的是个股和主题性机会。

通胀是上半年市场的主线,上半年通胀数据不断创出新高,央行对流动性持续紧缩,加息和调整存款准备金率一直贯穿始终,市场资金面比较紧张,随着货币紧缩政策的持续,市场开始担心实体经济受到影响,企业盈利下降,此外,政府对房地产的打压、欧债危机、美国经济艰难复苏、日本地震等问题也对市场产生了较大影响。上半年市场整体疲弱,尤其是部分中小板和创业板股票跌幅较大。中小盘股票前两年 IPO 发行市盈率过高,二级市场炒作也较为充分,估值与大盘监筹股差异太大。今年这个泡沫逐渐被刺破,一些公司的业绩不达预期,同时监管层加速中小盘股票的 IPO 审批,在筹码大幅增加的情况下,中小盘股逐渐失去了溢价能力,今年以来,一、二级市场的中小盘股票的估值均大幅下降,回归价值,这是国内 A 股市场进一步成熟的表现。

作为被动型指数基金,华富中证 100 指数基金上半年严格格守本基金的投资理念和投资目标,实现了对基准的有效跟踪。报告期内基金运作良好,跟踪偏离度和跟踪误差均符合基金合同的要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2009 年 12 月 30 日正式成立。截至 2011 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 0.8280 元,累计基金份额净值为 0.8280 元。本基金本报告期份额净值增长率为-0.17%,同期业绩比较基准收益率为-0.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前国内通胀已经逐步见顶,经济下滑的证据不明显,国外欧债、美债危机可能还会出现负面消息,因此我们判断,政府的调控行动逐步进入尾声,未来进一步紧缩流动性的空间不大。保障房、水利建设等投资有望对经济产生正面影响。另外由于上半年市场出现了相当幅度的跌幅,估值处于历史底部,大盘监筹股下跌空间有限,可能出现估值修复的脉冲行情。总体上我们认为下半年市场机会大于风险,更多的还是要把握结构性行情。随着国内 A 股市场的逐渐成熟,系统性的大幅波动会越来越少,结构性的价值发现机会越来越多,市场整体估值逐渐与成熟市场接轨,中小盘股票将会出现分化,能够受益于朝阳行业的优质公司有望走出独立于市场的行情,而基本面有瑕疵的中小盘股票将逐步被市场淘汰。

本基金是完全复制的指数基金,为投资者提供有效跟踪市场的投资工具,通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争实现对业绩基准的有效跟踪。我们将恪守基金合同的规定,保持对基准的紧密跟踪,使投资者分享中国经济长期快速增长的成果。

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

本基金本报告期出现亏损,按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定,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

2011 年上半年度,基金托管人在华富中证 100 指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2011 年上半年度,华富基金管理有限公司在华富中证 100 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2011 年上半年度,由华富基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华富中证 100 指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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:华富中证 100 指数证券投资基金

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	179,834.67	3,681,289.48
结算备付金		10,052,591.68	7,993,832.97
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	153,719,101.71	192,274,697.27
其中:股票投资		153,719,101.71	192,274,697.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	405,137.87
应收利息	6.4.7.5	4,295.20	4,003.06
应收股利		364,598.85	-
应收申购款		146,863.97	394,196.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		164,717,286.08	205,003,157.28
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		-	710,030.15
应付赎回款		57,795.97	4,677.20
应付管理人报酬		65,691.46	88,456.36
应付托管费		19,707.43	26,536.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	9,067.04	63,858.90
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	453,538.13	660,017.60
负债合计		605,800.03	1,553,577.12
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	198,205,969.04	245,289,886.42
未分配利润	6.4.7.10	-34,094,482.99	-41,840,306.26
所有者权益合计		164,111,486.05	203,449,580.16
负债和所有者权益总计		164,717,286.08	205,003,157.28

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.8280 元,基金份额总额 198,205,969.04 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:华富中证 100 指数证券投资基金

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		1,336,161.70	-81,024,362.50
1.利息收入		73,688.22	126,854.95
其中:存款利息收入	6.4.7.11	73,596.04	126,579.41
债券利息收入		92.18	275.54
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)		-8,263,956.00	-11,777,092.72
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-10,229,553.34	-13,127,907.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	52,987.22	9,804.76
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	1,912,610.12	1,341,009.68
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	9,454,062.49	-69,473,495.99
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	72,366.99	99,371.26
二、费用		933,868.47	1,395,890.25
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	439,683.04	634,647.84
2.托管费	6.4.10.2.2	131,904.87	190,394.40
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	149,459.26	361,880.08
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	212,821.30	208,967.93
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		402,293.23	-82,420,252.75
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		402,293.23	-82,420,252.75

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:华富中证 100 指数证券投资基金

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)	245,289,886.42	-41,840,306.26	203,449,580.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	402,293.23	402,293.23
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)	-47,083,917.38	7,343,530.04	-39,740,387.34
其中:1.基金申购款	29,776,323.39	-4,395,707.56	25,380,615.83
2.基金赎回款	-76,860,240.77	11,739,237.60	-65,121,003.17
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)	198,205,969.04	-34,094,482.99	164,111,486.05
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)	337,421,352.99	-106,530.08	337,314,822.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-82,420,252.75	-82,420,252.75
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)	-84,730,292.75	11,042,035.80	-73,688,256.95
其中:1.基金申购款	6,929,709.23	-1,014,064.55	5,915,644.68
2.基金赎回款	-91,660,001.98	12,056,100.35	-79,603,901.63
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)	252,691,060.24	-71,484,747.03	181,206,313.21

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_____

基金管理公司负责人 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

华富中证 100 指数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《华富中证 100 指数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许可[2009]1158 号核准募集设立。本基金自 2009 年 11 月 23 日起公开向社会发行,至 2009 年 12 月 25 日募集结束。经天健光华(北京)会计师事务所验资并出具天健光华验[2009]综字第 070007 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 337,341,867.02 元;募集资金的银行存款利息 79,485.97 元,折成基金份额,归投资人所有;设立募集期共募集 337,421,352.99 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,基金托管人为交通银行股份有限公司;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 2009 年 12 月 30 日生效,该日的基金份额为 337,421,352.99 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》、《华富中证 100 指数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 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:

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
交通银行股份有限公司	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	64,974,556.96	76.65%	223,537,221.29	80.74%

6.4.8.1.2 债券交易

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	700,079.40	100.00%	1,489,080.30	100.00%

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无通过关联方交易单元发生的债券回购交易。

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无通过关联方交易单元发生的权证交易。

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	55,228.93	77.45%	4,987.33	55.01%
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	190,006.81	81.43%	34,401.65	80.24%

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	439,683.04	634,647.84
其中:支付销售机构的客户维护费	137,036.20	168,977.96

注:基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%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	131,904.87	190,394.40

注:基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%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

本基金本报告期内和上年度可比期间内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

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
交通银行股份有限公司	179,834.67	10,279.44	2,840,406.61	12,029.57

注:1)本表仅列示活期存款余额及产生利息。

2)本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。本期末和上年度末的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示。

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
601998	中信银行	2011年 6 月 29 日	配股临时停牌	4.75	2011年 7 月 7 日	4.59	110,467	844,483.57	524,718.25	-

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	153,719,101.71	93.32
	其中:股票	153,719,101.71	93.32
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	10,232,426.35	6.21
6	其他各项资产	765,758.02	0.46
7	合计	164,717,286.08	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指数投资组合

7.2.1 指数投资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	394,240.00	0.24
B	采掘业	20,779,647.71	12.66
C	制造业	41,032,376.92	25.00
C0	食品、饮料	8,919,291.52	5.43
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	2,121,466.70	1.29
C5	电子	137,515.00	0.08
C6	金属、非金属	8,935,921.40	5.45
C7	机械、设备、仪表	19,425,293.68	11.84
C8	医药、生物制品	1,492,888.62	0.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,105,781.52	1.89
E	建筑业	4,668,185.51	2.84
F	交通运输、仓储业	6,367,503.84	3.88
G	信息技术业	3,650,205.09	2.22
H	批发和零售贸易	2,329,267.92	1.42
I	金融、保险业	63,573,851.58	38.74
J	房地产业	6,332,944.12	3.86
K	社会服务业	949,991.00	0.58
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	535,106.50	0.33
	合计	153,719,101.71	93.67

注:报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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

7.3.1 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	600036	招商银行	692,056	9,010,569.12	5.49
2	601318	中国平安	145,226	7,010,059.02	4.27
3	600016	民生银行	1,192,631	6,833,775.63	4.16
4	600000	浦发银行	593,775	5,842,746.00	3.56
5	601166	兴业银行	397,775	5,362,007.00	3.27
6	600030	中信证券	366,136	4,789,058.88	2.92
7	601088	中国神华	142,904	4,307,126.56	2.62
8	601398	工商银行	890,151	3,970,073.46	2.42
9	000002	万 科 A	420,023	3,549,194.35	2.16
10	600519	贵州茅台	16,436	3,494,786.68	2.13

注