华富量子生命力股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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:深圳发展银行股份有限公司
送出日期:2011年8月24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。

基金托管人深圳发展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4月1日(基金成立日)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	华富量子生命力股票
基金主代码	410009
交易代码	410009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月1日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	深圳发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	176,417,210.44份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采用数量化投资方法,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在进行资产配置时,主要根据基金管理人开发的"估值驱动战略资产配置模型",通过对市场未来1-3个月整体估值水平进行预测,实现基金在股票、债券及现金之间的合理配置。模型从市场估值的驱动因素出发,通过寻找与市场走势相关性最大的因子组合,构建市场趋势预测模型。该因子库包括的驱动因子包括但不限于:经济面因子、供求面因子、政策面因子、估值面因子、情绪面因子、盈利面因子。模型结果最终汇总为一个综合的配置指标,通过对市场未来走势的预测结果,调整基金在各类资产之间的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。一般情况下,其预期风险和预期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	深圳发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	董雁
	联系电话	021-68886996	0755-22166596
	电子邮箱	manzh@hffund.com	dongyan@sdb.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95501
传真		021-68887997	0755-82080406

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4月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-10,821,732.10
本期利润	-15,037,897.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0683
本期加权平均净值利润率	-7.08%
本期基金份额净值增长率	-7.57%
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	-13,361,989.31
期末可供分配基金份额利润	-0.0757
期末基金资产净值	163,055,221.13
期末基金份额净值	0.9243
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	-7.57%

注:1)本基金合同生效未满一年。

2)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。

3)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。

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	1.64%	1.00%	0.98%	0.90%	0.66%	0.10%
过去三个月	-7.57%	0.89%	-3.92%	0.83%	-3.65%	0.06%
自基金合同生效起至今	-7.57%	0.89%	-3.92%	0.83%	-3.65%	0.06%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%,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《华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%,债券、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具占基金资产的0%-40%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为2011年4月1日到2011年10月1日,本报告期内,本基金仍处于建仓期。

§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		
朱蓓	华富量子生命力基金基金经理	2011年4月1日	-	四年	上海交通大学安泰管理学院硕士,曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部助理投资经理,华富基金金融工程研究员、产品经理。

注:朱蓓的任职日期为该基金成立之日,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、华富量子生命力的基金合同,华富成长趋势、华富量子生命力都属于股票型基金,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

二季度受异常天气及食品价格上涨影响,通胀预期升温,加上对经济下滑的忧虑,市场悲观情绪浓重,市场走出趋势性下跌行情。4月欧美国家利空消息频出,导致市场大幅波动,牵连A股受挫。5月,大盘在经过前半个月的窄幅震荡后,后半个月出现大幅下跌。整体市场的低迷反映在行业板块的走势上,绝大多数行业板块均出现了不同程度的调整。6月,市场进一步寻底,市场预期通胀水平仍处于高位,货币政策一直在持续紧缩,但国家领导人发表了对控制通胀充满信心的言论,以及保障房相关利好政策的出台,鼓舞了市场的做多信心。

本基金严格按照量化模型进行操作,4月份根据市场情绪监控模型发出的看空信号,基金采取稳健操作策略,积极配置债券回购等绝对收益品种;5月份,基于选股模型价值低估的投资逻辑,前期跌幅较大的部分中小盘个股投资价值已逐渐凸显;6月,根据模型结果显示市场下跌空间有限,基金采取谨慎进取策略,以中性仓位,注重挖掘价值低估的中小盘个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同2011年4月1日生效,截止2011年6月30日,本基金份额净值为0.9243元,累计份额净值为0.9243元。本报告期,本基金份额净值增长率为-7.57%,同期业绩比较基准收益率为-3.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年受国内高通胀及经济下滑预期的影响,预计市场将继续维持震荡运行,波动较上半年有所增大。外围市场下半年不确定较大,美国债务问题的解决方案及希腊债务问题会增加股市的波动。本基金将进一步优化并整合现有资产配置、风格轮动、选股择时等量化模型,并积极开发更适应当前市场状态的模型。本基金将量化理念贯穿于投资的各个环节,积极管理、严格执行,力求在控制风险的前提下,为投资者创造更大收益。

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。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《华富量子生命力股票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

本报告期内,深圳发展银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对华富量子生命力股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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,本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内,由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、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:华富量子生命力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	43,699,591.03	-
结算备付金		2,342,241.66	-
存出保证金		500,000.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	133,717,031.44	-
其中:股票投资		133,717,031.44	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	17,161.20	-
应收股利		37,034.46	-
应收申购款		6,711.20	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		180,319,770.99	-
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		15,965,332.19	-
应付赎回款		89,578.14	-
应付管理人报酬		200,817.05	-
应付托管费		33,469.52	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	359,196.93	-
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	616,156.03	-
负债合计		17,264,549.86	-
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	176,417,210.44	-
未分配利润	6.4.7.10	-13,361,989.31	-
所有者权益合计		163,055,221.13	-
负债和所有者权益总计		180,319,770.99	-

注:本基金合同于2011年4月1日生效。报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.9243元,基金份额总额176,417,210.44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:华富量子生命力股票型证券投资基金

本报告期:2011年4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4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		-13,406,433.59	-
1.利息收入		492,897.84	-
其中:存款利息收入	6.4.7.11	313,978.96	-
债券利息收入		107,758.74	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		71,160.14	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-9,829,102.89	-
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-10,771,982.93	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-48,103.07	-
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	990,983.11	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-4,216,165.84	-
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	145,937.30	-
减:二、费用		1,631,464.35	-
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	792,861.06	-
2.托管费	6.4.10.2.2	132,143.50	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	589,741.36	-
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	116,718.43	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-15,037,897.94	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-15,037,897.94	-

注:本基金合同于2011年4月1日生效,无上年度可比期间。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:华富量子生命力股票型证券投资基金

本报告期:2011年4月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年4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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,037,897.94	-15,037,897.94
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)	176,417,210.44	1,675,908.63	178,093,119.07
其中:1.基金申购款	294,890,970.77	-48,708.05	294,842,262.72
2.基金赎回款	-118,473,760.33	1,724,616.68	-116,749,143.65
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)	176,417,210.44	-13,361,989.31	163,055,221.13
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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注:本基金合同于2011年4月1日生效,无上年度可比期间。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

华富量子生命力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《华富量子生命力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许可[2010]1585号文批准募集设立。本基金自2011年2月28日起公开向社会发行,至2011年3月25日募集结束。经天健正信会计师事务所验资并出具天健正信验(2011)综字第020032号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。本次募集的净认购金额为293,506,500.23元人民币,有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计148,404.31元人民币,折成基金份额,归投资人所有。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,基金托管人为深圳发展银行股份有限公司;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2011年4月1日生效,该日的基金份额为293,654,904.54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》、《华富量子生命力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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2011年4月1日至2011年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币;记账本位币单位为元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,其他金融资产划分为贷款和应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

6.4.4.4.1 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

6.4.4.4.1.1 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.4.1.2 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于获得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减权证确定的成本确认债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

6.4.4.4.1.3 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证按附注6.4.4.4.1.2所示的方法确认权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.4.2 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

6.4.4.4.3 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值,主要资产的估值方法如下:

6.4.4.5.1 股票投资

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

首次公开发行但未上市的股票采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票,在同一股票上市交易后,在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

自2006年11月13日起基金新投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为:若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分认为估值增值。

6.4.4.5.2 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘净价估值;估值日无交易,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值。银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

6.4.4.5.3 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止,上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值;估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的市场交易收盘价估值;估值日无交易的且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值;在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值;因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

6.4.4.5.4 如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的,可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

6.4.4.10.1 基金管理人报酬

根据《华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同》的规定,基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提,按月支付。

6.4.4.10.2 基金托管费

根据《华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同》的规定,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。

6.4.4.10.3 卖出回购证券支出

卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

6.4.4.10.4 其他费用

按实际支出金额列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后五位的,则根据权责发生制原则,采用待摊或预提的方法确认。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权;若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记结算机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额;本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%;收益分配基准日可供分配利润指该日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即指基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;本基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日;法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无

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,继续免征收营业税。

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。)

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‰。

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
深圳发展银行股份有限公司	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

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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4月1日(基金合同生效日)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	792,861.06	-
其中:支付销售机构的客户维护费	200,931.44	-

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4月1日(基金合同生效日)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	132,143.50	-

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4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(2011年4月1日)持有的基金份额	10,007,750.00	-
期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额	10,007,750.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.67%	-

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010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
华安证券有限责任公司	10,008,100.00	5.67%	-	-

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 2011年4月1日(基金合同生效日)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
深圳发展银行股份有限公司	43,699,591.03	304,859.36	-	-

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
002372	伟星新材	2011年6月27日	重大事项停牌	17.39	2011年7月5日	17.94	42,301	796,170.92	735,614.39	-

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	133,717,031.44	74.16
	其中:股票	133,717,031.44	74.16
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	46,041,832.69	25.53
6	其他各项资产	560,906.86	0.31
7	合计	180,319,770.99	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	-	-
B	采掘业	4,549,410.96	2.79
C	制造业	73,966,032.35	45.36
C0	食品、饮料	2,459,903.58	1.51
C1	纺织、服装、皮毛	4,534,218.80	2.78
C2	木材、家具	59.98	0.00
C3	造纸、印刷	3,881,736.35	2.38
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,754,384.52	5.37
C5	电子	8,518,931.10	5.22
C6	金属、非金属	4,532,915.90	2.78
C7	机械、设备、仪表	31,797,654.79	19.50
C8	医药、生物制品	8,870,305.49	5.44
C99	其他制造业	615,921.84	0.38
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,152,684.26	0.71
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	15,564,378.16	9.55
G	信息技术业	8,008,781.43	4.91
H	批发和零售贸易	7,481,178.51	4.59
I	金融、保险业	7,390,604.91	4.53
J	房地产业	7,625,895.12	4.68
K	社会服务业	5,826,843.10	3.57
L	传播与文化产业	1,622,517.00	1.00
M	综合类	528,705.64	0.32
	合计	133,717,031.44	82.01

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	300086	康芝药业	79,800	1,524,978.00	0.94
2	002117	东港股份	79,715	1,489,873.35	0.91
3	601111	中国国航	153,277	1,469,926.43	0.90
4	600486	扬农化工	67,522	1,467,928.28	0.90
5	600166	福田汽车	168,096	1,459,073.28	0.89
6	002191	劲嘉股份	166,100	1,450,053.00	0.89
7	600480	凌云股份	106,000	1,446,900.00	0.89
8	601688	华泰证券	116,985	1,444,764.75	0.89
9	600246	万通地产	288,897	1,444,485.00	0.89
10	600754	锦江股份	82,468	1,435,767.88	0.88

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600664	哈药股份	3,809,912.65	2.34
2	300086	康芝药业	3,440,450.52	2.11
3	300077	国民技术	3,438,515.98	2.11
4	002362	汉王科技	2,995,992.73	1.84
5	000916	华北高速	2,698,357.29	1.65
6	000989	九芝堂	2,687,982.12	1.65
7	002172	澳洋科技	2,687,679.81	1.65
8	300112	万讯自控	2,685,244.46	1.65
9	002133	广宇集团	2,685,221.86	1.65
10	600573	惠泉啤酒	2,678,318.51	1.64
11	002435	长江润发	2,672,664.57	1.64
12	600323	南海发展	2,667,671.49	1.64
13	002494	华斯股份	2,394,119.39	1.47
14	002028	思源电气	2,335,508.61	1.43
15	300078	中瑞思创	2,312,736.83	1.42
16	300081	恒信移动	2,268,425.60	1.39
17	600269	赣粤高速	2,264,398.58	1.39
18	300135	宝利沥青	2,263,814.44	1.39
19	300119	瑞普生物	2,257,616.60	1.38
20	000715	中兴商业	2,255,981.12	1.38

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600664	哈药股份	2,872,570.28	1.76
2	002362	汉王科技	2,130,305.73	1.31
3	002434	万里扬	2,060,315.42	1.26
4	300131	英唐智控	2,002,733.21	1.23
5	300041	回天胶业	2,000,745.34	1.23
6	600976	武汉健民	1,943,887.19	1.19
7	002048	宁波华翔	1,916,457.78	1.18
8	600323	南海发展	1,899,383.32	1.16
9	002436	兴森科技	1,887,159.40	1.16
10	601718	际华集团	1,884,702.91	1.16
11	002489	浙江永强	1,883,925.28	1.16
12	600386	北巴传媒	1,882,689.53	1.15
13	000916	华北高速	1,882,322.06	1.15
14	002435	长江润发	1,871,530.60	1.15
15	002393	力生制药	1,859,912.66	1.14
16	300133	华策影视	1,849,743.94	1.13
17	002467	二六三	1,842,775.53	1.13
18	002401	交技发展	1,819,983.23	1.12
19	002345	潮宏基	1,819,358.91	1.12
20	300086	康芝药业	1,750,737.63	1.07

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

买入股票成本(成交)总额	292,406,133.72
卖出股票收入(成交)总额	143,700,953.51

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、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体除劲嘉股份被监管部门立案调查外,其余的没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

劲嘉股份(002191)于2010年7月27日发布关于被中国证券监督管理委员会立案调查的公告,公告称该公司于2010年7月26日收到中国证券监督管理委员会《立案调查通知书》(2010深稽立通字01号)。因涉嫌违反证券法律法规,中国证券监督管理委员会深圳稽查局决定对该公司及相关人员立案调查。此次调查截止目前尚未有结论。本基金根据基金合同中所规定的量化模型进行选股,对该股票的投资符合法律法规和公司制度的规定。

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 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	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	37,034.46
4	应收利息	17,161.20
5	应收申购款	6,711.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	560,906.86

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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
2,620	67,334.81	53,008,551.00	30.05%	123,408,659.44	69.95%

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	-	-

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年4月1日)基金份额总额	293,654,904.54
本报告期基金总申购份额	1,236,066.23
减:本报告期基金总赎回份额	118,473,760.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	176,417,210.44

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。

§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

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,韩玮先生、季雷先生不再担任华富价值增长灵活配置混合型证券投资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,增聘张钫先生为华富强化回报债券型证券投资基金的基金经理。

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

10.7.1 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	
华泰联合证券	1	233,581,356.20	53.56%	189,786.63	52.84%	-
国联证券	1	84,524,564.17	19.38%	71,845.22	20.00%	-
世纪证券	1	72,982,418.30	16.73%	59,299.10	16.51%	-
中投证券	1	45,018,748.56	10.32%	38,265.98	10.65%	-

10.7.2 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
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	234,818,833.51	100.00%	668,600,000.00	100.00%	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

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。

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

§11 影响投资者决策的其他重要信息

2011年4月29日,托管人深圳发展银行股份有限公司(以下简称深发展)在银行间债券市场成功发行了36.5亿元混合资本债券。本期募集资金将依据使用法律和监管部门的批准用于充实发行人的资本基础,补充附属资本,提升资本充足率。

2011年6月29日,深发展关于重大资产重组事项获得中国证监会核准进行公告。6月28日深发展收到中国证券监督管理委员会《关于核准深圳发展银行股份有限公司向中国平安保险(集团)股份有限公司发行股份购买资产的批复》(证监许可[2011]1022号)。

2011年6月30日,深发展就发行股份购买资产暨关联交易发布报告书及摘要。依照《重组办法》的有关规定,深发展依据与中国平安于2010年签署《股份认购协议》、《股份认购协议之补充协议》的交易构成重大资产重组。同时,本次交易涉及深发展发行股份购买资产,需提交中国证监会并购重组审核委员会审核,并经证监会核准后方可实施。中国平安保险(集团)有限公司(即本次收购人)通过本次交易将认购深发展非公开发行股份的数量为1638336654股(具体数量以中国证监会最终核准的结果为准)。本次交易完成后,收购人将直接及间接持有深发展约26.84亿股股份,约占本次交易完成后深发展总股本的52.38%,成为深发展的控股股东。

2011年6月30日,深发展公告关于重大资产重组完成后三年内平安银行(相关资产)盈利厘定方案。按照上市公司重大资产重组管理办法第三十三条,深发展需要在重大资产重组实施完毕后3年内的年度报告中单独披露平安银行(或相关资产)的实际盈利数与评估报告中利润预测数的差异。以平安银行被深发展吸收合并,平安银行法人资格不再存续为时间点(简称"合并时点"),此时点前发生的业务称为"合并前业务",此时点后发生的新业务称为"合并后业务"。合并时点前平安银行的盈利,由于平安银行为独立法人机构,有独立的账务处理系统,合并时点前盈利数据依据平安银行经审计之财务报告厘定。合并时点后平安银行的盈利才按照此方案厘定。