景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城内需贰号股票
基金主代码	260109
交易代码	260109
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月11日
报告期末基金份额总额	4,503,924,731.56份
投资目标	本基金通过优先投资于内需拉动型行业中的优势企业,分享中国经济和行业的快速增长带来的最大收益,实现基金资产的长期、可持续的稳定增值。
投资策略	股票投资部分以"内需拉动型"行业的优势企业为主,以成长、价值及稳定收入为基础,在合适的价位买入具有高成长性的成长型股票,价值被市场低估的价值型股票,以及能提供稳定收入的收益型股票。债券投资部分着重本金安全性和流动性。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=沪深综合指数总市值加权指数×80%+中国债券总指数×20%
风险收益特征	本基金是风险程度较高的投资品种
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-227,816,208.76
2.本期利润	-503,655,651.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.113
4.期末基金资产净值	4,018,953,387.78
5.期末基金份额净值	0.892

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上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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

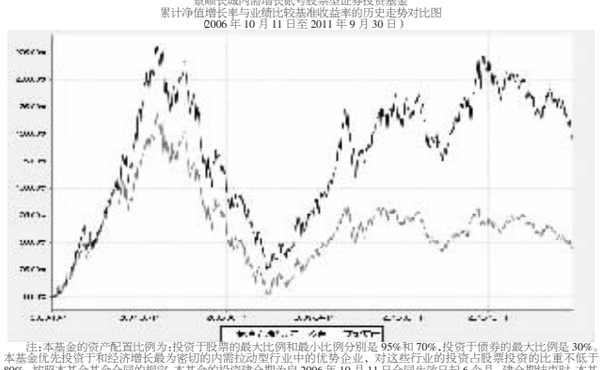
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.16%	1.06%	-11.41%	1.00%	0.25%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年10月11日至2011年9月30日)



注:本基金的资产配置比例为:投资于股票的最大比例和最小比例分别是95%和70%,投资于债券的最大比例是30%。本基金优先投资于和经济增长最为密切的内需拉动型行业中的优势企业,对这些行业的投资占股票投资的比重不低于80%。按照本基金基金合同的规定,本基金的投资建仓期为自2006年10月11日合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏辉	本基金基金经理,景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理,景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金经理,投资总监	2007-9-15	-	10	华中理工大学工学学士、经济学硕士。曾先后担任深圳市农村商业银行资金部债券交易员、长城证券研究部研究员、融通基金研究策划部行业研究员;2007年3月加入本公司。
杨鹏	本基金基金经理,景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理,景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金经理	2010-8-21	-	7	北京大学经济学学士、上海财经大学经济学硕士。曾任职于融通基金研究策划部,担任宏观研究员、债券研究员和货币基金基金经理助理职务;2008年3月加入本公司。

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"按基金合同生效日填写,"离任日期"为根据公司决定的解聘日期(公告前一日)。对此后的非首任基金经理,"任职日期"指根据公司决定聘任后的公告日期,"离任日期"指根据公司决定的解聘日期(公告前一日)。

2.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,本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,我司分析了投资风格相似的两只基金-景顺长城内需增长开放式证券投资基金和景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金的业绩,其表现差异如下:

基金名称	报告期内净值增长率
景顺长城内需增长股票	-10.91%
景顺长城内需贰号股票	-11.16%

在报告期内,上述两只基金业绩表现差异在5%之内。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度本基金降低了股票资产配置比例,基于对投资增速的担心,降低了相关行业的配置比例。

3季度业绩表现不理想,虽然及时降低了仓位,但个股选择存在一定偏差,导致业绩依然不尽人意。以白酒为例,本基金虽然有较高的配置比例,但前期配置比例集中在泸州老窖,在3季度带来了较大的负贡献,从而抵消了相当一部分年初以来的正贡献。本基金未来将在选股的基础上,适当增加波段操作的力度。

展望未来,中国经济在增长方式转型的过程中将涌现出一批又一批的优秀企业,这将为我们提供良好的投资机会。本基金将重点配置具有长期增长潜力的优秀企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年3季度,本基金份额净值增长率为-11.16%,高于业绩比较基准收益率0.25%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,990,352,729.70	69.10
	其中:股票	2,990,352,729.70	69.10
2	固定收益投资	439,115,000.00	10.15
	其中:债券	439,115,000.00	10.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	321,600,000.00	7.43
	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	566,039,593.91	13.08
6	其他各项资产	10,396,699.09	0.24
7	合计	4,327,504,022.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	187,475,330.30	4.66
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,813,756,121.91	45.13
C0	食品、饮料	954,275,742.33	23.74
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	35,315,243.48	0.88
C5	电子	139,725,672.45	3.48
C6	金属、非金属	94,566,456.32	2.35
C7	机械、设备、仪表	442,089,214.60	11.00
C8	医药、生物制品	147,783,792.73	3.68
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	30,791,175.96	0.77
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	126,048,474.80	3.14
H	批发和零售贸易	83,077,175.50	2.07
I	金融、保险业	198,374,866.62	4.94
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	44,347,352.74	1.10
L	传播与文化产业	506,482,231.87	12.60
M	综合类	-	-
	合计	2,990,352,729.70	74.41

5.3 报告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

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	300124	汇川技术	5,184,068	363,662,370.20	9.05
2	000568	泸州老窖	8,381,224	326,029,613.60	8.11
3	600519	贵州茅台	1,011,405	192,763,678.95	4.80
4	600600	青岛啤酒	5,448,001	180,110,913.06	4.48
5	300027	华谊兄弟	8,070,155	122,908,460.65	3.06
6	000858	五粮液	3,196,024	116,015,671.20	2.89
7	300251	光线传媒	1,851,632	114,597,504.48	2.85
8	000988	华工科技	7,593,505	110,637,367.85	2.75
9	600000	浦发银行	11,647,977	99,473,723.58	2.48
10	601166	兴业银行	7,982,336	98,901,143.04	2.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	439,115,000.00	10.93
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	439,115,000.00	10.93

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101030	11央行票据30	2,000,000	193,100,000.00	4.80
2	1101069	11央行票据69	500,000	49,585,000.00	1.23
3	1101071	11央行票据71	500,000	49,580,000.00	1.23
4	1101073	11央行票据73	500,000	49,570,000.00	1.23
5	1001087	10央行票据87	500,000	48,950,000.00	1.22

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 宜宾五粮液股份有限公司(下称:五粮液,股票代码:000858)因信息披露存在违法事实于2011年5月27日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》([2011]17号),主要涉及到信息披露不及时不充分的问题,同时对公司以及管理层进行了不同数额的罚款。

本基金投研人员分析认为,五粮液是食品饮料行业里一家具有中长期投资价值的公司,违规行为大部分发生时间已经久远,公司治理已经得到了很大的改善,目前估值处于历史低位。

本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对五粮液进行了投资。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,780,798.09
2	应收证券清算款	659,869.11
3	应收股利	-
4	应收利息	4,572,692.65
5	应收申购款	2,383,339.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,396,699.09

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中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在流通受限情况的说明

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	4,404,581,778.90
本报告期基金总申购份额	274,268,089.06
减:本报告期基金总赎回份额	174,925,136.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,503,924,731.56

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金设立的文件;

2、《景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金合同》;

3、《景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金托管协议》;

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

7.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

7.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
二〇一一年十月二十四日

华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30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10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2011年7月1日至2011年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富策略精选混合
基金主代码	410006
交易代码	410006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月24日
报告期末基金份额总额	88,852,733.02份
投资目标	本基金将运用多层次的复合投资策略,在严格控制风险并保证充分流动性的前提下,力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略的基本思想是在充分控制风险的前提下实现高收益。依据风险-收益-投资策略关系原理,本基金采用包括资产配置策略、行业配置策略和个股精选策略在内的多层次复合投资策略进行实际投资,高层策略作用是规避风险,低层策略用于提高收益。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金属于灵活配置混合型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,543,009.62
2.本期利润	-9,794,148.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1099
4.期末基金资产净值	72,725,860.39
5.期末基金份额净值	0.8185

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。

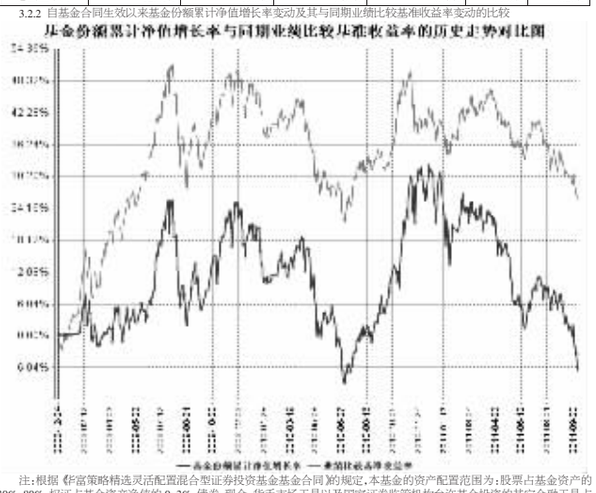
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	-12.01%	1.05%	-8.95%	0.79%	-3.06%	0.26%

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《华富策略精选灵活配置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:股票占基金资产的30%~80%,权证占基金资产净值的0~3%,债券、现金、货币市场工具以及国家证监管机构允许基金投资的其它金融工具占基金资产的5%~70%,其中,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%。本基金建仓期为2008年12月24日到2009年6月24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《华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季雷	华富策略精选基金基金经理	2008年12月26日	-	十一年	工商管理硕士、物理学士。先后担任东北证券金融与产业研究所行业公司部经理、金融工程部经理,投资策划部经理兼首席策略师;东方基金研究部副经理、东方龙基金经理助理、研究部经理;2007年3月至2008年9月担任东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理兼金融工程部经理,投资决策委员会委员。
崔健	华富策略精选基金基金经理	2010年8月27日	-	五年	中央财经大学金融学硕士。历任平安资产管理公司投资经理助理,泰信基金管理有限公司研究员、泰信优质生活股票型基金基金经理助理等职务,2010年7月加入华富基金管理有限公司。

注:季雷和崔健的任职日期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,对本基金的管理始终按照基金合同,招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

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

按照华富策略精选、华富竞争力和华富价值增长的基金合同,华富策略精选、华富竞争力和华富价值增长都属于混合型基金,2011年3季度,华富策略精选、华富竞争力和华富价值增长的净值增长率分别为-12.01%、-10.93%与-8.57%。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2011年第三季度,中国经济呈现滞涨格局,大规模的货币扩张和财政支出对实体经济的边际贡献已经弱化,需求充点难觅,库存风险不断累积,而信用扩张所带来的广义通胀(资产泡沫、物价上涨)和债务风险则需要时间解决;紧货币、宽财政、升汇率"的宏观政策取向带来了利率中枢的大幅提升;流动性条件持续紧张;海外金融市场的动荡亦有所加剧。在基本面和流动性的双重压制下,A股市场出现大幅下跌,周期性行业跌幅居前,以食品饮料为代表的防御型行业相对表现较好。

报告期内,本基金采取了较为均衡的行业配置策略,但由于对系统性风险认识的不足,仓位策略不够得当,影响了基金的净值表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2008年12月24日正式成立。截止2011年9月30日,本基金份额净值为0.8185元,累计份额净值为0.9785元。报告期,本基金份额净值增长率为-12.01%,同期业绩比较基准收益率为-8.95%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季度,我们认为:经过前期的快速下跌,市场的可参与度有所提升,但总体应保持谨慎。宏观政策的中期目标仍在于治理通胀(物价、房价),而通胀的下行在较大概率上将伴随着增长的减速,增长通胀的情景组合或将从目前的"增长回落、通胀上升"转向今年底、明年初的"增长见底、通胀回落",因此,盈利增长的结构性契机可能更多地围绕供给层面的变化和经济转型而展开。同时,与全球"去杠杆"的过程一致,除非国内就业形势出现严重恶化,期待总量政策的持续放松并不现实。

本基金将继续保持较为均衡的行业配置策略,在风格上更为侧重成长性和主题性,积极为明年寻找和布局合适的中长线机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	64,650,779.68	64.08
	其中:股票	64,650,779.68	64.08
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	27,894,908.40	35.29
6	其他资产	491,914.33	0.62
7	合计	79,037,602.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,866,000.00	2.57
B	采掘业	2,418,000.00	3.32
C	制造业	26,242,889.57	36.08
C0	食品、饮料	3,223,790.72	4.43
C1	纺织、服装、皮毛	1,585,200.00	2.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,757,799.90	7.92
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	1,894,700.00	2.61
C7	机械、设备、仪表	10,909,652.05	15.00
C8	医药、生物制品	2,871,746.90	3.95
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	781,500.00	1.07
E	建筑业	745,700.00	1.03
F	交通运输、仓储业	954,000.00	1.31
G	信息技术业	4,925,427.87	6.77
H	批发和零售贸易	1,346,865.30	1.85
I	金融、保险业	2,250,000.00	3.09
J	房地产业	1,561,796.94	2.15
K	社会服务业	3,987,600.00	5.48
L	传播与文化产业	3,571,000.00	4.91
M	综合类	-	-
	合计	50,650,779.68	69.65

5.3 报告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

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	600199	金种子酒	139,910	2,547,761.10	3.50
2	600348	阳泉煤业	100,000	2,418,000.00	3.32
3	600030	中信证券	200,000	2,250,000.00	3.09
4	601311	骆驼股份	100,000	2,205,000.00	3.03
5	002298	鑫龙电器	157,779	2,074,793.85	2.85
6	300090	盛运股份	200,000	2,004,000.00	2.76
7	002299	圣农发展	120,000	1,866,000.00	2.57
8	002050	三花股份	59,803	1,686,444.60	2.32
9	002154	报喜鸟	120,000	1,585,200.00	2.18
10	600485	中创信测	119,911	1,579,227.87	2.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	407,594.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,275.13
5	应收申购款	80,045.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	491,914.33

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不在流通受限情况。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	91,704,395.75
本报告期期间基金总申购份额	4,777,873.67
减:本报告期期间基金总赎回份额	7,629,536.40
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	88,852,733.02

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同

2、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富中证100指数证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9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
报告送出日期:2011年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2011年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至2011年9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	202,720,424.50份
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投资组合,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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-951,570.23
2.本期利润	-23,464,983.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1178
4.期末基金资产净值	144,020,209.09
5.期末基金份额净值	0.7104

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。

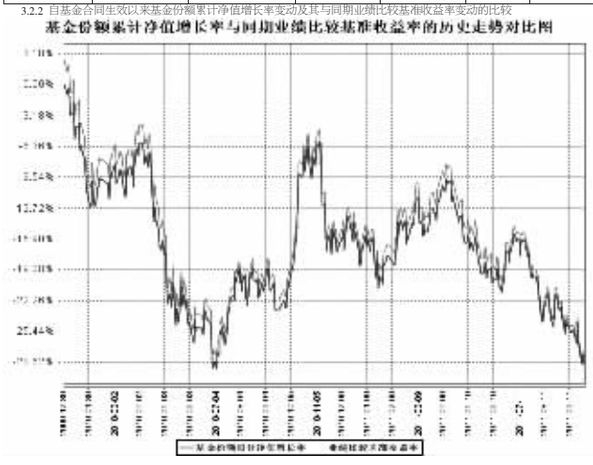
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	-14.20%	1.23%	-14.45%	1.24%	0.25%	-0.01%

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《华富中证100指数证券投资基金基金合同》的规定,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%。本基金建仓期为2009年12月30日到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。本报告期内,本基金严格执行了《华富中证100指数证券投资基金基金合同》的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。

注:郭晨的任职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,对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度国内股市、债市呈现单边下跌的走势,全球主要股市,大宗商品基本都出现了大幅下跌,各种负面消息不绝于