华富成长趋势股票型证券投资基金

2011 年度报告摘要

2011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:招商银行股份有限公司
送出日期:2012年3月30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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月29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2011年01月01日起至2011年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富成长趋势股票型证券投资基金
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	2,016,154,397.20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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-376,648,497.48	219,011,660.08	-44,956,166.79
本期利润	-550,282,140.24	151,316,743.59	754,887,234.85
加权平均基金份额本期利润	-0.2653	0.0637	0.2781
本期基金份额净值增长率	-33.71%	7.52%	57.22%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4732	-0.2053	-0.2714
期末基金资产净值	1,062,087,432.45	1,717,191,569.72	1,831,633,213.32
期末基金份额净值	0.5268	0.7947	0.7391

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。

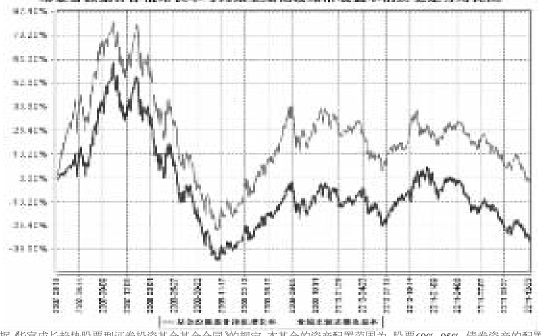
3.2 基金净值表现

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	-5.12%	1.38%	-6.52%	1.13%	1.40%	0.25%
过去六个月	-20.27%	1.26%	-18.25%	1.09%	-2.02%	0.17%
过去一年	-33.71%	1.26%	-20.26%	1.04%	-13.45%	0.22%
过去三年	12.06%	1.51%	26.04%	1.34%	-13.98%	0.17%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-32.67%	1.77%	-0.71%	1.69%	-31.96%	0.08%

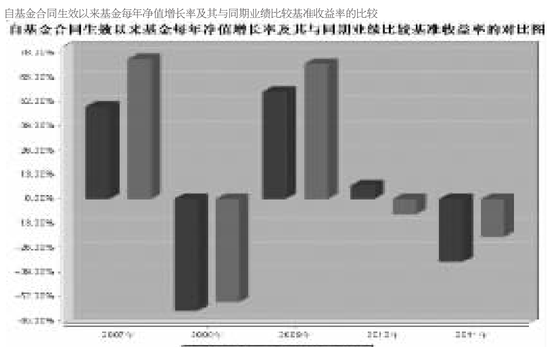
注:业绩比较基准收益率=80%×中信标普300指数+20%×中信标普全债指数,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来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
2011年	-	-	-	-	
2010年	-	-	-	-	
2009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2011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、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金和华富中小板指数增强型证券投资基金十只基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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、研究生学历。历任中企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股票型基金,2011年,华富成长趋势和华富量子生命力的净值增长率分别为-33.71%与-25.49%。两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

2011年上证综指下跌21.7%,A股经历了10年来仅次于2008年跌幅的熊市。导致这轮熊市的主要原因是,经济局势困难而复杂,政策上以防通胀为核心目标,采取了紧缩间接融资、鼓励直接融资的措施。A股市场难以承担股票供给、股东套现的双重压力,在2-4月的短暂反弹后,呈现逐波下跌的走势。市场热点散乱而短暂,全年调整幅度最大的板块是估值偏高且成长性不突出的中小板和创业板,其综合指数分别下跌34.1%和35.4%。

本基金在2011年的投资运作有几次失误。主要是对通胀形势偏于乐观,CPI从1月的4.9%上行到6月份的最高点6.4%,由此引发的流动性收紧超过我们预期。2011年共上调存款准备金6次,加息3次。其次是仓位策略不当,尤其在三季度对"政府出台措施解决中小企业融资难",以及"推进保障房建设拉动经济增长"抱有过高期望,保持了较高仓位,拉大了和同行的业绩差距。

2011年我们在低估值的银行、地产板块配置不足,对食品饮料配置比例未超过同行水平;同时在中小市值股票的配置偏多,对市场热点积极捕捉但在如此大环境下胜率并不高。总结经验和教训,我们认为,A股市场缺乏可以真正穿越周期而且价格合理的股票。A股市场更类似弱有效市场,市场对经济信息和投资逻辑的反应并非理性而及时,因此趋势投资方法有其特定的适用范围。从中长期趋势看,股票价格走势将向其合理价值回归,在估值充分调整后的价值投资机会更值得重视。

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0.5268元,累计份额净值为0.8168元;本报告期份额净值增长率为-33.71%,同期业绩比较基准收益率为-20.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济指标分析显示,中国经济已经进入周期性的底部。2011年四个季度的GDP增速分别为9.7%、9.5%、9.2%和8.9%,呈现小幅减速的趋势。但是在亮丽数字的背后,下半年尤其是四季度房地产投资和出口开始加速下滑,房地产投资从上半年超过35%的增速下滑到12月的10.8%;欧债危机继续发酵,12月中国出口增速13.4%,为三年来新低。制造业增长放缓,企业库存增加,企业被动去库存导致生产者物价指数PPI从7月份的7.5%下跌到10月份的5%,12月份达到1.7%。

对于2012年的A股市场,我们持谨慎乐观的态度。主要的理由是:第一,可以预期,"稳增长"将是2012年政策的主线,适度的刺激投资政策可以期待。房地产如果出现价跌量升的情况,产业链相关行业的下滑局面将得到缓解。其次,在增长和通胀均回落之后,流动性适度放松的条件已经成熟,2011年12月5日和2012年2月24日,央行下调存款类金融机构人民币存款准备金率各0.5个百分点。货币供应增速2011年末已经低于央行的增长率目标,若2012年定在14%的M2增速目标则意味着近12万亿元的新增货币供给。第三,监管层估值已经足够便宜,银行股目前的滚动市盈率仅7.4倍,相对于成熟的H股市场亦有折让。市场出现回暖迹象,若能得到基本面的验证,则有助于巩固回升势头。

本基金2012年行业配置策略,将保持对低估值的金融、地产、能源、食品饮料行业的核心配置,重视医药、信息等对宏观经济周期较不敏感的投资机会。依据对企业活动的调研情况,捕捉经济可能回升带来的机械、建材、化工等行业的反弹机会。若通胀和增长形势坏于预期,行业选择上对汽车、家电等消费股,以及农业、黄金等通胀受益股给予重视,并保持谨慎的仓位应对。我们预期2012年仍无大的趋势性机会,指数波动幅度较大,我们将更重视对个股投资价值的筛选,提高交易的胜率,获取绝对收益。

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。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

根据本报告3.1华富成长趋势股票型基金本期利润为-550,282,140.24,期末可供分配利润为--954,066,964.75。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。

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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审(2012)6-22号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	华富成长趋势股票型证券投资基金全体持有人	
引言段	我们审计了后附的华富成长趋势股票型证券投资基金(以下简称"华富成长趋势基金")财务报表,包括2011年12月31日的资产负债表,2011年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是华富成长趋势基金的基金管理人华富基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;(2)选择和运用恰当的会计政策;(3)作出合理的会计估计。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,在所有重大方面公允反映了华富成长趋势基金2011年12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	曹小勤	李勤
会计师事务所的名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	杭州市西溪路128号新湖商务大厦9楼	
审计报告日期	2012年3月20日	

§7 年度财务报表

7.1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12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产:		
银行存款	57,965,337.72	69,387,863.06
结算备付金	4,622,520.72	9,586,466.27
存出保证金	4,303,122.00	3,151,154.53
交易性金融资产	990,405,745.59	1,652,256,202.30
其中:股票投资	990,405,745.59	1,622,148,202.30
基金投资	-	-
债券投资	-	30,108,000.00
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	13,977,750.22	29,412,256.02
应收利息	15,859.32	988,406.63
应收股利	-	-
应收申购款	49,991.67	511,300.44
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,071,340,327.24	1,765,293,649.25
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,658,565.40	37,556,623.98
应付赎回款	192,193.25	844,279.13
应付管理人报酬	1,404,007.16	2,213,904.06
应付托管费	234,001.21	368,984.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,554,112.04	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	3,210,015.73	2,960,050.01
负债合计	9,252,894.79	48,102,079.53
所有者权益:		
实收基金	2,016,154,397.20	2,160,670,586.00
未分配利润	-954,066,964.75	-443,479,016.28
所有者权益合计	1,062,087,432.45	1,717,191,569.72
负债和所有者权益总计	1,071,340,327.24	1,765,293,649.25

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.5268元,基金份额总额2,016,154,397.20份。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-491,098,824.83	206,101,495.87
1.利息收入	1,644,303.68	2,228,961.49
其中:存款利息收入	564,842.76	1,030,337.98
债券利息收入	1,079,460.92	1,057,474.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	141,148.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-319,154,100.54	271,231,440.30
其中:股票投资收益	-328,045,228.25	263,341,633.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-157,958.73	413,554.65
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	9,049,086.44	7,476,251.76
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-173,633,642.76	-67,694,916.49
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	44,614.79	336,010.57
减:二、费用	59,183,315.41	54,784,752.28
1.管理人报酬	20,799,459.43	24,821,279.05
2.托管费	3,466,576.66	4,136,879.86
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	34,430,326.53	25,339,474.15
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	485,796.82	487,119.22
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-550,282,140.24	151,316,743.59
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-550,282,140.24	151,316,743.59

7.3 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	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)	-	-550,282,140.24	-550,282,140.24
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)	-144,516,188.80	39,694,191.77	-104,821,997.03
其中:1.基金申购款	91,463,519.36	-28,182,552.10	63,280,967.26
2.基金赎回款	-235,979,708.16	67,876,743.87	-168,102,964.29
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)	2,016,154,397.20	-954,066,964.75	1,062,087,432.45

项目	上年度可比期间 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)	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)	-	151,316,743.59	151,316,743.59
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)	-317,420,385.36	51,661,998.17	-265,758,387.19
其中:1.基金申购款	364,893,370.85	-110,882,529.65	254,010,841.20
2.基金赎回款	-682,313,756.21	162,544,527.82	-519,769,228.39
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)	2,160,670,586.00	-443,479,016.28	1,717,191,569.72

报表附注为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。

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2011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12月31日的财务状况以及2011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,继续免征收营业税。

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。)

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
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
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 2011年1月1日至2011年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
华安证券	1,746,702,574.57	7.71%	803,930,834.51	4.84%

7.4.8.1.2 债券交易

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交易。

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 2011年1月1日至2011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	1,484,693.10	7.89%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 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	683,343.75	4.93%	-	-

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,799,459.43	24,821,279.05
其中:支付销售机构的客户维护费	5,217,346.77	6,225,652.00

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,466,576.66	4,136,879.86

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	-	-
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	1.38%	-

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

本基金本报告期和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

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 2011年1月1日至2011年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日 期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	57,965,337.72	405,777.58	69,387,863.06	940,241.20

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及上年度可比期间内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(2011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
600315	上海家化	2011年12月30日	重大事项停牌	34.09	2012年1月4日	34.75	972,923	33,740,111.12	33,166,945.07	-

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	2011年12月31日公允价值	2010年12月31日公允价值
第一层次	957,238,800.52	1,608,885,687.46
第二层次	33,166,945.07	43,370,514.84
第三层次	-	-
合计	990,405,745.59	1,652,256,202.30

§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	990,405,745.59	92.45
	其中:股票	990,405,745.59	92.45
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	62,587,858.44	5.84
6	其他各项资产	18,346,723.21	1.71
7	合计	1,071,340,327.24	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	40,063,457.52	3.77
B	采掘业	14,749,002.50	1.39
C	制造业	472,630,404.19	44.50
C0	食品、饮料	148,550,886.85	13.99
C1	纺织、服装、皮毛	44,966,389.80	4.23
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	62,708,642.87	5.90
C5	电子	30,829,701.50	2.90
C6	金属、非金属	44,059,927.91	4.15
C7	机械、设备、仪表	131,873,114.20	12.42
C8	医药、生物制品	9,641,741.06	0.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,031,802.92	0.29
E	建筑业	110,828,625.63	10.43
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	43,936,366.98	4.14
H	批发和零售贸易	29,581,745.06	2.79
I	金融、保险业	216,082,766.43	20.35
J	房地产业	23,667,957.96	2.23
K	社会服务业	29,193,416.40	2.75
L	传播与文化产业	6,640,200.00	0.63
M	综合类	-	-
	合计	990,405,745.59	93.25

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	002140	东华科技	3,839,367	88,305,441.00	8.31
2	600016	民生银行	11,749,967	69,207,305.63	6.52
3	601288	农业银行	19,500,000	51,090,000.00	4.81
4	600587	新华医疗	1,580,121	49,457,787.30	4.66
5	601166	兴业银行	3,400,000	42,568,000.00	4.01
6	000858	五粮液	1,070,228	35,103,478.40	3.31
7	600315	上海家化	972,923	33,166,945.07	3.12
8	300198	纳川股份	1,771,085	29,541,697.80	2.78
9	600177	雅戈尔	3,029,650	28,418,117.00	2.68
10	002447	壹桥苗业	922,523	27,897,095.52	2.63

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	600016	民生银行	308,562,802.32	17.97
2	002140	东华科技	264,512,869.27	15.40
3	601166	兴业银行	225,301,873.18	13.12
4	600111	包钢稀土	179,296,888.11	10.44
5	600585	海螺水泥	178,436,012.24	10.39
6	600031	三一重工	170,554,730.59	9.93
7	000568	泸州老窖	150,744,977.45	8.78
8	600587	新华医疗	141,474,158.07	8.24
9	600425	青松建化	140,347,381.38	8.17
10	002006	精功科技	126,136,237.57	7.35
11	000858	五粮液	124,848,741.17	7.27
12	000826	桑德环境	101,102,315.39	5.89
13	000630	铜陵有色	100,642,273.66	5.86
14	600240	华业地产	96,568,887.33	5.62
15	000937	冀中能源	94,610,450.47	5.51
16	600096	云天化	87,521,813.42	5.10
17	601101	昊华能源	83,255,380.49	4.85
18	601288	农业银行	82,191,712.00	4.79
19	002001	新和成	75,992,262.35	4.43
20	600172	黄河旋风	73,834,626.00	4.30
21	600519	贵州茅台	72,427,176.35	4.22
22	002010	传化股份	72,133,109.91	4.20
23	600104	上汽集团	70,685,920.67	4.12
24	002264	新华都	70,275,690.62	4.09
25	000877	天山股份	69,695,694.63	4.06
26	002061	江山化工	68,455,533.84	3.99
27	002236	大华股份	66,516,053.83	3.87
28	601169	北京银行	63,980,885.67	3.73
29	300198	纳川股份	63,371,549.96	3.69
30	600537	亿晶光电	63,283,119.33	3.69
31	600739	辽宁成大	63,196,656.11	3.68
32	000527	美的电器	62,401,000.32	3.63
33	000998	隆平高科	61,189,525.32	3.56
34	601088	中国神华	60,411,710.90	3.52
35	002408	齐翔腾达	59,181,781.28	3.45
36	601857	中国石油	59,065,722.95	3.44
37	601699	潞安环能	58,036,207.66	3.38
38	600150	中国船舶	56,926,200.91	3.32
39	600802	福建水泥	55,946,442.43	3.26
40	600066	宇通客车	54,466,612.68	3.17
41	000816	江淮动力	54,397,262.22	3.17
42	000651	格力电器	53,922,276.93	3.14
43	002304	洋河股份	53,823,680.16	3.13
44	600967	北方创业	53,477,882.44	3.11
45	002167	东方锆业	52,129,724.35	3.04
46	600251	冠农股份	51,662,032.80	3.01
47	601989	中国重工	49,398,427.76	2.88
48	000039	中集集团	49,178,898.65	2.86
49	600089	特变电工	48,199,248.89	2.81
50	000157	中联重科	47,209,850.81	2.75
51	002244	滨江集团	46,677,231.88	2.72
52	000718	苏宁环球	46,309,209.66	2.70
53	002392	北京利尔	45,422,160.44	2.65
54	601678	滨化股份	44,354,148.20	2.58
55	000540	中天城投	44,286,681.23	2.58
56	000680	山推股份	44,229,157.78	2.58
57	601766	中国南车	43,913,940.64	2.56
58	002106	莱宝高科	43,230,132.77	2.52
59	000933	神火股份	43,203,031.20	2.52
60	601328	交通银行	42,951,338.97	2.50
61	600497	驰宏锌锗	42,157,980.48	2.46
62	601808	中海油服	41,667,113.31	2.43
63	600058	五矿发展	41,042,494.50	2.39
64	002142	宁波银行	40,829,915.55	2.38
65	600160	巨化股份	40,583,690.26	2.36
66	002586	围海股份	40,099,571.88	2.34
67	601866	中海集运	39,901,968.86	2.32
68	000024	招商地产	39,432,272.21	2.30
69	000639	西王食品	38,555,900.86	2.25
70	300212	易华录	38,255,371.51	2.23
71	600048	保利地产	38,244,281.77	2.23
72	000558	莱茵置业	37,519,350.93	2.18
73	600729	重庆百货	37,398,072.43	2.18
74	600636	三爱富	37,079,975.86	2.16
75	600062	双鹤药业	36,535,647.17	2.13
76	600348	阳泉煤业	36,459,637.96	2.12
77	600010	包钢股份	36,282,078.14	2.11
78	600406	国电南瑞	36,040,364.87	2.10
79	300146	汤臣倍健	35,246,636.04	2.05
80	601601	中国太保	35,197,933.29	2.05
81	600309	烟台万华	34,893,649.82	2.03
82	000961	中南建设	34,868,552.64	2.03
83	002477	雏鹰农牧	34,856,618.85	2.03
84	600815	厦工股份	34,792,554.29	2.03
85	000538	云南白药	34,774,419.62	2.03
86	300020	银江股份	34,738,116.82	2.02
87	002385	大北农	34,653,462.64	2.02
88	300183	东软载波	34,541,928.83	2.01

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。上海汽车的股票证券简称于2012年1月09日变更为上汽集团。

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	600016	民生银行	237,674,862.27	13.84
2	002140	东华科技	233,801,409.45	13.62
3	002006	精功科技	222,278,420.49	12.94
4	601166	兴业银行	218,843,610.02	12.74
5	600111	包钢稀土	192,382,350.39	11.20
6	600031	三一重工	184,494,240.30	10.74
7	000568	泸州老窖	165,488,725.26	9.64
8	600585	海螺水泥	163,252,780.43	9.51
9	000826	桑德环境	143,250,173.79	8.34
10	002010	传化股份	131,106,700.34	7.63
11	600425	青松建化	108,359,215.67	6.31
12	600240	华业地产	101,845,528.49	5.93
13	000937	冀中能源	99,051,747.61	5.77
14	000630	铜陵有色	93,941,631.09	5.47
15	600587	新华医疗	88,920,477.74	5.18
16	601101	昊华能源	88,578,819.24	5.16
17	002106	莱宝高科	87,672,832.90	5.11
18	000858	五粮液	86,797,725.52	5.05
19	600096	云天化	83,214,581.93	4.85
20	601989	中国重工	78,913,465.35	4.60
21	002001	新和成	76,097,650.73	4.43
22	601808	中海油服	74,732,865.63	4.35
23	002304	洋河股份	73,005,019.05	4.25
24	000039	中集集团	71,524,747.75	4.17
25	000877	天山股份	71,346,311.40	4.15
26	601169	北京银行	70,574,642.77	4.11
27	600519	贵州茅台	68,971,691.03	4.02
28	002236	大华股份	67,077,011.65	3.91
29	000998	隆平高科	67,021,326.30	3.90
30	002069	獐子岛	66,840,799.36	3.89
31	000527	美的电器	66,045,519.40	3.85
32	600062	双鹤药业	65,220,372.38	3.80
33	002264	新华都	64,751,123.36	3.77
34	600172	黄河旋风	64,532,195.68	3.76
35	002168	深圳惠程	63,001,505.76	3.67
36	002061	江山化工	62,395,262.31	3.63
37	601699	潞安环能	62,213,678.36	3.62
38	601857	中国石油	60,220,450.32	3.51
39	600537	亿晶光电	60,050,188.93	3.50
40	601766	中国南车	59,899,268.34	3.49
41	000012	南玻A	59,332,270.22	3.46
42	600104	上汽集团	58,462,261.44	3.40
43	002408	齐翔腾达	56,660,654.81	3.30
44	002118	紫鑫药业	55,410,895.16	3.23
45	600802	福建水泥	54,152,419.44	3.15
46	600150	中国船舶	53,165,832.20	3.10
47	000651	格力电器	53,057,406.90	3.09
48	600967	北方创业	52,387,927.25	3.05
49	600251	冠农股份	52,220,112.57	3.04
50	000816	江淮动力	51,958,359.41	3.03
51	000540	中天城投	51,500,745.59	3.00
52	600739	辽宁成大	50,407,930.85	2.94
53	000061	农产品	50,379,132.85	2.93
54	000680	山推股份	49,114,051.63	2.86
55	002167	东方锆业	48,761,951.75	2.84
56	600970	中材国际	48,623,877.58	2.83
57	002043	兔宝宝	47,640,847.67	2.77
58	002142	宁波银行	47,526,769.63	2.77
59	601088	中国神华	47,087,860.64	2.74
60	601678	滨化股份	47,054,169.22	2.74
61	600068	葛洲坝	46,686,480.89	2.72
62	000718	苏宁环球	44,826,404.89	2.61
63	002392	北京利尔	43,110,702.66	2.51
64	600160	巨化股份	43,099,772.90	2.51
65	002586	围海股份	43,097,825.62	2.51
66	000538	云南白药	41,834,454.96	2.44
67	600058	五矿发展	40,476,216.74	2.36
68	600497	驰宏锌锗	40,430,681.81	2.35
69	600636	三爱富	40,151,630.62	2.34
70	601866	中海集运	39,470,889.34	2.30
71	000933	神火股份	37,518,527.43	2.18
72	000024	招商地产	37,413,642.79	2.18
73	600089	特变电工	37,355,186.41	2.18
74	000558	莱茵置业	37,309,744.12	2.17
75	600383	金地集团	37,259,039.23	2.17
76	000157	中联重科	37,133,308.94	2.16
77	000009	中国宝安	36,799,022.46	2.14
78	002146	荣盛发展	36,685,879.78	2.14
79	002050	三花股份	36,683,348.50	2.14
80	600406	国电南瑞	36,298,987.03	2.11
81	600547	山东黄金	35,673,538.12	2.08
82	300229	拓尔思	35,654,188.29	2.08
83	600729	重庆百货	34,942,730.60	2.03
84	300183	东软载波	34,827,482.76	2.03
85	600535	天士力	34,745,624.75	2.02
86	000961	中南建设	34,686,576.17	2.02
87	600549	厦门钨业	34,636,160.01	2.02
88	600612	老凤祥	34,485,923.40	2.01

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。上海汽车的股票证券简称于2012年1月09日变更为上汽集团。

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	11,275,554,782.27
卖出股票收入(成交)总额	11,405,350,407.97

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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,除五粮液被中国证监会行政处罚、纳川股份被中国证监会福建证监局责令改正外,其余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。

五粮液(000858)于2011年5月28日发布"关于收到中国证监会《行政处罚决定书》的公告",公告称五粮液于2011年5月27日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2011]17号),因信息披露存在违法事实,中国证监会对五粮液作出给予警告,并处以60万元罚款的行政处罚。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度的规定。

纳川股份(300198)于2011年8月19日发布"关于收到福建证监局行政监管措施决定书的公告",纳川股份于2011年8月17日收到福建证监局下发的《关于对福建纳川管材科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2011]22号)(以下简称:"《决定》"),要求纳川股份对于《决定》中指出的纳川股份存在的问题采取切实有效的措施进行改正。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度的规定。

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	4,303,122.00
2	应收证券清算款	13,977,750.22
3	应收股利	-
4	应收利息	15,859.32
5	应收申购款	49,991.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,346,723.21

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600315	上海家化	33,166,945.07	3.12	重大事项停牌

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
95,109	21,198.36	32,698,577.18	1.62%	1,983,455,820.02	98.38%

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	4,215.03	0.0002%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年3月19日)基金份额总额	6,777,723,584.78
本报告期期初基金份额总额	2,160,670,586.00
本报告期基金总申购份额	91,463,519.36
减:本报告期基金总赎回份额	235,979,708.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,016,154,397.20

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,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,因个人原因,韩玮先生不再担任华富中证100指数证券投资基金基金经理的职务。
3.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。
4.经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,增聘胡伟先生为华富收益增强债券型证券投资基金的基金经理。
5.经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因个人原因,曾刚先生不再担任华富强化回报债券型证券投资基金基金经理的职务。
6.经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因个人原因,曾刚先生不再担任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理的职务。
7.根据招商银行股份有限公司招银发[2011]331号文,夏博辉先生不再担任招商银行总行资产托管部总经理职务,已聘任吴晓辉先生担任总行资产托管部负责人。

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

经公司董事会审议通过,同意将本基金的审计机构由天健正信会计师事务所变更为天健会计师事务所(特殊普通合伙),本基金本年度支付给审计机构天健会计师事务所(特殊普通合伙)审计报酬为10万元人民币。天健会计师事务所(特殊普通合伙)从2012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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国泰君安	1	2,974,716,923.32	13.13%	2,416,978.78	12.84%	-
华泰联合证券	1	2,255,550,168.09	9.96%	1,832,667.79	9.74%	-
华安证券	1	1,746,702,574.57	7.71%	1,484,693.10	7.89%	-
中国国际金融公司	2	1,732,681,615.04	7.65%	1,407,817.42	7.48%	-
申银万国	1	1,635,928,821.94	7.22%	1,390,530.54	7.39%	-
招商证券	2	1,601,870,707.19	7.07%	1,301,530.43	6.91%	-
东方证券	1	1,564,495,221.92	6.91%	1,329,815.36	7.07%	-
东兴证券	1	1,182,997,388.76	5.22%	1,005,544.45	5.34%	-
海通证券	1	1,010,125,330.09	4.46%	858,606.11	4.56%	-
中银证券	1	1,003,530,630.40	4.43%	815,373.92	4.33%	-
中信证券	1	941,447,185.90	4.16%	800,229.03	4.25%	-
兴业证券	1	710,865,396.01	3.14%	577,582.92	3.07%	-
安信证券	1	629,027,642.23	2.78%	534,670.50	2.84%	-
银河证券	1	618,502,872.24	2.73%	525,727.59	2.79%	-
广发证券	1	503,120,848.20	2.22%	427,651.47	2.27%	-
国都证券	1	501,325,473.26	2.21%	426,123.85	2.26%	-
天风证券	1	345,875,893.16	1.53%	293,993.59	1.56%	-
国信证券	1	306,498,920.82	1.35%	249,032.20	1.32%	-
首创证券	1	284,013,195.80	1.25%	230,762.66	1.23%	-
国联证券	1	274,493,653.26	1.21%	223,027.96	1.18%	-
华创证券	1	274,077,543.87	1.21%	222,689.62	1.18%	-
东海证券	1	200,000,039.01	0.88%	169,999.55	0.90%	-
银泰证券	1	164,880,770.24	0.73%	133,966.72	0.71%	-
日信证券	1	88,504,049.15	0.39%	75,227.59	0.40%	-
方正证券	1	73,633,552.12	0.33%	62,589.09	0.33%	-
中信建投证券	1	29,777,316.85	0.13%	25,310.43	0.13%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	304,375.38	100.00%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

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:新增了国联证券、日信证券、渤海证券、华融证券、西南证券和国海证券各一个席位。

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

无。