华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

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:深圳发展银行股份有限公司
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。

基金托管人深圳发展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	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华富价值增长混合
基金主代码	410007
交易代码	410007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年 7 月 15 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	283,419,298.48 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于价值相对低估且能为股东创造持续稳定回报的公司,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	本基金采用较为灵活的投资策略。在资产配置中,本基金采用自上而下的方式,通过分析证券市场投资环境,预测股票市场和债券市场未来收益和风险,确定资产配置方案;在股票选择中,本基金采用定量分析、定性分析和实地调研等方法,自下而上,精选个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×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。

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 7 月 15 日-2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-44,977,494.33	-32,323,151.19	-25,201,247.09
本期利润	-62,853,401.07	-29,770,591.70	-15,457,479.53
加权平均基金份额本期利润	-0.2143	-0.0769	-0.0267
本期基金份额净值增长率	-23.86%	-7.33%	-1.04%
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	-0.3017	-0.1255	-0.0389
期末基金资产净值	197,915,220.02	280,874,186.55	432,118,554.13
期末基金份额净值	0.6983	0.9171	0.9896

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。

4)本基金合同于 2009 年 7 月 15 日生效,当年度可比报告期间为 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日。

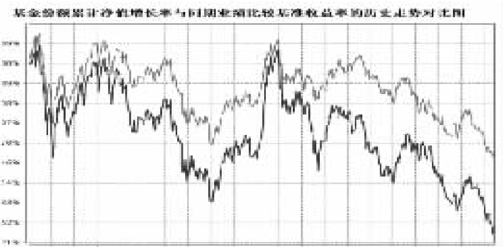
3.2 基金净值表现

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	-7.19%	1.04%	-3.77%	0.84%	-3.42%	0.20%
过去六个月	-15.14%	1.02%	-12.70%	0.81%	-2.44%	0.21%
过去一年	-23.86%	1.08%	-13.48%	0.78%	-10.38%	0.30%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-30.17%	1.33%	-16.30%	0.97%	-13.87%	0.36%

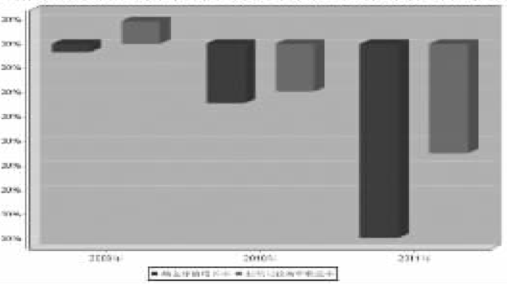
注:业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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《华富价值增长灵活配置混合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 30%-80%;债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-70%;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%。本基金建仓期为 2009 年 7 月 15 日到 2010 年 1 月 15 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《华富价值增长灵活配置混合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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭锋	华富价值增长基金基金经理	2010年 12 月 27 日	-	四年	复旦大学经济学学士,历任雷曼兄弟亚洲投资有限公司行业分析师、华富基金管理有限公司行业研究员,2010 年 6 月起任华富基金管理有限公司华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理助理。
韩玮	华富价值增长基金基金经理、华富中证 100 指数基金基金经理、公司投资部总监	2009年 8 月 4 日	2011 年 1 月 24 日	十一年	清华大学工商管理硕士、研究生学历。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。
季雷	华富价值增长基金基金经理、华富策略精选基金基金经理	2009年 7 月 15 日	2011 年 1 月 25 日	十一年	工商管理硕士、本科学历。先后担任东北证券高级研究员;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。

注:郭锋和韩玮的任职日期指公司作出决定之日,季雷的任职日期为该基金成立之日,韩玮和季雷的离任日期为中国证券业协会作出注销决定之日,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

按照华富价值增长、华富竞争力和华富策略精选的基金合同,华富价值增长、华富竞争力和华富策略精选都属于混合型基金, 2011 年,华富价值增长、华富竞争力和华富策略精选的净值增长率分别为-23.86%、-36.39%与-32.84%。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 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 年是流动性全面紧缩的一年,年初有些行业景气的投资机会,随着宏观调控的逐渐深入,全年前高后低,整体是防御格局。年末随着宏观经济去库存的压力,经济减速。全年中小板在流动性收缩下估值整体下移,很多公司业绩不达预期,在戴维斯双杀下股票有较大的调整。期间国际欧债危机的升级,加大了市场的担忧。四季度,外汇占款的逆转,国内房地产销量萎缩,发电量的低迷等各种负面因素导致市场恐慌。价值增长对股票的杀跌还是判断不够充分,虽然所选成长个股业绩增长基本符合预期,但整体防御配置不多。

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 0.6983 元,累计份额净值为 0.6983 元;本报告期份额净值增长率为-23.86%,同期业绩比较基准收益率为-13.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济缓慢复苏,欧洲经济除德国外整体继续疲软。中国 2012 年流动性预计比 2011 年好,估值经过 2011 年的下跌有修复的空间,不确定性来自于政策和实体经济复苏的步伐。房地产政策虽然不会全面放开,但局部可能有微调。出口可能继续不温不火。利率市场双轨制,要密切关注市场实际利率的波动。通胀压力全面缓解,但也要谨防反复。同时价值增长也会关注伊朗危机等短期的冲击。从投资策略上讲,价值增长重点关注经济转型,力求操作更为稳健,保持核心的成长股仓位,波动操作周期类的机会。

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会计师事务所(特殊普通合伙)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 ,华富价值增长灵活配置混合型基金本期利润为-62,853,401.07,期末可供分配利润为-85,504,078.46。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

本报告期内,深圳发展银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对华富价值增长基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《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《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 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)6-27 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	华富价值增长灵活配置混合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价值增长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"华富价值增长基金")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价值增长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价值增长基金 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:华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金
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	57,592,143.58	18,488,535.28
结算备付金	1,264,518.57	228,064.09
存出保证金	1,989,332.20	1,250,000.00
交易性金融资产	160,318,622.95	176,788,409.51
其中:股票投资	154,643,822.95	172,757,409.51
基金投资	-	-
债券投资	5,674,800.00	4,031,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	10,000,000.00	-
应收证券清算款	-	121,905,762.61
应收利息	39,399.21	9,073.69
应收股利	-	-
应收申购款	16,854.11	74,190.97
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	231,220,870.62	318,744,036.15
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	31,475,277.49	35,978,624.33
应付赎回款	64,393.24	310,703.84
应付管理人报酬	262,644.30	363,448.16
应付托管费	43,774.06	60,574.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	451,949.25	397,975.53
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,007,612.26	758,523.05
负债合计	33,305,650.60	37,869,849.60
所有者权益:		
实收基金	283,419,298.48	306,248,011.35
未分配利润	-85,504,078.46	-25,373,824.80
所有者权益合计	197,915,220.02	280,874,186.55
负债和所有者权益总计	231,220,870.62	318,744,036.15

注:报告截止日 2011 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.6983 元,基金份额总额 283,419,298.48 份。

7.2 利润表

会计主体:华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金
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	-50,437,128.73	-21,452,582.61
1.利息收入	747,510.17	575,930.06
其中:存款利息收入	371,953.72	340,071.75
债券利息收入	24,087.93	235,858.31
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	351,468.52	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-33,338,394.45	-24,717,571.29
其中:股票投资收益	-31,549,244.59	-31,490,439.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,542,374.30	4,481,487.87
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	753,224.44	2,291,380.26
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-17,875,906.74	2,552,559.49
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	29,662.29	136,499.13
减:二、费用	12,416,272.34	8,318,009.09
1.管理人报酬	3,638,322.98	5,103,353.36
2.托管费	606,387.17	850,558.83
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,693,562.19	1,886,096.90
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	478,000.00	478,000.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-62,853,401.07	-29,770,591.70
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-62,853,401.07	-29,770,591.70

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金
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)	306,248,011.35	-25,373,824.80	280,874,186.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-62,853,401.07	-62,853,401.07
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)	-22,828,712.87	2,723,147.41	-20,105,565.46
其中:1.基金申购款	25,002,837.05	-5,139,425.83	19,863,411.22
2.基金赎回款	-47,831,549.92	7,862,573.24	-39,968,976.68
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)	283,419,298.48	-85,504,078.46	197,915,220.02
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)	436,655,352.97	-4,536,798.84	432,118,554.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-29,770,591.70	-29,770,591.70
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)	-130,407,341.62	8,933,565.74	-121,473,775.88
其中:1.基金申购款	45,853,191.71	-1,544,573.19	44,308,618.52
2.基金赎回款	-176,260,533.33	10,478,138.93	-165,782,394.40
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)	306,248,011.35	-25,373,824.80	280,874,186.55

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

华富价值增长灵活配置混合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《华富价值增长灵活配置混合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[2009]309 号文批准募集设立。本基金自 2009 年 5 月 25 日起公开向社会发行,至 2009 年 7 月 10 日募集结束。经天健光华(北京)会计师事务所(现已合并为天健正信会计师事务所)验资并出具天健光华证验(2009)专字第 070003 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 678,852,520.44 元人民币,有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计 269,382.24 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 2009 年 7 月 15 日生效,该日的基金份额为 679,121,902.68 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》、《华富价值增长灵活配置混合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
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
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

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交易。

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	3,638,322.98	5,103,353.36
其中:支付销售机构的客户维护费	724,337.43	935,158.32

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	606,387.17	850,558.83

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(2009 年 7 月 15 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	50,000,388.89	50,000,388.89
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	50,000,388.89	50,000,388.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.64%	16.33%

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

本报告期末和上年度末没有其他关联方投资本基金的情况。

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		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	期末余额	当期利息收入
深圳发展银行股份有限公司	57,592,143.58	317,447.17	18,488,535.28	323,365.76

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和上年度可比期间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

本基金本报告期末未持有的流通受限证券。

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	160,318,622.95	176,788,409.51
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	160,318,622.95	176,788,409.51

§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

类别	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	154,643,822.95	66.88
	其中:股票	154,643,822.95	66.88
2	固定收益投资	5,674,800.00	2.45
	其中:债券	5,674,800.00	2.45
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	10,000,000.00	4.32
	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	58,856,662.15	25.45
6	其他各项资产	2,045,585.52	0.88
7	合计	231,220,870.62	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	-	-
B	采掘业	9,340,964.31	4.72
C	制造业	83,179,181.83	42.03
C0	食品、饮料	4,585,567.50	2.32
C1	纺织、服装、皮毛	4,205,800.00	2.13
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,333,893.74	4.21
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	32,541,864.07	16.44
C8	医药、生物制品	31,892,056.52	16.11
C99	其他制造业	1,620,000.00	0.82
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	805,000.00	0.41
F	交通运输、仓储业	2,014,200.00	1.02
G	信息技术业	15,576,647.40	7.87
H	批发和零售贸易	3,789,647.50	1.91
I	金融、保险业	12,040,081.81	6.08
J	房地产业	22,484,500.10	11.36
K	社会服务业	3,324,300.00	1.68
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,089,300.00	1.06
	合计	154,643,822.95	78.14

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	600256	广汇股份	678,845	13,970,630.10	7.06
2	600406	国电南瑞	349,952	10,918,502.40	5.52
3	000581	威孚高科	300,241	10,775,649.49	5.44
4	600062	双鹤药业	639,738	9,979,912.80	5.04
5	002603	以岭药业	210,900	8,096,451.00	4.09
6	600036	招商银行	600,000	7,122,000.00	3.60
7	600104	上海汽车	450,000	6,363,000.00	3.22
8	600535	天士力	142,700	5,984,838.00	3.02
9	300218	安利股份	346,399	5,975,382.75	3.02
10	002266	浙富股份	300,874	5,096,805.56	2.58

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	600256	广汇股份	85,737,689.55	30.53
2	600406	国电南瑞	44,776,170.11	15.94
3	000581	威孚高科	41,599,190.29	14.81
4	002283	天润曲轴	39,860,692.11	14.19
5	000937	冀中能源	36,387,080.38	12.95
6	600111	包钢稀土	35,832,680.08	12.76
7	600036	招商银行	35,595,905.30	12.67
8	600252	中恒集团	34,149,102.68	12.16
9	002036	宜科科技	32,889,457.96	11.71
10	002094	青岛金王	32,429,540.89	11.55
11	600226	升华拜克	32,042,339.62	11.41
12	600031	三一重工	30,691,547.13	10.93
13	600030	中信证券	30,274,277.00	10.78
14	600535	天士力	28,376,156.39	10.10
15	002118	紫鑫药业	28,235,772.17	10.05
16	300029	天龙光电	26,422,654.57	9.41
17	600125	铁龙物流	26,278,087.06	9.36
18	600292	九龙电力	25,821,611.07	9.19
19	002303	美盈森	25,343,073.86	9.02
20	600193	创兴资源	24,848,521.58	8.85
21	002049	晶源电子	24,780,057.56	8.82
22	000024	招商地产	24,534,598.12	8.74
23	300218	安利股份	24,105,210.82	8.58
24	000568	泸州老窖	23,316,965.10	8.30
25	600188	兖州煤业	22,900,311.59	8.15
26	600392	太工天成	22,216,126.95	7.91
27	600585	海螺水泥	21,805,256.62	7.76
28	002271	东方雨虹	21,349,509.45	7.60
29	600218	全柴动力	21,188,353.34	7.54
30	002179	中航光电	21,092,214.85	7.51
31	000998	隆平高科	20,977,049.11	7.47
32	000566	海南海药	20,813,984.89	7.41
33	600251	冠农股份	20,178,239.00	7.18
34	000858	五 粮 液	20,068,977.82	7.15
35	600141	兴发集团	20,026,613.67	7.13
36	300055	万邦达	19,449,544.18	6.92
37	601699	潞安环能	19,312,445.00	6.88
38	600309	烟台万华	19,149,438.90	6.82
39	000426	兴业矿业	18,936,118.68	6.74
40	601808	中海油服	18,856,391.91	6.71
41	000630	铜陵有色	18,788,356.77	6.69
42	600519	贵州茅台	18,050,372.97	6.43
43	600000	浦发银行	17,987,548.34	6.40
44	000758	中色股份	17,793,887.91	6.34
45	600547	山东黄金	16,814,877.39	5.99
46	002009	天奇股份	16,648,704.33	5.93
47	600240	华业地产	16,446,798.71	5.86
48	002155	辰州矿业	16,421,048.09	5.85
49	000527	美的电器	16,255,069.24	5.79
50	000551	创元科技	15,745,786.43	5.61
51	601166	兴业银行	15,577,748.40	5.55
52	002230	科大讯飞	15,474,041.09	5.51
53	600869	三普药业	15,421,665.79	5.49
54	600029	南方航空	15,197,664.80	5.41
55	000063	中兴通讯	15,186,486.55	5.41
56	600104	上海汽车	14,886,539.54	5.30
57	000969	安泰科技	14,317,352.00	5.10
58	600048	保利地产	13,893,888.41	4.95
59	002603	以岭药业	13,771,999.95	4.90
60	002092	中泰化学	13,439,763.29	4.78
61	000651	格力电器	13,413,995.90	4.78
62	000761	本钢板材	13,271,706.74	4.73
63	000776	广发证券	13,202,263.54	4.70
64	600580	卧龙电气	12,844,435.87	4.57
65	600458	时代新材	12,836,074.56	4.57
66	600581	八一钢铁	12,728,349.15	4.53
67	600339	天利高新	12,616,613.71	4.49
68	600844	丹化科技	12,375,763.59	4.41
69	600362	江西铜业	11,974,247.50	4.26
70	002004	华邦制药	11,959,928.46	4.26
71	600085	同仁堂	11,958,117.20	4.26
72	002168	深圳惠程	11,770,500.23	4.19
73	600426	华鲁恒升	11,390,353.60	4.06
74	600186	莲花味精	11,350,880.09	4.04
75	600395	盘江股份	11,344,858.56	4.04
76	600019	宝钢股份	11,086,555.97	3.95
77	600163	福建南纸	10,699,500.35	3.81
78	600271	航天信息	10,615,483.07	3.78
79	600636	三爱富	10,600,292.50	3.77
80	600078	澄星股份	10,316,905.90	3.67
81	601989	中国重工	10,211,411.80	3.64
82	002266	浙富股份	9,971,453.83	3.55
83	600150	中国船舶	9,954,157.44	3.54
84	000792	盐湖股份	9,941,773.42	3.54
85	600702	沱牌舍得	9,890,058.72	3.52
86	002170	芭田股份	9,749,354.34	3.47
87	600062	双鹤药业	9,636,086.43	3.43
88	002001	新 和 成	9,589,894.19	3.41
89	002235	安妮股份	9,146,096.13	3.26
90	000401	冀东水泥	8,686,426.98	3.09
91	601677	明泰铝业	8,676,631.08	3.09
92	600383	金地集团	8,487,051.80	3.02
93	000422	湖北宜化	8,368,180.44	2.98
94	601601	中国太保	8,296,549.00	2.95
95	600016	民生银行	8,173,203.07	2.91
96	002091	江苏国泰	8,153,253.72	2.90
97	002011	盾安环境	8,064,761.80	2.87
98	600387	海越股份	8,050,233.16	2.87
99	600056	中国医药	8,007,065.30	2.85
100	000002	万 科 A	7,983,067.37	2.84
101	600276	恒瑞医药	7,958,884.53	2.83
102	600887	伊利股份	7,892,786.95	2.81
103	600600	青岛啤酒	7,884,250.10	2.81
104	002129	中环股份	7,722,947.00	2.75
105	600802	福建水泥	7,665,349.03	2.73
106	002556	辉隆股份	7,448,763.63	2.65
107	600420	现代制药	7,368,444.16	2.62
108	002140	东华科技	7,256,890.85	2.58
109	000816	江淮动力	7,129,392.42	2.54
110	600685	广船国际	7,121,381.50	2.54
111	600511	国药股份	7,072,791.50	2.52
112	600631	百联股份	7,034,587.07	2.50
113	600316	洪都航空	6,942,206.00	2.47
114	000157	中联重科	6,883,909.62	2.45
115	601088	中国神华	6,847,557.28	2.44
116	600976	武汉健民	6,783,566.49	2.42
117	002304	洋河股份	6,679,106.38	2.38
118	600348	阳泉煤业	6,666,164.00	2.37
119	000826	桑德环境	6,634,210.79	2.36
120	600101	明星电力	6,619,127.26	2.36
121	000301	东方市场	6,598,781.21	2.35
122	600875	东方电气	6,590,469.46	2.35
123	002062	宏润建设	6,556,487.65	2.33
124	002167	东方锆业	6,525,425.48	2.32
125	300197	铁汉生态	6,522,838.76	2.32
126	601006	大秦铁路	6,476,253.25	2.31
127	300024	机器人	6,302,898.60	2.24
128	600629	棱光实业	6,274,694.52	2.23
129	300132	青松股份	6,228,936.72	2.22
130	000887	中鼎股份	6,161,415.44	2.19
131	601311	骆驼股份	6,057,603.50	2.16
132	000960	锡业股份	6,051,388.00	2.15
133	001696	宗申动力	6,030,483.40	2.15
134	300172	中电环保	5,931,676.26	2.11
135	000590	紫光古汉	5,855,125.52	2.08
136	600801	华新水泥	5,800,121.99	2.07
137	600750	江中药业	5,637,411.60	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。

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	600256	广汇股份	71,800,125.12	25.56
2	000581	威孚高科	38,856,066.77	13.83
3	600406	国电南瑞	38,122,721.65	13.57
4	600111	包钢稀土	36,765,785.78	13.09
5	600252	中恒集团	36,681,848.98	13.06
6	002283	天润曲轴	35,534,517.60	12.65
7	000937	冀中能源	33,803,220.61	12.04
8	600031	三一重工	33,627,527.72	11.97
9	002118	紫鑫药业	33,107,076.34	11.79
10	002036	宜科科技	30,111,321.68	10.72
11	300029	天龙光电	29,924,506.94	10.65
12	600030	中信证券	29,360,812.71	10.45
13	600226	升华拜克	29,347,742.20	10.45
14	600292	九龙电力	29,179,816.58	10.39
15	002049	晶源电子	28,257,702.53	10.06
16	300055	万邦达	27,868,579.38	9.92
17	600036	招商银行	27,716,413.23	9.87
18	600125	铁龙物流	25,565,729.56	9.10
19	002094	青岛金王	25,145,045.06	8.95
20	600585	海螺水泥	24,978,793.75	8.89
21	000858	五 粮 液	23,722,955.62	8.45
22	002303	美盈森	23,701,248.54	8.44
23	000568	泸州老窖	23,518,998.18	8.37
24	000024	招商地产	23,343,058.36	8.31
25	000063	中兴通讯	22,609,603.26	8.05
26	000527	美的电器	22,073,053.98	7.86
27	600251	冠农股份	22,049,922.81	7.85
28	600535	天士力	22,016,586.81	7.84
29	600392	太工天成	21,434,099.43	7.63
30	000998	隆平高科	21,084,798.82	7.51
31	600193	创兴资源	20,996,243.19	7.48
32	002271	东方雨虹	20,809,043.36	7.41
33	002179	中航光电	20,712,322.70	7.37
34	601808	中海油服	20,513,371.95	7.30
35	600141	兴发集团	19,549,619.61	6.96
36	000566	海南海药	19,472,728.78	6.93
37	600309	烟台万华	19,366,286.23	6.90
38	000426	兴业矿业	19,265,102.55	6.86
39	600188	兖州煤业	19,029,742.37	6.78
40	600218	全柴动力	18,217,631.62	6.49
41	600000	浦发银行	18,015,678.73	6.41
42	000758	中色股份	17,825,427.33	6.35
43	601699	潞安环能	17,807,422.01	6.34
44	000551	创元科技	17,528,223.06	6.24
45	000630	铜陵有色	17,101,883.46	6.09
46	600519	贵州茅台	16,998,215.64	6.05
47	300218	安利股份	16,458,260.96	5.86
48	600547	山东黄金	16,375,977.23	5.83
49	002155	辰州矿业	16,299,814.46	5.80
50	600395	盘江股份	16,190,765.97	5.76
51	600869	三普药业	16,043,378.32	5.71
52	002009	天奇股份	15,746,798.79	5.61
53	600240	华业地产	15,263,492.64	5.43
54	600029	南方航空	14,878,776.71	5.30
55	000761	本钢板材	14,289,453.75	5.09
56	600362	江西铜业	14,261,850.93	5.08
57	600348	阳泉煤业	14,168,494.07	5.04
58	000969	安泰科技	13,952,675.93	4.97
59	600844	丹化科技	13,824,727.23	4.92
60	002092	中泰化学	13,515,536.53	4.81
61	601166	兴业银行	13,059,906.35	4.65
62	600580	卧龙电气	12,787,970.03	4.55
63	600186	莲花味精	12,193,204.55	4.34
64	002168	深圳惠程	12,106,115.41	4.31
65	600163	福建南纸	12,096,331.75	4.31
66	600339	天利高新	12,032,041.90	4.28
67	000776	广发证券	11,968,280.76	4.26
68	600085	同仁堂	11,958,529.10	4.26
69	600458	时代新材	11,769,875.34	4.19
70	600581	八一钢铁	11,734,152.61	4.18
71	000651	格力电器	11,464,612.12	4.08
72	000060	中金岭南	11,434,026.57	4.07
73	600019	宝钢股份	11,177,624.29	3.98
74	600636	三爱富	10,964,115.90	3.90
75	002230	科大讯飞	10,964,019.34	3.90
76	600426	华鲁恒升	10,780,703.21	3.84
77	600078	澄星股份	10,692,127.14	3.81
78	600887	伊利股份	10,659,441.95	3.80
79	600271	航天信息	10,359,580.65	3.69
80	601989	中国重工	10,354,722.84	3.69
81	600150	中国船舶	9,930,010.00	3.54
82	600048	保利地产	9,921,683.70	3.53
83	600104	上海汽车	9,616,507.03	3.42
84	600702	沱牌舍得	9,559,443.22	3.40
85	002001	新 和 成	9,473,995.61	3.37
86	002235	安妮股份	9,383,591.34	3.34
87	000792	盐湖股份	9,122,206.60	3.25
88	000826	桑德环境	8,986,083.30	3.20
89	601677	明泰铝业	8,863,915.76	3.16
90	002011	盾安环境	8,863,807.57	3.16
91	002129	中环股份	8,721,576.75	3.11
92	600387	海越股份	8,412,536.12	3.00
93	002004	华邦制药	8,315,960.80	2.96
94	000401	冀东水泥	8,306,302.73	2.96
95	600802	福建水泥	8,162,288.35	2.91
96	601766	中国南车	8,104,775.66	2.89
97	601601	中国太保	8,100,103.82	2.88
98	600765	中航重机	8,065,817.50	2.87
99	000422	湖北宜化	8,027,335.42	2.86
100	600056	中国医药	7,817,416.32	2.78
101	600600	青岛啤酒	7,790,402.14	2.77
102	002170	芭田股份	7,723,990.29	2.75
103	600016	民生银行	7,694,000.00	2.74
104	002277	友阿股份	7,490,000.53	2.67
105	002091	江苏国泰	7,466,558.09	2.66
106	002304	洋河股份	7,189,896.06	2.56
107	000816	江淮动力	7,095,421.98	2.53
108	600631	百联股份	7,068,336.07	2.52
109	600685	广船国际	7,022,477.85	2.50
110	600420	现代制药	7,014,501.64	2.50
111	600976	武汉健民	6,826,077.34	2.43
112	600801	华新水泥	6,785,019.29	2.42
113	300197	铁汉生态	6,731,906.19	2.40
114	601088	中国神华	6,704,340.00	2.39
115	000157	中联重科	6,680,202.83	2.38
116	002062	宏润建设	6,672,668.69	2.38
117	600875	东方电气	6,629,815.29	2.36
118	600101	明星电力	6,621,559.92	2.36
119	600511	国药股份	6,547,361.05	2.33
120	000301	东方市场	6,444,229.12	2.29
121	002140	东华科技	6,435,513.90	2.29
122	002167	东方锆业	6,405,463.06	2.28
123	000590	紫光古汉	6,370,203.83	2.27
124	600750	江中药业	6,282,525.39	2.24
125	000887	中鼎股份	6,238,642.67	2.22
126	000960	锡业股份	6,092,441.93	2.17
127	600316	洪都航空	6,051,265.53	2.15
128	300172	中电环保	6,033,088.35	2.15
129	600629	棱光实业	6,011,916.05	2.14
130	000639	西王食品	5,966,544.39	2.12
131	001696	宗申动力	5,944,750.00	2.12
132	300024	机器人	5,758,992.01	2.05
133	601311	骆驼股份	5,719,273.00	2.04

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。

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	2,555,927,197.82
卖出股票收入(成交)总额	2,524,596,085.82

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	5,674,800.00	2.87
8	其他	-	-
9	合计	5,674,800.00	2.87

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	60,000	5,674,800.00	2.87

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,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。

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	1,989,332.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	39,399.21
5	应收申购款	16,854.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,045,585.52

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	5,674,800.00	2.87

8.9.5 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。

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		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
6,125	46,272.54	90,345,977.89	31.88%	193,073,320.59	68.12%

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	-	-

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009 年 7 月 15 日)基金份额总额	679,121,902.68
本报告期期初基金份额总额	306,248,011.35
本报告期基金总申购份额	25,002,837.05
减:本报告期基金总赎回份额	47,831,549.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	283,419,298.48

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、报告期内基金托管人的托管部门无重大人事变动。

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		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	
国信证券	2	2,498,371,880.34	49.18%	2,074,399.94	49.06%	-
申银万国	1	1,074,244,842.97	21.15%	872,831.62	20.64%	-
光大证券	1	806,852,915.72	15.88%	685,822.28	16.22%	-
厦门证券	1	417,517,652.33	8.22%	354,889.11	8.39%	-
齐鲁证券	1	282,657,824.30	5.56%	240,258.87	5.68%	-

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		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
国信证券	443,280,588.58	78.62%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	94,686,736.80	16.79%	280,000,000.00	51.57%	-	-
厦门证券	25,832,090.30	4.58%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	263,000,000.00	48.43%	-	-

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三个,分别是申银万国、光大证券和齐鲁证券。

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

2011年 7 月 29 日托管人深圳发展银行股份有限公司(以下简称深圳发展银行)发布《深圳发展银行股份有限公司关于重大资产重组实施完成的公告》,该次重大资产重组完成以后, 中国平安及中国平安控股子公司中国平安人寿保险股份有限公司合计持有深圳发展银行 52.38%的股份,成为深圳发展银行的控股股东,平安银行成为深圳发展银行的控股子公司。