华富中证100指数证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3月31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:2012年4月23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2012年4月20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2012年1月1日起至2012年3月31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	220,180,182.64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股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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(2012年1月1日 - 2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-3,885,781.34
2.本期利润	5,190,118.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0244
4.期末基金资产净值	154,033,172.16
5.期末基金份额净值	0.6996

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。

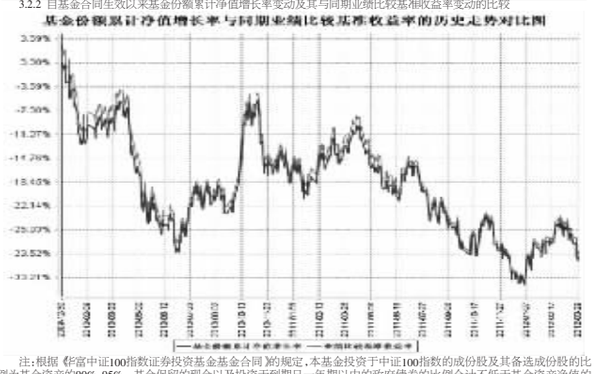
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.51%	1.32%	5.03%	1.32%	-0.52%	0.00%

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、华富中小板指数基金基金经理	2010年12月27日	-	五年	四川大学技术经济及管理专业硕士、研究生学历,历任平安资产管理有限责任公司任投资绩效分析师、东吴基金管理有限公司金融工程研究员,2009年11月进入华富基金管理有限公司任华富中证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。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.3.2 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

本季度的行情大起大落,惊心动魄。上证综合指数在年初探底2132之后,开始了一波较大级别的反弹。反弹一直持续到了3月上旬,幅度大约在十五个点左右,随后市场出现了快速回调,一直持续到了季度末期。

这波反弹是去年熊市以来最具有操作性的一次,各板块基本上都轮动了一遍,从季度初的强周期如钢铁有色,到白酒食品饮料等消费股均轮流出现了上涨,许多个股的反弹幅度还是很可观的。现在看来,这波上涨的动因主要有以下几点:1、去年年底对实体经济过于悲观预期的修复。2、对政策放松的预期。3、对流动性改善的预期。本季度由于指数基金一直保持较高的仓位,因此在这波反弹的过程中的业绩表现也较为出色。

作为被动型指数基金,本基金本季度严格恪守本基金的投资理念和投资目标,实现了对基准的有效跟踪。报告期内基金运作良好,跟踪偏离度和跟踪误差均符合基金合同的要求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2009年12月30日正式成立。截止2012年3月31日,本基金份额净值为0.6996元,累计份额净值为0.6996元。报告期,本基金份额净值增长率为4.51%,同期业绩比较基准收益率为5.03%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场争论的焦点在于未来是否还会破新低,也就是这波上涨究竟是反弹还是反转的问题。

看空的论据主要是对中国经济基本面的担忧,目前中国经济处于降速和转型的过程之中,市场担忧转型过程中的不确定性,对中国经济未来的支柱看不清楚,短期国内经济很难有大的起色,GDP增速还处于下行的过程中,何时见底还有争议,另外CPI是否能如预期趋顺利回落也不确定,这将直接影响未来政府的政策空间。

偏正面的论据主要是认为目前整个市场的平均估值处于历史底部,与国外成熟资本市场相比估值也不高,下跌的空间不大,上证综指从2009年8月份见到3478的高点之后,就一直处于调整的状态,调整的时间和幅度上都较为充分,前期对经济的悲观预期基本上都已经体现在股价之中,目前来看,欧债危机基本上处于可控范围内,美国经济出现了可喜的复苏,国内经济见底在年内应该可以见到,国内宏观调控的紧缩政策已经基本结束,2011年12月和2012年2月,央行已经两次下调存款准备金率,未来应该会继续降准甚至降息以刺激经济,所以未来经济基本面和调控政策都会对股市形成有利支撑。个人更倾向于市场不会破新低的看法,对未来的市场偏乐观,目前市场的成交量和活跃度已经明显优于去年年底,市场也已经突破了前期的下降趋势,二季度应该是一个盘整巩底的过程,长期来看,目前的点位肯定是个相对低点。

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

§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	145,740,288.88	93.98
	其中:股票	145,740,288.88	93.98
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	8,750,236.88	5.64
6	其他资产	580,220.74	0.37
7	合计	155,070,746.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资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	232,628.99	0.15
B	采掘业	18,044,321.57	11.71
C	制造业	38,475,107.04	24.98
C0	食品、饮料	10,694,769.15	6.94
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	1,562,300.32	1.01
C5	电子	387,234.00	0.25
C6	金属、非金属	9,007,995.36	5.85
C7	机械、设备、仪表	15,637,750.89	10.15
C8	医药、生物制品	1,185,057.32	0.77
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,152,254.13	2.05
E	建筑业	3,831,179.72	2.49
F	交通运输、仓储业	4,467,630.39	2.90
G	信息技术业	3,151,971.09	2.05
H	批发和零售贸易	1,904,145.75	1.24
I	金融、保险业	64,690,807.78	42.00
J	房地产业	6,874,624.26	4.46
K	社会服务业	915,618.16	0.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	145,740,288.88	94.62

注:本基金本报告期指数投资部分含拟于2012年4月1日调入中证100指数的备选成分股,具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

5.2.2报告期末积极投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

注:本基金本报告期未持有积极投资部分股票。

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

5.3.1报告期末指数投资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	600036	招商银行	677,503	8,062,285.70	5.23
2	600016	民生银行	1,223,018	7,668,322.86	4.98
3	600000	浦发银行	630,452	5,629,936.36	3.66
4	601166	兴业银行	420,292	5,598,289.44	3.63
5	601318	中国平安	151,437	5,539,565.46	3.60
6	601398	工商银行	937,028	4,057,331.24	2.63
7	601088	中国神华	153,390	3,928,317.90	2.55
8	600519	贵州茅台	19,471	3,835,008.16	2.49
9	000002	万 科A	450,897	3,733,427.16	2.42
10	600030	中信证券	320,294	3,712,207.46	2.41

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期未未持有积极投资部分股票。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期未未持有债券。

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:本基金本报告期未未持有债券。

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:本基金本报告期未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:本基金本报告期未未持有权证。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,127.64
5	应收申购款	327,093.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	580,220.74

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存在流通受限情况的说明

5.8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.8.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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	201,519,874.34
本报告期期间基金总申购份额	41,647,007.62
减:本报告期期间基金总赎回份额	22,986,699.32
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	220,180,182.64

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、华富中证100指数证券投资基金基金合同

2、华富中证100指数证券投资基金托管协议

3、华富中证100指数证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富中证100指数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。

华富中小板指数增强型证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3月31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:2012年4月23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2012年4月20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2012年1月1日至2012年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中小板指数增强
基金主代码	410010
交易代码	410010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月9日
报告期末基金份额总额	79,050,461.28份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,以被动跟踪标的指数为主,力争控制本基金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0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础之上,力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	作为指数增强型基金,本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上,采用适度的主动投资辅助提高收益,降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法,按照标的指数的成分股组成及其权重构建指数化投资组合,并按照标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股,在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。
业绩比较基准	中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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	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(2012年1月1日 - 2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-129,602.91
2.本期利润	-2,561,949.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0543
4.期末基金资产净值	76,842,861.83
5.期末基金份额净值	0.972

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。

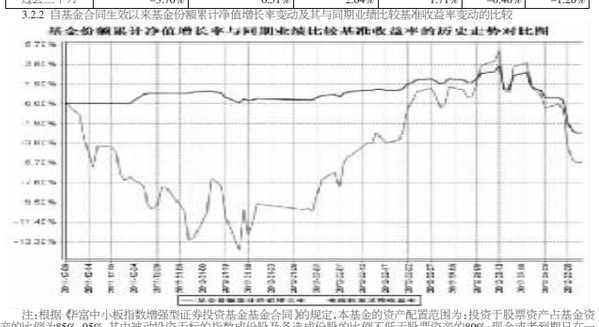
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.76%	0.51%	2.64%	1.71%	-6.40%	-1.20%

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《华富中小板指数增强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:投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为2011年12月9日到2012年6月9日,本报告期,本基金仍在建仓期内。

§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	华富中小板指数基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理	2011年12月9日	-	五年	四川大学技术经济及管理专业硕士、研究生学历,历任平安资产管理有限责任公司任投资绩效分析师、东吴基金管理有限公司金融工程研究员,2009年11月进入华富基金管理有限公司任华富中证100指数基金基金经理助理。

注:这里的任职日期指该基金成立之日。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。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.3.2 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

本季度的行情大起大落,惊心动魄。上证综合指数在年初探底2132之后,开始了一波较大级别的反弹。反弹一直持续到了3月上旬,幅度大约在十五个点左右,随后市场出现了快速回调,一直持续到了季度末期。

这波反弹是去年熊市以来最具有操作性的一次,各板块基本上都轮动了一遍,从季度初的强周期如钢铁有色,到白酒食品饮料等消费股均轮流出现了上涨,许多个股的反弹幅度还是很可观的。现在看来,这波上涨的动因主要有以下几点:1、去年年底对实体经济过于悲观预期的修复。2、对政策放松的预期。3、对流动性改善的预期。

本基金于2011年12月9日成立运作,本季度仍处于建仓期内,基金仓位和持仓结构还较为灵活。本基金在成立之后,就一直对市场保持较为谨慎的态度,因此保持了较为缓慢的建仓速度,在本季度本期市场出现了回调,本基金已经逐渐进行了加仓,截止一季度末,本基金从成立以来相对于业绩基准依然有正的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2011年12月9日正式成立。截止2012年3月31日,本基金份额净值为0.972元,累计份额净值为0.972元。报告期,本基金份额净值增长率为-3.76%,同期业绩比较基准收益率为2.64%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场争论的焦点在于未来是否还会破新低,也就是这波上涨究竟是反弹还是反转的问题。

看空的论据主要是对中国经济基本面的担忧,目前中国经济处于降速和转型的过程之中,市场担忧转型过程中的不确定性,对中国经济未来的支柱看不清楚,短期国内经济很难有大的起色,GDP增速还处于下行的过程中,何时见底还有争议,另外CPI是否能如预期趋顺利回落也不确定,这将直接影响未来政府的政策空间。

偏正面的论据主要是认为目前整个市场的平均估值处于历史底部,与国外成熟资本市场相比估值也不高,下跌的空间不大,上证综指从2009年8月份见到3478的高点之后,就一直处于调整的状态,调整的时间和幅度上都较为充分,前期对经济的悲观预期基本上都已经体现在股价之中,目前来看,欧债危机基本上处于可控范围内,美国经济出现了可喜的复苏,国内经济见底在年内应该可以见到,国内宏观调控的紧缩政策已经基本结束,2011年12月和2012年2月,央行已经两次下调存款准备金率,未来应该会继续降准甚至降息以刺激经济,所以未来经济基本面和调控政策都会对股市形成有利支撑。个人更倾向于市场不会破新低的看法,对未来的市场偏乐观,目前市场的成交量和活跃度已经明显优于去年年底,市场也已经突破了前期的下降趋势,二季度应该是一个盘整巩底的过程,长期来看,目前的点位肯定是个相对低点。

作为指数增强型基金,二季度本基金建仓期即将结束,届时本基金的仓位和配置结构都将达到基金合同的要求,将跟踪误差控制在基金合同要求的范围内,力争实现超越比较基准的投资收益。

§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	53,450,762.48	69.08
	其中:股票	53,450,762.48	69.08
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	6,309,613.00	8.15
6	其他资产	17,614,426.52	22.77
7	合计	77,374,802.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资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	2,307,106.68	3.00
B	采掘业	2,035,672.00	2.65
C	制造业	29,231,450.69	38.04
C0	食品、饮料	3,015,412.26	3.92
C1	纺织、服装、皮毛	1,962,419.29	2.55
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	236,013.61	0.31
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,841,592.02	5.00
C5	电子	4,780,936.49	6.22
C6	金属、非金属	1,211,177.20	1.58
C7	机械、设备、仪表	8,825,483.17	11.49
C8	医药、生物制品	4,796,404.65	6.24
C99	其他制造业	562,012.00	0.73
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,401,545.38	1.82
F	交通运输、仓储业	169,169.00	0.22
G	信息技术业	2,875,170.39	3.74
H	批发和零售贸易	4,720,934.93	6.14
I	金融、保险业	2,313,687.00	3.01
J	房地产业	1,134,791.68	1.48
K	社会服务业	565,860.00	0.74
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	46,755,387.75	60.85

5.2.2报告期末积极投资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	-	-
B	采掘业	1,055,460.00	1.37
C	制造业	3,210,511.15	4.18
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	568,500.00	0.74
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	362,430.09	0.47
C5	电子	437,500.00	0.57
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,842,081.06	2.40
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,094,605.50	1.42
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	866,570.08	1.13
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	294,600.00	0.38
M	综合类	173,628.00	0.23
	合计	6,695,374.73	8.71

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

5.3.1报告期末指数投资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	002024	苏宁电器	393,997	3,841,470.75	5.00
2	002304	洋河股份	16,057	2,362,787.55	3.07
3	002142	宁波银行	210,600	1,931,202.00	2.51
4	002155	辰州矿业	61,300	1,510,432.00	1.97
5	002073	软控股份	88,586	1,208,313.04	1.57
6	002029	七 匹 狼	30,435	1,125,181.95	1.46
7	002028	思源电气	79,176	1,070,459.52	1.39
8	002038	双鹭药业	36,004	956,266.24	1.24
9	002146	荣盛发展	90,437	935,118.58	1.22
10	002001	新 和 成	44,661	884,287.80	1.15

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601633	长城汽车	81,061	1,091,081.06	1.42
2	601991	大唐发电	150,000	754,500.00	0.98
3	002572	索菲亚	15,000	568,500.00	0.74
4	601808	中海油服	30,000	500,100.00	0.65
5	002281	光迅科技	18,304	476,270.08	0.62

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期未未持有债券。

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:本基金本报告期未未持有债券。

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:本基金本报告期未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:本基金本报告期未未持有权证。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,754.66
5	应收申购款	17,358,671.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,614,426.52

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存在流通受限情况的说明

5.8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.8.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

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	77,236,164.60
本报告期期间基金总申购份额	57,553,600.51
减:本报告期期间基金总赎回份额	55,739,303.83
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	79,050,461.28

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同

2、华富中小板指数增强型证券投资基金托管协议

3、华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富中小板指数增强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。

华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年3月31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:2012年4月23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2012年4月20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2012年1月1日至2012年3月31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	81,569,445.05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(2012年1月1日 - 2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-6,697,709.13
2.本期利润	-343,527.83
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041
4.期末基金资产净值	61,362