华富量子生命力股票型证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]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
报告送出日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

基金托管人深圳发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富量子生命力股票
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]份
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	本基金从市场估值的驱动因素出发进行资产配置，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，对市场未来[illegible]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。本基金采用自下而上的选股策略，实行组合个股精选以及行业权重优化的全程数量化投资模式，主要投资于综合资质优良、价值相对低估，能为股东创造持续稳健回报的公司。选股模型严格遵循“价值投资”理念，围绕价值和价格两大因素，通过公司资质和估值情绪双层筛选机制，逐级筛选股票，并最终确定股票投资组合。
业绩比较基准	沪深[illegible]指数收益率元[illegible]%+中证全债指数收益率元[illegible]
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

[illegible] 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（[illegible]年[illegible]月[illegible]日 原[illegible]年[illegible]月[illegible]日）
[illegible]本期已实现收益	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]

注：[illegible]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。

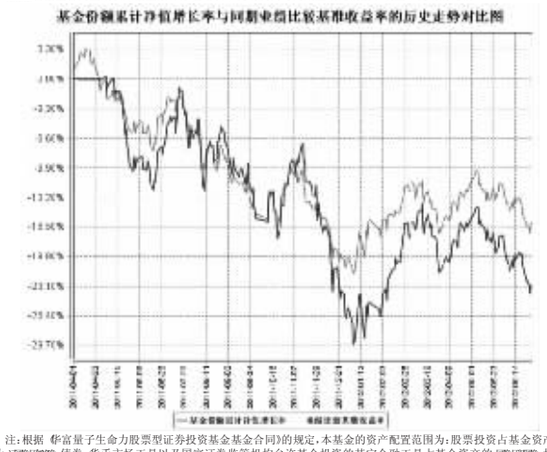
[illegible]所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

[illegible] 基金净值表现

[illegible] 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[illegible]	净值增长率标准差于	业绩比较基准收益率[illegible]	业绩比较基准收益率标准差[illegible]	[illegible]	[illegible]
过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible] 自基金合同生效以来基金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，本基金投资于中证[illegible]指数的成份股及其备选成份股的比例为[illegible]%，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[illegible]%，权证投资占基金资产净值的比例为[illegible]%。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[illegible]%。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为[illegible]年[illegible]月[illegible]日到[illegible]年[illegible]月[illegible]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《华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同》的规定。

§5 管理人报告

[illegible] 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		
朱蓓	华富量子生命力基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	五年	上海交通大学安泰管理学院会计学硕士，研究生学历，曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理，华富基金金融工程研究员、产品设计经理。

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。

[illegible] 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。

[illegible] 公平交易专项说明

[illegible] 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

[illegible] 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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[illegible]%的情形。

[illegible] 报告期内基金的业绩表现

二季度受国内经济持续下滑及海外欧债危机的负面影响，市场先涨后跌，沪深[illegible]指数微涨[illegible]%。期间表现最好的三个行业分别是：医药生物、食品饮料、房地产；表现最差的三个行业分别是：黑色金属、采掘、信息服务。宏观政策方面，为了缓解资金面紧张局势，促进经济增长，央行在二季度下调了存款准备金率[illegible]%，降息[illegible]%。货币政策逐步放松的趋势已得到确认。基金操作上，我们严格依照量化模型选股，但由于二季度风格转换频率加快，因子选股类模型表现欠佳。

[illegible] 报告期内基金的业绩表现

本基金于[illegible]年[illegible]月[illegible]日正式成立。截止[illegible]年[illegible]月[illegible]日，本基金份额净值为[illegible]元，累计份额净值为[illegible]元。报告期，本基金份额净值增长率为[illegible]%，同期业绩比较基准收益率为[illegible]%。

[illegible] 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于未来的货币政策，我们认为随着通胀继续下行，经济回升乏力，货币政策的力度将持续加强，利率政策和准备金率政策将并行不悖。三季度欧债危机蔓延局势相对可控，对国内压力有所减轻。我们认为市场仍处在震荡筑底阶段，在“稳经济”政策刺激下，经济下行趋势有望减速。我们将密切关注经济基本面情况，按照量化模型进行配置选股操作。

§6 投资组合报告

[illegible] 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（%）
[illegible]	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
[illegible]	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金融衍生品投资	[illegible]	[illegible]
[illegible]	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
[illegible]	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他资产	[illegible]	[illegible]
[illegible]	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible] 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（%）
[illegible]	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	采掘业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	制造业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
[illegible]	木材、家具	[illegible]	[illegible]
[illegible]	造纸、印刷	[illegible]	[illegible]
[illegible]	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	电子	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
[illegible]	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
[illegible]	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他制造业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	建筑业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	信息技术业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	房地产业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	社会服务业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible] 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（%）
员	[illegible]	千红制药	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	上海医药	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	天保基建	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	友谊股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	南方航空	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	华联综超	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	沪电股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	中国石油	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	三友化工	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	上港集团	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible] 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

[illegible] 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。

[illegible] 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。

[illegible] 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。

[illegible] 投资组合报告附注

[illegible] 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。

[illegible] 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。

[illegible] 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	[illegible]
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	[illegible]
苑	待摊费用	[illegible]
愿	其他	[illegible]
怨	合计	[illegible]

[illegible] 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。

[illegible] 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

[illegible] 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。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期期间基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期期间基金总赎回份额	[illegible]
本报告期期间基拆分变动份额	[illegible]
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

§8 备查文件目录

[illegible] 备查文件目录

员华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同

圆华富量子生命力股票型证券投资基金托管协议

猿华富量子生命力股票型证券投资基金招募说明书

源报告期内华富量子生命力股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

[illegible] 存放地点

基金管理人、基金托管人处

[illegible] 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。

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]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
报告送出日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

基金托管人深圳发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富价值增长混合
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]份
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[illegible]指数收益率[illegible]%+中证全债指数收益率[illegible]
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	深圳发展银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

[illegible] 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（[illegible]年[illegible]月[illegible]日 原[illegible]年[illegible]月[illegible]日）
[illegible]本期已实现收益	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]

注：[illegible]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。

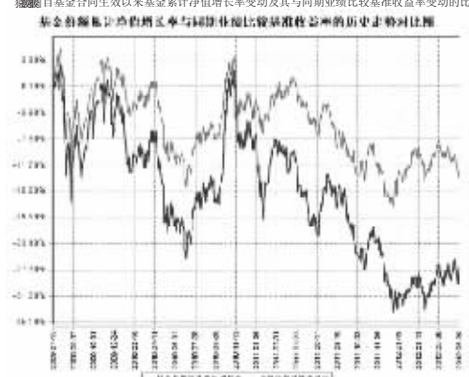
[illegible]所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

[illegible] 基金净值表现

[illegible] 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[illegible]	净值增长率标准差于	业绩比较基准收益率[illegible]	业绩比较基准收益率标准差[illegible]	[illegible]	[illegible]
过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible] 自基金合同生效以来基金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[illegible]%原[illegible]%，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它金融工具占基金资产的[illegible]%，权证投资占基金资产净值的比例为[illegible]%，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[illegible]%。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为[illegible]年[illegible]月[illegible]日到[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

§5 管理人报告

[illegible] 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		
郭锋	华富价值增长基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	五年	香港大学工商管理学硕士，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，[illegible]年[illegible]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。

注：这里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。

[illegible] 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。

[illegible] 公平交易专项说明

[illegible] 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

[illegible] 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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[illegible]%的情形。

[illegible] 报告期内基金的业绩表现

本基金于[illegible]年[illegible]月[illegible]日正式成立。截止[illegible]年[illegible]月[illegible]日，本基金份额净值为[illegible]元，累计份额净值为[illegible]元。报告期，本基金份额净值增长率为[illegible]%，同期业绩比较基准收益率为[illegible]%。

[illegible] 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，政策上依然会向稳增长的方向转，预计下半年可能会继续下调存准率或降息。[illegible]增速下半年见底的概率很大，但是七八月份逐渐出炉的经济数据和企业盈利数据可能会加重市场对经济基本面的担心，因此三季度市场可能依然会在纠结中震荡，市场往下的空间不大，毕竟估值已经相当便宜，处于历史低位，即使与国际其他资本市场比较，国内[illegible]也不贵，市场依然以结构性行情为主。市场本身是有一定的规律的，从投资时钟来看，现在是配置权益类资产的良好时机，一般来说，在熊市末端，市场开始都会对经济刺激政策比较麻木，当政策逐渐积累，投资者开始预期政策对经济的刺激有实质性的作用时，市场会逐渐出现机会。

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。我们将格守基金合同的规定，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。

§6 投资组合报告

[illegible] 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（%）
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	[illegible]	[illegible]
猿	金融衍生品投资	[illegible]	[illegible]
源	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible] 报告期末按行业分类的股票投资组合

[illegible] 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（%）
粤	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
月	采掘业	[illegible]	[illegible]
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
[illegible]	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
[illegible]	木材、家具	[illegible]	[illegible]
[illegible]	造纸、印刷	[illegible]	[illegible]
[illegible]	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
[illegible]	电子	[illegible]	[illegible]
[illegible]	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
[illegible]	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
[illegible]	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
[illegible]	其他制造业	[illegible]	[illegible]
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
标	建筑业	[illegible]	[illegible]
云	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
郎	信息技术业	[illegible]	[illegible]
匀	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
陨	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
配	综合类	[illegible]	[illegible]
	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible] 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（%）
员	[illegible]	沱牌舍得	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	金枫酒业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	恒瑞医药	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	广汇能源	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	中国太保	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	富瑞特装	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	贵州茅台	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	壹桥苗业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	陕国投 粤	[illegible]	[illegible]	[illegible]
[illegible]	[illegible]	民生银行	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible] 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（%）
员	国家债券	[illegible]	[illegible]
圆	央行票据	[illegible]	[illegible]
猿	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中：政策性金融债	[illegible]	[illegible]
源	企业债券	[illegible]	[illegible]
缘	企业短期融资券	[illegible]	[illegible]
远	中期票据	[illegible]	[illegible]
苑	可转债	[illegible]	[illegible]
愿	其他	[illegible]	[illegible]
怨	合计	[illegible]	[illegible]

[illegible] 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（%）
员	[illegible]	中行转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	新钢转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible] 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。

[illegible] 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。

[illegible] 投资组合报告附注

[illegible] 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。

[illegible] 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。

[illegible] 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	[illegible]
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	[illegible]
苑	待摊费用	[illegible]
愿	其他	[illegible]
怨	合计	[illegible]

[illegible] 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。

[illegible] 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

[illegible] 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。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期期间基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期期间基金总赎回份额	[illegible]
本报告期期间基拆分变动份额	[illegible]
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

§8 备查文件目录

[illegible] 备查文件目录

员华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同

圆华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议

猿华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

源报告期内华富价值增长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

[illegible] 存放地点

基金管理人、基金托管人处

[illegible] 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[illegible]指数证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年[illegible]月[illegible]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：[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证[illegible]指数
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]份
投资目标	本基金进行被动式指数投资，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[illegible]%和年跟踪误差不超过[illegible]%，以实现对中证[illegible]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[illegible]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[illegible]指数收益率[illegible]%+[illegible]年银行定期存款收益率（税后）[illegible]
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

[illegible] 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（[illegible]年[illegible]月[illegible]日 原[illegible]年[illegible]月[illegible]日）
[illegible]本期已实现收益	[illegible]
[illegible]本期利润	[illegible]
[illegible]加权平均基金份额本期利润	[illegible]
[illegible]期末基金资产净值	[illegible]
[illegible]期末基金份额净值	[illegible]

注：[illegible]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。

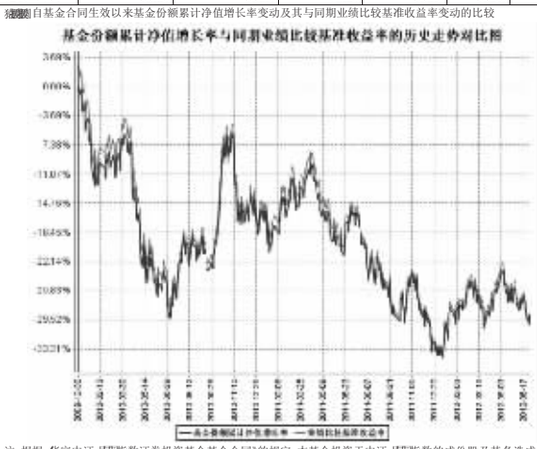
[illegible]所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

[illegible] 基金净值表现

[illegible] 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[illegible]	净值增长率标准差于	业绩比较基准收益率[illegible]	业绩比较基准收益率标准差[illegible]	[illegible]	[illegible]
过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

[illegible] 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[illegible]指数证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于中证[illegible]指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的[illegible]%，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[illegible]%。本基金建仓期为[illegible]年[illegible]月[illegible]日到[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]指数证券投资基金基金合同》的规定。

§5 管理人报告

[illegible] 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[illegible]指数基金基金经理、华富中小板指数基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	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，[illegible]年[illegible]月进入华富基金管理有限公司任华富中证[illegible]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。

[illegible] 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。

[illegible] 公平交易专项说明

[illegible] 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

[illegible] 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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[illegible]%的情形。

[illegible] 报告期内基金的业绩表现

本基金于[illegible]年[illegible]月[illegible]日正式成立。截止[illegible]年[illegible]月[illegible]日，本基金份额净值为[illegible]元，累计份额净值为[illeg