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8月28日

1.1 重要提示

## &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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同

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8月27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、

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 6 月 30 日止

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金简称	华富量子生命力股票
基金主代码	410009
交易代码	410009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月1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	143,417,123.14 份
基金合同存绌期	不定期

2.2 巫並/ 四次円	
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	本基企在进行時个配置計上型與根基企業則人开皮的。對信服示地接管产 配置物面。通过市场大米。1、中整体信息水平计行制、求组基化 限、债券及单企之间的合理管理、模型从市场信的原式则需出步、通过寻找 与市场走势相关性最大的担于组合、构建市场给的原式则需出步。通过寻找 与市场走势相关性最大的担于组合、构建市场给的原域制度。 该是开始包括 约或完成于包括低不限于"经济而因子"供来而因子,使或而因子,价值而因 子,销售而因子。应利而因子,使是结果最终不远为一个综合的配置指标,通 过时市场本术是炒的原础是集,既是是全年发生了之间的危重批价。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 * 75%+中证全债指数收益率 * 25%
风险收益特征	本基金属干股票型证券投资基金。属干较高预期风险、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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项	B	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
	姓名	满志弘	<b>董</b> 雁
信息披露负责人	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

	20 工女別为旧你和坐並中且权机
3.1 主要会计数据和财务指标	

3.1.1 期间数据和指标	报告期 2012年1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-8,269,651.69
本期利润	2,471,700.17
加权平均基金份额本期利润	0.0166
本期基金份额净值增长率	3.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2012 年 6 月 30 日 )
期末可供分配基金份额利润	-0.2309
期末基金资产净值	110,308,047.20
期末基金份额争值	0.7691

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6月30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	率①	率标准差②	收益率③	益率标准差④	(1)-(3)	(2)-(4)
过去一个月	-6.80%	1.10%	-4.77%	0.81%	-2.03%	0.29%
过去三个月	-2.16%	1.01%	0.88%	0.83%	-3.04%	0.18%
过去六个月	3.22%	1.35%	4.68%	0.99%	-1.46%	0.36%
过去一年	-16.79%	1.41%	-12.75%	1.01%	-4.04%	0.40%
自基金合同生效 起至今	-23.09%	1.32%	-16.17%	0.97%	-6.92%	0.35%
注:业绩比较	交基准=沪深 3	00 指数收益	率 * 75%+中证	E全债指数收益	率 * 25%, 业绩比	· 较基准在每个

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

# 基金价额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图 130% -110k% 23.16%

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,本基金股票投资占基金资产的比例 为60%-95%,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0%-40%,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 2011 年 4 月 1 日到 2011 年 10 月 1 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。

## 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 2012 年 6 月 30 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、华富策略精洗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 金和华宫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	11. 中华亚的华亚5	E理 (助理 )期限	证券从业年限	说明
×20-114	87.95	任职日期	离任日期	HE3FANJE+FPR	13093
		2011年4月1日	-	五年	上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历,曾担任平平金产产管理有限责任公司金化投资经理助理, 华富基金金融工程研究员、产品设计经理。

注:任职日期为该基金成立之日,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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。 4.3.3 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5%的情形。

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

上半年政策放松不力令经济增长持续走低,并开始影响到就业,通胀也一路下滑。6月基建投资的加速 显现出一些政策实质性放松的信号。需求是此次国内经济减速的主要原因,内需不足的结构性失衡难以改 变,外需也难以重回 08 年前的旺盛状态。

上半年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300指数上涨4.9%。期 间表现最好的三个行业分别是:房地产、有色金属、食品饮料;表现最差的三个行业分别是:信息服务、黑色

额净值为 0.7691 元。本报告期,本基金份额净值增长率为 3.22%,同期业绩比较基准收益率为 4.68%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度 GDP 增速已经回落至 7.6%。随着欧债危机的愈演愈烈,国内需求不振,经济持续低迷的风险还 在加大,并开始对就业产生冲击。在这种情况下,逆周期政策再度发力。海外方面,在债务规模继续膨胀的同 时,欧洲的经济正在衰退;西班牙、意大利地方债务问题的爆发,带来市场的动荡,消费、投资信心的低迷将 对欧洲经济进一步形成抑制。

下半年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。我们认为市场仍处在筑底阶段,在 稳经济"政策刺激下,经济形势有望在下半年减速下 行。我们将密切关注宏观经济基本面情况,按照量化模型进行配置选股操作。

## 华富量子生命力股票型证券投资基金

## 2012 半年度 报告摘要

## 2012年6月30日

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。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il 为估值有被否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

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同》的有关 规定,本期利润为2,471,700.17元,期末可供分配利润为-33,109,075.94元。本报告期内未进行利润分配。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 金《以下称"本基金"的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基

本报告期内,本托管人根据《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

该基金本报告期内未进行利润分配。

报告 (注:财务会计报告中的 绘融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内),投资组合报告等内容真

## §6 半年度财务会计报告 (未经审计)

报告截止日: 2012年6月30日

资产	附注号	本期末 2012年 6 月 30 日	上年度末 2011年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	6,521,769.84	6,221,398.4
结算备付金		1,041,359.83	371,687.8
存出保证金		500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	102,886,626.29	85,391,564.83
其中:股票投资		102,886,626.29	85,391,564.8
基金投资		-	
债券投资		-	
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产	6.4.7.3	-	
买人返售金融资产	6.4.7.4	-	11,000,000.00
应收证券清算款		492,965.32	4,629,770.5
应收利息	6.4.7.5	2,752.08	3,380.8
应收股利		92,327.38	
应收申购款		19,851.89	19,605.9
递延所得税资产		-	
其他资产	6.4.7.6	_	
资产总计		111,557,652.63	108,137,408.4
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年 6 月 30 日	上年度末 2011年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债	6.4.7.3	-	
卖出回购金融资产款		-	
应付证券清算款		-	533,083.5
应付赎回款		25,792.36	15,394.9
应付管理人报酬		142,133.13	151,742.3
应付托管费		23,688.83	25,290.3
应付销售服务费		-	
应付交易费用	6.4.7.7	349,082.84	216,524.3
应交税费		-	
应付利息		-	
应付利润		-	
递延所得税负债		-	
其他负债	6.4.7.8	708,908.27	850,057.9
负债合计		1,249,605.43	1,792,093.6
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	143,417,123.14	142,730,829.0
未分配利润	6.4.7.10	-33,109,075.94	-36,385,514.2
所有者权益合计		110,308,047.20	106,345,314.8
负债和所有者权益总计		111,557,652.63	108,137,408.4

注:报告截止日 2012 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.7691 元,基金份额总额 143,417,123.14 份。后附报

表附注为本财务报表的组成部分。

会计主体:华宫量子生命力股票型证券投资基金 本报告期: 2012年1月1日至 2012年6月30日

項目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年6月30 日	上年度可比期间 2011年4月1日至2011年6月 30日
一、收入		4,767,563.68	-13,406,433.59
1.利息收入		195,580.56	492,897.84
其中:存款利息收人	6.4.7.11	93,889.99	313,978.96
债券利息收入		-	107,758.74
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收入		101,690.57	71,160.14
其他利息收入		-	
2.投资收益 损失以 ""填列)		-6,187,476.52	-9,829,102.89
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-7,526,375.93	-10,771,982.93
基金投资收益		-	
债券投资收益	6.4.7.13	-	-48,103.07
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	
衍生工具收益	6.4.7.15	-	
股利收益	6.4.7.16	1,338,899.41	990,983.11
3.公允价值变动收益(损失以""号填列)	6.4.7.17	10,741,351.86	-4,216,165.84
4. 汇兑收益 损失以""号填列)		-	
5.其他收入 假失以 ""号填列)	6.4.7.18	18,107.78	145,937.30
减:二、费用		2,295,863.51	1,631,464.35
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	890,504.20	792,861.06
2.托管费	6.4.10.2.2	148,417.36	132,143.50
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	1,039,089.67	589,741.36
5.利息支出		-	
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.20	217,852.28	116,718.43
三、利润总额(亏损总额以""号填列)		2,471,700.17	-15,037,897.94
减:所得税费用		-	-
四、净利润(争亏损以""号填列)		2,471,700.17	-15,037,897.94

注: 后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益 基金净值 )变动表 会计主体,华宫量子生命力股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

			单位:人民币5
项目	2012年	本期 1月1日至2012年6月30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(低金净值)	142,730,829.07	-36,385,514.27	106,345,314.80
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期净利润)	-	2,471,700.17	2,471,700.17
三、本期基金份额交易产生的基金 净值变动数 (争值减少以""号填列)	686,294.07	804,738.16	1,491,032.23
其中:1.基金申购款	28,020,610.41	-4,372,550.54	23,648,059.87
2.基金赎回款	-27,334,316.34	5,177,288.70	-22,157,027.64
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)	143,417,123.14	-33,109,075.94	110,308,047.20
项目	2011年	上年度可比期间 4月1日至2011年6月30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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期净利润)	-	-15,037,897.94	-15,037,897.94
三、本期基金份额交易产生的基金 净值变动数 (争值减少以""号填列)	176,417,210.44	1,675,908.63	178,093,119.07
其中:1.基金申购款	294,890,970.77	-48,708.05	294,842,262.72
2.基金赎回款	-118,473,760.33	1,724,616.68	-116,749,143.65
四、本期向基金份额持有人分配利 润产生的基金净值变动 铮值减少 以""号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	176,417,210.44	-13,361,989.31	163,055,221.13
注:后附报表附注为本财务持		·	
本报告 6.1 至 6.4 财务报	表由下列负责人签署:		

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

6.4 报表附注 6.4.1 基金基本情况

华富量子生命力股票型证券投资基金由华富基金管理有限公司依照 件华人民共和国证券投资基金 本基金基金合同 2011年4月1日生效,截止 2012年6月 30日,本基金份额争值为 0.7691元,累计份 法》、征券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富量子生命力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许可 [2010] 1585 号文批准募集设立。本基金自 2011 年 2 月 28 日起公开向社 会发行,至2011年3月25日募集结束。经天健正信会计师事务所验资并出具天健华证验 2011)综字第 020032 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293,506,500.23 元人民 币,有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计148,404.31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2011年4月1日生 效,该日的基金份额为293,654,904.54份基金单位。

6.4.2 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》、《华富量子生命力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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

本报告期本基金会计估计无变更。 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

关税务法规和实务操作,主要税项如下

的财务状况以及2012半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。

6.4.4 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的说明

本基金 2012 半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 2012 年 6 月 30 日

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 般票)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

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

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

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

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

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 代繳 20.00%的个人所得稅。 住: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%

## §5 托管人报告

本报告期内,深圳发展银行股份有限公司《以下称"本托管人")在对华富量子生命力股票型证券投资基 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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的直字、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

会计主体:华富量子生命力股票型证券投资基金

收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

单边征收,税率保持1%。

计算应纳税所得额。)

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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。 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、代銷机构
华安证券有限责任公司(华安证券")	基金管理人的股东、代銷机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金截止至本报告期末及上年度可比期间未租用关联方交易单元。

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)。

6.4.8.2.1 基金管理费

6.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年4月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	890,504.20	792,861.0
其中:支付销售机构的客户维护费	255,134.12	527,059.2

单位:人民币元 2012年1月1日至2012年6月30日

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=Ex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) 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 含回购 )交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 2012年1月1日至2012年6月30日 2011年4月1日至2011年6月30日

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,申购买人总份

额里包含红利再投、转换人份额。

6.4.8.4.2 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

					份额单位:伤	
		本期末 2012年 6 月 30 日		上年度末 2011年 12 月 31 日		
	关联方名称	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份額	持有的基金份额 占基金总份额的比 例	
	华安证券有限 责任公司	5,008,100.00	3.49%	5,008,100.00	3.51%	

注: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。 6.4.8.5 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	
だ联方 名称	2012年1月1日	本期 至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011年4月1日至2011年6月30日		
石标	期末余額	当期利息收人	期末余額	当期利息收入	
发展银行 有限公司	6,521,769.84	83,368.79	43,699,591.03	304,859.36	

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明 6.4.9 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 本基金无因认购新发/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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 金额单位:人民币元 期末估值总额 备注

6.4.9.3 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。 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

号 项目	金額	占基金总资产的比例 66)
权益投资	102,886,626.29	92.23
其中:股票	102,886,626.29	92.23
固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-
资产支持证券	-	-
金融衍生品投资	-	-
买人返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	7,563,129.67	6.78
其他各项资产	1,107,896.67	0.99
合计	111,557,652.63	100.00

注:本表列示的其他各项资产详见 7.9.3 期末其他各项资产构成

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

占基金资产净值比例 66)	公允价值	行业类别	代码
1.	1,528,292.70	农、林、牧、渔业	A
4.	5,285,099.84	采掘业	В
60.	66,869,082.01	制造业	С
1.	1,339,566.48	食品、饮料	CO
7.	8,222,554.35	纺织、服装、皮毛	C1
0.	154,346.90	木材、家具	C2
2.	3,118,505.72	造纸、印刷	C3
15.	16,778,214.51	石油、化学、塑胶、塑料	C4
5.	6,085,600.07	电子	C5
8.	9,875,555.51	金属、非金属	C6
11.	12,886,580.36	机械、设备、仪表	C7
4.	4,753,506.10	医药、生物制品	C8
3.	3,654,652.01	其他制造业	C99
0.	324,118.53	电力、煤气及水的生产和供应业	D
0.	144,528.20	建筑业	E
7.	7,937,559.49	交通运输、仓储业	F
1.	1,925,870.61	信息技术业	G
8.	9,686,240.54	批发和零售贸易	Н
5.	5,565,191.56	金融、保险业	I
1.	1,244,469.25	房地产业	J
0.	157,750.72	社会服务业	K
0.	769,361.52	传播与文化产业	L
1.	1,449,061.32	综合类	M
93.	102,886,626.29	合计	

## 7.3 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

	>>	I DEFENDED TO SELECTION OF SELE	2 NIESCO 25 C 2 211/2 H 21/2 1	- Fire Adventage Ann	
					金额单位:人民币元
序号	股票代码	股票名称	数量 段)	公允价值	占基金资产净值比例 66)
1	002550	千红制药	50,955	1,107,252.15	1.00
2	601607	上海医药	103,085	1,099,916.95	1.00
3	000965	天保基建	235,580	1,083,668.00	0.98
4	600827	友谊股份	95,465	1,079,709.15	0.98
5	600029	南方航空	232,853	1,073,452.33	0.97
6	600361	华联综超	188,295	1,069,515.60	0.97
7	002463	沪电股份	239,426	1,067,839.96	0.97
8	601857	中国石油	117,844	1,066,488.20	0.97
9	600409	三友化工	163,113	1,065,127.89	0.97
10	C00010	1.39.40.00	200 700	1 062 426 00	0.07

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半年度报告正文

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计工人全频极中加加其全资产净值 202 或前 20 夕的股票阳组

	守且 2%以用 20 右的权录明细	(旭山州//)	录月大八亚砂	7.4.1
金额单位:人				
占期初基金资产净值 %)	本期累计买人金额	股票名称	股票代码	序号
8,190.22	2,478,190.22	辽通化工	000059	1
0,543.06	2,210,543.06	XD大同煤	601001	2
9, 169.00	2,209,169.00	中煤能源	601898	3
8,542.03	2,118,542.03	徐工机械	000425	4
2,542.87	2,052,542.87	海普瑞	002399	5
0.670.41	2,020,670.41	上海医药	601607	6
5,768.72	1,956,768.72	深圳机场	000089	7
7,601.78	1,897,601.78	中国石油	601857	8
9,353.00	1,889,353.00	招商银行	600036	9
3,459.00	1,873,459.00	浦发银行	600000	10
3,297.60	1,873,297.60	上港集团	600018	11
),362.58	1,830,362.58	宁波银行	002142	12
9,118.00	1,819,118.00	民生银行	600016	13
5,341.15	1,806,341.15	禾欣股份	002343	14
,510.00	1,801,510.00	大秦铁路	601006	15
),383.43	1,790,383.43	王府井	600859	16
), 154.59	1,790,154.59	平煤股份	601666	17
2,579.06	1,772,579.06	中国人寿	601628	18
3,345.22	1,763,345.22	大冶特钢	000708	19

注:本表列示 买人金额"按买人成交金额 成交单价乘以成交数量 填列,未考虑相关交易费用

				金额单位:人民币
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 66
1	002336	人人乐	2,120,003.71	1.99
2	300147	香雪制药	2,113,391.73	1.99
3	000425	徐工机械	1,950,050.44	1.83
4	002406	远东传动	1,928,904.63	1.8
5	600122	宏图高科	1,822,418.62	1.7
6	300118	东方日升	1,753,246.19	1.6
7	000012	南玻A	1,746,926.08	1.6
8	600888	新疆众和	1,725,219.74	1.6
9	601628	中国人寿	1,722,166.14	1.6
10	600418	江淮汽车	1,667,522.63	1.5
11	601006	大秦铁路	1,641,500.07	1.5
12	601666	平煤股份	1,625,554.74	1.5
13	600873	梅花集团	1,623,264.01	1.5
14	600362	江西铜业	1,578,017.15	1.4
15	002106	莱宝高科	1,574,817.99	1.4
16	002435	长江润发	1,564,624.52	1.4
17	002172	澳洋科技	1,552,033.75	1.4
18	600835	上海机电	1,528,714.76	1.4
19	600676	交运股份	1,520,273.47	1.4

注:本表列示 实出金额"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。

7.4.3 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

注:本表列示 买人股票成本 成交)总额"及 实出股票收入 成交)总额"均按买卖成交金额 成交单份 乘以成交数量,填列,未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成 19,851.8

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 7.9.5 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涌受限情况。 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五人的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

存有人户数(户

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理未持有本基

§9 开放式基金份额变动

	单位:1
基金合同生效日(2011年4月1日)基金份額总額	293,654,904.54
本报告期期初基金份额总额	142,730,829.07
本报告期基金总申购份额	28,020,610.41
减:本报告期基金总赎回份额	27,334,316.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	143,417,123.14

注:总申购份额含红利再投、转换人份额;总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.2 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 。经华高基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因个人原因,崔健先生不再担任华富策略精造灵活和置混合管证券投资基金基经理前等人,再任标德义担任该基金基金管理。 2. 经华高基金管理有限公司第二届董争全等十三次会议《临时会议》并而审议通过,因个人原因,都牧先生不再担任华富基金管理 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.1 基金份额持有人大会决议

10.4 基金投资策略的改变

金额单位:人民币元

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1 基金和用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

10.7.1 查亚拉尔证外公司又约十九还门及朱汉英次国亚文门间记								
					金额单	位:人民币:		
	名称 交易单元数 量	股票交易		应支付该券商的佣金				
券商名称		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	备注		
华泰联合证券	1	360,819,286.61	52.79%	295,749.08	51.82%	-		
中投证券	1	163,458,732.05	23.92%	140,508.69	24.62%	-		
国联证券	1	84,038,702.63	12.30%	71,433.35	12.52%	-		
国盛证券	1	52,227,682.44	7.64%	44,393.48	7.78%	-		

1 22.915.814.52 3.35% 18,619.41 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额毕业:人民们									
	债券交易		债券回购交易		权证交易				
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券回 购 成交总额的比 例	成交金額	占当期权证 成交总额的比 例			
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-			
中投证券	-	-	-	1	-	-			
国联证券	-	-	291,600,000.00	65.97%	-	-			
国盛证券	-	-	150,400,000.00	34.03%	-	-			
世纪证券	_	-	1	-	-	-			

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

2)债券交易中的企业债及可分离债的成交金额按净价统计,可转债的成交金额按全价统计。 §11 影响投资者决策的其他重要信息