华富强化回报债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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2013年1月18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10月1日至2012年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富强化回报债券 (场内简称:华富强债)
基金主代码	164105
交易代码	164105
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金 (LOF)。
基金合同生效日	2010年9月8日
报告期末基金份额总额	1,999,206,694.42份
投资目标	在控制风险的基础上,力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素,研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险,以确定各类金融资产的配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	29,049,961.83
2.本期利润	32,623,885.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0163
4.期末基金资产净值	2,109,810,086.82
5.期末基金份额净值	1.055

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。

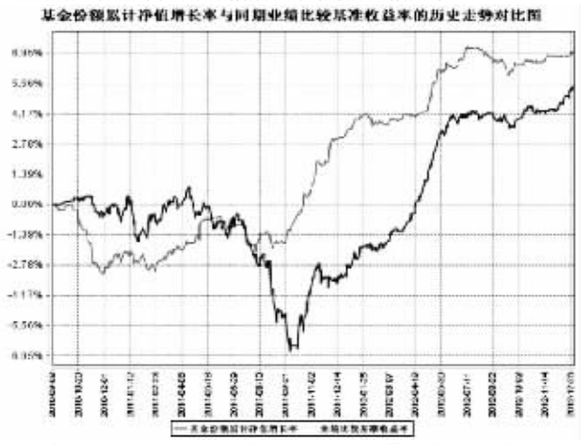
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.54%	0.09%	0.58%	0.04%	0.96%	0.05%

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《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%。本基金还可以参与新股申购、股票增发和要约收购类股票投资,并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于非固定收益类证券的比例不超过基金资产的20%。在封闭期结束后,本基金保留的现金以及投资于到期日在一年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2010年9月8日到2011年3月8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《华富强化回报债券型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		
张钧	华富强化回报债券基金基金经理	2011年4月26日	-	十年	上海社会科学院金融学硕士、研究生学历,历任上海远东资信评估有限公司研究员、房地产评级部经理、集团与证券评级部副经理,新华财经有限公司资信评级部高级经理,2009年5月加入华富基金管理有限公司,任债券研究员、华富强化回报债券基金基金助理。

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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度的市场呈现出冰火两重天的格局,市场期待的十八大维稳行情在十月、十一月并没有如期到来,十八大结束之后,市场信心崩溃,不断下跌,一度击穿2000点,最低达到1940点,一些个股的跌幅更是巨大,尤其以中小板创业板股票为甚,进入12月份之后,市场出现了攻刚性的变化,在基本面和政策面并没有太大的变化的背景之下,12月份上证综指单月涨幅14.6%,成交量显著放大,以银行为代表的大盘蓝筹领涨,市场的信心仿佛一夜之间就回来了。

市场攻刚性的走势还是与经济基本面密切相关的,进入四季度后,各项经济数据开始出现见底回升的态势,经济基本面触底已经逐步明确,PMI数据开始回升,企业去库存的过程逐渐完成,许多行业的库存数据已处于底部,政府为了稳定经济增长,也推出了一系列的措施,比如增加铁路等行业的基础设施建设,虽说此次不比08.09年四万亿措施来的猛,但是在经济转型的大背景下,适度刺激以稳定增长更合情合理,在这样的背景之下,股市继续下滑明显不符合逻辑,但是究竟在什么点位和时间节点出现反弹是很难预测的。市场在拐点出现之前的下跌和信心崩溃非常惨烈,出现反弹之后究竟如何判断,这检都在四季度强烈的考验基金管理团队的心理和业务水平。

本基金在四季度前期虽然已经观察到了经济数据的企稳,但是面对A股的趋势性下跌,并不敢轻易加仓,仓位一直维持在与业绩基准相当的平均仓位,结构上偏向指数配置,降低增强配置。当12月初观察到反弹的成交量的有效放大后,认为此次反弹与前几次的力度有所不同,选择指数成分股进行了适度加仓。

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12月31日,本基金份额净值为0.922元,累计份额净值为0.922元。报告期,本基金份额净值增长率为-1.18%,同期业绩比较基准收益率为-0.47%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年一季度,我们认为2012年12月的反弹趋势有望进一步延续,海外方面,美国"财政悬崖"危机在最后一刻得以解决,欧债危机在不断朝积极的方向发展;国内方面,经济开始回暖,出口趋势企稳回升,政治环境较为稳定,宏观方面的一系列利好信息有助于提振市场信心,配合以目前较充裕的流动性,都将有助于股市一季度继续向好。一季度,随着上市公司年报的相继披露,个股行情可能出现分化,绩优个股或受市场关注。

作为中小板指数增强型基金,本基金的仓位和结构会严格按照基金合同的要求进行配置,将跟踪误差控制在基金合同要求的范围内,同时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	49,580,327.60	1.64
	其中:股票	49,580,327.60	1.64
2	固定收益投资	2,856,299,053.58	94.54
	其中:债券	2,856,299,053.58	94.54
	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	63,773,126.53	2.11
6	其他资产	51,642,431.53	1.71
7	合计	3,021,294,939.24	100.00

5.2 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 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,147,827.60	0.15
B	采掘业	8,244,500.00	0.39
C	制造业	13,798,400.00	0.65
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	13,798,400.00	0.65
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	18,928,000.00	0.90
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	2,305,600.00	0.11
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	3,156,000.00	0.15
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	49,580,327.60	2.35

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

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	601006	大秦铁路	2,800,000	18,928,000.00	0.90
2	600143	金发科技	2,560,000	13,798,400.00	0.65
3	002683	宏大爆破	550,000	8,244,500.00	0.39
4	601965	中国汽研	400,000	3,156,000.00	0.15
5	601118	海南橡胶	554,195	3,147,827.60	0.15
6	601336	新华保险	80,000	2,305,600.00	0.11

5.4 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 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	98,860,000.00	4.69
	其中:政策性金融债	98,860,000.00	4.69
4	企业债券	2,020,637,967.35	95.77
5	企业短期融资券	431,226,000.00	20.44
6	中期票据	120,612,000.00	5.72
7	可转债	184,963,086.23	8.76
8	其他	-	-
9	合计	2,856,299,053.58	135.38

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

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 (%)
1	113003	重工转债	1,200,000	126,936,000.00	6.02
2	1280175	12铁道01	1,100,000	106,040,000.00	5.03
3	122106	11唐新01	800,000	81,200,000.00	3.85
4	122214	12大秦债	800,000	80,072,000.00	3.80
5	122068	11海螺01	778,270	78,216,135.00	3.71

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:本基金本报告期末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:本基金本报告期末未持有权证。

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	51,392,431.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,642,431.53

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	113003	重工转债	126,936,000.00	6.02
2	110015	石化转债	30,873,000.00	1.46
3	110018	国电转债	11,264,000.00	0.53
4	110013	国投转债	1,634,666.00	0.08
5	110019	恒丰转债	1,035,364.40	0.05
6	110012	海运转债	556,267.60	0.03
7	125887	中期转债	457,142.43	0.02
8	113002	工行转债	444,894.80	0.02

5.8.5 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。

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 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	-
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	-
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例 (%)	-

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本封闭式基金

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、华富强化回报债券型证券投资基金基金合同

2、华富强化回报债券型证券投资基金托管协议

3、华富强化回报债券型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富强化回报债券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。

华富中小板指数增强型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月21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2013年1月18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10月1日至2012年12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	66,597,505.54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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,610,156.51
2.本期利润	-964,292.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0132
4.期末基金资产净值	61,385,133.23
5.期末基金份额净值	0.922

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。

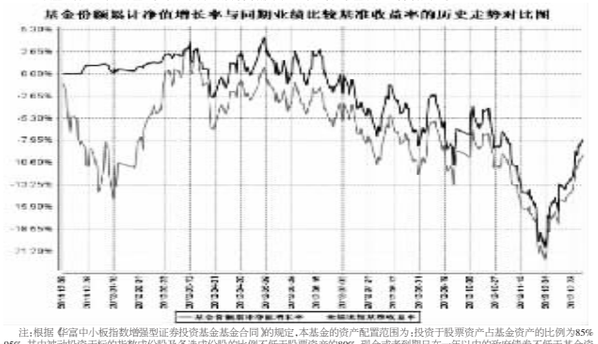
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-1.18%	1.28%	-0.47%	1.23%	-0.71%	0.05%

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。本基金建仓期为2011年12月9日到2012年6月9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《华富中小板指数增强型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	华富竞争力优选基金基金经理、华富策略精选混合基金基金经理、华富价值增长混合基金基金经理	2011年12月9日	2012年12月19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,2011年12月9日至2012年12月19日担任华富中小板指数增强型基金基金经理,2010年12月27日至2012年12月19日担任华富中证100指数基金基金经理。
朱蓓	华富中小板指数增强基金基金经理、华富量子生命力基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理	2012年12月19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:郭晨的任职日期指公司作出决定之日,离任日期指中国证券业协议作出注销决定之日;朱蓓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。

4.2 管理人对投资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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2012年四季度,经济回暖带动盈利筑底回升,12月初市场急转而上,外资开始抄底中国,银行股带领大盘不断向上,整个四季度,沪深300指数上涨10.02%,期间表现最好的三个行业分别是:房地产、金融服务、交运设备;表现最差的三个行业分别是:信息服务、餐饮旅游、食品饮料。周期类股票表现明显优于非周期类股票。

本基金按照量化择时模型,保持中高仓位运作。选股方面,本基金力求寻找在反弹行情初期弹性较大投资品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2011年4月1日正式成立。截止2012年12月31日,本基金份额净值为0.7235元,累计份额净值为0.7235元。报告期,本基金份额净值增长率为4.82%,同期业绩比较基准收益率为7.68%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年是中国新一届政府的开局之年。我们认为,在外部经济环境仍然复杂、如何改革还没达成共识的条件下,政策基调更偏向于"稳中待进",更多的会为未来十年经济发展谋划发展方向和打基础。PPI的小幅回升,将有利于改善工业企业收入、带动企业阶段性补库存。在物价相对稳定下,宽松政策延续继续推动基建投资回升,同时房地产投资和消费也将由下行转为底部趋稳,这将给市场带来新的稳定力量。我们对一季度市场相对乐观,市场在强势反弹后1月份出现回调概率较大,但后市有望震荡向上。

§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	89,994,534.48	93.54
	其中:股票	89,994,534.48	93.54
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	4,166,992.19	6.68
6	其他资产	265,571.92	0.43
7	合计	62,426,388.20	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	1,800,336.18	2.93
B	采掘业	4,157,196.23	6.77
C	制造业	31,073,450.23	50.62
C0	食品、饮料	4,504,083.18	7.34
C1	纺织、服装、皮毛	799,632.14	1.30
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	351,788.47	0.57
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,067,094.19	8.25
C5	电子	6,663,370.49	10.86
C6	金属、非金属	915,133.94	1.49
C7	机械、设备、仪表	6,644,140.31	10.82
C8	医药、生物制品	5,637,711.46	9.18
C99	其他制造业	490,496.05	0.80
D	电力、煤气及水的生产和供应业	254,893.98	0.42
E	建筑业	2,562,330.07	4.17
F	交通运输、仓储业	193,462.17	0.32
G	信息技术业	3,279,047.53	5.34
H	批发和零售贸易	4,686,559.05	7.63
I	金融、保险业	2,437,448.10	3.97
J	房地产业	1,739,108.79	2.83
K	社会服务业	776,930.52	1.27
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	52,960,762.85	86.28

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	318,507.52	0.52
C	制造业	3,185,053.72	5.19
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	865,337.50	1.41
C5	电子	538,931.20	0.88
C6	金属、非金属	1,208,126.50	1.97
C7	机械、设备、仪表	253,120.00	0.41
C8	医药、生物制品	319,538.52	0.52
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	252,300.00	0.41
E	建筑业	662,000.00	1.08
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	248,950.00	0.41
I	金融、保险业	366,250.00	0.60
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	5,033,061.24	8.20

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	608,656	4,047,562.40	6.59
2	002304	洋河股份	33,774	3,153,478.38	5.14
3	002236	大华股份	41,406	1,919,168.10	3.13
4	002155	辰州矿业	90,832	1,823,906.56	2.97
5	002142	宁波银行	162,432	1,731,525.12	2.82
6	002081	金螳螂	33,680	1,482,593.60	2.42
7	002422	科伦药业	26,462	1,482,401.24	2.41
8	002241	歌尔声学	38,387	1,447,189.90	2.36
9	002385	大北农	62,528	1,350,604.80	2.20
10	002230	科大讯飞	42,247	1,280,084.10	2.09

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	002271	东方雨虹	56,146	856,226.50	1.39
2	002250	联化科技	35,125	684,937.50	1.12
3	002375	亚厦股份	25,000	662,000.00	1.08
4	300088	长信科技	35,456	538,931.20	0.88
5	002673	西部证券	25,000	366,250.00	0.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末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:本基金本报告期末未持有权证。

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	915.59
5	应收申购款	14,656.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	265,571.92

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不存在流通受限情况。

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	88,640,744.05
本报告期期间基金总申购份额	8,585,982.75
减:本报告期期间基金总赎回份额	30,629,221.26
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	66,597,505.54

§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。

华富量子生命力股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2013年1月21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2013年1月18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10月1日至2012年12月31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	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
报告期末基金份额总额	131,110,509.63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1-3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	平安银行股份有限公司

§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10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-947,640.03
2.本期利润	4,175,136.00