

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2009 年年度报告
2009 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：2010 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

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 2010 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。

本报告期自 2009 年 7 月 15 日（基金成立日）起至 2009 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 审计报告.....	13
6.1 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表.....	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告.....	30
8.1 期末基金资产组合情况.....	30
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	35

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	36
8.9 投资组合报告附注	36
§9 基金份额持有人信息	37
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
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	37
§10 开放式基金份额变动	37
§11 重大事件揭示	37
11.1 基金份额持有人大会决议	37
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	38
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
11.4 基金投资策略的改变	38
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	38
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	38
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	38
11.8 其他重大事件	39
§12 影响投资者决策的其他重要信息	41
§13 备查文件目录	41

§ 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	436,655,352.97 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	宋菁
	联系电话	021-68886996	0755-22168761
	电子邮箱	manzh@hffund.com	songjing@sdb.com.cn

客户服务电话	400-700-8001	95501
传真	021-68887997	0755-22168347
注册地址	上海市浦东南路 588 号浦发大厦 14 层	广东省深圳市深南东路 5047 号
办公地址	上海市陆家嘴环路 1000 号汇丰大厦 31 楼	广东省深圳市深南东路 5047 号
邮政编码	200120	518001
法定代表人	姚怀然	法兰克·纽曼

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健正信会计师事务所有限公司	北京市西城区月坛北街 26 号恒华国际商务中心 4 层 401
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市陆家嘴环路 1000 号汇丰大厦 31 楼

§ 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	2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-25,201,247.09
本期利润	-15,457,479.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0267
本期加权平均净值利润率	-2.81%
本期基金份额净值增长率	-1.04%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末
期末可供分配利润	-16,987,968.65
期末可供分配基金份额利润	-0.0389
期末基金资产净值	432,118,554.13

期末基金份额净值	0.9896
3.1.3 累计期末指标	2009 年末
基金份额累计净值增长率	-1.04%

注：1) 本基金合同生效未满一年。

2) 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。

3) 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。

4) 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。

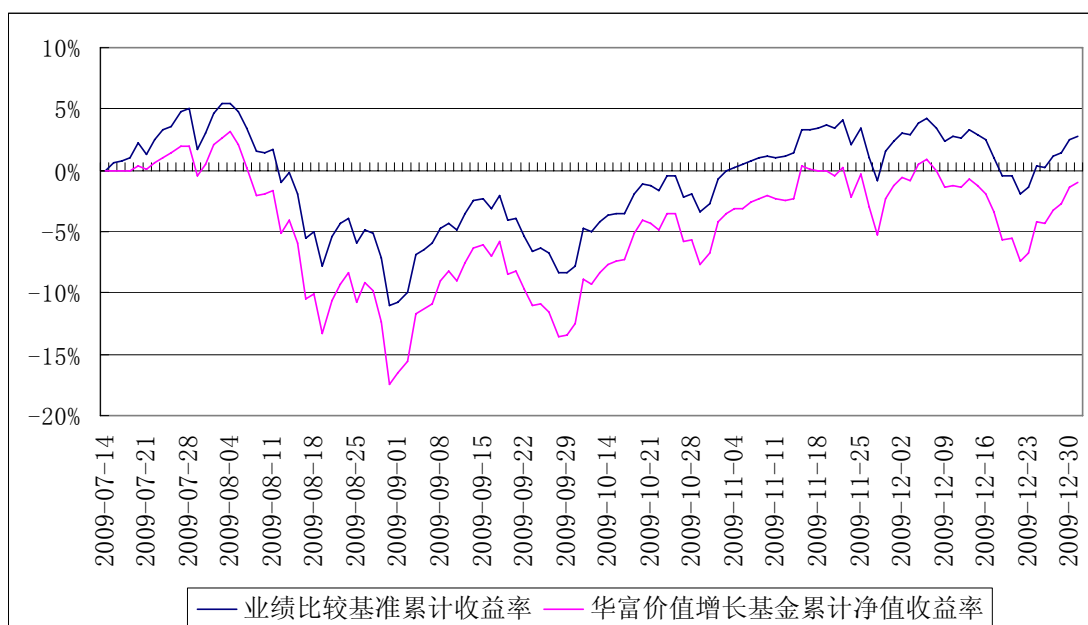
3.2 基金净值表现

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	13.15%	1.41%	11.44%	1.06%	1.71%	0.35%
过去六个月	—	—	—	—	—	—
过去一年	—	—	—	—	—	—
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效起至今	-1.04%	1.65%	2.79%	1.31%	-3.83%	0.34%

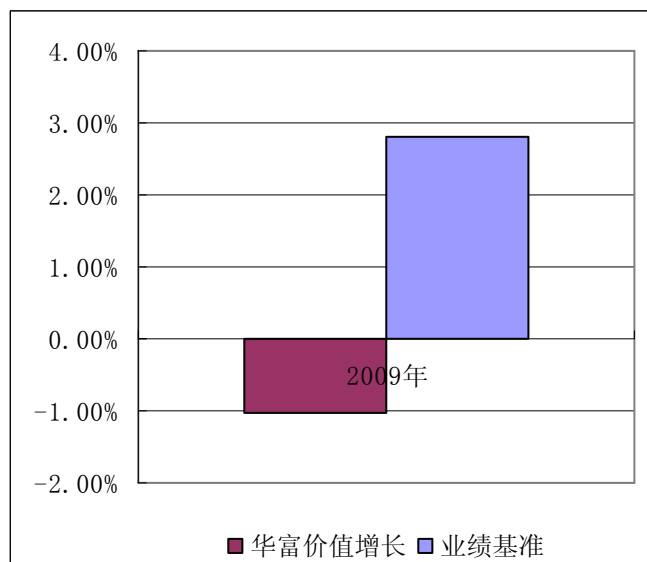
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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%。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2009 年 7 月 15 日到 2010 年 1 月 15 日，截止本报告期末，本基金仍在建仓期内。

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：1) 上述比较期间为 2009 年 7 月 15 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日。
2) 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
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。基金管理人于 2005 年 3 月 02 日发起成立并管理其第一只开放式基金——华富竞争力优选混合型证券投资基金。2006 年 6 月 21 日发起成立并管理其第二只开放式基金——华富货币市场基金。2007 年 3 月 19 日发起成立并管理其第三只开放式基金——华富成长趋势股票型证券投资基金。2008 年 5 月 28 日发起成立并管理其第四只开放式基金——华富收益增强债券型证券投资基金。2008 年 12 月 24 日发起成立并管理其第五只开放式基金——华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金。2009 年 7 月 15 日发起成立并管理其第六只开放式基金——华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金。2009 年 12 月 30 日发起成立并管理其第七只开放式基金——华富中证 100 指数证券投资基金。

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		
季雷	本基金基金经理、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2009 年 7 月 15 日	-	九年	工商管理硕士、物理学士。先后担任东北证券金融与产业研究所行业公司部经理、金融工程部经理，投资策划部经理兼首席策略师；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兼金融工程部经理，投资决策委员会委员。
韩玮	本基金基金经理、华	2009 年 8 月 04 日	-	九年	清华大学工商管理硕士。历任五洋期

	富中证 100 指数 基金基金 经理、公司 投资部总 监				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。
--	---	--	--	--	---

注：季雷的任职日期为该基金成立之日，韩玮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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本基金本年度处于建仓期内，其基金业绩与其他风格相似的基金没有可比性。

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

在全球金融危机爆发的大背景下，各国政府相继出台各种货币政策和财政政策刺激经济。2009年，中国政府通过要求“出手要快、出拳要重、措施要准、工作要实”，积极扩大投资、扩大内需，中国经济率先出现强劲复苏。社会资金流动性充裕，全年新增人民币贷款高达9.59万亿元，货币增速维持高位。2009年上市公司整体业绩稳步提升，在多重利好因素共同作用下，上半年A股市场呈现持续上升的格局。下半年，虽然国际与国内经济形势持续好转，但是由于A股市场增速过快以及投资者对信贷规模“微调”担心过度，市场先出现大幅回调，之后又走出震荡上升的形态。纵观全年，在汽车产销量持续高增长的影响下，汽车、汽车零部件、轮胎橡胶等行业涨幅领先，随后是煤炭、有色、环保等行业。而铁路运输、建筑、石油开采等行业全年涨幅落后。固定收益市场，上半年可转换债券随着股市上升涨幅可观，下半年信用债较高的到期收益率蕴含着较好的投资机会。

本基金2009年下半年开始运作，主要处于建仓期。重点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。起初由于建仓速度较快，致使净值随大盘下跌。随后，本基金趁市场极度悲观之机果断提高了基金仓位，并超配了汽车行业，增持了家电行业，减持了房地产行业，在市场反弹过程中取得了较好的效果。本基金还陆续买入信用债和可转债，为来年的固定收益

投资作铺垫。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2009 年 7 月 15 日生效，截止 2009 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9896 元，累计份额净值为 0.9896 元。报告期，本基金份额净值增长率为-1.04%，同期业绩比较基准收益率为 2.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2010 年，全球经济复苏的局面已经形成，各国政府刺激经济政策的退出必然会相继开始实施。欧洲主权债务风险以及对通胀水平的超预期，增加了全球经济运行的不确定性。预计中国经济在 2010 年仍将保持高速增长，消费升级、出口恢复会弥补投资增长的不足，人口红利、城市化等有利因素还将在未来一段时间内驱动中国经济增长。2010 年促内需、调结构政策的具体措施将逐步出台，会促进相关产业加速发展。预计上市公司总体业绩会在上半年呈现大幅增长，下半年呈现稳定增长。虽然信贷增长规模会出现放缓现象，但是投资者财富的积累、对股市信心的恢复、对房地产投资热情的降低以及储蓄活期化都会增加股票市场资金流入。目前，大多数蓝筹股以及一批成长性确定的中小盘股，其股价处于合理区间。本基金认为“回归常态，回归价值”将是 2010 年 A 股市场运行的主基调。A 股市场出现 2007 年至 2009 年暴涨暴跌行情的可能性很小，而是回归震荡上升的正常状态，企业经营过程中创造的价值将成为推动股价上升的决定力量。本基金将强化自下而上的选股策略，精选具备良好的公司治理、行业成长明确、核心竞争力持续提升、价格相对合理的上市公司，深入发掘收入分配调节、医疗改革、节能减排、金融创新以及扶植新兴产业等政策调整带来的结构性机会。本基金还将密切关注由刺激政策退出、通胀超预期、汇率波动等因素可能引发的短期市场风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2009 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、加强内部控制制度建设，完善内部控制环境。在全面修订基本制度后，组织安排各部门对所有规章制度进行全面梳理，根据业务发展的需要，新制定了《华富基金管理有限公司信用债信用评级及投资管理办法》、《新股询价、配股、增发管理制度》等投资制度，进一步完善了投研人员管理办法。从强化合规意识、树立规范概念、优化业务流程、防范业务风险入手，全程监督和促进各部门的制度更新工作。

2、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

3、扩大风控工作的覆盖面。风控工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风控会报告，进行及时的风险揭示。

4、对公司各部门进行全面监察稽核，通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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正信会计师事务所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投资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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期出现亏损，按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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”）在对华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金（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《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、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	华富价值增值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值灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华富价值增长”）财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表，2009 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业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表是华富价值增长管理人华富基金管理有限公司的责任。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）做出合理的会计估计。	
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，华富价值增长财务报表已经按照企业会计准则和中国证券业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制，在所有重大方面公允反映了华富价值增长 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	马静	曹小勤
会计师事务所的名称	天健正信会计师事务所有限公司	
会计师事务所的地址	北京市西城区月坛北街 26 号恒华国际商务中心 4 层 401	
审计报告日期	2010 年 3 月 27 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：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	72,952,963.99
结算备付金		253,955.06
存出保证金		1,583,333.36
交易性金融资产	7.4.7.2	358,428,262.06
其中：股票投资		343,586,817.36
基金投资		-
债券投资		14,841,444.70
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,044,201.35
应收利息	7.4.7.5	251,410.23
应收股利		-
应收申购款		3,448.28
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		434,517,574.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		849,884.81
应付赎回款		195,374.64
应付管理人报酬		567,356.08
应付托管费		94,559.35
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	211,109.01
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	480,736.31
负债合计		2,399,020.20
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	436,655,352.97
未分配利润	7.4.7.10	-4,536,798.84
所有者权益合计		432,118,554.13
负债和所有者权益总计		434,517,574.33

注：本基金合同于 2009 年 7 月 15 日生效，实际报告期为 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日。报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9896 元，基金份额总额 436,655,352.97 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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：2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期金额 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		-9,386,972.21
1. 利息收入		557,197.19
其中：存款利息收入	7.4.7.11	491,591.17
债券利息收入		65,606.02
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-19,981,173.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-20,566,599.66
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	36,709.38
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	370,695.71
股利收益	7.4.7.15	178,021.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	9,743,767.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	293,236.29
减：二、费用		6,070,507.32
1. 管理人报酬		3,809,156.61
2. 托管费		634,859.38
3. 销售服务费		-

4. 交易费用	7.4.7.18	1,393,491.33
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	233,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,457,479.53
减：所得税费用		-
四、净利润（亏损总额以“-”号填列）		-15,457,479.53

注：本基金合同于 2009 年 7 月 15 日生效，实际报告期为 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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：2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 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）	679,121,902.68	-	679,121,902.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,457,479.53	-15,457,479.53
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）	-242,466,549.71	10,920,680.69	-231,545,869.02
其中：1. 基金申购款	3,362,218.81	-303,676.77	3,058,542.04
2. 基金赎回款	-245,828,768.52	11,224,357.46	-234,604,411.06
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）	436,655,352.97	-4,536,798.84	432,118,554.13

注：本基金合同于 2009 年 7 月 15 日生效，实际报告期为 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日。后附报表附注为本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：

姚怀然

谢庆阳

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)验资并出具天健华证验(2009)综字第 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 2009 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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表以衍生金融负债列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

7.4.4.4.1 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

7.4.4.4.1.1 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.4.1.2 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于获得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减权证确定的成本确认债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

7.4.4.4.1.3 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证按附注 7.4.4.4.1.2 所示的方法确认权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.4.2 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

7.4.4.4.3 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值,主要资产的估值方法如下:

7.4.4.5.1 股票投资

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

首次公开发行但未上市的股票采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票,在同一股票上市交易后,在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

自 2006 年 11 月 13 日起基金新投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为:若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数

的比例将两者之间差价的一部分认为估值增值。

7.4.4.5.2 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘净价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

7.4.4.5.3 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

7.4.4.5.4 如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代

扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的，可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

7.4.4.10.1 基金管理人报酬

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，基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，按月支付。

7.4.4.10.2 基金托管费

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，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。

7.4.4.10.3 卖出回购证券支出

卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

7.4.4.10.4 其他费用

按实际支出金额列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后五位的，则根据权责发生制原则，采用待摊或预提的方法确认。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 50%；；期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即指基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

7.4.5.3 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，继续免征收营业税。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	72,952,963.99
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	72,952,963.99

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		334,656,201.30	343,586,817.36	8,930,616.06
债券	交易所市场	14,028,293.20	14,841,444.70	813,151.50
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		348,684,494.50	358,428,262.06	9,743,767.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	14,990.23
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	97.79
应收债券利息	235,795.47
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	13.48
其他	513.26
合计	251,410.23

注：本表列示的其他为应收权证保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	211,109.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	211,109.01

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	736.31
应付审计费	50,000.00
应付信息披露费	180,000.00
合计	480,736.31

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	679,121,902.68	679,121,902.68
本期申购	3,362,218.81	3,362,218.81
本期赎回（以“-”号填列）	-245,828,768.52	-245,828,768.52
本期末	436,655,352.97	436,655,352.97

注：本基金在募集期间的净认购金额为 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 269,382.24 份。申购含红利再投、转换含转换出份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-25,201,247.09	9,743,767.56	-15,457,479.53
本期基金份额交易产生的变动数	8,213,278.44	2,707,402.25	10,920,680.69
其中：基金申购款	-93,963.20	-209,713.57	-303,676.77
基金赎回款	8,307,241.64	2,917,115.82	11,224,357.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,987,968.65	12,451,169.81	-4,536,798.84

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	474,006.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,376.42
其他	10,208.24
合计	491,591.17

注：其他所列本期金额包括权证保证金利息收入 10,149.90 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 58.34 元。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	341,525,471.60
减：卖出股票成本总额	362,092,071.26
买卖股票差价收入	-20,566,599.66

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	132,722.00
减：卖出债券（、债转股及	96,000.00

债券到期兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	12.62
债券投资收益	36,709.38

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	1,044,611.47
减: 卖出权证成本总额	673,915.76
买卖权证差价收入	370,695.71

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	178,021.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	178,021.32

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	9,743,767.56
——股票投资	8,930,616.06
——债券投资	813,151.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	9,743,767.56

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	287,665.30
基金转换费收入	5,547.61
其他	23.38
合计	293,236.29

注：“其他”为募集户利息收入。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,393,491.33
银行间市场交易费用	-
合计	1,393,491.33

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	180,000.00
自营托管账户维护费	3,000.00
合计	233,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,809,156.61
其中：支付销售机构的客户维护费	649,053.40

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 $H=E \times \text{年}$

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)。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期
	2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	634,859.38

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 $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ (H 为每日应计提的基金托管费, E 为前一日基金资产净值)。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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
	2009 年 7 月 15 日至 2009 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	50,000,388.89
期初持有的基金份额	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
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.45%

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。

7.4.10.4.2 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

本报告期末没有其他关联方投资本基金的情况

7.4.10.5 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	
	2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
深圳发展银行股份有限公司	72,952,963.99	474,006.51

7.4.10.6 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未参与关联方承销证券

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600999	招商证券	2009 年 11 月 12 日	2010 年 02 月 22 日	认购新股未流通	31.00	29.39	27,311	846,641.00	802,670.29	
601117	中国化学	2009 年 12 月 29 日	2010 年 01 月 07 日	认购新股未流通	5.43	5.43	12,000	65,160.00	65,160.00	
002308	威创股份	2009 年 11 月 18 日	2010 年 03 月 01 日	认购新股未流通	23.80	31.83	10,659	253,684.20	339,275.97	
002330	得利斯	2009 年 12 月 25 日	2010 年 01 月 06 日	认购新股未流通	13.18	13.18	500	6,590.00	6,590.00	
300037	新宙邦	2009 年 12 月 28 日	2010 年 01 月 08 日	认购新股未流通	28.99	28.99	500	14,495.00	14,495.00	
300039	上海凯宝	2009 年 12 月 28 日	2010 年 01 月 08 日	认购新股未流通	38.00	38.00	500	19,000.00	19,000.00	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

7.4.12.3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良

好信用等级证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未投资包括短期融资券、一年期以内的资产支持证券等短期金融产品。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2009 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	14,841,444.70
未评级	-
合计	14,841,444.70

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、商业银行债、非银行金融债等基金可投资的信用产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2009 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	72,952,963.99	-	-	-	-	-	72,952,963.99
结算备付金	253,955.06	-	-	-	-	-	253,955.06
存出保证金	1,333,333.36	-	-	-	-	250,000.00	1,583,333.36
交易性金融资产	-	-	-	5,316,195.00	9,525,249.70	343,586,817.36	358,428,262.06
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,044,201.35	1,044,201.35
应收利息	-	-	-	-	-	251,410.23	251,410.23
应收申购款	-	-	-	-	-	3,448.28	3,448.28
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	74,540,252.41	-	-	5,316,195.00	9,525,249.70	345,135,877.22	434,517,574.33
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	849,884.81	849,884.81
应付赎回款	-	-	-	-	-	195,374.64	195,374.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	567,356.08	567,356.08
应付托管费	-	-	-	-	-	94,559.35	94,559.35
应付交易费用	-	-	-	-	-	211,109.01	211,109.01
其他负债	-	-	-	-	-	480,736.31	480,736.31
负债总计	-	-	-	-	-	2,399,020.20	2,399,020.20
利率敏感度缺口	74,540,252.41	-	-	5,316,195.00	9,525,249.70	342,736,857.02	432,118,554.13

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2009 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 基点	1,204,467.00
	2. 市场利率上升 25 基点	-1,181,014.00

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格

实施监控。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	343,586,817.36	79.51
交易性金融资产-债券投资	14,841,444.70	3.43
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	358,428,262.06	82.95

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末（2009 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	1,335.58
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,335.58

7.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）	
	2. 观察期（1 年）	
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2009 年 12 月 31 日）
	合计	11,941,603.53

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	343,586,817.36	79.07
	其中：股票	343,586,817.36	79.07
2	固定收益投资	14,841,444.70	3.42
	其中：债券	14,841,444.70	3.42
	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	73,206,919.05	16.85
6	其他各项资产	2,882,393.22	0.66
7	合计	434,517,574.33	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	57,853,508.29	13.39
C	制造业	106,155,518.08	24.57
C0	食品、饮料	10,008,192.00	2.32
C1	纺织、服装、皮毛	3,994,608.96	0.92
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,176,328.91	1.43
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	32,914,071.75	7.62
C7	机械、设备、仪表	45,232,628.96	10.47
C8	医药、生物制品	7,829,687.50	1.81
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,353,648.00	1.01
F	交通运输、仓储业	6,330,267.20	1.46
G	信息技术业	21,150,459.97	4.89
H	批发和零售贸易	9,549,137.16	2.21
I	金融、保险业	103,195,845.08	23.88
J	房地产业	18,523,778.18	4.29
K	社会服务业	14,141,555.40	3.27
L	传播与文化产业	2,333,100.00	0.54
M	综合类	-	-
	合计	343,586,817.36	79.51

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601628	中国人寿	618,335	19,595,036.15	4.53
2	600030	中信证券	612,700	19,465,479.00	4.50
3	601088	中国神华	556,250	19,368,625.00	4.48
4	600036	招商银行	1,066,155	19,244,097.75	4.45
5	000983	西山煤电	475,621	18,972,521.69	4.39
6	000002	万科A	1,713,578	18,523,778.18	4.29
7	600000	浦发银行	755,813	16,393,583.97	3.79
8	000063	中兴通讯	344,100	15,439,767.00	3.57
9	601601	中国太保	580,956	14,884,092.72	3.44
10	000069	华侨城A	823,620	14,141,555.40	3.27
11	600104	上海汽车	523,031	13,666,800.03	3.16
12	601958	金钼股份	614,160	11,705,889.60	2.71
13	000898	鞍钢股份	567,800	9,084,800.00	2.10
14	000060	中金岭南	319,720	8,920,188.00	2.06
15	000417	合肥百货	589,948	8,654,537.16	2.00
16	600089	特变电工	357,400	8,506,120.00	1.97
17	601169	北京银行	429,980	8,315,813.20	1.92
18	600031	三一重工	224,973	8,281,256.13	1.92
19	600276	恒瑞医药	148,775	7,810,687.50	1.81
20	601899	紫金矿业	809,800	7,806,472.00	1.81
21	600600	青岛啤酒	198,200	7,454,302.00	1.73
22	000527	美的电器	311,684	7,231,068.80	1.67
23	000157	中联重科	248,400	6,460,884.00	1.50
24	600019	宝钢股份	602,100	5,816,286.00	1.35
25	600362	江西铜业	114,799	4,616,067.79	1.07
26	601398	工商银行	826,300	4,495,072.00	1.04
27	600585	海螺水泥	89,786	4,476,729.96	1.04
28	601186	中国铁建	469,200	4,288,488.00	0.99
29	600050	中国联通	587,300	4,281,417.00	0.99
30	601919	中国远洋	289,948	4,030,277.20	0.93
31	002154	报喜鸟	177,066	3,994,608.96	0.92
32	000792	盐湖钾肥	67,459	3,844,488.41	0.89
33	600519	贵州茅台	15,000	2,547,300.00	0.59
34	002238	天威视讯	110,000	2,333,100.00	0.54
35	000826	合加资源	149,990	2,317,345.50	0.54

36	601006	大秦铁路	223,300	2,299,990.00	0.53
37	002194	武汉凡谷	50,000	1,090,000.00	0.25
38	000528	柳 工	50,000	1,086,500.00	0.25
39	600415	小商品城	20,000	894,600.00	0.21
40	600999	招商证券	27,311	802,670.29	0.19
41	002308	威创股份	10,659	339,275.97	0.08
42	601117	中国化学	12,000	65,160.00	0.02
43	300039	上海凯宝	500	19,000.00	0.00
44	300037	新宙邦	500	14,495.00	0.00
45	002330	得利斯	500	6,590.00	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000069	华侨城 A	36,229,991.03	8.38
2	600036	招商银行	34,761,725.49	8.04
3	000002	万 科 A	33,061,742.55	7.65
4	600030	中信证券	31,877,304.19	7.38
5	601628	中国人寿	30,613,980.59	7.08
6	600585	海螺水泥	29,098,396.72	6.73
7	601088	中国神华	27,892,903.27	6.45
8	600000	浦发银行	25,604,467.21	5.93
9	601601	中国太保	24,169,740.89	5.59
10	000983	西山煤电	21,269,332.09	4.92
11	600104	上海汽车	20,419,649.33	4.73
12	000898	鞍钢股份	20,187,759.06	4.67
13	601398	工商银行	17,135,164.00	3.97
14	600050	中国联通	16,620,858.00	3.85
15	601958	金钼股份	16,521,175.22	3.82
16	600028	中国石化	16,148,263.53	3.74
17	000063	中兴通讯	15,800,099.17	3.66
18	601186	中国铁建	14,947,609.29	3.46
19	600019	宝钢股份	13,968,569.00	3.23
20	000060	中金岭南	13,761,029.04	3.18
21	000792	盐湖钾肥	12,558,285.61	2.91

22	000157	中联重科	12,026,149.71	2.78
23	600031	三一重工	11,347,547.32	2.63
24	601169	北京银行	11,228,954.51	2.60
25	000527	美的电器	11,137,795.38	2.58
26	601899	紫金矿业	10,542,201.30	2.44
27	600362	江西铜业	10,432,451.00	2.41
28	600089	特变电工	10,376,880.94	2.40
29	600900	长江电力	10,157,268.00	2.35
30	600795	国电电力	9,742,756.80	2.25
31	600261	浙江阳光	9,377,566.48	2.17

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	23,052,401.44	5.33
2	000069	华侨城 A	18,268,433.71	4.23
3	600104	上海汽车	14,462,938.66	3.35
4	600028	中国石化	13,692,550.34	3.17
5	600036	招商银行	13,490,772.56	3.12
6	601398	工商银行	12,099,800.00	2.80
7	601628	中国人寿	11,288,369.64	2.61
8	600261	浙江阳光	11,269,819.81	2.61
9	600050	中国联通	10,878,493.16	2.52
10	601601	中国太保	9,416,433.50	2.18
11	000002	万科 A	9,357,111.43	2.17
12	600030	中信证券	9,262,377.00	2.14
13	000898	鞍钢股份	9,113,826.82	2.11
14	600900	长江电力	9,038,652.85	2.09
15	601088	中国神华	8,591,128.56	1.99
16	601186	中国铁建	8,588,300.00	1.99
17	600795	国电电力	8,044,183.05	1.86
18	600000	浦发银行	7,228,216.48	1.67
19	000792	盐湖钾肥	6,996,553.56	1.62
20	600019	宝钢股份	6,971,412.90	1.61

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	696,748,272.56
卖出股票收入（成交）总额	341,525,471.60

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	7,361,073.20	1.70
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	7,480,371.50	1.73
7	其他	-	-
8	合计	14,841,444.70	3.43

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	111052	09 哈城投	33,580	3,248,529.20	0.75
2	122948	09 锡交债	30,000	2,782,500.00	0.64
3	110006	龙盛转债	18,000	2,767,680.00	0.64
4	110005	西洋转债	17,250	2,548,515.00	0.59
5	125969	安泰转债	14,450	2,164,176.50	0.50

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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

中兴通讯（证券代码：000063）于 2008 年 10 月 7 日收到财政部驻深圳市财政监察办事处向该公司送达的《行政处罚决定书》，就该公司及其所属四家子公司 2007 年度财务报表查出的报表编制、收入费用核算以及企业所得税汇算清缴等六方面问题进行处罚，罚款 16 万元，并补缴企业所得税 380 万元。该公司已经按照行政部门的意见对相关财务指标进行了修正，公司的主营业务未受影响。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

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	1,583,333.36
2	应收证券清算款	1,044,201.35
3	应收股利	—
4	应收利息	251,410.23
5	应收申购款	3,448.28
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,882,393.22

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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
6,394.00	68,291.42	126,742,080.75	29.03%	309,913,272.22	70.97%

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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,362,218.81
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	245,828,768.52
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	436,655,352.97

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第二届四次董事会审议通过，聘任邹牧先生担任公司副总经理。邹牧先生的任职资格已经中国证监会证监许可[2009]207 号文件核准。
- 2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘韩玮先生为华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
- 3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘陈德义先生为华富成长趋势股票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，吴圣涛先生因个人原因不再担任华富成长趋势股票型证券投资基金和华富收益增强债券型证券投资基金基金经理的职务。
- 5、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货币市场基金的基金经理。

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

本报告期内，本基金原会计师事务所天健光华会计师事务所被吸收合并为天健正信会计师事务所，为保证基金审计的连续性，本基金聘用天健正信会计师事务所为本基金的审计机构。华富价值增长基金本年度支付给原审计机构天健光华会计师事务所审计报酬为5万元人民币。天健正信会计师事务所将从2010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	682,731,859.07	66.35%	553,792.70	66.11%	
厦门证券	1	346,265,391.90	33.65%	283,935.60	33.89%	

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	5,524,705.41	47.09%	-	-	-	-
厦门证券	6,207,685.08	52.91%	-	-	1,044,611.47	100%

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。

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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009年5月22日
2	《关于华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金增加中国建设银行股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009年5月27日
3	《关于华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金增加中信银行股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009年6月02日
4	《关于华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金增加中国工商银行股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009年6月08日
5	《华富基金管理有限公司旗下基金增加江	在《中国证券报》、《上	2009年6月09日

	海证券为代销机构并参与网上申购费率优惠活动的公告》	海证券报》、《证券时报》上公告	
6	《关于华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金增加上海银行股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 6 月 22 日
7	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金延长募集期的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 6 月 26 日
8	《华富基金管理有限公司旗下基金增加爱建证券为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 7 月 02 日
9	《华富基金管理有限公司关于运用公司固有资金投资旗下华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 7 月 08 日
10	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 7 月 16 日
11	《华富基金管理有限公司旗下基金增加万联证券为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 7 月 30 日
12	《关于华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 8 月 07 日
13	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购赎回业务、定期定额投资及转换业务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 8 月 12 日
14	《华富基金管理有限公司旗下基金增加红塔证券为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 9 月 15 日
15	《华富基金管理有限公司关于旗下基金参	在《中国证券报》、《上	2009 年 9 月 23 日

	与创业板投资及相关风险揭示的公告》	海证券报》、《证券时报》上公告	
16	《华富基金管理有限公司迁址的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 9 月 28 日
17	《华富基金管理有限公司旗下基金增加信达证券为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 10 月 16 日
18	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2009 年度第三季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 10 月 29 日
19	《华富基金管理有限公司旗下基金增加广发华福证券为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 11 月 16 日
20	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2009 年 11 月 20 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

4、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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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。