

华富竞争力优选混合型证券投资基金 2011 年半年度报告摘要

2011年6月30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

送出日期：2011年8月24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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 23 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 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富竞争力优选混合
基金主代码	410001
交易代码	410001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 3 月 2 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
报告期末基金份额总额	1,792,638,810.18 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略，对基金投资风险的控制遵循“事前防范、事中控制、事后评估”的风险控制程序，运用华富 PMC 选股系统，力求实现基金资产的中长期稳定增值。
------	---

投资策略	在资产配置方面，采用自上而下的方法，确定各类资产的权重；在行业及股票选择方面，利用自身开发的“华富 PMC 选股系统”进行行业及股票综合筛选；在债券选择方面，通过研究宏观经济、国家政策及收益率曲线，积极调整债券组合的久期结构。
业绩比较基准	60%×中信标普 300 指数+35%×中信标普全债指数+5% ×同业存款利率
风险收益特征	本基金属于中等风险的混合型基金，其风险收益特征从长期平均来看，介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间。基金管理人通过适度主动的资产配置与积极主动的精选证券，实现风险限度内的合理回报。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	尹东
	联系电话	021-68886996	010-67595003
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-196, 010, 843. 06
本期利润	-252, 109, 506. 71
加权平均基金份额本期利润	-0. 1374
本期加权平均净值利润率	-19. 26%
本期基金份额净值增长率	-17. 75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-7, 640, 827. 76
期末可供分配基金份额利润	-0. 0043

期末基金资产净值	1,151,418,921.09
期末基金份额净值	0.6423
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	120.57%

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

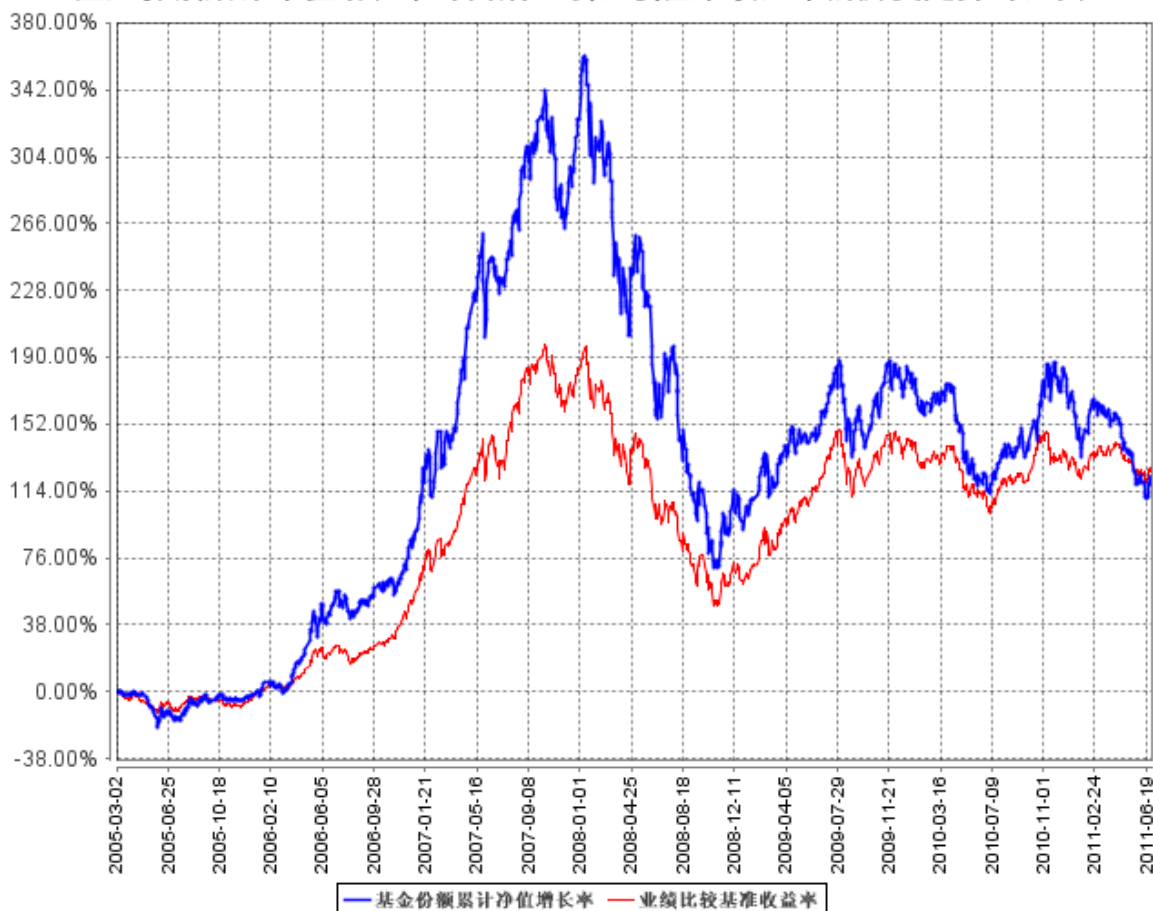
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去一个月	0.48%	1.18%	0.79%	0.73%	-0.31%	0.45%
过去三个月	-12.19%	1.01%	-3.18%	0.66%	-9.01%	0.35%
过去六个月	-17.75%	1.17%	-1.47%	0.74%	-16.28%	0.43%
过去一年	2.87%	1.38%	11.32%	0.84%	-8.45%	0.54%
过去三年	-15.76%	1.68%	14.08%	1.20%	-29.84%	0.48%
自基金合同生效起至今	120.57%	1.72%	127.28%	1.20%	-6.71%	0.52%

注：业绩比较基准收益率=60%×中信标普300指数+35%×中信标普全债指数+5%×同业存款利率，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

基金份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



注：根据《华富竞争力优选混合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：股票 30%~90%、债券 5%~65%、现金不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2005 年 3 月 2 日至 9 月 2 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《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 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。截止 2011 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、华富策略精选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和华富量子生命力股票型证券投资基金九只基金。

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	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		
张琦	华富竞争力优选基金基金经理	2010年6月2日	-	七年	英国里丁大学投资银行专业硕士，六年证券从业经验，2004年8月至2006年8月在光大证券有限公司从事证券研究工作，2006年8月至2010年3月在银华基金管理有限公司从事证券研究及专户投资工作，2010年4月加入我公司。

注：任职日期和离任日期均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

按照华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长的基金合同，华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长都属于混合型基金，2011年上半年，华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长的净值增长率分别为-17.75%、-17.24%与-10.27%。华富竞争力、华富策略精选的差异不大。华富价值增长与两只基金的差异主要由资产配置和行业配置的差异造成。

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

2011 年上半年中国资本市场呈现震荡下跌走势，对通货膨胀的担忧，导致紧缩政策迟迟不能放开，对欧美经济复苏的担忧，则进一步加剧了预期的恶化。

期间各行业表现，由于国际板推出的鼓噪，预期供给大幅增加的中小市值股票大幅下跌，而受益于估值与港股相比有优势的以银行为代表的大盘蓝筹股下跌较少。

本基金上半年投资策略较为失败，组合中成长类股票较多，又没有及时跟进水泥、工程机械等受益于政府投资拉动的行业，导致业绩欠佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2005 年 3 月 2 日正式成立。截至 2011 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.6423 元，累计基金份额净值为 1.9171 元。报告期，本基金本报告期份额净值增长率为-17.75%，同期业绩比较基准收益率为-1.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管预期政策可能继续紧缩，但随着保障房、水利建设、扶持新兴产业规划不断出台，依然会形成新的热点。

从资金面看，为了应对过去几年货币超发，货币政策将维持偏紧，市场更多体现为存量资金的游戏，通货膨胀也将在整体上压制市盈率，所以大盘蓝筹股票的所谓估值恢复并不能走得太远。

从基本面来看，也应该积极配置新经济。十二五规划最强调的是经济转型，目前高通胀和高房价对传统经济增长模式形成的压制，以及地方债务的不确定性，都需要经济转型，提高盈利能力从根本上予以解决。

市场指数在下半年可能的运行格局就是震荡，等待下一个突破方向的明朗。但中小板和创业板指数可能是继续向上，即行情的主线就是超跌的创业板和中小板。

在经历了上半年的下跌后，创业板和中小板普遍进入到一个相对合理的估值区间，而今后正是大批公司募集资金开始建成投产、收购兼并开始逐步产生效益的时间。

我们预期下半年市场不会有大的机会，但是板块活跃的态势应该得以延续，我们将积极参与主题板块轮动。主要选择受益于投资拉动的行业、成长类的中小企业等，尤其重点关注受益于价格体系理顺调整的行业；我们也关注部分受益于税收减负的消费品；由于地方融资平台的情况不清楚，回避银行。

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。

4.7 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《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-252,109,506.71，期末可供分配利润为-7,640,827.76。本报告期内未进行利润分配。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	67,315,884.98	325,695,971.38
结算备付金		6,383,154.77	10,237,149.46
存出保证金		5,482,759.06	6,362,425.13
交易性金融资产	6.4.7.2	1,088,169,502.32	1,192,758,588.85
其中：股票投资		1,029,805,606.62	1,109,499,361.55
基金投资		-	-
债券投资		58,363,895.70	83,259,227.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	568,207.97	444,422.81
应收股利		-	-
应收申购款		88,401.21	516,501.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,168,007,910.31	1,536,015,059.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 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		7,028,317.08	55,824,719.81
应付赎回款		623,038.24	391,590.53
应付管理人报酬		1,401,384.47	1,940,374.21
应付托管费		233,564.08	323,395.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,161,860.25	4,955,403.43
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	3,140,825.10	2,058,958.61
负债合计		16,588,989.22	65,494,442.25
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	978,237,555.50	1,027,672,985.79
未分配利润	6.4.7.10	173,181,365.59	442,847,630.96
所有者权益合计		1,151,418,921.09	1,470,520,616.75
负债和所有者权益总计		1,168,007,910.31	1,536,015,059.00

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6423 元，基金份额总额 1,792,638,810.18 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-224,350,373.86	-402,447,084.91
1. 利息收入		1,288,766.97	1,005,935.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	813,245.05	464,117.74
债券利息收入		475,521.92	489,086.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	52,731.31
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-169,554,231.20	-278,580,971.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-169,879,977.87	-293,008,999.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,005,494.52	8,287,836.31
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	2,331,241.19	6,140,191.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-56,098,663.65	-124,924,909.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,754.02	52,860.19
减：二、费用		27,759,132.85	22,318,836.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,767,009.10	11,529,625.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,627,834.81	1,921,604.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	16,121,909.91	8,624,971.36
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	242, 379. 03	242, 635. 32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-252, 109, 506. 71	-424, 765, 921. 20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-252, 109, 506. 71	-424, 765, 921. 20

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：华富竞争力优选混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 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）	1, 027, 672, 985. 79	442, 847, 630. 96	1, 470, 520, 616. 75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-252, 109, 506. 71	-252, 109, 506. 71
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）	-49, 435, 430. 29	-17, 556, 758. 66	-66, 992, 188. 95
其中：1. 基金申购款	11, 020, 739. 96	3, 541, 394. 00	14, 562, 133. 96
2. 基金赎回款	-60, 456, 170. 25	-21, 098, 152. 66	-81, 554, 322. 91
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）	978, 237, 555. 50	173, 181, 365. 59	1, 151, 418, 921. 09
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	1, 172, 765, 915. 67	607, 718, 400. 92	1, 780, 484, 316. 59
二、本期经营活动产生	-	-424, 765, 921. 20	-424, 765, 921. 20

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-50,457,872.15	-21,001,002.66	-71,458,874.81
其中：1. 基金申购款	8,179,479.30	2,965,407.02	11,144,886.32
2. 基金赎回款	-58,637,351.45	-23,966,409.68	-82,603,761.13
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）	1,122,308,043.52	161,951,477.06	1,284,259,520.58

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 章宏韬	_____ 姚怀然	_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富竞争力优选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《华富竞争力优选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基金字【2004】199 号文核准募集设立。本基金自 2005 年 1 月 4 日起公开向社会发行，至 2005 年 2 月 25 日募集结束。经安永大华会计师事务所有限责任公司验资并出具安永大华业字（2005）第 0015 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本次募集资金总额 600,803,457.07 元；募集资金的银行存款利息 303,413.67 元，折成基金份额，归投资人所有；设立募集期共募集 601,106,870.74 份基金单位。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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司；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 2005 年 3 月 2 日生效，该日的基金份额为 601,106,870.74 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》、《华富竞争力优选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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

6.4.5 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

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

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。

6.4.6 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：

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。

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。）

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 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，由双边征收改为向卖方单边征收，税率保持 1%。

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。

6.4.7 关联方关系

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

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
中国建设银行股份有限公司	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

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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华安证券	-	-	279,351,851.25	5.09%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元发生的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元发生的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元发生的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华安证券	-	-	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华安证券	226,974.33	4.93%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年 6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,767,009.10	11,529,625.37
其中：支付销售机构的客户维护费	1,504,582.04	1,763,593.51

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,627,834.81	1,921,604.24

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）。

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

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
----	--------------------------------	-------------------------------------

基金合同生效日（2005 年 3 月 2 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	36,372,790.53
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	-	36,372,790.53
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.77%

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。

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：份

关联方名称	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	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 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
合肥兴泰控股集团 集团有限公司	9,162,317.04	0.51%	9,162,317.04	0.49%

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。

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

关联方 名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行 股份有限公司	67,315,884.98	750,109.13	443,270,519.10	438,723.74

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 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及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末（2011 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。

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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000609	绵世股份	2011年6月30日	未公告重大事项	10.73	2011年8月16日	11.78	1,999,955	23,945,420.73	21,459,517.15	-

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

无

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,029,805,606.62	88.17
	其中：股票	1,029,805,606.62	88.17
2	固定收益投资	58,363,895.70	5.00
	其中：债券	58,363,895.70	5.00
	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	73,699,039.75	6.31
6	其他各项资产	6,139,368.24	0.53
7	合计	1,168,007,910.31	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

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	-	-
C	制造业	530,315,220.17	46.06
C0	食品、饮料	55,159,638.16	4.79

C1	纺织、服装、皮毛	2,318,550.00	0.20
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	83,079,599.80	7.22
C5	电子	16,000,000.00	1.39
C6	金属、非金属	37,720,783.47	3.28
C7	机械、设备、仪表	277,564,210.64	24.11
C8	医药、生物制品	8,070,000.00	0.70
C99	其他制造业	50,402,438.10	4.38
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	132,882,859.19	11.54
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	76,789,035.36	6.67
H	批发和零售贸易	11,389,384.94	0.99
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	114,452,927.50	9.94
K	社会服务业	100,897,249.42	8.76
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	63,078,930.04	5.48
	合计	1,029,805,606.62	89.44

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

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	600316	洪都航空	2,592,868	83,568,135.64	7.26
2	300055	万邦达	1,360,910	63,418,406.00	5.51
3	600193	创兴资源	4,564,322	63,078,930.04	5.48
4	600068	葛洲坝	4,999,885	59,948,621.15	5.21
5	600702	沱牌舍得	2,669,876	55,159,638.16	4.79
6	000969	安泰科技	2,580,770	50,402,438.10	4.38
7	300132	青松股份	3,023,778	47,170,936.80	4.10
8	300197	铁汉生态	560,000	37,240,000.00	3.23
9	002060	粤水电	2,815,003	35,694,238.04	3.10
10	600376	首开股份	2,640,596	34,882,273.16	3.03

注：600702 沱牌曲酒股票已在 2011 年 7 月 8 日公告更名为沱牌舍得。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 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002049	晶源电子	116,932,713.52	7.95
2	000807	云铝股份	114,672,394.50	7.80
3	600702	沱牌舍得	95,413,032.99	6.49
4	601398	工商银行	93,231,513.35	6.34
5	601006	大秦铁路	91,109,993.94	6.20
6	601668	中国建筑	90,196,400.00	6.13
7	601288	农业银行	85,957,000.00	5.85
8	002271	东方雨虹	83,653,761.21	5.69
9	600316	洪都航空	81,750,850.13	5.56
10	600141	兴发集团	81,473,901.14	5.54
11	600193	创兴资源	80,965,827.95	5.51
12	600888	新疆众和	80,909,145.37	5.50
13	300029	天龙光电	75,164,944.98	5.11
14	600395	盘江股份	70,502,193.50	4.79
15	000758	中色股份	67,990,449.39	4.62
16	600830	香溢融通	65,936,582.37	4.48
17	600595	中孚实业	61,582,049.92	4.19
18	600251	冠农股份	61,026,685.13	4.15
19	600111	包钢稀土	60,535,043.59	4.12
20	600773	西藏城投	59,541,346.42	4.05
21	000969	安泰科技	59,216,099.65	4.03
22	600188	兖州煤业	57,290,762.38	3.90
23	600068	葛洲坝	57,169,145.59	3.89
24	600019	宝钢股份	56,223,818.36	3.82
25	600030	中信证券	55,988,768.40	3.81
26	000629	攀钢钒钛	55,849,268.51	3.80
27	601808	中海油服	54,232,807.93	3.69
28	601989	中国重工	50,389,333.87	3.43
29	600600	青岛啤酒	48,592,104.06	3.30
30	600559	老白干酒	43,449,420.77	2.95
31	300178	腾邦国际	42,474,521.32	2.89

32	300197	铁汉生态	42,303,947.10	2.88
33	601958	金钼股份	42,222,000.09	2.87
34	000858	五粮液	41,659,185.72	2.83
35	000751	锌业股份	41,381,750.80	2.81
36	000861	海印股份	41,056,143.40	2.79
37	002428	云南锗业	39,289,699.75	2.67
38	600580	卧龙电气	39,107,035.31	2.66
39	601377	兴业证券	38,931,547.39	2.65
40	002225	濮耐股份	38,894,532.42	2.64
41	000050	深天马 A	38,800,936.07	2.64
42	601216	内蒙君正	38,778,069.44	2.64
43	002480	新筑股份	38,743,898.05	2.63
44	600170	上海建工	38,270,727.88	2.60
45	600346	大橡塑	35,557,137.14	2.42
46	000776	广发证券	33,665,963.30	2.29
47	600376	首开股份	33,513,296.83	2.28
48	600533	栖霞建设	33,341,857.44	2.27
49	002204	华锐铸钢	33,090,335.31	2.25
50	000889	渤海物流	32,742,074.76	2.23
51	002230	科大讯飞	32,321,298.79	2.20
52	002060	粤水电	32,242,361.70	2.19
53	300108	双龙股份	32,101,116.50	2.18
54	600326	西藏天路	31,595,830.37	2.15
55	300140	启源装备	30,711,345.80	2.09
56	600309	烟台万华	29,949,716.44	2.04
57	600367	红星发展	29,829,174.25	2.03
58	600362	江西铜业	29,828,689.45	2.03
59	600271	航天信息	29,819,458.62	2.03
60	002149	西部材料	29,649,266.62	2.02
61	600581	八一钢铁	29,616,951.55	2.01
62	600795	国电电力	29,435,000.00	2.00

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。600702 沱牌曲酒股票已在 2011 年 7 月 8 日公告更名为沱牌舍得。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002049	晶源电子	115,776,349.44	7.87
2	600141	兴发集团	106,923,589.52	7.27
3	000807	云铝股份	103,088,605.34	7.01
4	300029	天龙光电	99,574,982.83	6.77
5	601398	工商银行	88,049,264.33	5.99
6	601808	中海油服	86,166,877.06	5.86
7	601006	大秦铁路	84,675,183.86	5.76
8	601668	中国建筑	82,294,908.56	5.60
9	601288	农业银行	81,378,078.98	5.53
10	002271	东方雨虹	69,114,879.29	4.70
11	000050	深天马A	67,233,513.33	4.57
12	000758	中色股份	66,847,214.85	4.55
13	600111	包钢稀土	64,883,105.59	4.41
14	600395	盘江股份	64,398,833.12	4.38
15	600773	西藏城投	62,525,144.30	4.25
16	600251	冠农股份	62,417,333.55	4.24
17	600830	香溢融通	61,271,153.65	4.17
18	600595	中孚实业	58,905,361.15	4.01
19	600019	宝钢股份	57,164,373.34	3.89
20	600188	兖州煤业	56,487,666.84	3.84
21	002277	友阿股份	56,030,861.44	3.81
22	000629	攀钢钒钛	55,951,593.20	3.80
23	600030	中信证券	51,000,855.53	3.47
24	600888	新疆众和	48,651,436.64	3.31
25	600498	烽火通信	48,297,585.75	3.28
26	600496	精工钢构	47,865,721.52	3.26
27	600406	国电南瑞	47,737,242.64	3.25
28	002230	科大讯飞	47,141,839.27	3.21
29	600600	青岛啤酒	47,026,972.75	3.20
30	600581	八一钢铁	46,228,963.60	3.14
31	002480	新筑股份	42,082,433.57	2.86
32	000751	锌业股份	40,330,774.56	2.74
33	601958	金钼股份	40,277,742.35	2.74
34	000861	海印股份	40,209,205.48	2.73
35	600559	老白干酒	39,511,577.79	2.69
36	000858	五粮液	39,228,409.78	2.67

37	002428	云南锗业	38,941,590.29	2.65
38	600702	沱牌舍得	38,884,441.42	2.64
39	002225	濮耐股份	38,234,989.96	2.60
40	601377	兴业证券	37,855,385.95	2.57
41	300178	腾邦国际	37,547,331.57	2.55
42	600511	国药股份	37,504,598.98	2.55
43	600580	卧龙电气	36,100,920.57	2.45
44	601216	内蒙君正	35,559,840.22	2.42
45	600326	西藏天路	34,343,942.17	2.34
46	600170	上海建工	33,612,945.18	2.29
47	000776	广发证券	30,857,572.90	2.10
48	002204	华锐铸钢	30,522,770.86	2.08
49	002041	登海种业	30,495,254.47	2.07
50	600231	凌钢股份	29,871,384.74	2.03
51	002313	日海通讯	29,816,126.18	2.03
52	600309	烟台万华	29,489,056.29	2.01
53	600795	国电电力	29,480,579.90	2.00
54	300018	中元华电	29,423,336.58	2.00

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。600702 沱牌曲酒股票已在 2011 年 7 月 8 日公告更名为沱牌舍得。

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

买入股票成本（成交）总额	5,387,007,026.00
卖出股票收入（成交）总额	5,239,860,120.91

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、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

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	24,462,318.10	2.12
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债	33,901,577.60	2.94
8	其他	-	-
9	合计	58,363,895.70	5.07

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

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	110003	新钢转债	250,000	28,925,000.00	2.51
2	115002	国安债1	150,000	13,701,300.00	1.19
3	126008	08 上汽债	66,920	6,081,689.60	0.53
4	110078	澄星转债	23,680	2,819,577.60	0.24
5	126017	08 葛洲债	27,050	2,353,620.50	0.20

7.7 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。

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 本报告期内，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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,482,759.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	568,207.97
5	应收申购款	88,401.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	6,139,368.24
---	----	--------------

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110003	新钢转债	28,925,000.00	2.51
2	110078	澄星转债	2,819,577.60	0.24

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通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
97,585	18,370.02	15,049,821.61	0.84%	1,777,588,988.57	99.16%

8.2 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	299,141.24	0.0167%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005 年 3 月 2 日) 基金份额总额	601,106,870.74
本报告期期初基金份额总额	1,883,229,090.66
本报告期基金总申购份额	20,195,903.12

减:本报告期基金总赎回份额	110,786,183.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,792,638,810.18

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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

1、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作安排,韩玮先生、季雷先生不再担任华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,增聘张钊先生为华富强化回报债券型证券投资基金的基金经理。

3、本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2011〕115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

4、本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,本基金未有改聘为其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

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
平安证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
广发华福证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	1,539,407,182.03	14.49%	1,251,331.91	14.13%	-
长江证券	1	1,012,528,408.88	9.53%	860,643.33	9.72%	-
国金证券	2	1,004,654,012.44	9.45%	828,389.61	9.36%	-
光大证券	2	987,782,037.14	9.30%	804,915.09	9.09%	-
中山证券	1	862,001,205.12	8.11%	732,696.79	8.28%	-
世纪证券	1	761,026,998.25	7.16%	646,864.85	7.31%	-
新时代证券	1	538,806,424.06	5.07%	457,985.08	5.17%	-
民生证券	1	531,055,920.05	5.00%	451,395.56	5.10%	-
国泰君安	1	432,112,305.11	4.07%	367,295.04	4.15%	-
中信建投证券	1	369,837,335.90	3.48%	300,495.82	3.39%	-
安信证券	2	344,668,669.76	3.24%	280,045.62	3.16%	-
华宝证券	1	319,608,498.21	3.01%	271,664.60	3.07%	-
第一创业证券	1	295,002,424.31	2.78%	250,748.90	2.83%	-
宏源证券	1	283,185,627.89	2.66%	230,089.74	2.60%	-
长城证券	1	260,694,719.25	2.45%	211,816.21	2.39%	-
申银万国	1	254,462,590.99	2.39%	216,291.41	2.44%	-
中投证券	3	193,158,326.91	1.82%	156,942.40	1.77%	-
高华证券	1	177,396,392.97	1.67%	150,786.62	1.70%	-
华泰联合证券	1	141,410,329.78	1.33%	120,199.03	1.36%	-
西南证券	1	123,817,637.42	1.17%	100,603.13	1.14%	-

齐鲁证券	1	122,768,610.88	1.16%	104,353.16	1.18%	-
英大证券	1	71,481,489.56	0.67%	58,079.48	0.66%	-
华安证券	3	-	-	-	-	-

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
平安证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发华福证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	11,065,365.98	20.94%	-	-	-	-
长江证券	12,191,582.30	23.07%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	11,051,031.20	20.91%	-	-	-	-
中山证券	8,336,679.50	15.77%	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	10,207,700.00	19.31%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

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。本报告期本基金新增交易单元的情况分别是：英大证券和西南证券各新增 1 个席位。本报告期本基金注销交易单元的情况是：民族证券注销 1 个席位。

2) 债券交易中企业债及可分离债券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

无