

# 华富成长趋势股票型证券投资基金 2011 年 年度报告

2011 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2012 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 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 2011 年 01 月 01 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	11
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47

8.9 投资组合报告附注 .....	47
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
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 .....	48
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
11.4 基金投资策略的改变 .....	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
11.8 其他重大事件 .....	52
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
13.1 备查文件目录.....	56
13.2 存放地点.....	56
13.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富成长趋势股票型证券投资基金
基金简称	华富成长趋势股票
基金主代码	410003
交易代码	410003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月19日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,016,154,397.20份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	精选符合中国经济增长新趋势、能持续为股东创造价值的公司，采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略，在风险限度内，力争实现基金资产的长期稳定增值
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的。在行业及股票选择方面，本基金“自下而上”地以可持续增值企业为目标进行三次股票筛选来寻找价值被低估的优势企业，结合“自上而下”精选最优行业，动态寻找优势企业与景气行业的最佳结合，构建投资组合，以追求基金资产的中长期稳定增值
业绩比较基准	80%×中信标普 300 指数+20%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	张燕
	联系电话	021-68886996	0755-83199084
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-8001	95555
传真		021-68887997	0755-83195201
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层	深圳深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路	深圳深南大道7088号招商银行

	路 1000 号 31 层	大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	章宏韬	傅育宁

## 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	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
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	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	杭州市西溪路 128 号新湖商务大厦 9 楼
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层

## § 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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-376,648,497.48	219,011,660.08	-44,956,166.79
本期利润	-550,282,140.24	151,316,743.59	754,887,234.85
加权平均基金份额本期利润	-0.2653	0.0637	0.2781
本期加权平均净值利润率	-39.80%	9.14%	43.41%
本期基金份额净值增长率	-33.71%	7.52%	57.22%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-954,066,964.75	-443,479,016.28	-672,457,472.85
期末可供分配基金份额利润	-0.4732	-0.2053	-0.2714
期末基金资产净值	1,062,087,432.45	1,717,191,569.72	1,831,633,213.32
期末基金份额净值	0.5268	0.7947	0.7391
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	-32.67%	1.57%	-5.54%

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 12 月 31 日。

## 3.2 基金净值表现

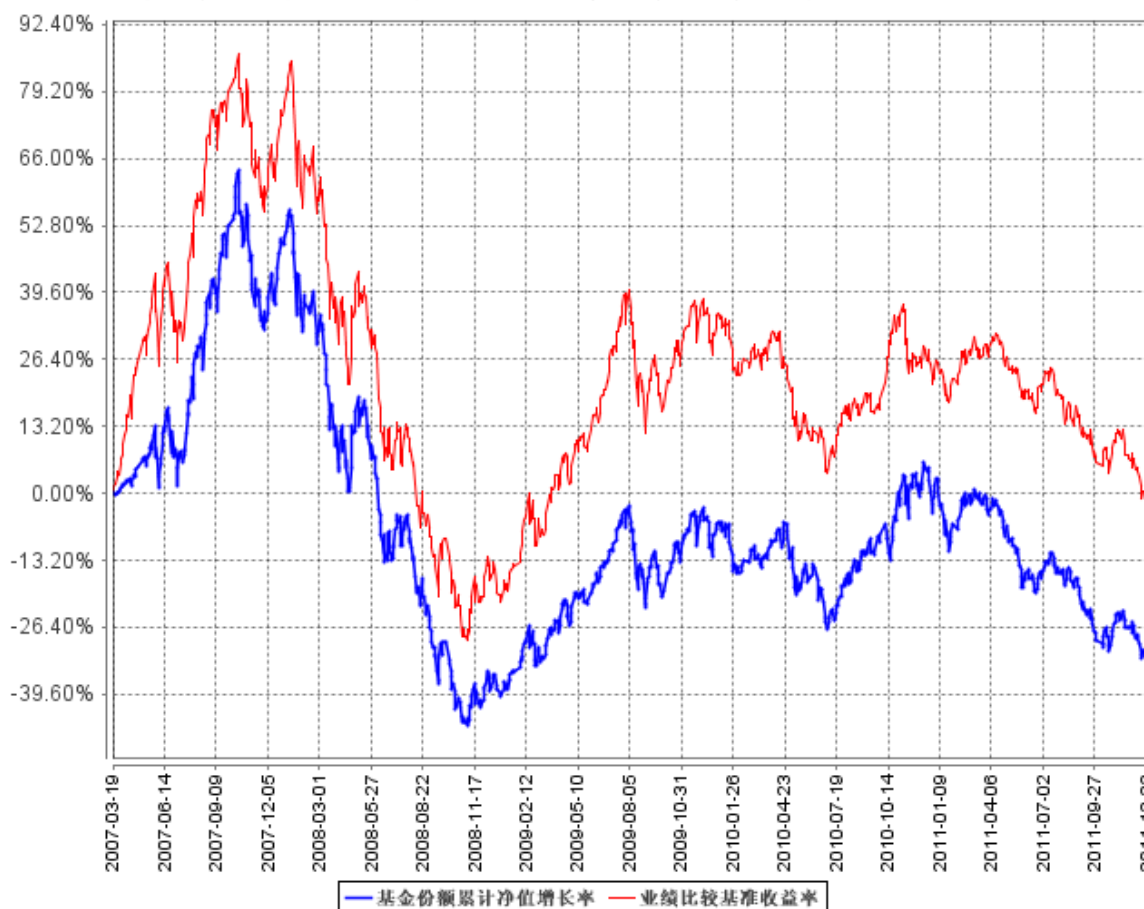
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.12%	1.38%	-6.52%	1.13%	1.40%	0.25%
过去六个月	-20.27%	1.26%	-18.25%	1.09%	-2.02%	0.17%
过去一年	-33.71%	1.26%	-20.26%	1.04%	-13.45%	0.22%
过去三年	12.06%	1.51%	26.04%	1.34%	-13.98%	0.17%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-32.67%	1.77%	-0.71%	1.69%	-31.96%	0.08%

注: 业绩比较基准收益率=80%×中信标普 300 指数+20%×中信标普全债指数, 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

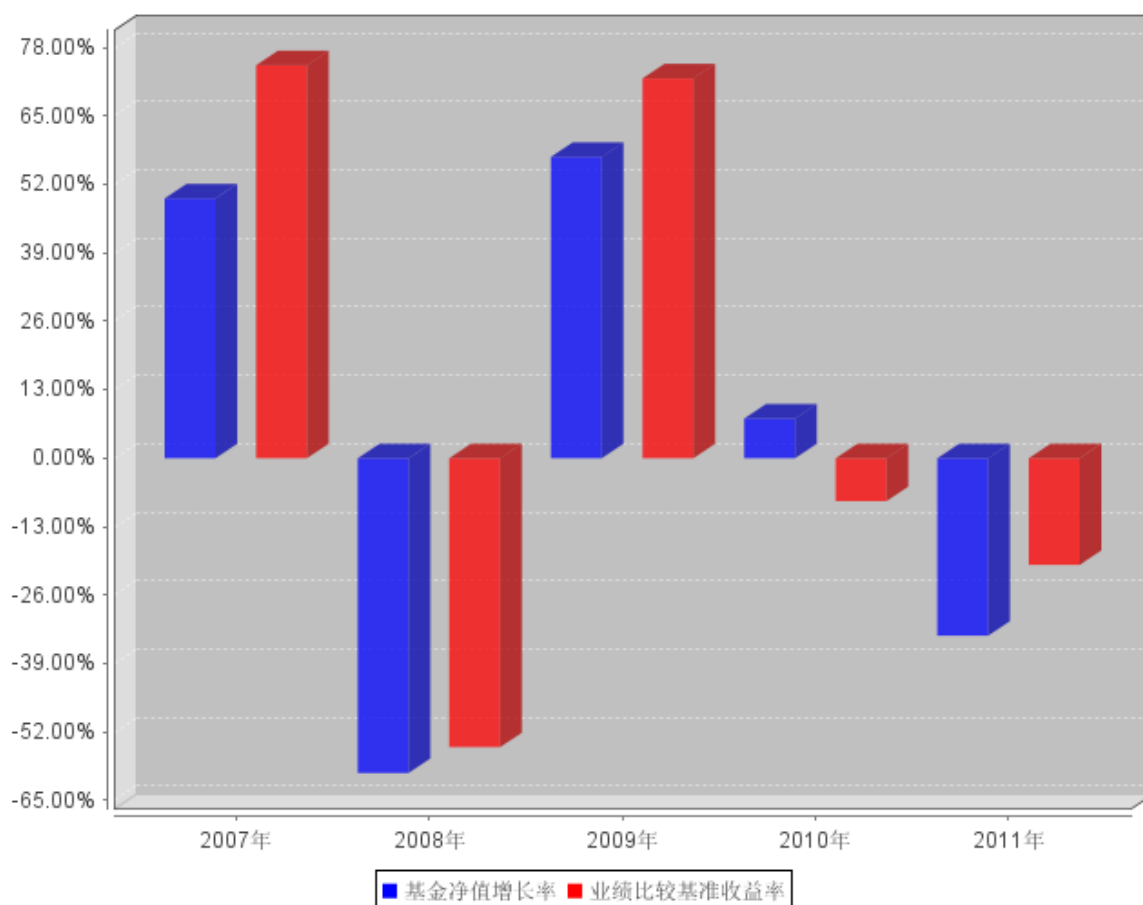


注：根据《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票 60%~95%，债券资产的配置比例为 0-35%，权证的配置比例为 0-3%，现金或者到期日在 1 年以内的政府债券的配置比例不低于基金资产净值的 5%，本基金建仓期为 2007 年 3 月 19 日至 9 月 19 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》的规定。

### 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



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对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，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
2011年	-	-	-	-	
2010年	-	-	-	-	
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。截止2011年12月31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、华富量子生命力股票型证券投资基金和华富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	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		
陈德义	华富成长趋势基金基金经理	2009年9月8日	-	七年	清华大学工商管理硕士、研究生学历。历任中企东方资产管理公司研究员、上海丰润投资顾问公司投资咨询经理、国元证券股份有限公司投资研究中心高级研究员、国联安基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。

注：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

按照华富成长趋势和华富量子生命力的基金合同，华富成长趋势和华富量子生命力都属于股票型基金，2011 年，华富成长趋势和华富量子生命力的净值增长率分别为-33.71%与-25.49%。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 年上证综指下跌 21.7%，A 股经历了 10 年来仅次于 2008 年跌幅的熊市。导致这轮熊市的主要原因是，经济局势困难而复杂，政策上以防通胀为核心目标，采取了紧缩间接融资、鼓励直接融资的措施。A 股市场难以承担股票供给、股东套现的双重压力，在 2-4 月的短暂反弹后，呈现逐波下跌的走势。市场热点散乱而短暂，全年调整幅度最大的板块是估值偏高且成长性不突出的中小板和创业板，其综合指数分别下跌 34.1%和 35.4%。

本基金在 2011 年的投资运作有几次失误。主要是对通胀形势偏于乐观，CPI 从 1 月的 4.9%上行到 6 月份的最高点 6.4%，由此引发的流动性收紧超过我们预期。2011 年共上调存款准备金 6 次，加息 3 次。其次是仓位策略不当，尤其在三季度对“政府出台措施解决中小企业融资难”，以及“推进保障房建设拉动经济增长”抱有过高期望，保持了较高仓位，拉大了和同行的业绩差距。

2011 年我们在低估值的银行、地产板块配置不足，对食品饮料配置比例未超过同行水平；同时在中小市值股票的配置偏多，对市场热点积极捕捉但在如此大环境下胜率并不高。总结经验和教训，我们认为，A 股市场缺乏可以真正穿越周期而且价格合理的股票。A 股市场更类似弱有效市场，市场对经济信息和投资逻辑的反应并非理性而及时，因此趋势投资方法有其特定的适用范围。从中长期趋势看，股票价格走势将向其合理价值回归，在估值充分调整后的价值投资机会更值得重视。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为 0.5268 元，累计份额净值为 0.8168 元；本报告期份额净值增长率为-33.71%，同期业绩比较基准收益率为-20.26%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济指标分析显示，中国经济已经进入周期性的底部。2011 年四个季度的 GDP 增速分别

为 9.7%、9.5%、9.2%和 8.9%，呈现小幅减速的趋势。但是在亮丽数字的背后，下半年尤其是四季度房地产投资和出口开始加速下滑，房地产投资从上半年超过 35%的增速下滑到 12 月的 10.8%；欧债危机继续发酵，12 月中国出口增速 13.4%，为三年来新低。制造业增长放缓，企业库存增加，企业被动去库存导致生产者物价指数 PPI 从 7 月份的 7.5%下跌到 10 月份的 5%，12 月份达到 1.7%。

对于 2012 年的 A 股市场，我们持谨慎乐观的态度。主要的理由是：第一，可以预期，“稳增长”将是 2012 年政策的主线，适度的刺激投资政策可以期待。房地产如果出现价跌量升的情况，产业链相关行业的下滑局面将得到缓解。其次，在增长和通胀均回落之后，流动性适度放松的条件已经成熟，2011 年 12 月 5 日和 2012 年 2 月 24 日，央行下调存款类金融机构人民币存款准备金率各 0.5 个百分点。货币供应增速 2011 年末已经低于央行的增长率目标，若 2012 年定在 14% 的 M2 增速目标则意味着近 12 万亿元的新增货币供给。第三，蓝筹股估值已经足够便宜，银行股目前的滚动市盈率仅 7.4 倍，相对于成熟的 H 股市场亦有折让。市场出现回暖迹象，若能得到基本面的验证，则有助于巩固回升势头。

本基金 2012 年行业配置策略，将保持对低估值的金融、地产、能源、食品饮料行业的核心配置，重视医药、信息等行业成长股超跌之后的投资机会。依据对企业活动的调研情况，捕捉经济可能回升带来的机械、建材、化工等行业的反弹机会。若通胀和增长形势坏于预期，行业选择上对汽车、家电等消费股，以及农业、黄金等通胀受益股给予重视，并保持谨慎的仓位应对。我们预期 2012 年仍无大的趋势性机会，指数波动幅度较大，我们将更重视对个股投资价值的筛选，提高交易的胜率，获取绝对收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011 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，新修订了股票池制度、注册登记业务规则等制度。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、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。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。

3、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。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制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，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

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

根据本报告 3.1 华富成长趋势股票型基金本期利润为-550,282,140.24，期末可供分配利润为-954,066,964.75。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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价

格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审(2012)6-22 号

### 6.2 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	华富成长趋势股票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成长趋势股票型证券投资基金（以下简称“华富成长趋势基金”）财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表，2011 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监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是华富成长趋势基金的基金管理人华富基金管理有限公司管理层的责任。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）作出合理的会计估计。
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，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了华富成长趋势基 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	曹小勤	李勤
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	杭州市西溪路 128 号新湖商务大厦 9 楼	
审计报告日期	2012 年 3 月 20 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华富成长趋势股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	57,965,337.72	69,387,863.06
结算备付金		4,622,520.72	9,586,466.27
存出保证金		4,303,122.00	3,151,154.53
交易性金融资产	7.4.7.2	990,405,745.59	1,652,256,202.30
其中：股票投资		990,405,745.59	1,622,148,202.30
基金投资		-	-
债券投资		-	30,108,000.00
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		13,977,750.22	29,412,256.02
应收利息	7.4.7.5	15,859.32	988,406.63
应收股利		-	-
应收申购款		49,991.67	511,300.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,071,340,327.24	1,765,293,649.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2010 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债:</b>			
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		2,658,565.40	37,556,623.98
应付赎回款		192,193.25	844,279.13
应付管理人报酬		1,404,007.16	2,213,904.06
应付托管费		234,001.21	368,984.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,554,112.04	4,158,238.34
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	3,210,015.73	2,960,050.01
负债合计		9,252,894.79	48,102,079.53
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,016,154,397.20	2,160,670,586.00
未分配利润	7.4.7.10	-954,066,964.75	-443,479,016.28
所有者权益合计		1,062,087,432.45	1,717,191,569.72
负债和所有者权益总计		1,071,340,327.24	1,765,293,649.25

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5268 元，基金份额总额 2,016,154,397.20 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华富成长趋势股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-491,098,824.83	206,101,495.87
1. 利息收入		1,644,303.68	2,228,961.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	564,842.76	1,030,337.98
债券利息收入		1,079,460.92	1,057,474.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	141,148.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-319,154,100.54	271,231,440.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-328,045,228.25	263,341,633.89



基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-157,958.73	413,554.65
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	9,049,086.44	7,476,251.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-173,633,642.76	-67,694,916.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	44,614.79	336,010.57
<b>减：二、费用</b>		59,183,315.41	54,784,752.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	20,799,459.43	24,821,279.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,466,576.66	4,136,879.86
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	34,430,326.53	25,339,474.15
5. 利息支出		1,155.97	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,155.97	-
6. 其他费用	7.4.7.20	485,796.82	487,119.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-550,282,140.24	151,316,743.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-550,282,140.24	151,316,743.59

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富成长趋势股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	2,160,670,586.00	-443,479,016.28	1,717,191,569.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-550,282,140.24	-550,282,140.24
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）	-144,516,188.80	39,694,191.77	-104,821,997.03
其中：1. 基金申购款	91,463,519.36	-28,182,552.10	63,280,967.26

2. 基金赎回款	-235,979,708.16	67,876,743.87	-168,102,964.29
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）	2,016,154,397.20	-954,066,964.75	1,062,087,432.45
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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）	2,478,090,971.36	-646,457,758.04	1,831,633,213.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	151,316,743.59	151,316,743.59
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）	-317,420,385.36	51,661,998.17	-265,758,387.19
其中：1. 基金申购款	364,893,370.85	-110,882,529.65	254,010,841.20
2. 基金赎回款	-682,313,756.21	162,544,527.82	-519,769,228.39
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）	2,160,670,586.00	-443,479,016.28	1,717,191,569.72

报表附注为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：

\_\_\_\_\_  
章宏韬

基金管理公司负责人

\_\_\_\_\_  
姚怀然

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
陈大毅

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华富成长趋势股票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《华富成长趋势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基金字【2007】50号文核准募集设立。本基金自2007年3月12日起公开向社会发行，至2007年3月14日募集结束。经天健华证中洲（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中洲验（2007）JR字第070001

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 6,777,158,977.43 元；募集资金的银行存款利息 564,607.35 元，折成基金份额，归投资人所有；设立募集期共募集 6,777,723,584.78 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，基金托管人为招商银行股份有限公司；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 2007 年 3 月 19 日生效，该日的基金份额为 6,777,723,584.78 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》、《华富成长趋势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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 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 12 月 31 日的财务状况以及 2011 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。

##### 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中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计入当期损益，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计入当期损益。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。

#### 7.4.4.3 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《华富成长趋势股票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《华富成长趋势股票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。基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配。在符合基金分红条件、且每基金份额可分配收益达到 0.02 元的前提下，本基金每季度至少分红一次。每年收益分配次数最多为 12 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 50%。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可以事先选择将可获分配的现金收益按照基金合同的约定转为基金份额进行再投资。

#### 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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	57,965,337.72	69,387,863.06
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	57,965,337.72	69,387,863.06

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,103,764,257.73	990,405,745.59	-113,358,512.14
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	1,103,764,257.73	990,405,745.59	-113,358,512.14
项目	上年度末 2010年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,561,605,111.68	1,622,148,202.30	60,543,090.62
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	30,375,960.00	30,108,000.00
	合计	30,375,960.00	30,108,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,591,981,071.68	1,652,256,202.30	60,275,130.62

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末和上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末和上年度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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	13,397.45	17,645.84
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	2,288.11	3,690.83
应收债券利息	-	966,969.86
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	45.06	-
其他	128.70	100.10
合计	15,859.32	988,406.63

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

本基金本报告期末和上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
----	--------------------	---------------------

交易所市场应付交易费用	1,554,112.04	4,158,013.34
银行间市场应付交易费用	-	225.00
合计	1,554,112.04	4,158,238.34

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	2,750,000.00	2,500,000.00
应付赎回费	15.73	50.01
预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	360,000.00	360,000.00
合计	3,210,015.73	2,960,050.01

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,160,670,586.00	2,160,670,586.00
本期申购	91,463,519.36	91,463,519.36
本期赎回（以“-”号填列）	-235,979,708.16	-235,979,708.16
_年_月_日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,016,154,397.20	2,016,154,397.20

注：申购含红利再投、转换入份额，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	-379,024,649.38	-64,454,366.90	-443,479,016.28
本期利润	-376,648,497.48	-173,633,642.76	-550,282,140.24
本期基金份额交易产生的变动数	32,725,856.84	6,968,334.93	39,694,191.77
其中：基金申购款	-21,662,781.73	-6,519,770.37	-28,182,552.10
基金赎回款	54,388,638.57	13,488,105.30	67,876,743.87
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-722,947,290.02	-231,119,674.73	-954,066,964.75
-----	-----------------	-----------------	-----------------

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
活期存款利息收入	405,777.58	940,241.20
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	153,225.21	85,860.57
其他	5,839.97	4,236.21
合计	564,842.76	1,030,337.98

注：其他所列本期金额包括权证保证金利息收入 4,091.10 元，申购款停留管理公司清算帐户产生的申购款利息收入 1,748.87 元；所列上年度可比期间金额包括权证保证金利息收入 3,321.51 元，申购款停留管理公司清算帐户产生的申购款利息收入 914.70 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	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	11,405,350,407.97	8,457,400,539.48
减：卖出股票成本总额	11,733,395,636.22	8,194,058,905.59
买卖股票差价收入	-328,045,228.25	263,341,633.89

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	230,355,864.70	147,723,364.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	226,941,870.00	145,889,559.01
减：应收利息总额	3,571,953.43	1,420,251.23
债券投资收益	-157,958.73	413,554.65

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末和上年度末无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末和上年度末无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	9,049,086.44	7,476,251.76
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	9,049,086.44	7,476,251.76

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-173,633,642.76	-67,694,916.49
——股票投资	-173,901,602.76	-67,426,956.49
——债券投资	267,960.00	-267,960.00
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-173,633,642.76	-67,694,916.49

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	42,169.01	325,527.53
基金转换费收入	2,445.78	10,483.04
合计	44,614.79	336,010.57

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
交易所市场交易费用	34,428,876.53	25,338,224.15
银行间市场交易费用	1,450.00	1,250.00
合计	34,430,326.53	25,339,474.15

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	360,000.00	360,000.00
银行汇划费用	7,796.82	9,119.22
自营托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	485,796.82	487,119.22

#### 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
招商银行股份有限公司	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

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	1,746,702,574.57	7.71%	803,930,834.51	4.84%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 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12月31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	1,484,693.10	7.89%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	683,343.75	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。

#### 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 2011年1月1日至2011年12 月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
	当期发生的基金应支付	20,799,459.43

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	5,217,346.77	6,225,652.00

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）。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,466,576.66	4,136,879.86

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

本基金本报告期内和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。

#### 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	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2007 年 3 月 19 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	27,842,127.24	-
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	27,842,127.24	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.38%	-

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

本基金本报告期和上年度可比期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。



#### 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	57,965,337.72	405,777.58	69,387,863.06	940,241.20

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 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及上年度可比期间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（2011 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

本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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
600315	上海家化	2011 年 12 月 30 日	重大事项停牌	34.09	2012 年 1 月 4 日	34.75	972,923	33,740,111.12	33,166,945.07	

##### 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的证券，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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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同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

单位：人民币元

本期末 2011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	57,965,337.72	-	-	-	-	-	57,965,337.72
结算备付金	4,622,520.72	-	-	-	-	-	4,622,520.72
存出保证金	260,000.00	-	-	-	-	4,043,122.00	4,303,122.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	990,405,745.59	990,405,745.59
应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,977,750.22	13,977,750.22
应收利息	-	-	-	-	-	15,859.32	15,859.32
应收申购款	49,991.67	-	-	-	-	-	49,991.67

资产总计	62,897,850.11	-	-	-	-	-1,008,442,477.13	1,071,340,327.24
负债							
应付证券清算款						2,658,565.40	2,658,565.40
应付赎回款						192,193.25	192,193.25
应付管理人报酬						1,404,007.16	1,404,007.16
应付托管费						234,001.21	234,001.21
应付交易费用						1,554,112.04	1,554,112.04
其他负债						3,210,015.73	3,210,015.73
负债总计						9,252,894.79	9,252,894.79
利率敏感度缺口	62,897,850.11					999,189,582.34	1,062,087,432.45
上年度末 2010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	69,387,863.06						69,387,863.06
结算备付金	9,586,466.27						9,586,466.27
存出保证金	260,000.00					2,891,154.53	3,151,154.53
交易性金融资产			-30,108,000.00			-1,622,148,202.30	1,652,256,202.30
应收证券清算款						29,412,256.02	29,412,256.02
应收利息						988,406.63	988,406.63
应收申购款	511,300.44						511,300.44
资产总计	79,745,629.77		-30,108,000.00			-1,655,440,019.48	1,765,293,649.25
负债							
应付证券清算款						37,556,623.98	37,556,623.98
应付赎回款						844,279.13	844,279.13
应付管理人报酬						2,213,904.06	2,213,904.06
应付托管费						368,984.01	368,984.01
应付交易费用						4,158,238.34	4,158,238.34
其他负债						2,960,050.01	2,960,050.01
负债总计						48,102,079.53	48,102,079.53
利率敏感度缺口	79,745,629.77		-30,108,000.00			-1,607,337,939.95	1,717,191,569.72

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	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（2011年12月31日）	上年度末（2010年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	-	21,613.77
市场利率上升 25 基点	-	-21,546.05	

#### 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 2011年12月31日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	990,405,745.59	93.25	1,622,148,202.30	94.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	30,108,000.00	1.75
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	990,405,745.59	93.25	1,652,256,202.30	96.22

##### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中信标普 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：人民币元）	
		本期末（2011年12月31日）	上年度末（2010年12月31日）
	中信标普 300 指数上升 5%	46,872,160.35	50,171,799.79
中信标普 300 指数下降 5%	-46,872,160.35	-50,171,799.79	

#### 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 (2011 年 12 月 31 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)
	合计	19,423,399.30	46,281,795.92

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据“财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好 2010 年年报工作的通知 (财会〔2010〕25 号)” (以下简称“通知”) 要求, 本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层: 第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的, 以该报价为依据确定公允价值; 第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价, 或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的, 以该报价为依据做必要调整确定公允价值; 第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的, 以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求, 年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下:

类别	2011 年 12 月 31 日公允价值	2010 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	957,238,800.52	1,608,885,687.46
第二层次	33,166,945.07	43,370,514.84
第三层次	-	-
合计	990,405,745.59	1,652,256,202.30

## § 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	990,405,745.59	92.45
	其中: 股票	990,405,745.59	92.45
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	62,587,858.44	5.84
6	其他各项资产	18,346,723.21	1.71
7	合计	1,071,340,327.24	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	40,063,457.52	3.77
B	采掘业	14,749,002.50	1.39
C	制造业	472,630,404.19	44.50
C0	食品、饮料	148,550,886.85	13.99
C1	纺织、服装、皮毛	44,966,389.80	4.23
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	62,708,642.87	5.90
C5	电子	30,829,701.50	2.90
C6	金属、非金属	44,059,927.91	4.15
C7	机械、设备、仪表	131,873,114.20	12.42
C8	医药、生物制品	9,641,741.06	0.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,031,802.92	0.29
E	建筑业	110,828,625.63	10.43
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	43,936,366.98	4.14
H	批发和零售贸易	29,581,745.06	2.79
I	金融、保险业	216,082,766.43	20.35
J	房地产业	23,667,957.96	2.23
K	社会服务业	29,193,416.40	2.75
L	传播与文化产业	6,640,200.00	0.63
M	综合类	-	-
	合计	990,405,745.59	93.25

## 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	002140	东华科技	3,839,367	88,305,441.00	8.31
2	600016	民生银行	11,749,967	69,207,305.63	6.52
3	601288	农业银行	19,500,000	51,090,000.00	4.81
4	600587	新华医疗	1,580,121	49,457,787.30	4.66
5	601166	兴业银行	3,400,000	42,568,000.00	4.01
6	000858	五粮液	1,070,228	35,103,478.40	3.31
7	600315	上海家化	972,923	33,166,945.07	3.12
8	300198	纳川股份	1,771,085	29,541,697.80	2.78
9	600177	雅戈尔	3,029,650	28,418,117.00	2.68
10	002447	壹桥苗业	922,523	27,897,095.52	2.63
11	601328	交通银行	5,809,843	26,028,096.64	2.45
12	600000	浦发银行	2,749,984	23,347,364.16	2.20
13	300015	爱尔眼科	927,672	23,145,416.40	2.18
14	600809	山西汾酒	355,740	22,461,423.60	2.11
15	600066	宇通客车	869,983	20,583,797.78	1.94
16	002385	大北农	590,937	19,205,452.50	1.81
17	300146	汤臣倍健	245,515	19,125,618.50	1.80
18	300253	卫宁软件	434,921	18,692,904.58	1.76
19	002327	富安娜	350,599	16,548,272.80	1.56
20	600199	金种子酒	1,102,184	16,422,541.60	1.55
21	000895	双汇发展	220,093	15,395,505.35	1.45
22	000596	古井贡酒	168,155	14,457,966.90	1.36
23	002310	东方园林	162,034	14,056,449.50	1.32
24	300212	易华录	472,478	13,947,550.56	1.31
25	600425	青松建化	1,143,980	13,556,163.00	1.28
26	600318	巢东股份	1,140,031	13,121,756.81	1.24
27	002041	登海种业	425,100	12,166,362.00	1.15
28	600637	百视通	800,000	12,040,000.00	1.13
29	600517	置信电气	781,916	11,501,984.36	1.08
30	002244	滨江集团	1,549,924	10,988,961.16	1.03
31	000963	华东医药	380,000	10,115,600.00	0.95
32	600104	上汽集团	700,000	9,898,000.00	0.93
33	600585	海螺水泥	629,946	9,858,654.90	0.93
34	300204	舒泰神	149,926	9,641,741.06	0.91
35	601088	中国神华	370,000	9,372,100.00	0.88
36	600655	豫园商城	1,100,229	9,219,919.02	0.87
37	000157	中联重科	1,109,977	8,535,723.13	0.80



38	600048	保利地产	850,000	8,500,000.00	0.80
39	002049	晶源电子	419,930	7,789,701.50	0.73
40	600089	特变电工	999,965	7,679,731.20	0.72
41	600690	青岛海尔	850,000	7,590,500.00	0.71
42	002457	青龙管业	569,951	7,523,353.20	0.71
43	300020	银江股份	608,415	7,148,876.25	0.67
44	300027	华谊兄弟	420,000	6,640,200.00	0.63
45	002236	大华股份	130,000	6,448,000.00	0.61
46	600519	贵州茅台	33,000	6,378,900.00	0.60
47	000826	桑德环境	240,000	6,048,000.00	0.57
48	002520	日发数码	259,940	6,009,812.80	0.57
49	600739	辽宁成大	443,196	5,446,878.84	0.51
50	002554	惠博普	449,950	5,376,902.50	0.51
51	600875	东方电气	229,978	5,314,791.58	0.50
52	002046	轴研科技	379,999	5,300,986.05	0.50
53	002375	亚厦股份	221,569	4,841,282.65	0.46
54	000705	浙江震元	499,932	4,799,347.20	0.45
55	002389	南洋科技	200,000	4,552,000.00	0.43
56	600823	世茂股份	399,904	4,178,996.80	0.39
57	002308	威创股份	399,907	4,147,035.59	0.39
58	601601	中国太保	200,000	3,842,000.00	0.36
59	002431	棕榈园林	149,936	3,625,452.48	0.34
60	600236	桂冠电力	799,948	3,031,802.92	0.29

注：上海汽车的股票证券简称于 2012 年 1 月 09 日变更为上汽集团。

## 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	600016	民生银行	308,562,802.32	17.97
2	002140	东华科技	264,512,869.27	15.40
3	601166	兴业银行	225,301,873.18	13.12
4	600111	包钢稀土	179,296,888.11	10.44
5	600585	海螺水泥	178,436,012.24	10.39
6	600031	三一重工	170,554,730.59	9.93
7	000568	泸州老窖	150,744,977.45	8.78
8	600587	新华医疗	141,474,158.07	8.24

9	600425	青松建化	140,347,381.38	8.17
10	002006	精功科技	126,136,237.57	7.35
11	000858	五粮液	124,848,741.17	7.27
12	000826	桑德环境	101,102,315.39	5.89
13	000630	铜陵有色	100,642,273.66	5.86
14	600240	华业地产	96,568,887.33	5.62
15	000937	冀中能源	94,610,450.47	5.51
16	600096	云天化	87,521,813.42	5.10
17	601101	昊华能源	83,255,380.49	4.85
18	601288	农业银行	82,191,712.00	4.79
19	002001	新和成	75,992,262.35	4.43
20	600172	黄河旋风	73,834,626.00	4.30
21	600519	贵州茅台	72,427,176.35	4.22
22	002010	传化股份	72,133,109.91	4.20
23	600104	上汽集团	70,685,920.67	4.12
24	002264	新华都	70,275,690.62	4.09
25	000877	天山股份	69,695,694.63	4.06
26	002061	江山化工	68,455,533.84	3.99
27	002236	大华股份	66,516,053.83	3.87
28	601169	北京银行	63,980,885.67	3.73
29	300198	纳川股份	63,371,549.96	3.69
30	600537	亿晶光电	63,283,119.33	3.69
31	600739	辽宁成大	63,196,656.11	3.68
32	000527	美的电器	62,401,000.32	3.63
33	000998	隆平高科	61,189,525.32	3.56
34	601088	中国神华	60,411,710.90	3.52
35	002408	齐翔腾达	59,181,781.28	3.45
36	601857	中国石油	59,065,722.95	3.44
37	601699	潞安环能	58,036,207.66	3.38
38	600150	中国船舶	56,926,200.91	3.32
39	600802	福建水泥	55,946,442.43	3.26
40	600066	宇通客车	54,466,612.68	3.17
41	000816	江淮动力	54,397,262.22	3.17
42	000651	格力电器	53,922,276.93	3.14
43	002304	洋河股份	53,823,680.16	3.13
44	600967	北方创业	53,477,882.44	3.11

45	002167	东方锆业	52,129,724.35	3.04
46	600251	冠农股份	51,662,032.80	3.01
47	601989	中国重工	49,398,427.76	2.88
48	000039	中集集团	49,178,898.65	2.86
49	600089	特变电工	48,199,248.89	2.81
50	000157	中联重科	47,209,850.81	2.75
51	002244	滨江集团	46,677,231.88	2.72
52	000718	苏宁环球	46,309,209.66	2.70
53	002392	北京利尔	45,422,160.44	2.65
54	601678	滨化股份	44,354,148.20	2.58
55	000540	中天城投	44,286,681.23	2.58
56	000680	山推股份	44,229,157.78	2.58
57	601766	中国南车	43,913,940.64	2.56
58	002106	莱宝高科	43,230,132.77	2.52
59	000933	神火股份	43,203,031.20	2.52
60	601328	交通银行	42,951,338.97	2.50
61	600497	驰宏锌锗	42,157,980.48	2.46
62	601808	中海油服	41,667,113.31	2.43
63	600058	五矿发展	41,042,494.50	2.39
64	002142	宁波银行	40,829,915.55	2.38
65	600160	巨化股份	40,583,690.26	2.36
66	002586	围海股份	40,099,571.88	2.34
67	601866	中海集运	39,901,968.86	2.32
68	000024	招商地产	39,432,272.21	2.30
69	000639	西王食品	38,555,900.86	2.25
70	300212	易华录	38,255,371.51	2.23
71	600048	保利地产	38,244,281.77	2.23
72	000558	莱茵置业	37,519,350.93	2.18
73	600729	重庆百货	37,398,072.43	2.18
74	600636	三爱富	37,079,975.86	2.16
75	600062	双鹤药业	36,535,647.17	2.13
76	600348	阳泉煤业	36,459,637.96	2.12
77	600010	包钢股份	36,282,078.14	2.11
78	600406	国电南瑞	36,040,364.87	2.10
79	300146	汤臣倍健	35,246,636.04	2.05
80	601601	中国太保	35,197,933.29	2.05

81	600309	烟台万华	34,893,649.82	2.03
82	000961	中南建设	34,868,552.64	2.03
83	002477	雏鹰农牧	34,856,618.85	2.03
84	600815	厦工股份	34,792,554.29	2.03
85	000538	云南白药	34,774,419.62	2.03
86	300020	银江股份	34,738,116.82	2.02
87	002385	大北农	34,653,462.64	2.02
88	300183	东软载波	34,541,928.83	2.01

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	600016	民生银行	237,674,862.27	13.84
2	002140	东华科技	233,801,409.45	13.62
3	002006	精功科技	222,278,420.49	12.94
4	601166	兴业银行	218,843,610.02	12.74
5	600111	包钢稀土	192,382,350.39	11.20
6	600031	三一重工	184,494,240.30	10.74
7	000568	泸州老窖	165,488,725.26	9.64
8	600585	海螺水泥	163,252,780.43	9.51
9	000826	桑德环境	143,250,173.79	8.34
10	002010	传化股份	131,106,700.34	7.63
11	600425	青松建化	108,359,215.67	6.31
12	600240	华业地产	101,845,528.49	5.93
13	000937	冀中能源	99,051,747.61	5.77
14	000630	铜陵有色	93,941,631.09	5.47
15	600587	新华医疗	88,920,477.74	5.18
16	601101	昊华能源	88,578,819.24	5.16
17	002106	莱宝高科	87,672,832.90	5.11
18	000858	五粮液	86,797,725.52	5.05
19	600096	云天化	83,214,581.93	4.85
20	601989	中国重工	78,913,465.35	4.60
21	002001	新和成	76,097,650.73	4.43
22	601808	中海油服	74,732,865.63	4.35

23	002304	洋河股份	73,005,019.05	4.25
24	000039	中集集团	71,524,747.75	4.17
25	000877	天山股份	71,346,311.40	4.15
26	601169	北京银行	70,574,642.77	4.11
27	600519	贵州茅台	68,971,691.03	4.02
28	002236	大华股份	67,077,011.65	3.91
29	000998	隆平高科	67,021,326.30	3.90
30	002069	獐子岛	66,840,799.36	3.89
31	000527	美的电器	66,045,519.40	3.85
32	600062	双鹤药业	65,220,372.38	3.80
33	002264	新华都	64,751,123.36	3.77
34	600172	黄河旋风	64,532,195.68	3.76
35	002168	深圳惠程	63,001,505.76	3.67
36	002061	江山化工	62,395,262.31	3.63
37	601699	潞安环能	62,213,678.36	3.62
38	601857	中国石油	60,220,450.32	3.51
39	600537	亿晶光电	60,050,188.93	3.50
40	601766	中国南车	59,899,268.34	3.49
41	000012	南玻A	59,332,270.22	3.46
42	600104	上汽集团	58,462,261.44	3.40
43	002408	齐翔腾达	56,660,654.81	3.30
44	002118	紫鑫药业	55,410,895.16	3.23
45	600802	福建水泥	54,152,419.44	3.15
46	600150	中国船舶	53,165,832.20	3.10
47	000651	格力电器	53,057,406.90	3.09
48	600967	北方创业	52,387,927.25	3.05
49	600251	冠农股份	52,220,112.57	3.04
50	000816	江淮动力	51,958,359.41	3.03
51	000540	中天城投	51,500,745.59	3.00
52	600739	辽宁成大	50,407,930.85	2.94
53	000061	农产品	50,379,132.85	2.93
54	000680	山推股份	49,114,051.63	2.86
55	002167	东方锆业	48,761,951.75	2.84
56	600970	中材国际	48,623,877.58	2.83
57	002043	兔宝宝	47,640,847.67	2.77
58	002142	宁波银行	47,526,769.63	2.77
59	601088	中国神华	47,087,860.64	2.74
60	601678	滨化股份	47,054,169.22	2.74

61	600068	葛洲坝	46,686,480.89	2.72
62	000718	苏宁环球	44,826,404.89	2.61
63	002392	北京利尔	43,110,702.66	2.51
64	600160	巨化股份	43,099,772.90	2.51
65	002586	围海股份	43,097,825.62	2.51
66	000538	云南白药	41,834,454.96	2.44
67	600058	五矿发展	40,476,216.74	2.36
68	600497	驰宏锌锗	40,430,681.81	2.35
69	600636	三爱富	40,151,630.62	2.34
70	601866	中海集运	39,470,889.34	2.30
71	000933	神火股份	37,518,527.43	2.18
72	000024	招商地产	37,413,642.79	2.18
73	600089	特变电工	37,355,186.41	2.18
74	000558	莱茵置业	37,309,744.12	2.17
75	600383	金地集团	37,259,039.23	2.17
76	000157	中联重科	37,133,308.94	2.16
77	000009	中国宝安	36,799,022.46	2.14
78	002146	荣盛发展	36,685,879.78	2.14
79	002050	三花股份	36,683,348.50	2.14
80	600406	国电南瑞	36,298,987.03	2.11
81	600547	山东黄金	35,673,538.12	2.08
82	300229	拓尔思	35,654,188.29	2.08
83	600729	重庆百货	34,942,730.60	2.03
84	300183	东软载波	34,827,482.76	2.03
85	600535	天士力	34,745,624.75	2.02
86	000961	中南建设	34,686,576.17	2.02
87	600549	厦门钨业	34,636,160.01	2.02
88	600612	老凤祥	34,485,923.40	2.01

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	11,275,554,782.27
卖出股票收入（成交）总额	11,405,350,407.97

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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** 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，除五粮液被中国证监会行政处罚、纳川股份被中国证监会福建证监局责令改正外，其余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。

五粮液（000858）于 2011 年 5 月 28 日发布“关于收到中国证监会《行政处罚决定书》的公告”，公告称五粮液于 2011 年 5 月 27 日收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2011]17 号），因信息披露存在违法事实，中国证监会对五粮液作出给予警告，并处以 60 万元罚款的行政处罚。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度的规定。

纳川股份（300198）于 2011 年 8 月 19 日发布“关于收到福建证监局行政监管措施决定书”的公告，纳川股份于 2011 年 8 月 17 日收到福建证监局下发的《关于对福建纳川管材科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》（【2011】22 号）（以下简称：“《决定》”），要求纳川股份对于《决定》中指出的纳川股份存在的问题采取切实有效的措施进行改正。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度的规定。

**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	4,303,122.00
2	应收证券清算款	13,977,750.22
3	应收股利	-
4	应收利息	15,859.32
5	应收申购款	49,991.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,346,723.21

### 8.9.4 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。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600315	上海家化	33,166,945.07	3.12	重大事项停牌

### 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
95,109	21,198.36	32,698,577.18	1.62%	1,983,455,820.02	98.38%

### 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	4,215.03	0.0002%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2007 年 3 月 19 日 ) 基金份额总额	6,777,723,584.78
本报告期期初基金份额总额	2,160,670,586.00
本报告期基金总申购份额	91,463,519.36
减:本报告期基金总赎回份额	235,979,708.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,016,154,397.20

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总经理办公会议审议通过，因工作安排，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，因个人原因，韩玮先生不再担任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理的职务。

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。

4、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收益增强债券型证券投资基金的基金经理。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，曾刚先生不再担任华富强化回报债券型证券投资基金基金经理的职务。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，曾刚先生不再担任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理的职务。

7、根据招商银行股份有限公司招银发[2011]331 号文，夏博辉先生不再担任招商银行总行资产托管部总经理职务，已聘任吴晓辉先生担任总行资产托管部负责人。

### 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

经公司董事会审议通过，同意将本基金的审计机构由天健正信会计师事务所变更为天健会计师事务所（特殊普通合伙），本基金本年度支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 10 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 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	
国泰君安	1	2,974,716,923.32	13.13%	2,416,978.78	12.84%	-
华泰联合证券	1	2,255,550,168.09	9.96%	1,832,667.79	9.74%	-
华安证券	1	1,746,702,574.57	7.71%	1,484,693.10	7.89%	-
中国国际金融公司	2	1,732,681,615.04	7.65%	1,407,817.42	7.48%	-
申银万国	1	1,635,928,821.94	7.22%	1,390,530.54	7.39%	-
招商证券	2	1,601,870,707.19	7.07%	1,301,530.43	6.91%	-
东方证券	1	1,564,495,221.92	6.91%	1,329,815.36	7.07%	-
东兴证券	1	1,182,997,388.76	5.22%	1,005,544.45	5.34%	-
海通证券	1	1,010,125,330.09	4.46%	858,606.11	4.56%	-
中银证券	1	1,003,530,630.40	4.43%	815,373.92	4.33%	-
中信证券	1	941,447,185.90	4.16%	800,229.03	4.25%	-
兴业证券	1	710,865,396.01	3.14%	577,582.92	3.07%	-
安信证券	1	629,027,642.23	2.78%	534,670.50	2.84%	-
银河证券	1	618,502,872.24	2.73%	525,727.59	2.79%	-
广发证券	1	503,120,848.20	2.22%	427,651.47	2.27%	-
国都证券	1	501,325,473.26	2.21%	426,123.85	2.26%	-
天风证券	1	345,875,893.16	1.53%	293,993.59	1.56%	-

国信证券	1	306,498,920.82	1.35%	249,032.20	1.32%	-
首创证券	1	284,013,195.80	1.25%	230,762.66	1.23%	-
国联证券	1	274,493,653.26	1.21%	223,027.96	1.18%	-
华创证券	1	274,077,543.87	1.21%	222,689.62	1.18%	-
东海证券	1	200,000,039.01	0.88%	169,999.55	0.90%	-
银泰证券	1	164,880,770.24	0.73%	133,966.72	0.71%	-
日信证券	1	88,504,049.15	0.39%	75,227.59	0.40%	-
方正证券	1	73,633,552.12	0.33%	62,589.09	0.33%	-
中信建投证券	1	29,777,316.85	0.13%	25,310.43	0.13%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

### 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	304,375.38	100.00%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

中银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

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：新增了国联证券、日信证券、渤海证券、华融证券、西南证券和国海证券各一个席位。

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。

### 11.8 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	《华富基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下基金的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年1月13日
2	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加日信证券为为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年1月17日
3	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加日信证券网上交易申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年1月17日
4	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳农村商业银行定期定额申购费率优惠活动公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年1月20日
5	《华富成长趋势股票型证券投资基金 2010 年第 4 季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年1月21日
6	《华富基金管理有限公司关于更换董事长的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年1月26日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加上海农村商业银行作为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年2月23日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海农村商业银行基金代销费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年2月23日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加华宝证券为代	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证	2011年3月3日

	销机构的公告》	券时报》上公告	
10	《华富成长趋势股票型证券投资基金 2010 年年度报告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 3 月 28 日
11	《华富成长趋势股票型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 4 月 22 日
12	《华富成长趋势股票型证券投资基金招募说明书更新（2011 年第 1 号）》及其摘要	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 4 月 29 日
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 5 月 9 日
14	《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	2011 年 5 月 26 日
15	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加厦门证券网上交易申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 6 月 29 日
16	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信银行网上银行、移动银行申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 7 月 4 日
17	《华富成长趋势股票型证券投资基金 2011 年第 2 季度报告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 7 月 20 日
18	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加东吴证券为代	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证	2011 年 8 月 19 日

	销机构的公告》	券时报》上公告	
19	《华富成长趋势股票型证券投资基金 2011 年半年度报告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 8 月 24 日
20	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华宝证券网上申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 8 月 31 日
21	《华富成长趋势股票型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 10 月 24 日
22	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华安证券申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 11 月 7 日
23	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加国海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	2011 年 11 月 24 日
24	《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	2011 年 11 月 26 日
25	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信万通证券开通定期定额投资业务的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 12 月 7 日
26	《关于华富基金管理有限公司旗下开放式基金变更代销机构的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 12 月 26 日
27	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华夏银行基金定投和网上银行基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 12 月 30 日

28	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续参加深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 12 月 30 日
29	《华富基金管理有限公司关于在中国银行开立直销账户银行账户变更的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 12 月 31 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、《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富成长趋势股票型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富成长趋势股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富成长趋势股票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。