

# 华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 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：深圳发展银行股份有限公司

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。

基金托管人深圳发展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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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>37</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48

8.9 投资组合报告附注 .....	48
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
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 .....	49
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
11.4 基金投资策略的改变 .....	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
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	283, 419, 298. 48 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	董雁
	联系电话	021-68886996	0755-22166596
	电子邮箱	manzh@hffund.com	dongyan@sdb.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95501
传真		021-68887997	0755-82080406
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	广东省深圳市深南东路 5047 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	广东省深圳市深南东路 5047 号

邮政编码	200120	518001
法定代表人	章宏韬	肖遂宁

## 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	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 7 月 15 日 -2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-44,977,494.33	-32,323,151.19	-25,201,247.09
本期利润	-62,853,401.07	-29,770,591.70	-15,457,479.53
加权平均基金份额本期利润	-0.2143	-0.0769	-0.0267
本期加权平均净值利润率	-25.95%	-8.76%	-2.81%
本期基金份额净值增长率	-23.86%	-7.33%	-1.04%
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	-85,504,078.46	-38,432,498.63	-16,987,968.65
期末可供分配基金份额利润	-0.3017	-0.1255	-0.0389
期末基金资产净值	197,915,220.02	280,874,186.55	432,118,554.13
期末基金份额净值	0.6983	0.9171	0.9896
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	-30.17%	-8.29%	-1.04%

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。

4) 本基金合同于 2009 年 7 月 15 日生效, 当年度可比报告期间为 2009 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日。

### 3.2 基金净值表现

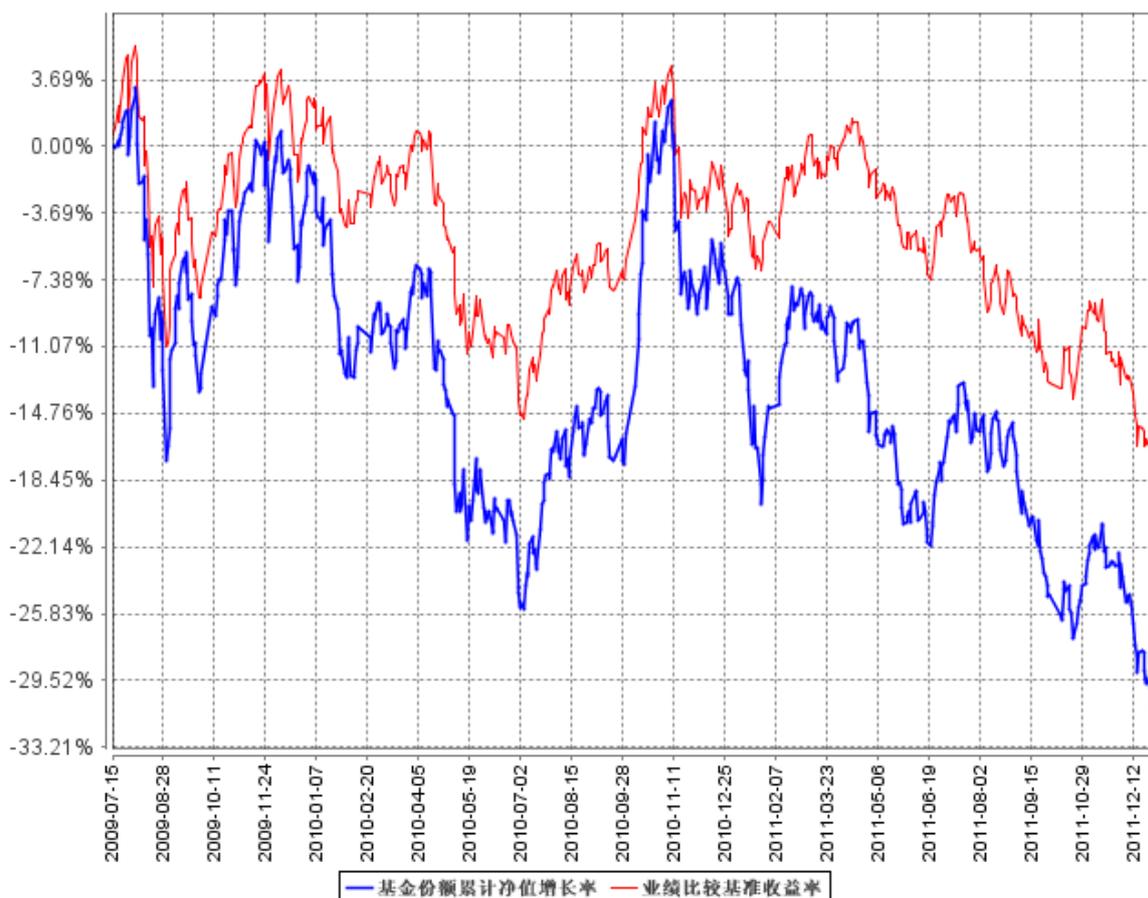
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-7.19%	1.04%	-3.77%	0.84%	-3.42%	0.20%
过去六个月	-15.14%	1.02%	-12.70%	0.81%	-2.44%	0.21%
过去一年	-23.86%	1.08%	-13.48%	0.78%	-10.38%	0.30%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-30.17%	1.33%	-16.30%	0.97%	-13.87%	0.36%

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

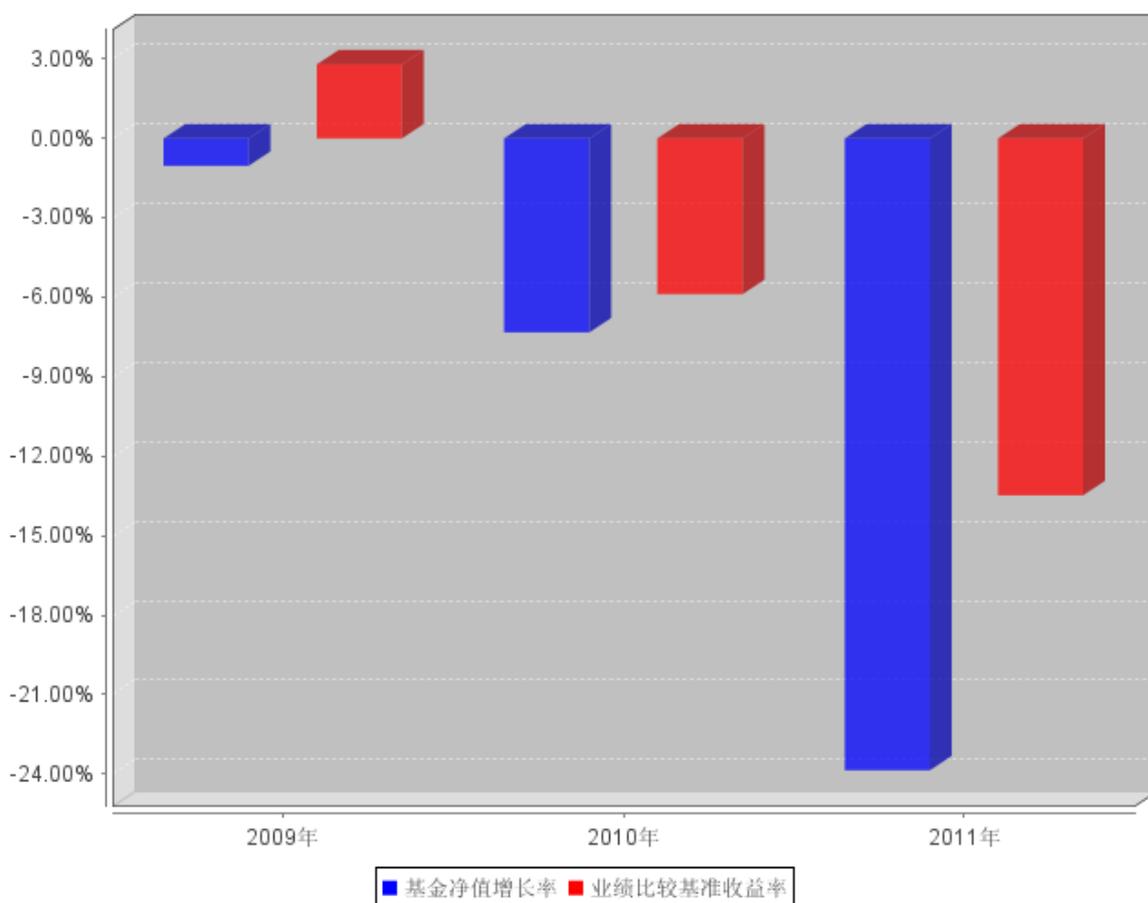
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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%。本基金建仓期为 2009 年 7 月 15 日到 2010 年 1 月 15 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《华富价值增长灵活配置混合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		
郭锋	华富价值增长基金基金经理	2010 年 12 月 27 日	-	四年	复旦大学经济学学士，历任雷曼兄弟亚洲投资有限公司行业分析师、华富基金管理有限公司行业研究员，2010 年 6 月起任华富基金管理有限公司华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理助理。
韩玮	华富价值增长基金基金经理、华富中证 100 指数基金基金经理、公司投资部总监	2009 年 8 月 4 日	2011 年 1 月 24 日	十一年	清华大学工商管理硕士、研究生学历。历任五洋期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。
季雷	华富价值增长基金基金经理、华富策	2009 年 7 月 15 日	2011 年 1 月 25 日	十一年	工商管理硕士、本科学历。先后担任东北证券高级研究员；东方基金研究部

	略精选基金基金经理			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。
--	-----------	--	--	--

注：郭锋和韩玮的任职日期指公司作出决定之日，季雷的任职日期为该基金成立之日，韩玮和季雷的离任日期为中国证券业协会作出注销决定之日，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

按照华富价值增长、华富竞争力和华富策略精选的基金合同，华富价值增长、华富竞争力和华富策略精选都属于混合型基金，2011 年，华富价值增长、华富竞争力和华富策略精选的净值增长率分别为-23.86%、-36.39%与-32.84%。三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 年是流动性全面紧缩的一年，年初有些行业景气的投资机会，随着宏观调控的逐渐深入，

全年前高后低，整体是防御格局。年末随着宏观经济去库存的压力，经济减速。全年中小板在流动性收缩下估值整体下移，很多公司业绩不达预期，在戴维斯双杀下股票有较大的调整。期间国际欧债危机的升级，加大了市场的担忧。四季度，外汇占款的逆转，国内房地产销量萎缩，发电量的低迷等各种负面因素导致市场恐慌。价值增长对股票的杀跌还是判断不够充分，虽然所成长个股业绩增长基本符合预期，但整体防御配置不多。

#### 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 0.6983 元，累计份额净值为 0.6983 元；本报告期份额净值增长率为-23.86%，同期业绩比较基准收益率为-13.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济缓慢复苏，欧洲经济除德国外整体继续疲软。中国 2012 年流动性预计比 2011 年好，估值经过 2011 年的下跌有修复的空间，不确定性来自于政策和实体经济复苏的步伐。房地产政策虽然不会全面放开，但局部可能有微调。出口可能继续不温不火。利率市场双轨制，要密切关注市场实际利率的波动。通胀压力全面缓解，但也要谨防反复。同时价值增长也会关注伊朗危机等短期的冲击。从投资策略上讲，价值增长重点关注经济转型，力求操作更为稳健，保持核心的成长股仓位，波动操作周期类的机会。

#### 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会计师事务所（特殊普通合伙）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，华富价值增长灵活配置混合型基金本期利润为-62,853,401.07，期末可供分配利润为-85,504,078.46。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”）在对华富价值增长基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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《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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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)6-27 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	华富价值增长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 <b>错误！未找到引用源。</b> （以下简称“华富价值增长基金”）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价值增长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价值增长基金 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。	
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：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

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	57,592,143.58	18,488,535.28
结算备付金		1,264,518.57	228,064.09
存出保证金		1,989,332.20	1,250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	160,318,622.95	176,788,409.51
其中：股票投资		154,643,822.95	172,757,409.51
基金投资		-	-
债券投资		5,674,800.00	4,031,000.00
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	10,000,000.00	-
应收证券清算款		-	121,905,762.61
应收利息	7.4.7.5	39,399.21	9,073.69
应收股利		-	-
应收申购款		16,854.11	74,190.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		231,220,870.62	318,744,036.15
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2011 年 12 月 31 日	2010 年 12 月 31 日
<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		31,475,277.49	35,978,624.33
应付赎回款		64,393.24	310,703.84
应付管理人报酬		262,644.30	363,448.16
应付托管费		43,774.06	60,574.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	451,949.25	397,975.53
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	1,007,612.26	758,523.05
负债合计		33,305,650.60	37,869,849.60
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	283,419,298.48	306,248,011.35
未分配利润	7.4.7.10	-85,504,078.46	-25,373,824.80
所有者权益合计		197,915,220.02	280,874,186.55
负债和所有者权益总计		231,220,870.62	318,744,036.15

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6983 元，基金份额总额 283,419,298.48 份。

## 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：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	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
<b>一、收入</b>		-50,437,128.73	-21,452,582.61
1. 利息收入		747,510.17	575,930.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	371,953.72	340,071.75
债券利息收入		24,087.93	235,858.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		351,468.52	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-33,338,394.45	-24,717,571.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-31,549,244.59	-31,490,439.42

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,542,374.30	4,481,487.87
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	753,224.44	2,291,380.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-17,875,906.74	2,552,559.49
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	29,662.29	136,499.13
<b>减：二、费用</b>		12,416,272.34	8,318,009.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,638,322.98	5,103,353.36
2. 托管费	7.4.10.2.2	606,387.17	850,558.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,693,562.19	1,886,096.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	478,000.00	478,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-62,853,401.07	-29,770,591.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-62,853,401.07	-29,770,591.70

### 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：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）	306,248,011.35	-25,373,824.80	280,874,186.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-62,853,401.07	-62,853,401.07
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）	-22,828,712.87	2,723,147.41	-20,105,565.46
其中：1. 基金申购款	25,002,837.05	-5,139,425.83	19,863,411.22
2. 基金赎回款	-47,831,549.92	7,862,573.24	-39,968,976.68

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）	283,419,298.48	-85,504,078.46	197,915,220.02
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2010年1月1日至2010年12月31日</b>		
<b>项目</b>	<b>实收基金</b>	<b>未分配利润</b>	<b>所有者权益合计</b>
一、期初所有者权益（基金净值）	436,655,352.97	-4,536,798.84	432,118,554.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-29,770,591.70	-29,770,591.70
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）	-130,407,341.62	8,933,565.74	-121,473,775.88
其中：1. 基金申购款	45,853,191.71	-1,544,573.19	44,308,618.52
2. 基金赎回款	-176,260,533.33	10,478,138.93	-165,782,394.40
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）	306,248,011.35	-25,373,824.80	280,874,186.55

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：

<u>章宏韬</u>	<u>姚怀然</u>	<u>陈大毅</u>
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）验资并出具天健光华证验（2009）专字第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 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。

##### 7.4.4.4.3 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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	57,592,143.58	18,488,535.28
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	57,592,143.58	18,488,535.28

##### 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	160,238,516.20	154,643,822.95	-5,594,693.25	
债券	交易所市场	5,659,686.44	5,674,800.00	15,113.56
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,659,686.44	5,674,800.00	15,113.56
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	165,898,202.64	160,318,622.95	-5,579,579.69
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	160,456,648.79	172,757,409.51	12,300,760.72
债券	交易所市场	4,035,433.67	4,031,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	4,035,433.67	4,031,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	164,492,082.46	176,788,409.51	12,296,327.05

#### 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

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	10,000,000.00	-
合计	10,000,000.00	-
项目	上年度末 2010年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末和上年度末无期末买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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	10,825.07	4,129.57
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	625.90	87.89

应收债券利息	22,408.77	4,471.23
应收买入返售证券利息	4,861.12	-
应收申购款利息	18.35	-
其他	660.00	385.00
合计	39,399.21	9,073.69

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	上年度末
	2011年12月31日	2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	451,949.25	397,975.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	451,949.25	397,975.53

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2011年12月31日	2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	250,000.00
应付赎回费	62.98	973.77
应付债券税金	47,549.28	47,549.28
应付审计费	100,000.00	100,000.00
应付信息披露费	360,000.00	360,000.00
合计	1,007,612.26	758,523.05

#### 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	306,248,011.35	306,248,011.35
本期申购	25,002,837.05	25,002,837.05
本期赎回(以“-”号填列)	-47,831,549.92	-47,831,549.92
本期末	283,419,298.48	283,419,298.48

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	-38,432,498.63	13,058,673.83	-25,373,824.80
本期利润	-44,977,494.33	-17,875,906.74	-62,853,401.07
本期基金份额交易产生的变动数	3,345,239.57	-622,092.16	2,723,147.41
其中：基金申购款	-5,013,916.41	-125,509.42	-5,139,425.83
基金赎回款	8,359,155.98	-496,582.74	7,862,573.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-80,064,753.39	-5,439,325.07	-85,504,078.46

#### 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	317,447.17	323,365.76
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	37,408.17	4,608.96
其他	17,098.38	12,097.03
合计	371,953.72	340,071.75

注：其他所列本期金额包括权证保证金利息收入 16,965.00 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 133.38 元；所列上年度可比期间金额包括权证保证金利息收入 11,237.46 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 859.57 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	2,524,596,085.82	672,174,301.86
减：卖出股票成本总额	2,556,145,330.41	703,664,741.28
买卖股票差价收入	-31,549,244.59	-31,490,439.42

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券(债转股及债券到 期兑付)成交总额	280,267,209.43	71,905,204.06
减:卖出债券(债转股及债 券到期兑付)成本总额	282,253,578.91	67,096,453.57
减:应收利息总额	556,004.82	327,262.62
债券投资收益	-2,542,374.30	4,481,487.87

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期和上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期和上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 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	753,224.44	2,291,380.26
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	753,224.44	2,291,380.26

#### 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	-17,875,906.74	2,552,559.49
——股票投资	-17,895,453.97	3,370,144.66
——债券投资	19,547.23	-817,585.17
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-17,875,906.74	2,552,559.49

#### 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	15,200.17	124,424.53
转换费收入	14,462.12	12,074.60
合计	29,662.29	136,499.13

#### 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	7,693,562.19	1,886,096.90
银行间市场交易费用	-	-
合计	7,693,562.19	1,886,096.90

#### 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
债券帐户维护费	-	-
自营托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	478,000.00	478,000.00

#### 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

本报告期内和上年度可比期间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	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管理费	3,638,322.98	5,103,353.36
其中：支付销售机构的客户维护费	724,337.43	935,158.32

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	606,387.17	850,558.83

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（2009 年 7 月 15 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	50,000,388.89	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	50,000,388.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.64%	16.33%

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

本报告期末和上年度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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
深圳发展银行股份有限公司	57,592,143.58	317,447.17	18,488,535.28	323,365.76

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和上年度可比期间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

本基金本报告期末未持有的流通受限证券。

## 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	5,674,800.00	-
AAA 以下	-	4,031,000.00
未评级	-	-
合计	5,674,800.00	4,031,000.00

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。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	57,592,143.58	-	-	-	-	-	57,592,143.58
结算备付金	1,264,518.57	-	-	-	-	-	1,264,518.57
存出保证金	1,333,333.36	-	-	-	-	655,998.84	1,989,332.20
交易性金融资产	-	-	5,674,800.00	-	-	154,643,822.95	160,318,622.95
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	-	-	10,000,000.00

应收利息						39,399.21	39,399.21
应收申购款	16,854.11						16,854.11
资产总计	70,206,849.62		5,674,800.00			155,339,221.00	231,220,870.62
负债							
应付证券清算款						31,475,277.49	31,475,277.49
应付赎回款						64,393.24	64,393.24
应付管理人报酬						262,644.30	262,644.30
应付托管费						43,774.06	43,774.06
应付交易费用						451,949.25	451,949.25
应交税费							
其他负债						1,007,612.26	1,007,612.26
负债总计						33,305,650.60	33,305,650.60
利率敏感度缺口	70,206,849.62		5,674,800.00			122,033,570.40	197,915,220.02
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	18,488,535.28						18,488,535.28
结算备付金	228,064.09						228,064.09
存出保证金	1,000,000.00					250,000.00	1,250,000.00
交易性金融资产		4,031,000.00				172,757,409.51	176,788,409.51
应收证券清算款						121,905,762.61	121,905,762.61
应收利息						9,073.69	9,073.69
应收申购款	74,190.97						74,190.97
其他资产							
资产总计	19,790,790.34	4,031,000.00				294,922,245.81	318,744,036.15
负债							
应付证券清算款						35,978,624.33	35,978,624.33
应付赎回款						310,703.84	310,703.84
应付管理人报酬						363,448.16	363,448.16
应付托管费						60,574.69	60,574.69
应付交易费用						397,975.53	397,975.53
应交税费							
其他负债						758,523.05	758,523.05
负债总计						37,869,849.60	37,869,849.60
利率敏感度缺口	19,790,790.34	4,031,000.00				257,052,396.21	280,874,186.55

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）

			日 )
	市场利率下降 25 基点	-	-
	市场利率上升 25 基点	-	-

#### 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	154,643,822.95	78.14	172,757,409.51	61.51
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	5,674,800.00	2.87	4,031,000.00	1.44
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	160,318,622.95	81.00	176,788,409.51	62.94

##### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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：人民币元)	
		本期末 (2011 年 12 月 31 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	7,049,041.25	8,174,719.02
	沪深 300 指数下降 5%	-7,049,041.25	-8,174,719.02

##### 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	3,289,678.27	4,850,264.14
--	----	--------------	--------------

#### 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	160,318,622.95	176,788,409.51
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	160,318,622.95	176,788,409.51

## § 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	154,643,822.95	66.88
	其中：股票	154,643,822.95	66.88
2	固定收益投资	5,674,800.00	2.45
	其中：债券	5,674,800.00	2.45
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	10,000,000.00	4.32
	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	58,856,662.15	25.45
6	其他各项资产	2,045,585.52	0.88
7	合计	231,220,870.62	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	9,340,964.31	4.72
C	制造业	83,179,181.83	42.03
C0	食品、饮料	4,585,567.50	2.32
C1	纺织、服装、皮毛	4,205,800.00	2.13
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,333,893.74	4.21
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	32,541,864.07	16.44
C8	医药、生物制品	31,892,056.52	16.11
C99	其他制造业	1,620,000.00	0.82
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	805,000.00	0.41
F	交通运输、仓储业	2,014,200.00	1.02
G	信息技术业	15,576,647.40	7.87
H	批发和零售贸易	3,789,647.50	1.91
I	金融、保险业	12,040,081.81	6.08
J	房地产业	22,484,500.10	11.36
K	社会服务业	3,324,300.00	1.68
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,089,300.00	1.06
	合计	154,643,822.95	78.14

## 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	600256	广汇股份	678,845	13,970,630.10	7.06
2	600406	国电南瑞	349,952	10,918,502.40	5.52
3	000581	威孚高科	300,241	10,775,649.49	5.44
4	600062	双鹤药业	639,738	9,979,912.80	5.04
5	002603	以岭药业	210,900	8,096,451.00	4.09
6	600036	招商银行	600,000	7,122,000.00	3.60

7	600104	上海汽车	450,000	6,363,000.00	3.22
8	600535	天士力	142,700	5,984,838.00	3.02
9	300218	安利股份	346,399	5,975,382.75	3.02
10	002266	浙富股份	300,874	5,096,805.56	2.58
11	600276	恒瑞医药	150,063	4,417,854.72	2.23
12	600188	兖州煤业	188,529	4,221,164.31	2.13
13	002036	宜科科技	340,000	4,205,800.00	2.13
14	002230	科大讯飞	119,897	4,196,395.00	2.12
15	600048	保利地产	349,997	3,499,970.00	1.77
16	002556	辉隆股份	192,437	3,367,647.50	1.70
17	300187	永清环保	70,000	3,324,300.00	1.68
18	000799	酒鬼酒	124,920	2,936,869.20	1.48
19	002283	天润曲轴	269,562	2,887,009.02	1.46
20	000651	格力电器	160,000	2,766,400.00	1.40
21	600383	金地集团	530,000	2,623,500.00	1.33
22	601166	兴业银行	200,000	2,504,000.00	1.27
23	000527	美的电器	200,000	2,448,000.00	1.24
24	000002	万科A	320,000	2,390,400.00	1.21
25	000338	潍柴动力	70,000	2,205,000.00	1.11
26	601398	工商银行	500,000	2,120,000.00	1.07
27	000937	冀中能源	125,000	2,107,500.00	1.06
28	600805	悦达投资	170,000	2,089,300.00	1.06
29	002004	华邦制药	60,000	2,040,000.00	1.03
30	601006	大秦铁路	270,000	2,014,200.00	1.02
31	600667	太极实业	299,995	1,646,972.55	0.83
32	002094	青岛金王	180,000	1,620,000.00	0.82
33	600583	海油工程	270,000	1,485,000.00	0.75
34	000513	丽珠集团	50,000	1,023,000.00	0.52
35	601808	中海油服	70,000	1,014,300.00	0.51
36	002140	东华科技	35,000	805,000.00	0.41
37	600519	贵州茅台	4,120	796,396.00	0.40
38	002170	芭田股份	83,971	641,538.44	0.32
39	300157	恒泰艾普	20,000	513,000.00	0.26
40	300170	汉得信息	25,000	461,750.00	0.23
41	002024	苏宁电器	50,000	422,000.00	0.21
42	600887	伊利股份	20,000	408,600.00	0.21
43	000661	长春高新	10,000	350,000.00	0.18
44	600016	民生银行	49,929	294,081.81	0.15
45	600702	沱牌舍得	17,210	286,202.30	0.14

46	600059	古越龙山	15,000	157,500.00	0.08
47	300132	青松股份	5,000	70,000.00	0.04

## 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	600256	广汇股份	85,737,689.55	30.53
2	600406	国电南瑞	44,776,170.11	15.94
3	000581	威孚高科	41,599,190.29	14.81
4	002283	天润曲轴	39,860,692.11	14.19
5	000937	冀中能源	36,387,080.38	12.95
6	600111	包钢稀土	35,832,680.08	12.76
7	600036	招商银行	35,595,905.30	12.67
8	600252	中恒集团	34,149,102.68	12.16
9	002036	宜科科技	32,889,457.96	11.71
10	002094	青岛金王	32,429,540.89	11.55
11	600226	升华拜克	32,042,339.62	11.41
12	600031	三一重工	30,691,547.13	10.93
13	600030	中信证券	30,274,277.00	10.78
14	600535	天士力	28,376,156.39	10.10
15	002118	紫鑫药业	28,235,772.17	10.05
16	300029	天龙光电	26,422,654.57	9.41
17	600125	铁龙物流	26,278,087.06	9.36
18	600292	九龙电力	25,821,611.07	9.19
19	002303	美盈森	25,343,073.86	9.02
20	600193	创兴资源	24,848,521.58	8.85
21	002049	晶源电子	24,780,057.56	8.82
22	000024	招商地产	24,534,598.12	8.74
23	300218	安利股份	24,105,210.82	8.58
24	000568	泸州老窖	23,316,965.10	8.30
25	600188	兖州煤业	22,900,311.59	8.15
26	600392	太工天成	22,216,126.95	7.91
27	600585	海螺水泥	21,805,256.62	7.76

28	002271	东方雨虹	21,349,509.45	7.60
29	600218	全柴动力	21,188,353.34	7.54
30	002179	中航光电	21,092,214.85	7.51
31	000998	隆平高科	20,977,049.11	7.47
32	000566	海南海药	20,813,984.89	7.41
33	600251	冠农股份	20,178,239.00	7.18
34	000858	五粮液	20,068,977.82	7.15
35	600141	兴发集团	20,026,613.67	7.13
36	300055	万邦达	19,449,544.18	6.92
37	601699	潞安环能	19,312,445.00	6.88
38	600309	烟台万华	19,149,438.90	6.82
39	000426	兴业矿业	18,936,118.68	6.74
40	601808	中海油服	18,856,391.91	6.71
41	000630	铜陵有色	18,788,356.77	6.69
42	600519	贵州茅台	18,050,372.97	6.43
43	600000	浦发银行	17,987,548.34	6.40
44	000758	中色股份	17,793,887.91	6.34
45	600547	山东黄金	16,814,877.39	5.99
46	002009	天奇股份	16,648,704.33	5.93
47	600240	华业地产	16,446,798.71	5.86
48	002155	辰州矿业	16,421,048.09	5.85
49	000527	美的电器	16,255,069.24	5.79
50	000551	创元科技	15,745,786.43	5.61
51	601166	兴业银行	15,577,748.40	5.55
52	002230	科大讯飞	15,474,041.09	5.51
53	600869	三普药业	15,421,665.79	5.49
54	600029	南方航空	15,197,664.80	5.41
55	000063	中兴通讯	15,186,486.55	5.41
56	600104	上海汽车	14,886,539.54	5.30
57	000969	安泰科技	14,317,352.00	5.10
58	600048	保利地产	13,893,888.41	4.95
59	002603	以岭药业	13,771,999.95	4.90
60	002092	中泰化学	13,439,763.29	4.78
61	000651	格力电器	13,413,995.90	4.78
62	000761	本钢板材	13,271,706.74	4.73
63	000776	广发证券	13,202,263.54	4.70

64	600580	卧龙电气	12,844,435.87	4.57
65	600458	时代新材	12,836,074.56	4.57
66	600581	八一钢铁	12,728,349.15	4.53
67	600339	天利高新	12,616,613.71	4.49
68	600844	丹化科技	12,375,763.59	4.41
69	600362	江西铜业	11,974,247.50	4.26
70	002004	华邦制药	11,959,928.46	4.26
71	600085	同仁堂	11,958,117.20	4.26
72	002168	深圳惠程	11,770,500.23	4.19
73	600426	华鲁恒升	11,390,353.60	4.06
74	600186	莲花味精	11,350,880.09	4.04
75	600395	盘江股份	11,344,858.56	4.04
76	600019	宝钢股份	11,086,555.97	3.95
77	600163	福建南纸	10,699,500.35	3.81
78	600271	航天信息	10,615,483.07	3.78
79	600636	三爱富	10,600,292.50	3.77
80	600078	澄星股份	10,316,905.90	3.67
81	601989	中国重工	10,211,411.80	3.64
82	002266	浙富股份	9,971,453.83	3.55
83	600150	中国船舶	9,954,157.44	3.54
84	000792	盐湖股份	9,941,773.42	3.54
85	600702	沱牌舍得	9,890,058.72	3.52
86	002170	芭田股份	9,749,354.34	3.47
87	600062	双鹤药业	9,636,086.43	3.43
88	002001	新和成	9,589,894.19	3.41
89	002235	安妮股份	9,146,096.13	3.26
90	000401	冀东水泥	8,686,426.98	3.09
91	601677	明泰铝业	8,676,631.08	3.09
92	600383	金地集团	8,487,051.80	3.02
93	000422	湖北宜化	8,368,180.44	2.98
94	601601	中国太保	8,296,549.00	2.95
95	600016	民生银行	8,173,203.07	2.91
96	002091	江苏国泰	8,153,253.72	2.90
97	002011	盾安环境	8,064,761.80	2.87
98	600387	海越股份	8,050,233.16	2.87
99	600056	中国医药	8,007,065.30	2.85

100	000002	万 科A	7,983,067.37	2.84
101	600276	恒瑞医药	7,958,884.53	2.83
102	600887	伊利股份	7,892,786.95	2.81
103	600600	青岛啤酒	7,884,250.10	2.81
104	002129	中环股份	7,722,947.00	2.75
105	600802	福建水泥	7,665,349.03	2.73
106	002556	辉隆股份	7,448,763.63	2.65
107	600420	现代制药	7,368,444.16	2.62
108	002140	东华科技	7,256,890.85	2.58
109	000816	江淮动力	7,129,392.42	2.54
110	600685	广船国际	7,121,381.50	2.54
111	600511	国药股份	7,072,791.50	2.52
112	600631	百联股份	7,034,587.07	2.50
113	600316	洪都航空	6,942,206.00	2.47
114	000157	中联重科	6,883,909.62	2.45
115	601088	中国神华	6,847,557.28	2.44
116	600976	武汉健民	6,783,566.49	2.42
117	002304	洋河股份	6,679,106.38	2.38
118	600348	阳泉煤业	6,666,164.00	2.37
119	000826	桑德环境	6,634,210.79	2.36
120	600101	明星电力	6,619,127.26	2.36
121	000301	东方市场	6,598,781.21	2.35
122	600875	东方电气	6,590,469.46	2.35
123	002062	宏润建设	6,556,487.65	2.33
124	002167	东方锆业	6,525,425.48	2.32
125	300197	铁汉生态	6,522,838.76	2.32
126	601006	大秦铁路	6,476,253.25	2.31
127	300024	机器人	6,302,898.60	2.24
128	600629	棱光实业	6,274,694.52	2.23
129	300132	青松股份	6,228,936.72	2.22
130	000887	中鼎股份	6,161,415.44	2.19
131	601311	骆驼股份	6,057,603.50	2.16
132	000960	锡业股份	6,051,388.00	2.15
133	001696	宗申动力	6,030,483.40	2.15
134	300172	中电环保	5,931,676.26	2.11
135	000590	紫光古汉	5,855,125.52	2.08

136	600801	华新水泥	5,800,121.99	2.07
137	600750	江中药业	5,637,411.60	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	600256	广汇股份	71,800,125.12	25.56
2	000581	威孚高科	38,856,066.77	13.83
3	600406	国电南瑞	38,122,721.65	13.57
4	600111	包钢稀土	36,765,785.78	13.09
5	600252	中恒集团	36,681,848.98	13.06
6	002283	天润曲轴	35,534,517.60	12.65
7	000937	冀中能源	33,803,220.61	12.04
8	600031	三一重工	33,627,527.72	11.97
9	002118	紫鑫药业	33,107,076.34	11.79
10	002036	宜科科技	30,111,321.68	10.72
11	300029	天龙光电	29,924,506.94	10.65
12	600030	中信证券	29,360,812.71	10.45
13	600226	升华拜克	29,347,742.20	10.45
14	600292	九龙电力	29,179,816.58	10.39
15	002049	晶源电子	28,257,702.53	10.06
16	300055	万邦达	27,868,579.38	9.92
17	600036	招商银行	27,716,413.23	9.87
18	600125	铁龙物流	25,565,729.56	9.10
19	002094	青岛金王	25,145,045.06	8.95
20	600585	海螺水泥	24,978,793.75	8.89
21	000858	五粮液	23,722,955.62	8.45
22	002303	美盈森	23,701,248.54	8.44
23	000568	泸州老窖	23,518,998.18	8.37
24	000024	招商地产	23,343,058.36	8.31
25	000063	中兴通讯	22,609,603.26	8.05
26	000527	美的电器	22,073,053.98	7.86
27	600251	冠农股份	22,049,922.81	7.85
28	600535	天士力	22,016,586.81	7.84
29	600392	太工天成	21,434,099.43	7.63

30	000998	隆平高科	21,084,798.82	7.51
31	600193	创兴资源	20,996,243.19	7.48
32	002271	东方雨虹	20,809,043.36	7.41
33	002179	中航光电	20,712,322.70	7.37
34	601808	中海油服	20,513,371.95	7.30
35	600141	兴发集团	19,549,619.61	6.96
36	000566	海南海药	19,472,728.78	6.93
37	600309	烟台万华	19,366,286.23	6.90
38	000426	兴业矿业	19,265,102.55	6.86
39	600188	兖州煤业	19,029,742.37	6.78
40	600218	全柴动力	18,217,631.62	6.49
41	600000	浦发银行	18,015,678.73	6.41
42	000758	中色股份	17,825,427.33	6.35
43	601699	潞安环能	17,807,422.01	6.34
44	000551	创元科技	17,528,223.06	6.24
45	000630	铜陵有色	17,101,883.46	6.09
46	600519	贵州茅台	16,998,215.64	6.05
47	300218	安利股份	16,458,260.96	5.86
48	600547	山东黄金	16,375,977.23	5.83
49	002155	辰州矿业	16,299,814.46	5.80
50	600395	盘江股份	16,190,765.97	5.76
51	600869	三普药业	16,043,378.32	5.71
52	002009	天奇股份	15,746,798.79	5.61
53	600240	华业地产	15,263,492.64	5.43
54	600029	南方航空	14,878,776.71	5.30
55	000761	本钢板材	14,289,453.75	5.09
56	600362	江西铜业	14,261,850.93	5.08
57	600348	阳泉煤业	14,168,494.07	5.04
58	000969	安泰科技	13,952,675.93	4.97
59	600844	丹化科技	13,824,727.23	4.92
60	002092	中泰化学	13,515,536.53	4.81
61	601166	兴业银行	13,059,906.35	4.65
62	600580	卧龙电气	12,787,970.03	4.55
63	600186	莲花味精	12,193,204.55	4.34
64	002168	深圳惠程	12,106,115.41	4.31
65	600163	福建南纸	12,096,331.75	4.31
66	600339	天利高新	12,032,041.90	4.28
67	000776	广发证券	11,968,280.76	4.26

68	600085	同仁堂	11,958,529.10	4.26
69	600458	时代新材	11,769,875.34	4.19
70	600581	八一钢铁	11,734,152.61	4.18
71	000651	格力电器	11,464,612.12	4.08
72	000060	中金岭南	11,434,026.57	4.07
73	600019	宝钢股份	11,177,624.29	3.98
74	600636	三爱富	10,964,115.90	3.90
75	002230	科大讯飞	10,964,019.34	3.90
76	600426	华鲁恒升	10,780,703.21	3.84
77	600078	澄星股份	10,692,127.14	3.81
78	600887	伊利股份	10,659,441.95	3.80
79	600271	航天信息	10,359,580.65	3.69
80	601989	中国重工	10,354,722.84	3.69
81	600150	中国船舶	9,930,010.00	3.54
82	600048	保利地产	9,921,683.70	3.53
83	600104	上海汽车	9,616,507.03	3.42
84	600702	沱牌舍得	9,559,443.22	3.40
85	002001	新 和 成	9,473,995.61	3.37
86	002235	安妮股份	9,383,591.34	3.34
87	000792	盐湖股份	9,122,206.60	3.25
88	000826	桑德环境	8,986,083.30	3.20
89	601677	明泰铝业	8,863,915.76	3.16
90	002011	盾安环境	8,863,807.57	3.16
91	002129	中环股份	8,721,576.75	3.11
92	600387	海越股份	8,412,536.12	3.00
93	002004	华邦制药	8,315,960.80	2.96
94	000401	冀东水泥	8,306,302.73	2.96
95	600802	福建水泥	8,162,288.35	2.91
96	601766	中国南车	8,104,775.66	2.89
97	601601	中国太保	8,100,103.82	2.88
98	600765	中航重机	8,065,817.50	2.87
99	000422	湖北宜化	8,027,335.42	2.86
100	600056	中国医药	7,817,416.32	2.78
101	600600	青岛啤酒	7,790,402.14	2.77
102	002170	芭田股份	7,723,990.29	2.75
103	600016	民生银行	7,694,000.00	2.74
104	002277	友阿股份	7,490,000.53	2.67
105	002091	江苏国泰	7,466,558.09	2.66

106	002304	洋河股份	7,189,896.06	2.56
107	000816	江淮动力	7,095,421.98	2.53
108	600631	百联股份	7,068,336.07	2.52
109	600685	广船国际	7,022,477.85	2.50
110	600420	现代制药	7,014,501.64	2.50
111	600976	武汉健民	6,826,077.34	2.43
112	600801	华新水泥	6,785,019.29	2.42
113	300197	铁汉生态	6,731,906.19	2.40
114	601088	中国神华	6,704,340.00	2.39
115	000157	中联重科	6,680,202.83	2.38
116	002062	宏润建设	6,672,668.69	2.38
117	600875	东方电气	6,629,815.29	2.36
118	600101	明星电力	6,621,559.92	2.36
119	600511	国药股份	6,547,361.05	2.33
120	000301	东方市场	6,444,229.12	2.29
121	002140	东华科技	6,435,513.90	2.29
122	002167	东方锆业	6,405,463.06	2.28
123	000590	紫光古汉	6,370,203.83	2.27
124	600750	江中药业	6,282,525.39	2.24
125	000887	中鼎股份	6,238,642.67	2.22
126	000960	锡业股份	6,092,441.93	2.17
127	600316	洪都航空	6,051,265.53	2.15
128	300172	中电环保	6,033,088.35	2.15
129	600629	棱光实业	6,011,916.05	2.14
130	000639	西王食品	5,966,544.39	2.12
131	001696	宗申动力	5,944,750.00	2.12
132	300024	机器人	5,758,992.01	2.05
133	601311	骆驼股份	5,719,273.00	2.04

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	2,555,927,197.82
卖出股票收入（成交）总额	2,524,596,085.82

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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,674,800.00	2.87
8	其他	-	-
9	合计	5,674,800.00	2.87

### 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	113001	中行转债	60,000	5,674,800.00	2.87

### 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，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。

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	1,989,332.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	39,399.21

5	应收申购款	16,854.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,045,585.52

#### 8.9.4 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	113001	中行转债	5,674,800.00	2.87

#### 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
6,125	46,272.54	90,345,977.89	31.88%	193,073,320.59	68.12%

#### 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
------------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	306,248,011.35
本报告期基金总申购份额	25,002,837.05
减:本报告期基金总赎回份额	47,831,549.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	283,419,298.48

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、报告期内基金托管人的托管部门无重大人事变动。

### 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	
国信证券	2	2,498,371,880.34	49.18%	2,074,399.94	49.06%	-
申银万国	1	1,074,244,842.97	21.15%	872,831.62	20.64%	-
光大证券	1	806,852,915.72	15.88%	685,822.28	16.22%	-
厦门证券	1	417,517,652.33	8.22%	354,889.11	8.39%	-
齐鲁证券	1	282,657,824.30	5.56%	240,258.87	5.68%	-

#### 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	443,280,588.58	78.62%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	94,686,736.80	16.79%	280,000,000.00	51.57%	-	-
厦门证券	25,832,090.30	4.58%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	263,000,000.00	48.43%	-	-

			0		
--	--	--	---	--	--

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三个，分别是申银万国、光大证券和齐鲁证券。

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
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
4	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 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
5	《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
6	《华富基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 1 月 27 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 3 月 3 日
10	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 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	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 3 月 31 日
12	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 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
13	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 4 月 29 日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 5 月 6 日
15	《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

16	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 5 月 19 日
17	《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
18	《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
19	《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
20	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 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
21	《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 8 月 19 日
22	《华富价值增长灵活配置型证券投资基金 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
23	《华富价值增长灵活配置型证券投资基金招募说明书更新（2011 年第 2 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 8 月 29 日
24	《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
25	《华富价值增长灵活配置混合型	在《中国证券报》、	2011 年 10 月 24 日

	证券投资基金 2011 年第 3 季度报告》	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
26	《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
27	《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
28	《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
29	《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
30	《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
31	《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
32	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行 2012 倾心回馈基金定投优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 12 月 30 日
33	《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

34	《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

2011 年 7 月 29 日托管人深圳发展银行股份有限公司（以下简称深圳发展银行）发布《深圳发展银行股份有限公司关于重大资产重组实施完成的公告》，该次重大资产重组完成以后，中国平安及中国平安控股子公司中国平安人寿保险股份有限公司合计持有深圳发展银行 52.38% 的股份，成为深圳发展银行的控股股东，平安银行成为深圳发展银行的控股子公司。

## § 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。