

# 华富竞争力优选混合型证券投资基金 2011 年年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012年3月30日

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人中国建设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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富竞争力优选混合型证券投资基金
基金简称	华富竞争力优选混合
基金主代码	410001
交易代码	410001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 3 月 2 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,761,256,583.35 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

登载基金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

## § 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	-327,256,124.89	-145,835,592.78	290,842,931.85
本期利润	-509,195,125.56	-106,057,452.08	671,149,672.07
加权平均基金份额本期利润	-0.2822	-0.0520	0.2781
本期基金份额净值增长率	-36.39%	-5.75%	47.79%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0784	0.1033	0.1704
期末基金资产净值	874,782,873.63	1,470,520,616.75	1,780,484,316.59
期末基金份额净值	0.4967	0.7809	0.8285

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

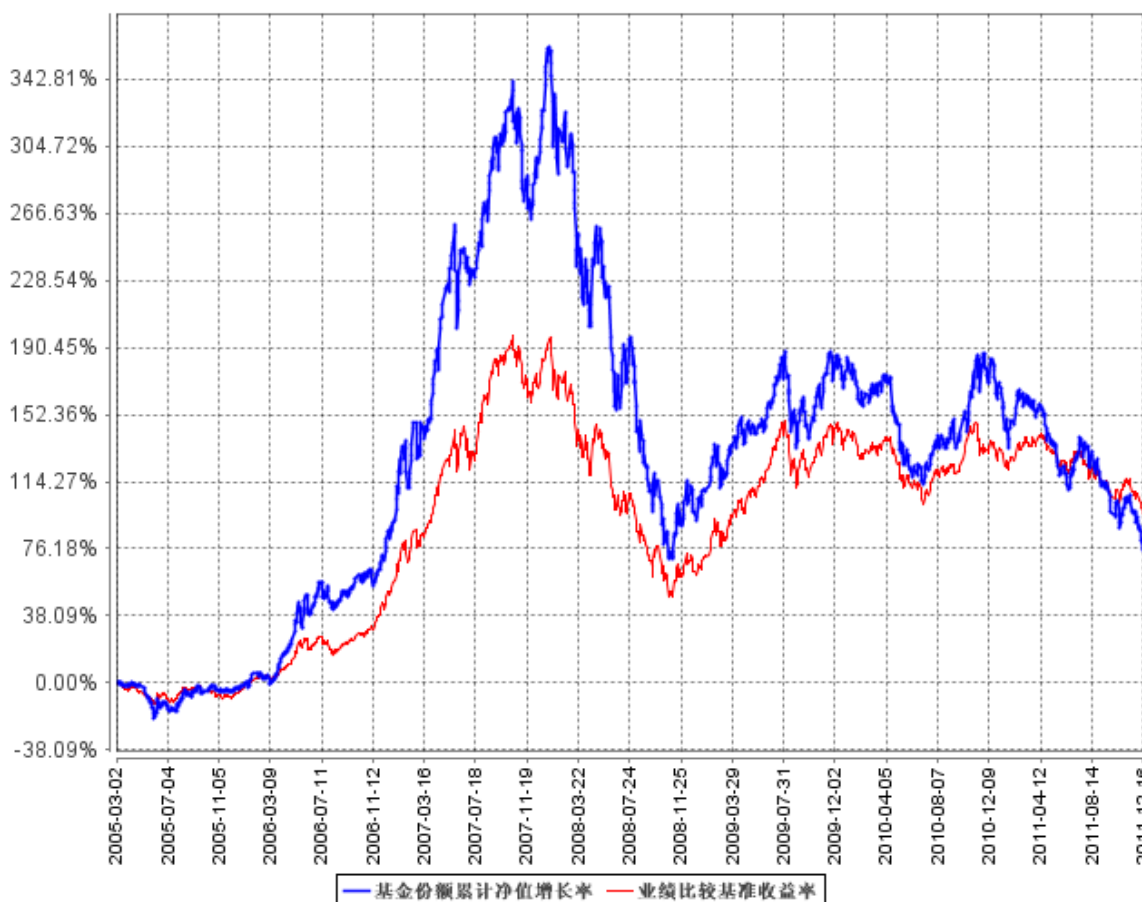
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-13.18%	1.40%	-4.34%	0.85%	-8.84%	0.55%
过去六个月	-22.67%	1.32%	-13.48%	0.82%	-9.19%	0.50%
过去一年	-36.39%	1.25%	-14.74%	0.78%	-21.65%	0.47%
过去三年	-11.40%	1.41%	22.00%	1.00%	-33.40%	0.41%
过去五年	-10.82%	1.83%	25.13%	1.29%	-35.95%	0.54%
自基金合同生效起至今	70.57%	1.70%	96.65%	1.18%	-26.08%	0.52%

注：业绩比较基准收益率=60%×中信标普 300 指数+35%×中信标普全债指数+5%×同业存款利率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

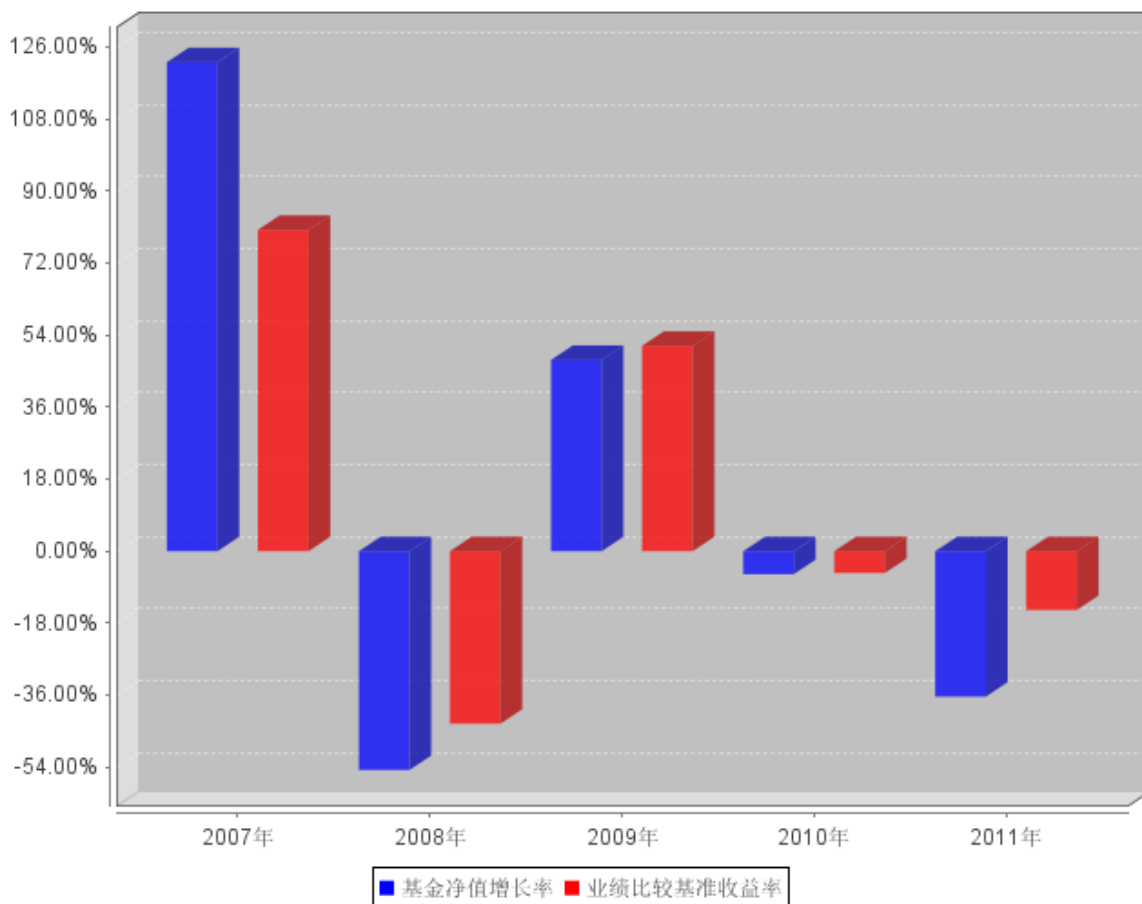
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票 30%~90%、债券 5%~65%、现金不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2005 年 3 月 2 日至 9 月 2 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

### 3.2.3 过去五年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

过去五年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



### 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、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		
张琦	华富竞争力优选基金经理	2010年6月2日	-	七年	英国里丁大学投资银行专业硕士、研究生学历，历任光大证券有限公司研究员、银华基金管理有限公司投资经理，2010年4月加入我公司。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人在报告期内严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》以及本公司公平交易制度的相关规定，在日常交易中公平对待所管理的不同投资组合。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长的基金合同，华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长都属于混合型基金，2011年，华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长的净值增长率分别为-36.39%、-32.84%与-23.86%。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 年的股市表现乏力，本基金的表现欠佳，由于开局落后，希望通过重仓某一热点板块迅速改善业绩，心态失衡并且四处出击之下，却错过了上半年的水泥和下半年的传媒两大热点，在换手率高企的同时，业绩却每况愈下。

1 月进行了减仓操作，但没有调整持股结构；2 月参与了高油价、磷矿石等热点；3 月中小市值股票受伤；4 月开始加入大型银行、交通运输基础设施、大型建筑公司等准债券类资产；5 月遭受了两次较大的损失，一次是电解铝、一次高贝塔的配置遭受国际板打击；6 月品种主要是保障房、水利；7 月成功进行了水利板块的龙头切换，铅酸电池的投资效果也不错，本月业绩表现很好；8 月的失误是没有配置消费类，低估了主流资金流向的力度；9 月在铅酸电池的重点配置遭受了补跌；10 月由于对于文化产业政策扶持的理解不足，错过了业绩追赶的最佳机会；11 月增持了一号文的主题品种，环保、新材料也有所配置；12 月增加了食品饮料等消费类。

### 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 0.4967 元，累计份额净值为 1.6502 元；本报告期份额净值增长率为-36.39%，同期业绩比较基准收益率为-14.74%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年影响市场的核心因素是房地产调控，取代房地产行业的新经济增长模式对于所有市场参与者都是模糊的，在房地产的风险没有充分释放之前，经济的去库存可能要持续至年中，此前经济的基本面都难言乐观，即经济方面还要看房地产，标志是房价。

流动性方面，继续保持中性的货币政策是大概率事件，资金将持续紧张，A 股市场还将表现为场内资金博弈，机会来源于板块之间估值比较的势能，没有增量资金入场，无以推动大规模行情。外围资金入场与否，主要观察的对象是无风险收益率，它决定了 A 股整体的吸引力。

政策的影响在下降，主要关注分红制度改革，如电力、证券等板块。产业结构调整受益品种里面，主要依托于研究，选择细分行业中地位独特的、业绩高增长的标的。

2012 年外围市场的影响将会比较大，美国经济的恢复程度以及美元的走势对于周期类资源品至关重要，欧洲债务的流动性约束影响其次。美国因素中，还有一个独特的研究对象——页岩气，它对于油价的影响至关重要，对整个于化工行业尤其是化肥、农药，以及农产品、新能源等都有



根本性的深远影响。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-509,195,125.56，期末可供分配利润为-138,129,215.22。本报告期内未进行利润分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 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)6-21 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	华富竞争力优选混合型证券投资基金全体持有人	
引言段	我们审计了后附的华富竞争力优选混合型证券投资基金（以下简称“华富竞争力基金”）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竞争力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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	
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竞争力基金 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：华富竞争力优选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	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	86,605,307.55	325,695,971.38
结算备付金	6,598,894.89	10,237,149.46
存出保证金	2,914,850.86	6,362,425.13
交易性金融资产	745,194,890.50	1,192,758,588.85
其中：股票投资	692,361,385.70	1,109,499,361.55
基金投资	-	-
债券投资	52,833,504.80	83,259,227.30
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	49,500,274.25	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	273,399.70	444,422.81
应收股利	-	-
应收申购款	96,176.10	516,501.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	891,183,793.85	1,536,015,059.00
<b>负债和所有者权益</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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	9,103,186.20	55,824,719.81
应付赎回款	62,391.81	391,590.53
应付管理人报酬	1,187,406.39	1,940,374.21
应付托管费	197,901.08	323,395.66

应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,453,791.21	4,955,403.43
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,396,243.53	2,058,958.61
负债合计	16,400,920.22	65,494,442.25
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	961,112,282.43	1,027,672,985.79
未分配利润	-86,329,408.80	442,847,630.96
所有者权益合计	874,782,873.63	1,470,520,616.75
负债和所有者权益总计	891,183,793.85	1,536,015,059.00

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4967 元，基金份额总额 1,761,256,583.35 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 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	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>	-458,961,862.80	-48,063,069.65
1. 利息收入	2,463,290.33	2,421,696.34
其中：存款利息收入	1,589,476.07	1,376,658.58
债券利息收入	859,164.68	992,306.45
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	14,649.58	52,731.31
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-279,505,097.35	-90,364,020.43
其中：股票投资收益	-280,843,330.73	-108,771,657.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,564,969.71	8,968,947.72
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,903,203.09	9,438,689.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-181,939,000.67	39,778,140.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	18,944.89	101,113.74

<b>减：二、费用</b>	50,233,262.76	57,994,382.43
1. 管理人报酬	17,916,251.28	22,508,677.20
2. 托管费	2,986,041.89	3,751,446.14
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	28,842,370.82	31,244,975.88
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	488,598.77	489,283.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-509,195,125.56	-106,057,452.08
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-509,195,125.56	-106,057,452.08

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 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）	1,027,672,985.79	442,847,630.96	1,470,520,616.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-509,195,125.56	-509,195,125.56
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）	-66,560,703.36	-19,981,914.20	-86,542,617.56
其中：1. 基金申购款	22,299,566.37	5,306,322.18	27,605,888.55
2. 基金赎回款	-88,860,269.73	-25,288,236.38	-114,148,506.11
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）	961,112,282.43	-86,329,408.80	874,782,873.63
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		



1.832556370 元，拆分比例为 1:1.832556370。本基金管理人按照 1.832556370 的拆分比例增加基金份额持有人持有的基金份额数。拆分后，基金份额净值变为 1.0000 元，相应地，本基金份额持有人原来每 1 份基金份额拆分后为 1.832556370 份，拆分后基金份额数保留到小数点后 2 位，本基金注册登记机构于 2007 年 6 月 13 日进行了变更登记。

#### 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》、《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

#### 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 报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致

#### 7.4.5 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）交易印花税率

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 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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券有限责任公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、代销机构
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

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 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	1,704,660,423.84	8.99%	651,130,209.49	3.20%

###### 7.4.8.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
华安证券	2,890,943.60	4.36%	-	-

###### 7.4.8.1.3 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。

###### 7.4.8.1.4 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。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年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	1,405,709.22	8.91%	890,330.50	36.29%
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	529,046.59	3.12%	94,031.59	1.90%

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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年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的管理费	17,916,251.28
其中：支付销售机构的客户维护费	2,756,401.05	3,447,958.77

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）。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年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的托管费	2,986,041.89

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 ÷ 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)。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位: 份

项目	本期	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
期初持有的基金份额	-	36,372,790.53
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	36,372,790.53
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

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。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2011年12月31日		2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华安证券有限责任公司	7,148,185.30	0.41%	-	-
合肥兴泰控股集团有限公司	9,162,317.04	0.52%	9,162,317.04	0.49%

注: 关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定, 符合公允性要求。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期		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
中国建设银行股份有限公司	86,605,307.55	1,459,663.18	325,695,971.38	1,270,514.35

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002214	大立科技	2011 年 11 月 10 日	重大事项停牌	29.84	2012 年 2 月 29 日	34.11	807,168	28,341,808.70	24,085,893.12	
600991	广汽长丰	2011 年 12 月 28 日	重大事项停牌	14.72	2012 年 1 月 4 日	15.11	840,600	12,409,138.00	12,373,632.00	

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 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	708,735,365.38	1,162,473,747.45
第二层次	36,459,525.12	30,284,841.40
第三层次	-	-
合计	745,194,890.50	1,192,758,588.85

## § 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	692,361,385.70	77.69
	其中：股票	692,361,385.70	77.69
2	固定收益投资	52,833,504.80	5.93
	其中：债券	52,833,504.80	5.93
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	49,500,274.25	5.55
	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	93,204,202.44	10.46
6	其他各项资产	3,284,426.66	0.37
7	合计	891,183,793.85	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	31,749,663.96	3.63
B	采掘业	-	-
C	制造业	432,453,647.18	49.44
C0	食品、饮料	40,191,522.35	4.59
C1	纺织、服装、皮毛	15,892,048.25	1.82
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	34,330,723.24	3.92
C4	石油、化学、塑胶、塑料	86,573,725.45	9.90
C5	电子	106,379,689.25	12.16
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	133,142,052.13	15.22

C8	医药、生物制品	15,943,886.51	1.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,390,670.89	1.87
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	53,236,100.96	6.09
H	批发和零售贸易	56,910,228.09	6.51
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	101,621,074.62	11.62
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	692,361,385.70	79.15

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002283	天润曲轴	5,066,084	54,257,759.64	6.20
2	300187	永清环保	1,124,761	53,414,899.89	6.11
3	001696	宗申动力	7,665,090	46,603,747.20	5.33
4	300218	安利股份	1,865,589	32,181,410.25	3.68
5	300132	青松股份	2,211,350	30,958,900.00	3.54
6	300022	吉峰农机	2,515,163	29,704,075.03	3.40
7	002329	皇氏乳业	1,978,572	27,007,507.80	3.09
8	600257	大湖股份	4,258,052	26,527,663.96	3.03
9	002025	航天电器	1,953,957	25,166,966.16	2.88
10	002214	大立科技	807,168	24,085,893.12	2.75

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的年度报告正文

### 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	600316	洪都航空	133,757,918.35	9.10
2	002049	晶源电子	127,053,713.52	8.64
3	000807	云铝股份	114,672,394.50	7.80

4	000629	攀钢钒钛	113,091,809.65	7.69
5	600702	沱牌舍得	111,272,306.94	7.57
6	600141	兴发集团	110,546,699.56	7.52
7	000969	安泰科技	107,509,670.82	7.31
8	600030	中信证券	105,024,525.02	7.14
9	600193	创兴资源	101,064,294.57	6.87
10	601398	工商银行	93,231,513.35	6.34
11	601006	大秦铁路	91,109,993.94	6.20
12	601668	中国建筑	90,196,400.00	6.13
13	600888	新疆众和	89,649,791.10	6.10
14	601311	骆驼股份	89,469,145.68	6.08
15	002009	天奇股份	86,934,390.04	5.91
16	601288	农业银行	85,957,000.00	5.85
17	002271	东方雨虹	83,653,761.21	5.69
18	600111	包钢稀土	81,774,098.09	5.56
19	002094	青岛金王	77,116,722.12	5.24
20	000779	三毛派神	76,943,800.65	5.23
21	300029	天龙光电	75,164,944.98	5.11
22	000861	海印股份	74,635,116.66	5.08
23	300068	南都电源	74,524,455.34	5.07
24	300197	铁汉生态	71,871,462.73	4.89
25	600395	盘江股份	70,502,193.50	4.79
26	000598	兴蓉投资	69,516,443.47	4.73
27	600048	保利地产	68,834,129.23	4.68
28	600068	葛洲坝	68,757,688.24	4.68
29	001696	宗申动力	68,190,216.46	4.64
30	000758	中色股份	67,990,449.39	4.62
31	002283	天润曲轴	67,529,276.88	4.59
32	000002	万科A	66,826,130.26	4.54
33	600830	香溢融通	65,936,582.37	4.48
34	600482	风帆股份	61,910,811.31	4.21
35	600595	中孚实业	61,582,049.92	4.19
36	600251	冠农股份	61,026,685.13	4.15
37	600773	西藏城投	59,541,346.42	4.05
38	600078	澄星股份	59,378,813.69	4.04
39	600516	方大炭素	58,245,148.60	3.96

40	300187	永清环保	57,558,108.37	3.91
41	600188	兖州煤业	57,290,762.38	3.90
42	600531	豫光金铅	56,606,168.35	3.85
43	600019	宝钢股份	56,223,818.36	3.82
44	601117	中国化学	55,827,758.21	3.80
45	600497	驰宏锌锗	55,782,954.69	3.79
46	601808	中海油服	54,232,807.93	3.69
47	600176	中国玻纤	53,045,836.33	3.61
48	600367	红星发展	52,772,111.85	3.59
49	601607	上海医药	52,203,183.05	3.55
50	601989	中国重工	50,389,333.87	3.43
51	601186	中国铁建	49,144,523.11	3.34
52	600600	青岛啤酒	48,592,104.06	3.30
53	000039	中集集团	48,251,707.00	3.28
54	000718	苏宁环球	48,220,902.33	3.28
55	600346	大橡塑	47,402,021.93	3.22
56	600528	中铁二局	47,232,919.90	3.21
57	300218	安利股份	46,277,661.62	3.15
58	600967	北方创业	46,144,082.29	3.14
59	600614	鼎立股份	45,956,259.05	3.13
60	000776	广发证券	45,772,852.31	3.11
61	002230	科大讯飞	45,338,172.66	3.08
62	000024	招商地产	44,819,041.58	3.05
63	600583	海油工程	44,792,319.74	3.05
64	300022	吉峰农机	44,301,943.60	3.01
65	600559	老白干酒	43,449,420.77	2.95
66	300178	腾邦国际	42,474,521.32	2.89
67	601958	金钼股份	42,222,000.09	2.87
68	000858	五粮液	41,659,185.72	2.83
69	300132	青松股份	41,593,603.62	2.83
70	000751	锌业股份	41,381,750.80	2.81
71	600362	江西铜业	41,104,968.26	2.80
72	600837	海通证券	40,692,778.97	2.77
73	300087	荃银高科	40,532,710.32	2.76
74	000998	隆平高科	40,469,420.25	2.75
75	000727	华东科技	40,464,467.26	2.75

76	300142	沃森生物	39,711,724.16	2.70
77	600420	现代制药	39,349,820.68	2.68
78	002428	云南锗业	39,289,699.75	2.67
79	600580	卧龙电气	39,107,035.31	2.66
80	601377	兴业证券	38,931,547.39	2.65
81	002225	濮耐股份	38,894,532.42	2.64
82	000050	深天马A	38,800,936.07	2.64
83	601216	内蒙君正	38,778,069.44	2.64
84	002480	新筑股份	38,743,898.05	2.63
85	600170	上海建工	38,270,727.88	2.60
86	600724	宁波富达	37,547,981.79	2.55
87	300021	大禹节水	37,522,684.39	2.55
88	000012	南玻A	37,474,010.29	2.55
89	600354	敦煌种业	37,091,152.64	2.52
90	000426	兴业矿业	36,897,786.16	2.51
91	000537	广宇发展	34,943,568.58	2.38
92	600257	大湖股份	34,881,684.86	2.37
93	600376	首开股份	33,513,296.83	2.28
94	600533	栖霞建设	33,341,857.44	2.27
95	002204	大连重工	33,090,335.31	2.25
96	000889	渤海物流	32,742,074.76	2.23
97	002104	恒宝股份	32,660,427.09	2.22
98	002121	科陆电子	32,252,045.32	2.19
99	002060	粤水电	32,242,361.70	2.19
100	300108	双龙股份	32,101,116.50	2.18
101	002190	成飞集成	31,600,439.96	2.15
102	600326	西藏天路	31,595,830.37	2.15
103	002618	丹邦科技	31,197,881.02	2.12
104	600312	平高电气	31,186,142.89	2.12
105	600805	悦达投资	30,730,260.37	2.09
106	300140	启源装备	30,711,345.80	2.09
107	601788	光大证券	30,694,392.72	2.09
108	601009	南京银行	30,639,649.27	2.08
109	600135	乐凯胶片	30,472,090.40	2.07
110	600309	烟台万华	29,949,716.44	2.04
111	600271	航天信息	29,819,458.62	2.03



112	000970	中科三环	29,659,881.90	2.02
113	002149	西部材料	29,649,266.62	2.02
114	600581	八一钢铁	29,616,951.55	2.01
115	002329	皇氏乳业	29,570,705.77	2.01
116	600795	国电电力	29,435,000.00	2.00

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

#### 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	600141	兴发集团	135,109,159.15	9.19
2	002049	晶源电子	125,121,818.38	8.51
3	600316	洪都航空	115,503,112.02	7.85
4	000629	攀钢钒钛	112,680,940.99	7.66
5	000807	云铝股份	103,088,605.34	7.01
6	000969	安泰科技	100,935,842.31	6.86
7	300029	天龙光电	99,574,982.83	6.77
8	600030	中信证券	98,805,537.80	6.72
9	600702	沱牌舍得	97,418,770.86	6.62
10	600193	创兴资源	93,498,290.67	6.36
11	601398	工商银行	88,049,264.33	5.99
12	300197	铁汉生态	86,302,093.78	5.87
13	601808	中海油服	86,166,877.06	5.86
14	601006	大秦铁路	84,675,183.86	5.76
15	600111	包钢稀土	84,118,731.36	5.72
16	600888	新疆众和	82,780,283.69	5.63
17	601668	中国建筑	82,294,908.56	5.60
18	300068	南都电源	81,471,326.60	5.54
19	601288	农业银行	81,378,078.98	5.53
20	002271	东方雨虹	80,318,192.23	5.46
21	002009	天奇股份	79,386,792.63	5.40
22	601311	骆驼股份	75,901,482.13	5.16
23	000779	三毛派神	75,616,157.33	5.14
24	600516	方大炭素	74,078,508.28	5.04
25	000861	海印股份	72,962,119.38	4.96

26	002094	青岛金王	71,764,774.15	4.88
27	600068	葛洲坝	70,361,879.45	4.78
28	000598	兴蓉投资	69,416,366.43	4.72
29	600048	保利地产	68,369,947.29	4.65
30	000050	深天马A	67,233,513.33	4.57
31	000758	中色股份	66,847,214.85	4.55
32	600395	盘江股份	64,398,833.12	4.38
33	600078	澄星股份	64,323,684.60	4.37
34	000002	万科A	63,758,774.76	4.34
35	600773	西藏城投	62,525,144.30	4.25
36	600251	冠农股份	62,417,333.55	4.24
37	600830	香溢融通	61,271,153.65	4.17
38	600595	中孚实业	58,905,361.15	4.01
39	002230	科大讯飞	58,690,909.02	3.99
40	600019	宝钢股份	57,164,373.34	3.89
41	600188	兖州煤业	56,487,666.84	3.84
42	002277	友阿股份	56,030,861.44	3.81
43	600531	豫光金铅	55,462,830.09	3.77
44	601989	中国重工	53,759,663.26	3.66
45	600497	驰宏锌锗	53,316,526.76	3.63
46	600367	红星发展	52,534,158.88	3.57
47	002041	登海种业	52,188,111.90	3.55
48	601117	中国化学	51,844,576.26	3.53
49	601607	上海医药	49,790,907.05	3.39
50	600482	风帆股份	49,686,869.82	3.38
51	601186	中国铁建	49,465,421.89	3.36
52	000039	中集集团	48,540,797.90	3.30
53	600583	海油工程	48,398,443.34	3.29
54	600498	烽火通信	48,297,585.75	3.28
55	000718	苏宁环球	48,075,281.39	3.27
56	600496	精工钢构	47,865,721.52	3.26
57	600967	北方创业	47,751,123.80	3.25
58	600406	国电南瑞	47,737,242.64	3.25
59	600600	青岛啤酒	47,026,972.75	3.20
60	600533	栖霞建设	46,301,078.28	3.15
61	600581	八一钢铁	46,228,963.60	3.14
62	000998	隆平高科	45,703,075.37	3.11
63	600176	中国玻纤	45,504,563.98	3.09

64	000024	招商地产	44,450,225.16	3.02
65	600346	大橡塑	43,776,271.68	2.98
66	300021	大禹节水	43,552,964.79	2.96
67	000776	广发证券	42,575,614.18	2.90
68	002104	恒宝股份	42,517,290.66	2.89
69	002480	新筑股份	42,082,433.57	2.86
70	600614	鼎立股份	41,970,463.44	2.85
71	000751	锌业股份	40,330,774.56	2.74
72	601958	金钼股份	40,277,742.35	2.74
73	600837	海通证券	39,989,115.98	2.72
74	600559	老白干酒	39,511,577.79	2.69
75	300142	沃森生物	39,408,234.81	2.68
76	600366	宁波韵升	39,344,098.05	2.68
77	000858	五粮液	39,228,409.78	2.67
78	002428	云南锗业	38,941,590.29	2.65
79	600362	江西铜业	38,793,790.62	2.64
80	002225	濮耐股份	38,234,989.96	2.60
81	300087	荃银高科	38,191,921.31	2.60
82	601377	兴业证券	37,855,385.95	2.57
83	300178	腾邦国际	37,547,331.57	2.55
84	600511	国药股份	37,504,598.98	2.55
85	600354	敦煌种业	36,189,720.71	2.46
86	600580	卧龙电气	36,100,920.57	2.45
87	000012	南玻A	35,560,247.20	2.42
88	601216	内蒙君正	35,559,840.22	2.42
89	002060	粤水电	34,712,099.51	2.36
90	000537	广宇发展	34,699,620.55	2.36
91	600724	宁波富达	34,530,665.42	2.35
92	300018	中元华电	34,405,934.67	2.34
93	600326	西藏天路	34,343,942.17	2.34
94	600170	上海建工	33,612,945.18	2.29
95	600376	首开股份	33,307,684.32	2.27
96	002190	成飞集成	32,885,686.70	2.24
97	600420	现代制药	32,576,713.59	2.22
98	000426	兴业矿业	31,935,037.07	2.17
99	600271	航天信息	31,119,876.64	2.12
100	002204	大连重工	30,522,770.86	2.08
101	002121	科陆电子	30,342,312.24	2.06

102	600312	平高电气	29,924,879.23	2.03
103	600231	凌钢股份	29,871,384.74	2.03
104	002313	日海通讯	29,816,126.18	2.03
105	002618	丹邦科技	29,767,210.09	2.02
106	601009	南京银行	29,614,594.72	2.01
107	600309	烟台万华	29,489,056.29	2.01
108	600795	国电电力	29,480,579.90	2.00
109	600161	天坛生物	29,479,847.63	2.00

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

### 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	9,505,626,200.10
卖出股票收入（成交）总额	9,463,229,125.21

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	23,888,104.80	2.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	28,945,400.00	3.31
8	其他	-	-
9	合计	52,833,504.80	6.04

### 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	110003	新钢转债	250,000	24,925,000.00	2.85
2	115002	国安债1	150,000	13,897,500.00	1.59

3	126008	08 上汽债	106,920	9,990,604.80	1.14
4	110015	石化转债	40,000	4,020,400.00	0.46

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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	2,914,850.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	273,399.70
5	应收申购款	96,176.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,284,426.66

#### 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	110003	新钢转债	24,925,000.00	2.85
2	110015	石化转债	4,020,400.00	0.46

#### 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	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	-----------	----------	----------

			价值	例 (%)	
1	002214	大立科技	24,085,893.12	2.75	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
96,567	18,238.70	22,198,006.91	1.26%	1,739,058,576.44	98.74%

### 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	299,141.24	0.0170%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2005 年 3 月 2 日 ) 基金份额总额	601,106,870.74
本报告期期初基金份额总额	1,883,229,090.66
本报告期基金总申购份额	40,864,371.77
减:本报告期基金总赎回份额	162,836,879.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,761,256,583.35

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、本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。本基金托管人 2011 年 10 月 24 日发布任免通知，聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	
中信证券	2	2,179,938,210.96	11.49%	1,787,928.73	11.33%	-
光大证券	2	1,990,862,482.06	10.50%	1,619,925.30	10.27%	-
华安证券	3	1,704,660,423.84	8.99%	1,405,709.22	8.91%	-
国金证券	2	1,699,105,130.17	8.96%	1,392,637.08	8.83%	-
长江证券	1	1,558,386,281.49	8.22%	1,324,621.26	8.40%	-
中山证券	1	1,241,671,882.49	6.55%	1,055,416.99	6.69%	-
民生证券	1	1,185,182,785.99	6.25%	1,007,400.08	6.39%	-
新时代证券	1	1,005,774,634.93	5.30%	854,906.51	5.42%	-
安信证券	2	849,839,235.81	4.48%	690,499.83	4.38%	-
世纪证券	1	761,026,998.25	4.01%	646,864.85	4.10%	-
中信建投证券	1	667,225,247.34	3.52%	542,125.27	3.44%	-
宏源证券	1	531,247,684.52	2.80%	431,642.21	2.74%	-
申银万国	1	515,968,770.77	2.72%	438,572.22	2.78%	-
国泰君安	1	432,112,305.11	2.28%	367,295.04	2.33%	-
西南证券	1	363,014,728.59	1.91%	294,954.24	1.87%	-
长城证券	1	326,119,763.23	1.72%	264,974.87	1.68%	-
华宝证券	1	319,608,498.21	1.68%	271,664.60	1.72%	-
东北证券	1	318,847,481.36	1.68%	271,018.56	1.72%	-
第一创业证券	1	295,002,424.31	1.56%	250,748.90	1.59%	-
中投证券	3	253,124,716.50	1.33%	205,665.42	1.30%	-



国联证券	1	196,546,712.77	1.04%	167,064.41	1.06%	-
高华证券	1	177,396,392.97	0.94%	150,786.62	0.96%	-
华泰联合证券	2	141,410,329.78	0.75%	120,199.03	0.76%	-
英大证券	1	127,243,196.11	0.67%	103,386.14	0.66%	-
齐鲁证券	1	122,768,610.88	0.65%	104,353.16	0.66%	-
方正证券	1	4,770,396.87	0.03%	4,054.76	0.03%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
广发华福证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	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
中信证券	11,065,365.98	16.70%	-	-	-	-
光大证券	11,051,031.20	16.67%	-	-	-	-
华安证券	2,890,943.60	4.36%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	19,090,781.58	28.81%	-	-	-	-
中山证券	11,968,151.10	18.06%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	10,207,700.00	15.40%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
广发华福证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-

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：西南证券、华泰联合证券、英大证券、方正证券、东吴证券、国海证券各新增 1 个席位。本报告期本基金注销交易单元的情况是：民族证券注销 1 个席位。

2) 债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2011 年 10 月 28 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，根

据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“本行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

2、2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。