

# 华富量子生命力股票型证券投资基金 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：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

### 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 4 月 1 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	华富量子生命力股票型证券投资基金
基金简称	华富量子生命力股票
基金主代码	410009
交易代码	410009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 1 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	142,730,829.07 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采用数量化投资方法，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	本基金在进行资产配置时，主要根据基金管理人开发的“估值驱动战略资产配置模型”，通过对市场未来

	1-3 个月整体估值水平进行预测，实现基金在股票、债券及现金之间的合理配置。模型从市场估值的驱动因素出发，通过寻找与市场走势相关性最大的因子组合，构建市场趋势预测模型。该因子库包括的驱动因子包括但不限于：经济面因子、供求面因子、政策面因子、估值面因子、情绪面因子、盈利面因子。模型结果最终汇总为一个综合的配置指标，通过对市场未来走势的预测结果，调整基金在各类资产之间的配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。一般情况下，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 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

## 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 4 月 1 日 -2011 年 12 月 31 日	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-23,728,117.54	-	-
本期利润	-42,709,371.68	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2381	-	-
本期基金份额净值增长率	-25.49%	-	-
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	-0.2549	-	-

期末基金资产净值	106,345,314.80	-	-
期末基金份额净值	0.7451	-	-

注：1) 本基金合同生效未满一年。

2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3) 以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日。

## 3.2 基金净值表现

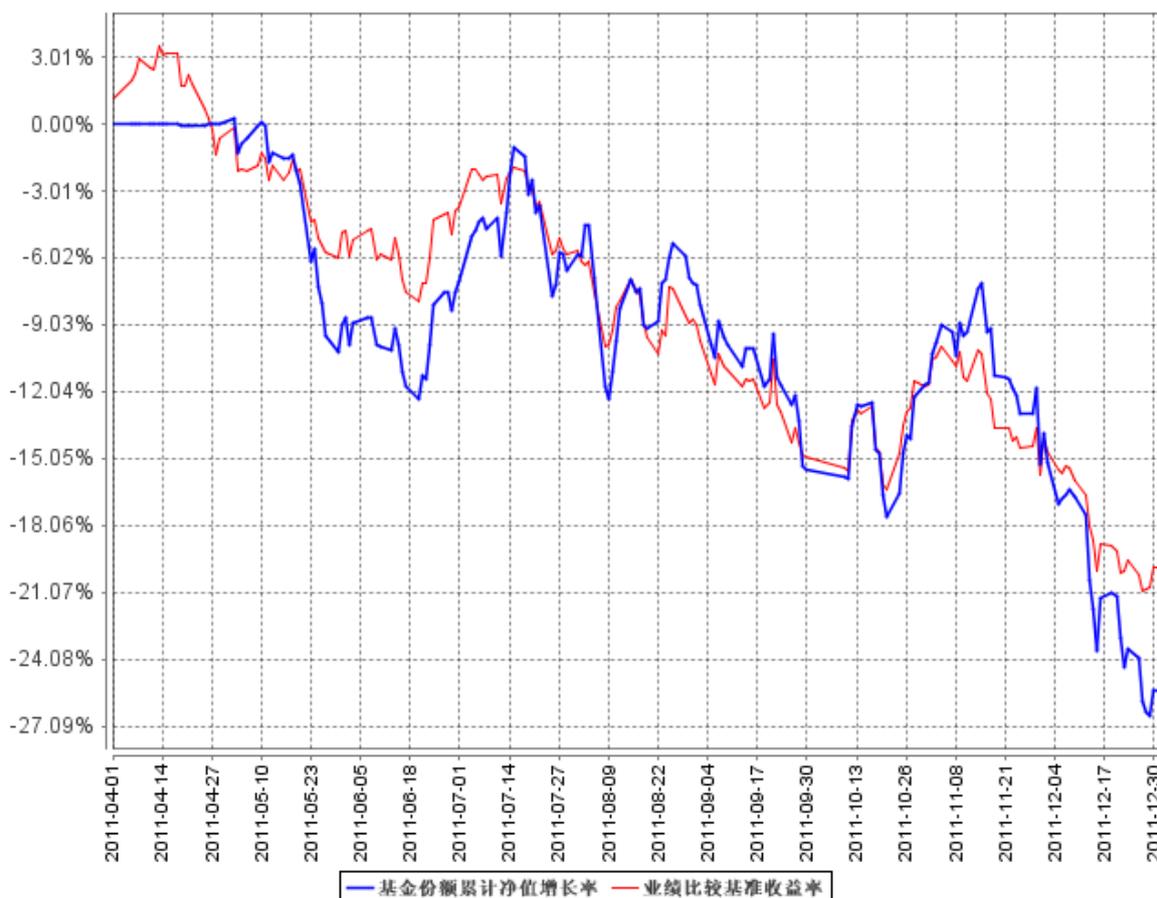
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-11.76%	1.50%	-5.79%	1.05%	-5.97%	0.45%
过去六个月	-19.39%	1.47%	-16.65%	1.02%	-2.74%	0.45%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-25.49%	1.30%	-19.92%	0.96%	-5.57%	0.34%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率\*75%+中证全债指数收益率\*25%，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

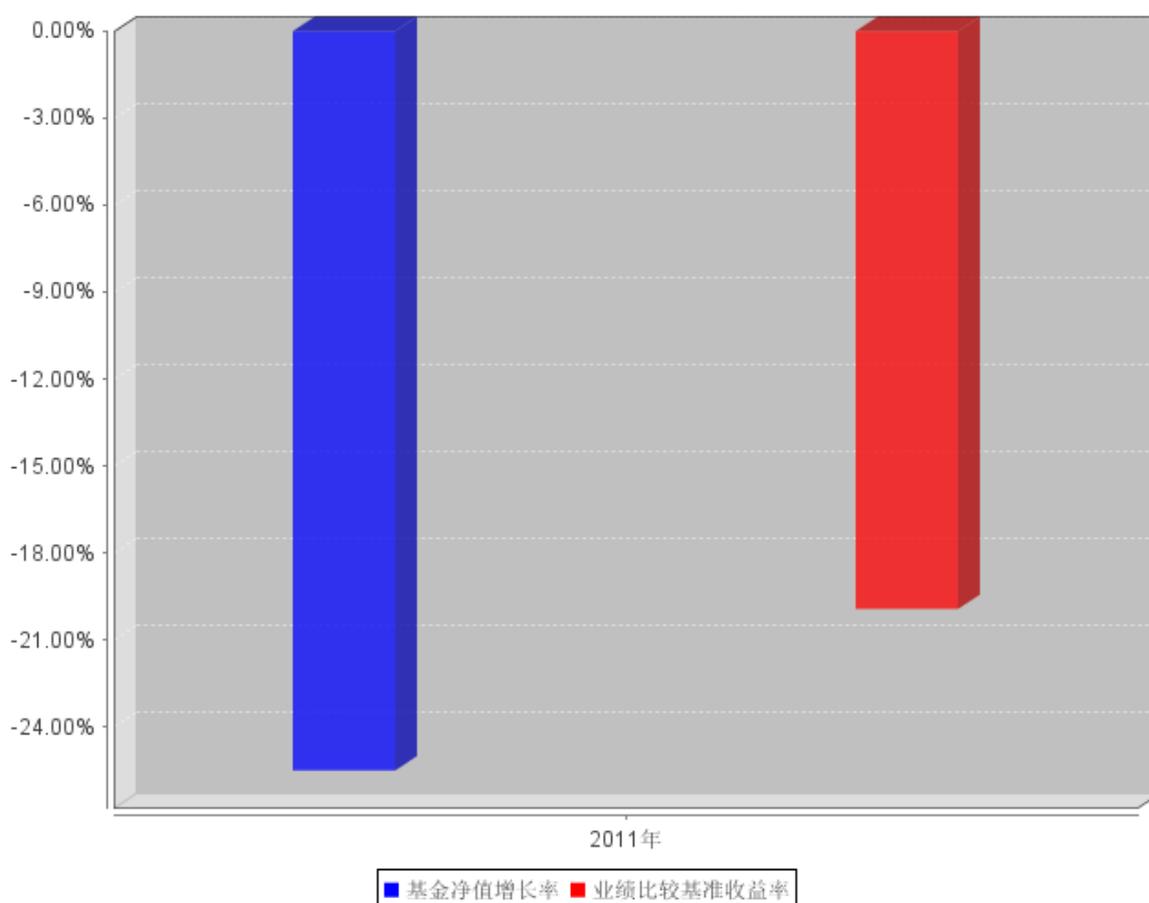
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富量子生命力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：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%；债券、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具占基金资产的 0%-40%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2011 年 4 月 1 日到 2011 年 10 月 1 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《华富量子生命力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：1) 上述比较期间为 2011 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日。

2) 按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2011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		
朱蓓	华富量子生命力基金经理	2011年4月1日	-	四年	上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历，曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理，华富基金金融工程研究员、产品设计经理。

注：这里的任职日期指该基金成立之日。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

按照华富量子生命力和华富成长趋势的基金合同，华富量子生命力和华富成长趋势都属于股票型基金，2011年，华富量子生命力和华富成长趋势的净值增长率分别为-25.49%与-33.71%。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 年量子生命力基金共运作了 9 个月，期间涨幅为-25.49%，同期沪深 300 指数涨幅为-27.23%。其中，有 7 个月跑赢沪深 300 指数，胜率为 77.8%。

二季度，根据市场趋势识别模型，我们判断市场仍处于宽幅震荡状态，主要采取中性仓位稳健操作策略，期间由于受到赎回因素影响，业绩波动较大。三季度，我们依据风格轮动模型，期间进行了配置风格的调整。四季度在政策放松低于预期及经济加速下滑的交替冲击下，市场单边加速下滑。尽管期间基金在操作风格上相对稳健，但在市场快速下跌中，部分量化模型表现不佳，导致净值下跌较快。综合全年来看，量子基金整体运作正常，各模型样本外检验结果良好，有效性处于正常区间范围内。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2011 年 4 月 1 日正式成立。截止 2011 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.7451 元，累计份额净值为 0.7451 元。报告期，本基金份额净值增长率为-25.49%，同期业绩比较基准收益率为-19.92%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了分别以“保增长”、“控通胀”为主基调的经济宏观调控后，2012 年将中国经济将会以一种更均衡的模式发展。房地产调控在未来几年不会放松，以房地产为经济支柱的传统经济发展模式也将在 2012 年面临挑战。经济增长与控制通胀，像是在跷跷板的两端，中国将寻求一种新的发展模式平衡于其中。

目前政策拐点已经出现，在通胀可控的前提下，2012 年政府重心会从“控通胀”向“增长与通胀并重”的局势转换。但和以往市场对政策放松的预期经济背景不同，这次政策放松是趋势性的。2012 年 1 季度市场将再次经受欧债危机的考验，国内刺激政策的推出和调控政策的出台呈现多变性，经济将在不断下移过程中寻求新的均衡点，混沌增长的过程将十分复杂。

## 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

根据本报告 3.1，华富量子生命力股票型基金本期利润为-42,709,371.68，期末可供分配利润为-36,385,514.27。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”）在对华富量子生命力基金（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)6-30 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	华富量子生命力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量子生命力股票型证券投资基金（以下简称“华富量子生命力基金”）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量子生命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量子生命力基金 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 号新潮商务大厦 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：华富量子生命力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	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	6,221,398.45	-
结算备付金	371,687.84	-
存出保证金	500,000.00	-
交易性金融资产	85,391,564.83	-
其中：股票投资	85,391,564.83	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	11,000,000.00	-
应收证券清算款	4,629,770.50	-
应收利息	3,380.86	-
应收股利	-	-
应收申购款	19,605.99	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	108,137,408.47	-
<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	533,083.58	-
应付赎回款	15,394.99	-
应付管理人报酬	151,742.34	-
应付托管费	25,290.39	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	216,524.38	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	850,057.99	-
负债合计	1,792,093.67	-
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	142,730,829.07	-
未分配利润	-36,385,514.27	-
所有者权益合计	106,345,314.80	-
负债和所有者权益总计	108,137,408.47	-

注：本基金合同于 2011 年 4 月 1 日生效，实际报告期为 2011 年 4 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日。

报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7451 元，基金份额总额 142,730,829.07 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华富量子生命力股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 4 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2011 年 4 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>	-38,640,022.03	-
1.利息收入	726,711.23	-
其中：存款利息收入	456,456.19	-
债券利息收入	107,758.74	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	162,496.30	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-20,574,862.31	-
其中：股票投资收益	-21,715,211.95	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-48,103.07	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,188,452.71	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-18,981,254.14	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	189,383.19	-
<b>减：二、费用</b>	4,069,349.65	-
1. 管理人报酬	1,865,401.32	-
2. 托管费	310,900.22	-
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	1,534,648.11	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	358,400.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-42,709,371.68	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-42,709,371.68	-

注：本基金合同于 2011 年 4 月 1 日生效，实际报告期为 2011 年 4 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富量子生命力股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 4 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 4 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-42,709,371.68	-42,709,371.68
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）	142,730,829.07	6,323,857.41	149,054,686.48
其中：1. 基金申购款	301,354,391.52	-676,284.56	300,678,106.96
2. 基金赎回款	-158,623,562.45	7,000,141.97	-151,623,420.48
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）	142,730,829.07	-36,385,514.27	106,345,314.80

注：本基金合同于 2011 年 4 月 1 日生效，实际报告期为 2011 年 4 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日。

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

华富量子生命力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《华富量子生命力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【2010】1585 号文核准募集设立。本基金自 2011 年 2 月 28 日起公开向社会发行，至 2011 年 3 月 25 日募集结束。经天健正信会计师事务所有限公司验资并出具天健正信验（2011）综字第 020032 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 293,506,500.23 元；募集资金的银行存款利息 148,404.31 元，折成基金份额，归投资人所有；设立募集期共募集 293,654,904.54 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 2011 年 4 月 1 日生效，该日的基金份额为 293,654,904.54 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》、《华富量子生命力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。本期会计报表的实际编制期间为 2011 年 4 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持

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

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表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 所示的方法确权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

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

#### 7.4.4.4.2 贷款和应收款项

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

#### 7.4.4.4.3 其他金融负债

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

#### 7.4.4.5.1 股票投资

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

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

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

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

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

于非公开发行股票初始投资成本，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《华富量子生命力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《华富量子生命力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；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；收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额；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收益分配基准日可供分配利润的 10%；收益分配基准日可供分配利润指该日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（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### 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:

以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

基金买卖股票、债券的差价收入,从 2004 年 1 月 1 日起,继续免征收营业税。

对基金买卖股票、债券的差价收入,从 2004 年 1 月 1 日起,继续免征收企业所得税;对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20.00%的个人所得税。(注:自 2005 年 6 月 13 日起,基金从上市公司取得的股息红利所得减按 50.00%计算应纳税所得额。)

基金买卖股票,经国务院批准,从 2008 年 4 月 24 日起证券(股票)交易印花税税率由现行的 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%。

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
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

### 7.4.8 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

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

## 7.4.8.2 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4月1日(基金合同生效日)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	1,865,401.32	-
其中：支付销售机构的客户维护费	527,059.27	-

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4月1日(基金合同生效日)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	310,900.22	-

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）。

### 7.4.8.3 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 2011年4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
基金合同生效日（2011年4月1日）持有的基金份额	10,007,750.00	-
期初持有的基金份额	10,007,750.00	-
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	10,007,750.00	-
期末持有的基金份额	7.01%	-

占基金总份额比例		
----------	--	--

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 2011年12月31日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华安证券有限责任公司	5,008,100.00	3.51%	-	-

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 2011年4月1日(基金合同生效日)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
深圳发展银行股份有限公司	6,221,398.45	442,386.82	-	-

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

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

#### 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
第一层次	85,391,564.83
第二层次	-
第三层次	-
合计	85,391,564.83

## § 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	85,391,564.83	78.97
	其中：股票	85,391,564.83	78.97
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	11,000,000.00	10.17
	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	6,593,086.29	6.10
6	其他各项资产	5,152,757.35	4.77
7	合计	108,137,408.47	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	698,960.31	0.66

B	采掘业	278,052.00	0.26
C	制造业	60,235,273.18	56.64
C0	食品、饮料	2,976,460.29	2.80
C1	纺织、服装、皮毛	3,466,564.23	3.26
C2	木材、家具	1,277,714.36	1.20
C3	造纸、印刷	3,142,023.43	2.95
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,004,405.34	10.35
C5	电子	6,540,129.24	6.15
C6	金属、非金属	8,260,779.07	7.77
C7	机械、设备、仪表	20,027,838.96	18.83
C8	医药、生物制品	2,396,709.26	2.25
C99	其他制造业	1,142,649.00	1.07
D	电力、煤气及水的生产和供应业	662,043.33	0.62
E	建筑业	801,818.47	0.75
F	交通运输、仓储业	2,084,483.44	1.96
G	信息技术业	2,720,377.94	2.56
H	批发和零售贸易	6,220,125.70	5.85
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	10,158,250.04	9.55
K	社会服务业	1,484,173.82	1.40
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	48,006.60	0.05
	合计	85,391,564.83	80.30

### 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	300154	瑞凌股份	72,003	835,234.80	0.79
2	300141	和顺电气	32,812	820,300.00	0.77
3	300118	东方日升	61,369	808,229.73	0.76
4	000418	小天鹅 A	93,508	801,363.56	0.75
5	002449	国星光电	49,122	788,408.10	0.74
6	002434	万里扬	93,399	779,881.65	0.73
7	000732	泰禾集团	149,974	770,866.36	0.72
8	002435	长江润发	76,622	769,284.88	0.72
9	300129	泰胜风能	90,900	769,014.00	0.72
10	000959	首钢股份	286,446	767,675.28	0.72

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300077	国民技术	5,802,780.83	5.46
2	002362	汉王科技	5,270,901.11	4.96
3	000965	天保基建	5,092,161.34	4.79
4	002437	誉衡药业	4,531,881.66	4.26
5	002435	长江润发	4,526,506.80	4.26
6	002172	澳洋科技	4,510,489.81	4.24
7	300112	万讯自控	4,479,457.49	4.21
8	600573	惠泉啤酒	4,453,414.00	4.19
9	002463	沪电股份	4,358,899.10	4.10
10	002467	二六三	4,353,484.65	4.09
11	002333	罗普斯金	4,272,472.94	4.02
12	600664	哈药股份	4,106,358.75	3.86
13	300125	易世达	4,027,831.88	3.79
14	300086	康芝药业	4,026,041.13	3.79
15	002247	帝龙新材	3,835,978.16	3.61
16	002485	希努尔	3,812,292.81	3.58
17	002468	艾迪西	3,757,409.77	3.53
18	300120	经纬电材	3,717,162.61	3.50
19	002441	众业达	3,694,386.57	3.47
20	300066	三川股份	3,681,060.94	3.46
21	300041	回天胶业	3,660,021.97	3.44
22	002351	漫步者	3,646,028.79	3.43
23	300033	同花顺	3,632,216.52	3.42
24	002489	浙江永强	3,625,449.29	3.41
25	002336	人人乐	3,616,287.81	3.40
26	002494	华斯股份	3,601,617.15	3.39
27	000916	华北高速	3,576,148.29	3.36
28	300141	和顺电气	3,568,806.89	3.36
29	000619	海螺型材	3,509,006.08	3.30

30	002434	万里扬	3,468,085.24	3.26
31	002387	黑牛食品	3,455,778.82	3.25
32	002404	嘉欣丝绸	3,431,389.19	3.23
33	300119	瑞普生物	3,414,072.21	3.21
34	300126	锐奇股份	3,411,409.98	3.21
35	300118	东方日升	3,387,242.76	3.19
36	002315	焦点科技	3,370,150.83	3.17
37	600418	江淮汽车	3,355,813.31	3.16
38	002133	广宇集团	3,340,739.86	3.14
39	002366	丹甫股份	3,329,855.13	3.13
40	300129	泰胜风能	3,318,950.35	3.12
41	002401	中海科技	3,317,729.78	3.12
42	002449	国星光电	3,241,745.03	3.05
43	002464	金利科技	3,230,763.03	3.04
44	002335	科华恒盛	3,218,361.96	3.03
45	600269	赣粤高速	3,213,907.58	3.02
46	000521	美菱电器	3,210,249.04	3.02
47	600323	南海发展	3,205,786.30	3.01
48	002306	湘鄂情	3,193,926.70	3.00
49	002144	宏达高科	3,193,782.13	3.00
50	600006	东风汽车	3,185,592.00	3.00
51	002455	百川股份	3,177,118.27	2.99
52	000671	阳光城	3,156,330.83	2.97
53	000715	中兴商业	3,120,966.73	2.93
54	002436	兴森科技	3,096,866.46	2.91
55	300083	劲胜股份	3,075,901.92	2.89
56	300155	安居宝	3,069,242.72	2.89
57	300135	宝利沥青	3,052,758.05	2.87
58	002454	松芝股份	3,051,492.54	2.87
59	300078	中瑞思创	3,037,863.83	2.86
60	002042	华孚色纺	3,001,403.83	2.82
61	000572	海马汽车	2,961,526.90	2.78
62	600035	楚天高速	2,921,253.44	2.75
63	300081	恒信移动	2,910,812.46	2.74
64	002492	恒基达鑫	2,848,276.64	2.68
65	002491	通鼎光电	2,845,665.30	2.68

66	300052	中青宝	2,836,180.85	2.67
67	002320	海峡股份	2,835,932.80	2.67
68	002367	康力电梯	2,804,455.00	2.64
69	002495	佳隆股份	2,798,319.82	2.63
70	002092	中泰化学	2,793,587.38	2.63
71	600480	凌云股份	2,754,416.32	2.59
72	600976	武汉健民	2,749,454.48	2.59
73	002406	远东传动	2,745,536.04	2.58
74	300103	达刚路机	2,735,149.40	2.57
75	002518	科士达	2,715,029.91	2.55
76	002400	省广股份	2,711,885.34	2.55
77	600246	万通地产	2,706,946.29	2.55
78	000989	九芝堂	2,687,982.12	2.53
79	002515	金字火腿	2,624,208.10	2.47
80	000608	阳光股份	2,588,857.77	2.43
81	002372	伟星新材	2,554,792.56	2.40
82	601866	中海集运	2,548,860.61	2.40
83	002224	三力士	2,538,417.09	2.39
84	601919	中国远洋	2,531,196.46	2.38
85	300133	华策影视	2,530,944.75	2.38
86	601688	华泰证券	2,519,575.62	2.37
87	000800	一汽轿车	2,511,543.08	2.36
88	600761	安徽合力	2,493,084.28	2.34
89	002028	思源电气	2,483,322.61	2.34
90	002507	涪陵榨菜	2,443,617.95	2.30
91	002444	巨星科技	2,425,053.00	2.28
92	300147	香雪制药	2,414,887.56	2.27
93	000900	现代投资	2,376,593.18	2.23
94	600822	上海物贸	2,361,655.78	2.22
95	600486	扬农化工	2,358,566.77	2.22
96	002290	禾盛新材	2,311,444.87	2.17
97	002048	宁波华翔	2,305,467.66	2.17
98	002117	东港股份	2,296,268.03	2.16
99	600231	凌钢股份	2,279,738.04	2.14
100	000882	华联股份	2,276,636.29	2.14
101	600774	汉商集团	2,268,046.31	2.13

102	000885	同力水泥	2,259,840.87	2.13
103	000631	顺发恒业	2,251,394.21	2.12
104	600754	锦江股份	2,235,810.58	2.10
105	600806	昆明机床	2,228,538.24	2.10
106	600720	祁连山	2,228,448.72	2.10
107	600166	福田汽车	2,227,693.74	2.09
108	601111	中国国航	2,227,583.90	2.09
109	300143	星河生物	2,223,355.20	2.09
110	002396	星网锐捷	2,202,670.00	2.07
111	300159	新研股份	2,197,074.35	2.07
112	002103	广博股份	2,193,520.74	2.06
113	600626	申达股份	2,154,651.01	2.03
114	600170	上海建工	2,139,495.58	2.01
115	002514	宝馨科技	2,139,352.28	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300077	国民技术	5,359,482.54	5.04
2	002362	汉王科技	4,426,275.73	4.16
3	002467	二六三	4,272,748.90	4.02
4	000965	天保基建	3,986,905.07	3.75
5	300112	万讯自控	3,955,332.09	3.72
6	600664	哈药股份	3,870,916.04	3.64
7	002437	誉衡药业	3,735,542.52	3.51
8	002485	希努尔	3,686,567.32	3.47
9	300119	瑞普生物	3,376,035.88	3.17
10	002441	众业达	3,366,081.50	3.17
11	002172	澳洋科技	3,363,256.20	3.16
12	002435	长江润发	3,360,962.57	3.16
13	002387	黑牛食品	3,334,872.07	3.14
14	002463	沪电股份	3,292,621.62	3.10
15	002468	艾迪西	3,290,135.28	3.09
16	002247	帝龙新材	3,269,128.58	3.07

17	000916	华北高速	3,244,621.63	3.05
18	600573	惠泉啤酒	3,216,230.05	3.02
19	002315	焦点科技	3,171,466.06	2.98
20	002144	宏达高科	3,151,413.51	2.96
21	002335	科华恒盛	3,095,798.19	2.91
22	002133	广宇集团	3,072,777.29	2.89
23	002436	兴森科技	3,067,176.47	2.88
24	600323	南海发展	3,066,806.57	2.88
25	300086	康芝药业	3,061,133.69	2.88
26	002306	湘鄂情	3,026,987.20	2.85
27	002333	罗普斯金	3,019,764.85	2.84
28	300155	安居宝	2,991,843.94	2.81
29	300103	达刚路机	2,959,734.65	2.78
30	002351	漫步者	2,941,074.05	2.77
31	600006	东风汽车	2,940,064.25	2.76
32	600269	赣粤高速	2,937,394.64	2.76
33	002404	嘉欣丝绸	2,937,369.71	2.76
34	300083	劲胜股份	2,838,138.91	2.67
35	300041	回天胶业	2,826,976.66	2.66
36	300141	和顺电气	2,772,544.96	2.61
37	300125	易世达	2,766,526.25	2.60
38	300078	中瑞思创	2,763,554.50	2.60
39	600418	江淮汽车	2,751,222.84	2.59
40	002336	人人乐	2,737,493.39	2.57
41	000671	阳光城	2,734,454.49	2.57
42	300135	宝利沥青	2,696,632.46	2.54
43	300126	锐奇股份	2,693,643.91	2.53
44	600976	武汉健民	2,680,005.55	2.52
45	002367	康力电梯	2,673,731.47	2.51
46	300052	中青宝	2,640,162.67	2.48
47	300066	三川股份	2,611,226.31	2.46
48	002401	中海科技	2,608,151.14	2.45
49	300120	经纬电材	2,597,261.44	2.44
50	002464	金利科技	2,594,360.80	2.44
51	300081	恒信移动	2,593,640.44	2.44
52	000989	九芝堂	2,580,969.89	2.43
53	002400	省广股份	2,571,578.67	2.42
54	000715	中兴商业	2,565,015.57	2.41

55	002372	伟星新材	2,469,634.28	2.32
56	300033	同花顺	2,458,137.10	2.31
57	002320	海峡股份	2,447,953.43	2.30
58	002434	万里扬	2,424,687.00	2.28
59	000800	一汽轿车	2,396,670.19	2.25
60	300133	华策影视	2,381,351.57	2.24
61	002117	东港股份	2,380,915.22	2.24
62	002491	通鼎光电	2,376,622.93	2.23
63	002494	华斯股份	2,366,920.46	2.23
64	601688	华泰证券	2,344,197.86	2.20
65	600246	万通地产	2,331,788.60	2.19
66	601919	中国远洋	2,316,014.73	2.18
67	601866	中海集运	2,312,812.77	2.17
68	002489	浙江永强	2,299,496.14	2.16
69	600376	首开股份	2,266,619.45	2.13
70	000619	海螺型材	2,261,710.23	2.13
71	300159	新研股份	2,227,918.22	2.09
72	002092	中泰化学	2,205,142.59	2.07
73	002507	涪陵榨菜	2,177,827.85	2.05
74	000900	现代投资	2,157,399.93	2.03

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	587,952,627.03
卖出股票收入（成交）总额	461,864,596.11

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	500,000.00
2	应收证券清算款	4,629,770.50
3	应收股利	-
4	应收利息	3,380.86
5	应收申购款	19,605.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,152,757.35

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,543	40,285.30	32,513,064.25	22.78%	110,217,764.82	77.22%

## 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（2011年4月1日）基金份额总额	293,654,904.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,699,486.98
减：基金合同生效日起至本报告期期末基金总赎回份额	158,623,562.45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	142,730,829.07

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 8 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	
世纪证券	1	440,435,570.32	41.95%	357,858.77	41.39%	-
华泰联合证券	1	300,243,381.80	28.60%	243,950.32	28.22%	-
国联证券	1	226,084,345.65	21.54%	192,171.41	22.23%	-
中投证券	1	83,053,925.37	7.91%	70,596.08	8.17%	-
国盛证券	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

世纪证券	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-
国联证券	234,818,833.51	100.00%	802,500,000.00	100.00%	-
中投证券	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-

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：世纪证券、华泰联合证券、国联证券、中投证券以及国盛证券各新增一个席位。

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。

## § 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。