

华富成长趋势股票型证券投资基金 2012 年 年度报告摘要

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 27 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 2012 年 01 月 01 日起至 2012 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富成长趋势股票型证券投资基金
基金简称	华富成长趋势股票
基金主代码	410003
交易代码	410003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 3 月 19 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,930,141,502.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	张燕
	联系电话	021-68886996	0755-83199084
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-8001	95555
传真		021-68887997	0755-83195201

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	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

§ 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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-256,355,694.68	-376,648,497.48	219,011,660.08
本期利润	-65,348,934.98	-550,282,140.24	151,316,743.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0331	-0.2653	0.0637
本期基金份额净值增长率	-6.30%	-33.71%	7.52%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.5064	-0.4732	-0.2053
期末基金资产净值	952,800,729.46	1,062,087,432.45	1,717,191,569.72
期末基金份额净值	0.4936	0.5268	0.7947

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	4.49%	1.17%	8.03%	1.00%	-3.54%	0.17%
过去六个月	-4.08%	1.21%	2.35%	0.97%	-6.43%	0.24%
过去一年	-6.30%	1.19%	6.94%	1.00%	-13.24%	0.19%

过去三年	-33.22%	1.35%	-21.70%	1.10%	-11.52%	0.25%
过去五年	-57.75%	1.68%	-39.19%	1.56%	-18.56%	0.12%
自基金合同生效起至今	-36.91%	1.69%	6.18%	1.59%	-43.09%	0.10%

注：业绩比较基准收益率=80%×中信标普 300 指数+20%×中信标普全债指数，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

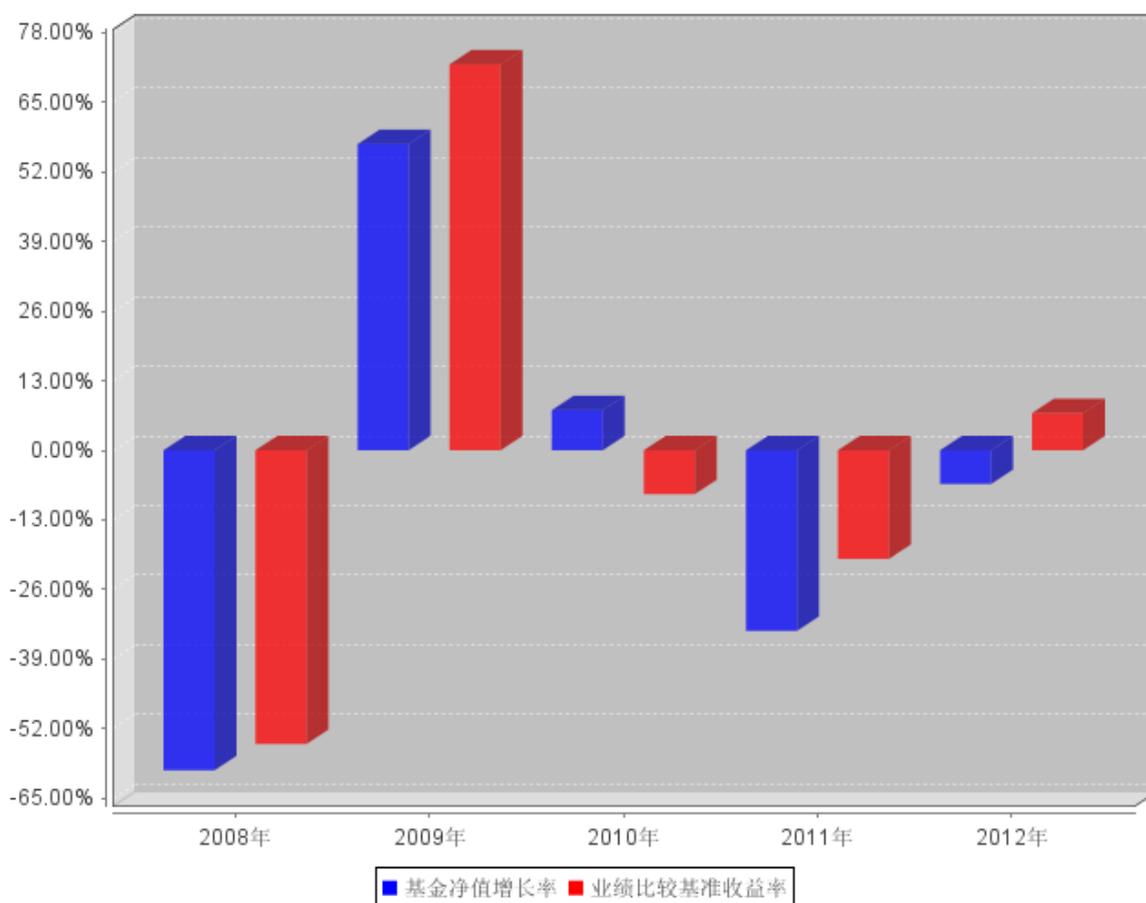
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 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
2012年度	-	-	-	-	
2011年度	-	-	-	-	
2010年度	-	-	-	-	
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股份有限

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 2012 年 12 月 31 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金和华富中小板指数增强型证券投资基金十只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈德义	华富成长趋势基金基金经理、华富策略精选混合基金基金经理	2009年9月8日	2013年1月16日	八年	清华大学工商管理硕士、研究生学历。历任中企东方资产管理公司研究员、上海丰润投资顾问公司投资咨询经理、国元证券股份有限公司投资研究中心高级研究员、国联安基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理。
龚炜	华富成长趋势股票型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、公司投资决策委员会成员、公司投研副总监兼基金投资部总监	2012年12月21日	-	八年	安徽财经大学金融学硕士，研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监，2012年9月加入华富基金管理有限公司，任研究发展部金融工程研究员。

注：陈德义的任职日期指公司作出决定之日，离任日期指中国证券业协会作出注销决定之日；龚炜的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支撑。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分

析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

2012 年上证综指上涨 3.17%，伴随着投资者心理变化经历了“预期经济见底-预期落空-预期政策刺激-预期落空-预期经济复苏”等多个阶段，A 股经历了大幅震荡的一年。由于预期差的持续出现，实体经济现状、流动性、政策力度、股票供给和股东套现等多重因素的交织，投资的操作难度加大，业绩稳定增长，基本面优秀的企业得到投资者持续的青睐。整体而言，市场热点散乱而短暂，全年涨幅最大的板块是近年来持续受政策压制但 2012 年下半年量价齐升的房地产行业，其中信一级行业房地产板块指数涨幅达 34.99%。

本基金在 2012 年的投资运作有较大失误，主要是对市场的预期差把握有所偏差，调仓节奏把握有所欠缺。本基金在年初超配银行、食品等行业，减持估值较高及有业绩风险的中小股票，而对周期性行业大盘蓝筹股加仓力度不够大。而在上半年市场表现中有色金属、房地产、保险券商等强周期行业表现领先大盘，食品饮料、医药等消费类行业后来居上。本基金虽然积极进行了个股和板块的波段投资操作。但由于年初布局时在房地产、券商等类行业的配置不足，以及在建材、煤炭行业的配置遭受了一定损失，上半年本基金表现不佳。而下半年开始由于持续的股票融资和套现压力，股市持续下跌，本基金由于仓位方面未做大的减仓，净值表现不佳。在 12 月开始股市由于经济复苏预期的刺激，房地产金融板块大幅上涨，本基金由于行业配置上相对偏重非周期行业，虽然在后期做了比较多调整，但整体净值表现仍不理想。总结经验和教训，我们认为，A 股

市场中市场对经济信息和投资逻辑的反应并非理性而及时，因此趋势投资方法有其特定的适用范围。但从中长期趋势看，股票价格走势将向其合理价值回归，在估值充分调整后的价值投资机会更值得重视。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为 0.4936 元，累计份额净值为 0.7836 元；本报告期份额净值增长率为-6.30%，同期业绩比较基准收益率为 6.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济指标分析显示，中国经济已经逐步走出周期性的底部开始了缓慢的复苏。2012 年四个季度的 GDP 增速分别为 8.1%、7.6%、7.4%和 7.9%，呈现小幅探底回升的趋势。消费对经济增长的贡献率超过了投资，成为拉动经济增长的第一动力。2012 年全年 GDP 增长 7.8%中，最终消费对 GDP 贡献是 51.8%，资本形成贡献 50.4%，货物和服务的净出口贡献-2.2%。这是过去 10 年很少出现的情况，表明消费已超过投资成为中国经济增长的最大引擎。展望 2013 年尽管推动和抑制消费增长的因素同时存在，但中国经济增长的动力依然存在，消费将持续成为经济增长的第一动力。对于 2013 年的 A 股市场，我们持谨慎乐观的态度。主要的理由是：第一，可以预期，推进城镇化建设将是未来几年政策的主线，政府换届完成后，适度的刺激投资政策可以期待，房地产如果出现价稳量升的情况，产业链相关行业的下滑局面将得到缓解。其次，蓝筹股估值已经足够便宜，银行股目前的滚动市盈率不到 10 倍，相对于成熟的 H 股市场亦有折让。市场出现回暖迹象，若能得到基本面的验证，则有助于巩固回升势头。第三，我国目前正处于人均 GDP 超过 5000 美元的发展阶段，消费升级进入快速上升通道。

本基金 2013 年行业配置策略，将保持对低估值的金融、地产、汽车、家电等行业的核心配置，重视医药、化工、TMT 等行业成长股超跌之后的投资机会。依据对企业活动的调研情况，捕捉经济可能回升带来的机械、建材、有色、煤炭、建筑等行业的反弹机会。若通胀和增长形势坏于预期，行业选择上对汽车、家电等消费股，以及农业等通胀受益股给予重视，并保持谨慎的仓位应对。我们预期 2013 年仍无具备大的趋势性机会，指数波动幅度较大，我们将重视对个股投资价值的筛选，精选合适的投资时机，获取绝对收益。

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《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-65,348,934.98，期末可供分配利润为-977,340,773.13。本报告期内未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审（2013）6-25 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富成长趋势股票型证券投资基金全体持有人
引言段	我们审计了后附的华富成长趋势股票型证券投资基金（以下简称“华富成长趋势”）财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表，2012 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是华富成长趋势基金的基金管理人华富基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。
注册会计师的责任段	<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成长趋势基 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 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	2013 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华富成长趋势股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	96,427,483.21	57,965,337.72
结算备付金	6,319,810.81	4,622,520.72
存出保证金	3,750,000.00	4,303,122.00
交易性金融资产	848,722,238.92	990,405,745.59
其中：股票投资	845,257,492.92	990,405,745.59
基金投资	-	-
债券投资	3,464,746.00	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	21,621,168.54	13,977,750.22
应收利息	43,463.81	15,859.32
应收股利	-	-
应收申购款	17,675.15	49,991.67
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	976,901,840.44	1,071,340,327.24
负债和所有者权益	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债：		
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	16,057,494.37	2,658,565.40

应付赎回款	381,594.07	192,193.25
应付管理人报酬	1,142,914.82	1,404,007.16
应付托管费	190,485.82	234,001.21
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,118,612.25	1,554,112.04
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	4,210,009.65	3,210,015.73
负债合计	24,101,110.98	9,252,894.79
所有者权益：		
实收基金	1,930,141,502.59	2,016,154,397.20
未分配利润	-977,340,773.13	-954,066,964.75
所有者权益合计	952,800,729.46	1,062,087,432.45
负债和所有者权益总计	976,901,840.44	1,071,340,327.24

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4936 元，基金份额总额 1,930,141,502.59 份。

7.2 利润表

会计主体：华富成长趋势股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012 年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011 年12月31日
一、收入	-29,451,045.79	-491,098,824.83
1. 利息收入	1,742,934.56	1,644,303.68
其中：存款利息收入	547,111.28	564,842.76
债券利息收入	52,722.62	1,079,460.92
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,143,100.66	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-222,252,287.67	-319,154,100.54
其中：股票投资收益	-233,152,834.48	-328,045,228.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-889,036.23	-157,958.73
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	11,789,583.04	9,049,086.44

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	191,006,759.70	-173,633,642.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	51,547.62	44,614.79
减：二、费用	35,897,889.19	59,183,315.41
1. 管理人报酬	14,896,620.29	20,799,459.43
2. 托管费	2,482,770.03	3,466,576.66
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	18,035,589.56	34,430,326.53
5. 利息支出	-	1,155.97
其中：卖出回购金融资产支出	-	1,155.97
6. 其他费用	482,909.31	485,796.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-65,348,934.98	-550,282,140.24
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-65,348,934.98	-550,282,140.24

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富成长趋势股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,016,154,397.20	-954,066,964.75	1,062,087,432.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-65,348,934.98	-65,348,934.98
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）	-86,012,894.61	42,075,126.60	-43,937,768.01
其中：1. 基金申购款	33,459,644.63	-17,358,851.95	16,100,792.68
2. 基金赎回款	-119,472,539.24	59,433,978.55	-60,038,560.69
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	1,930,141,502.59	-977,340,773.13	952,800,729.46

监督管理委员会备案；基金合同于 2007 年 3 月 19 日生效，该日的基金份额为 6,777,723,584.78 份基金单位。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 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 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司（“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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	734,447,002.38	6.21%	1,746,702,574.57	7.71%

7.4.8.1.2 债券交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华安证券	199,900,000.00	15.33%	-	-

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 2012年1月1日至2012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	668,637.69	6.54%	668,637.69	31.56%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华安证券	1,484,693.10	7.89%	-	-

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 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	14,896,620.29
其中：支付销售机构的客户维护费	3,729,993.36	5,217,346.77

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 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
	当期发生的基金应支付的托管费	2,482,770.03

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
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2007 年 3 月 19 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	27,842,127.24	-
期间申购/买入总份额	-	27,842,127.24
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	27,842,127.24	27,842,127.24
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.44%	1.38%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期和上年度可比期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.8.5 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	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	96,427,483.21	462,417.35	57,965,337.72	405,777.58

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及上年度可比期间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（2012 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

本基金本期末未持有因认购新发增发的流通受限股票。

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	2012 年 12 月 31 日公允价值	2011 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	848,722,238.92	957,238,800.52
第二层次	-	33,166,945.07
第三层次	-	-
合计	848,722,238.92	990,405,745.59

§ 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	845,257,492.92	86.52
	其中：股票	845,257,492.92	86.52
2	固定收益投资	3,464,746.00	0.35
	其中：债券	3,464,746.00	0.35
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	102,747,294.02	10.52
6	其他各项资产	25,432,307.50	2.60
7	合计	976,901,840.44	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	3,249,000.00	0.34
B	采掘业	35,852,400.00	3.76
C	制造业	413,984,046.69	43.45
C0	食品、饮料	32,662,149.00	3.43
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	41,403,027.62	4.35
C5	电子	4,663,628.10	0.49
C6	金属、非金属	82,132,243.60	8.62
C7	机械、设备、仪表	213,800,533.80	22.44
C8	医药、生物制品	39,322,464.57	4.13
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	13,675,818.23	1.44
E	建筑业	31,848,678.92	3.34
F	交通运输、仓储业	18,555,734.10	1.95
G	信息技术业	19,295,698.23	2.03
H	批发和零售贸易	39,230,760.39	4.12
I	金融、保险业	138,920,034.32	14.58
J	房地产业	61,209,842.78	6.42
K	社会服务业	57,079,919.26	5.99
L	传播与文化产业	12,355,560.00	1.30
M	综合类	-	-
	合计	845,257,492.92	88.71

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	600016	民生银行	8,000,000	62,880,000.00	6.60
2	601166	兴业银行	3,089,841	51,569,446.29	5.41
3	600104	上汽集团	2,719,832	47,977,836.48	5.04
4	600585	海螺水泥	2,299,921	42,433,542.45	4.45
5	601117	中国化学	4,700,000	38,728,000.00	4.06
6	000157	中联重科	4,000,000	36,840,000.00	3.87
7	600157	永泰能源	3,000,000	28,230,000.00	2.96
8	601186	中国铁建	4,649,958	27,295,253.46	2.86
9	601607	上海医药	2,319,859	25,773,633.49	2.71
10	600686	金龙汽车	3,620,394	24,510,067.38	2.57

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	601166	兴业银行	126,267,467.16	11.89
2	600048	保利地产	104,849,339.46	9.87
3	600104	上汽集团	100,810,321.76	9.49
4	600016	民生银行	84,702,000.00	7.98
5	000568	泸州老窖	84,666,940.15	7.97
6	000157	中联重科	75,299,101.81	7.09
7	600519	贵州茅台	72,732,898.01	6.85
8	000858	五粮液	71,236,389.84	6.71
9	600157	永泰能源	69,948,931.35	6.59
10	601117	中国化学	65,750,854.73	6.19
11	601318	中国平安	63,778,394.77	6.01
12	000799	酒鬼酒	63,497,623.70	5.98

13	600585	海螺水泥	60,668,402.83	5.71
14	000522	白云山A	55,535,634.30	5.23
15	600518	康美药业	55,436,155.12	5.22
16	601288	农业银行	52,156,000.00	4.91
17	300291	华录百纳	50,363,687.25	4.74
18	002353	杰瑞股份	50,272,626.30	4.73
19	600030	中信证券	50,060,645.63	4.71
20	000651	格力电器	45,507,337.43	4.28
21	600383	金地集团	45,365,567.45	4.27
22	002408	齐翔腾达	44,355,633.55	4.18
23	601186	中国铁建	43,049,227.58	4.05
24	600340	华夏幸福	42,778,158.68	4.03
25	002236	大华股份	42,668,201.43	4.02
26	600489	中金黄金	41,772,977.89	3.93
27	600837	海通证券	41,110,624.46	3.87
28	601988	中国银行	39,078,352.66	3.68
29	002456	欧菲光	38,092,734.43	3.59
30	300070	碧水源	37,742,771.03	3.55
31	000661	长春高新	37,080,901.83	3.49
32	601009	南京银行	37,042,563.18	3.49
33	002690	美亚光电	34,939,671.16	3.29
34	601888	中国国旅	34,125,576.93	3.21
35	300020	银江股份	33,920,337.67	3.19
36	601088	中国神华	33,829,595.67	3.19
37	002294	信立泰	33,729,836.72	3.18
38	002271	东方雨虹	33,165,185.55	3.12
39	000060	中金岭南	32,850,157.99	3.09
40	002310	东方园林	32,312,521.01	3.04
41	000826	桑德环境	31,347,789.97	2.95
42	600546	山煤国际	30,583,379.05	2.88
43	601668	中国建筑	30,518,900.00	2.87
44	002422	科伦药业	30,326,949.02	2.86
45	601169	北京银行	30,274,453.34	2.85
46	002385	大北农	30,141,947.01	2.84
47	600285	羚锐制药	29,868,260.35	2.81
48	300177	中海达	29,093,582.10	2.74

49	000656	金科股份	29,037,223.94	2.73
50	300164	通源石油	28,741,333.88	2.71
51	002415	海康威视	28,475,742.63	2.68
52	600820	隧道股份	28,442,371.97	2.68
53	300197	铁汉生态	28,361,091.93	2.67
54	000926	福星股份	26,898,228.24	2.53
55	002358	森源电气	26,643,633.72	2.51
56	600686	金龙汽车	26,615,474.48	2.51
57	600702	沱牌舍得	26,463,407.92	2.49
58	601139	深圳燃气	26,391,235.45	2.48
59	002028	思源电气	26,281,719.14	2.47
60	300090	盛运股份	26,249,165.42	2.47
61	600315	上海家化	26,211,012.68	2.47
62	601328	交通银行	26,077,294.90	2.46
63	600761	安徽合力	25,921,797.12	2.44
64	600150	中国船舶	25,749,683.41	2.42
65	600000	浦发银行	25,550,950.00	2.41
66	002306	湘鄂情	25,281,540.78	2.38
67	600893	航空动力	25,021,873.99	2.36
68	601607	上海医药	24,974,831.57	2.35
69	002400	省广股份	24,973,477.48	2.35
70	600199	金种子酒	24,492,957.40	2.31
71	601699	潞安环能	23,200,187.29	2.18
72	002447	壹桥苗业	23,109,698.11	2.18
73	002273	水晶光电	23,001,667.17	2.17
74	002146	荣盛发展	22,917,945.75	2.16
75	601808	中海油服	22,766,758.48	2.14
76	601857	中国石油	22,088,090.00	2.08
77	002646	青青稞酒	22,079,655.08	2.08
78	000650	仁和药业	21,754,326.14	2.05
79	300146	汤臣倍健	21,693,139.78	2.04
80	002038	双鹭药业	21,552,201.02	2.03
81	300058	蓝色光标	21,529,637.88	2.03
82	002450	康得新	21,529,533.40	2.03
83	002024	苏宁电器	21,511,945.46	2.03

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	601166	兴业银行	131,584,118.51	12.39
2	000858	五粮液	112,634,668.67	10.61
3	600048	保利地产	102,389,803.89	9.64
4	600016	民生银行	99,476,831.58	9.37
5	601288	农业银行	86,790,574.00	8.17
6	002140	东华科技	85,704,574.32	8.07
7	600519	贵州茅台	81,578,837.80	7.68
8	600104	上汽集团	72,079,619.20	6.79
9	000799	酒鬼酒	68,706,379.94	6.47
10	601318	中国平安	62,012,358.21	5.84
11	600587	新华医疗	58,550,731.04	5.51
12	600315	上海家化	56,381,689.90	5.31
13	000568	泸州老窖	55,501,070.74	5.23
14	000522	白云山A	55,363,410.09	5.21
15	601328	交通银行	53,106,112.71	5.00
16	600518	康美药业	52,008,508.90	4.90
17	000157	中联重科	50,535,206.10	4.76
18	002236	大华股份	50,363,146.99	4.74
19	600340	华夏幸福	50,170,940.01	4.72
20	002447	壹桥苗业	49,851,891.28	4.69
21	600030	中信证券	49,625,683.97	4.67
22	600000	浦发银行	48,145,726.47	4.53
23	600383	金地集团	47,033,233.65	4.43
24	600199	金种子酒	44,588,780.79	4.20
25	601088	中国神华	43,720,465.59	4.12
26	600157	永泰能源	42,938,592.98	4.04
27	002353	杰瑞股份	42,589,335.55	4.01
28	002310	东方园林	42,548,646.11	4.01
29	600489	中金黄金	42,180,082.55	3.97
30	300146	汤臣倍健	40,809,579.38	3.84
31	002385	大北农	40,774,019.48	3.84
32	300020	银江股份	39,803,614.07	3.75

33	601988	中国银行	39,760,734.14	3.74
34	600837	海通证券	39,484,893.80	3.72
35	002294	信立泰	39,426,920.94	3.71
36	002408	齐翔腾达	38,679,698.02	3.64
37	300291	华录百纳	38,453,235.03	3.62
38	002456	欧菲光	38,159,642.07	3.59
39	002690	美亚光电	37,465,015.94	3.53
40	000826	桑德环境	36,975,493.42	3.48
41	000661	长春高新	35,852,321.78	3.38
42	601117	中国化学	35,000,645.90	3.30
43	300198	纳川股份	34,789,134.20	3.28
44	601888	中国国旅	33,961,860.68	3.20
45	601009	南京银行	33,950,512.77	3.20
46	600690	青岛海尔	32,346,921.91	3.05
47	300070	碧水源	30,940,216.36	2.91
48	601668	中国建筑	30,931,754.02	2.91
49	002422	科伦药业	30,723,162.14	2.89
50	600177	雅戈尔	30,683,503.12	2.89
51	601169	北京银行	30,191,236.05	2.84
52	300212	易华录	30,025,100.67	2.83
53	600585	海螺水泥	29,570,387.00	2.78
54	300090	盛运股份	28,869,327.60	2.72
55	300197	铁汉生态	27,713,678.25	2.61
56	000926	福星股份	27,597,410.27	2.60
57	600739	辽宁成大	26,841,894.65	2.53
58	600066	宇通客车	26,822,779.05	2.53
59	600761	安徽合力	26,521,339.71	2.50
60	002415	海康威视	26,459,472.69	2.49
61	002358	森源电气	26,279,778.18	2.47
62	300164	通源石油	25,394,578.68	2.39
63	300177	中海达	25,367,477.75	2.39
64	600809	山西汾酒	25,073,326.58	2.36
65	000651	格力电器	24,544,665.95	2.31
66	600702	沱牌舍得	23,971,483.88	2.26
67	600150	中国船舶	23,853,257.60	2.25
68	600546	山煤国际	23,768,435.43	2.24
69	002244	滨江集团	23,303,854.54	2.19
70	300058	蓝色光标	23,208,144.09	2.19

71	002450	康得新	22,603,836.18	2.13
72	002024	苏宁电器	22,486,673.89	2.12
73	601808	中海油服	22,397,529.19	2.11
74	002306	湘鄂情	22,259,223.84	2.10
75	002038	双鹭药业	22,246,250.19	2.09
76	601699	潞安环能	22,087,795.77	2.08
77	601139	深圳燃气	22,052,867.85	2.08
78	600820	隧道股份	21,957,248.74	2.07
79	600517	置信电气	21,915,835.25	2.06
80	002547	春兴精工	21,860,409.97	2.06
81	600285	羚锐制药	21,788,166.87	2.05
82	000963	华东医药	21,785,351.52	2.05
83	002241	歌尔声学	21,433,089.07	2.02
84	601857	中国石油	21,397,072.11	2.01
85	002646	青青稞酒	21,260,723.28	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	5,862,748,320.34
卖出股票收入（成交）总额	5,965,773,669.13

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	3,464,746.00	0.36

8	其他	-	-
9	合计	3,464,746.00	0.36

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	35,960	3,464,746.00	0.36

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	3,750,000.00
2	应收证券清算款	21,621,168.54
3	应收股利	-
4	应收利息	43,463.81
5	应收申购款	17,675.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	25,432,307.50

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	3,464,746.00	0.36

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
90,732	21,273.00	32,398,562.85	1.68%	1,897,742,939.74	98.32%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	4,215.03	0.0002%

注：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年3月19日）基金份额总额	6,777,723,584.78
本报告期期初基金份额总额	2,016,154,397.20
本报告期基金总申购份额	33,459,644.63
减：本报告期基金总赎回份额	119,472,539.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,930,141,502.59

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，因个人原因，崔健先生不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务，聘任陈德义先生担任该基金基金经理。

2、经华富基金管理有限公司第三届董事会第十三次会议（临时会议）书面审议通过，因个人原因，邹牧先生不再担任华富基金管理有限公司副总经理。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘郭晨先生为华富竞争力优选混合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，因工作安排，郭晨先生不再担任华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理职务，聘任朱蓓女士担任该基金基金经理。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，郭晨先生不再担任华富中证100指数证券投资基金基金经理职务，聘任朱蓓女士担任该基金基金经理。

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，郭锋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职务，聘任郭晨先生担任该基金基金经理。

7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘郭晨先生为华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

8、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，张琦先生不再担任华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理的职务。

9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘龚炜先生为华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。

10、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘龚炜先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理。

11、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，陈德义先生不再担任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理的职务。

12、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，陈德义先生不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

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

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需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	
民生证券	1	1,397,863,148.59	11.82%	1,172,562.04	11.47%	-
国泰君安	1	1,048,683,817.62	8.87%	894,010.93	8.75%	-
中信建投证券	2	1,043,910,898.81	8.83%	898,091.14	8.79%	-
海通证券	1	932,545,358.50	7.89%	813,648.30	7.96%	-
中信证券	1	757,089,601.83	6.40%	666,803.22	6.52%	-
华安证券	1	734,447,002.38	6.21%	668,637.69	6.54%	-
东北证券	1	715,804,945.20	6.05%	633,417.31	6.20%	-
国信证券	1	662,929,444.89	5.61%	552,731.92	5.41%	-
广发证券	1	646,175,274.79	5.46%	563,314.72	5.51%	-
华泰证券	1	562,651,488.58	4.76%	457,158.67	4.47%	-
东兴证券	1	552,244,216.86	4.67%	469,407.26	4.59%	-
国都证券	1	448,687,982.71	3.79%	389,601.13	3.81%	-
兴业证券	1	318,831,216.76	2.70%	279,118.66	2.73%	-
东方证券	1	302,777,924.92	2.56%	257,359.45	2.52%	-
国盛证券	1	270,988,176.01	2.29%	238,757.10	2.34%	-
中投证券	1	236,212,356.83	2.00%	209,024.59	2.05%	-
宏源证券	1	205,784,374.68	1.74%	184,676.72	1.81%	-
申银万国	1	168,654,367.85	1.43%	153,543.14	1.50%	-
国联证券	1	152,634,986.97	1.29%	135,067.21	1.32%	-
银河证券	1	139,933,696.33	1.18%	127,395.50	1.25%	-
中国国际金融 公司	2	132,936,854.30	1.12%	112,422.93	1.10%	-
厦门证券	1	129,318,387.05	1.09%	117,732.73	1.15%	-
中银证券	1	66,067,906.12	0.56%	55,705.59	0.55%	-
齐鲁证券	2	47,239,499.80	0.40%	41,802.08	0.41%	-
华创证券	1	45,050,735.64	0.38%	38,511.17	0.38%	-
国海证券	1	37,539,952.91	0.32%	33,219.15	0.33%	-
招商证券	2	36,755,568.41	0.31%	31,150.47	0.30%	-
首创证券	1	30,520,936.73	0.26%	24,798.69	0.24%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-

银泰证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：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民生证券、国盛证券、中信建投证券、东北证券、中投证券和齐鲁证券各一个交易单元，撤销了湘财证券、东海证券和渤海证券各一个席位。

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
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	21,383,468.20	18.85%	204,000,000.00	15.65%	-	-
海通证券	30,248,572.90	26.66%	314,000,000.00	24.08%	-	-
中信证券	22,052,548.80	19.44%	-	-	-	-
华安证券	-	-	199,900,000.00	15.33%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	212,000,000.00	16.26%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	46,000,000.00	3.53%	-	-
国都证券	-	-	141,000,000.00	10.81%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	39,769,280.70	35.05%	135,000,000.00	10.35%	-	-
国盛证券	-	-	16,900,000.00	1.30%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

申银万国	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 公司	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	35,000,000.00	2.68%	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。