

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2012 年年度报告

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：平安银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 28 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。

基金托管人平安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。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 2012 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
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
§4 管理人报告	9
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	39
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46

8.9 投资组合报告附注	47
§9 基金份额持有人信息.....	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
§10 开放式基金份额变动.....	48
§11 重大事件揭示.....	48
11.1 基金份额持有人大会决议	48
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	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	50
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8 其他重大事件	51
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§13 备查文件目录.....	55
13.1 备查文件目录	55
13.2 存放地点	55
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	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	257,309,675.37 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	平安银行股份有限公司
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	DONGYAN930@pingan.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95511
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	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号

邮政编码	200120	518001
法定代表人	章宏韬	孙建一

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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-12,055,604.02	-44,977,494.33	-32,323,151.19
本期利润	8,025,157.55	-62,853,401.07	-29,770,591.70
加权平均基金份额本期利润	0.0298	-0.2143	-0.0769
本期加权平均净值利润率	4.21%	-25.95%	-8.76%
本期基金份额净值增长率	4.07%	-23.86%	-7.33%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-83,813,802.60	-85,504,078.46	-38,432,498.63
期末可供分配基金份额利润	-0.3257	-0.3017	-0.1255
期末基金资产净值	186,992,685.29	197,915,220.02	280,874,186.55
期末基金份额净值	0.7267	0.6983	0.9171
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-27.33%	-30.17%	-8.29%

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

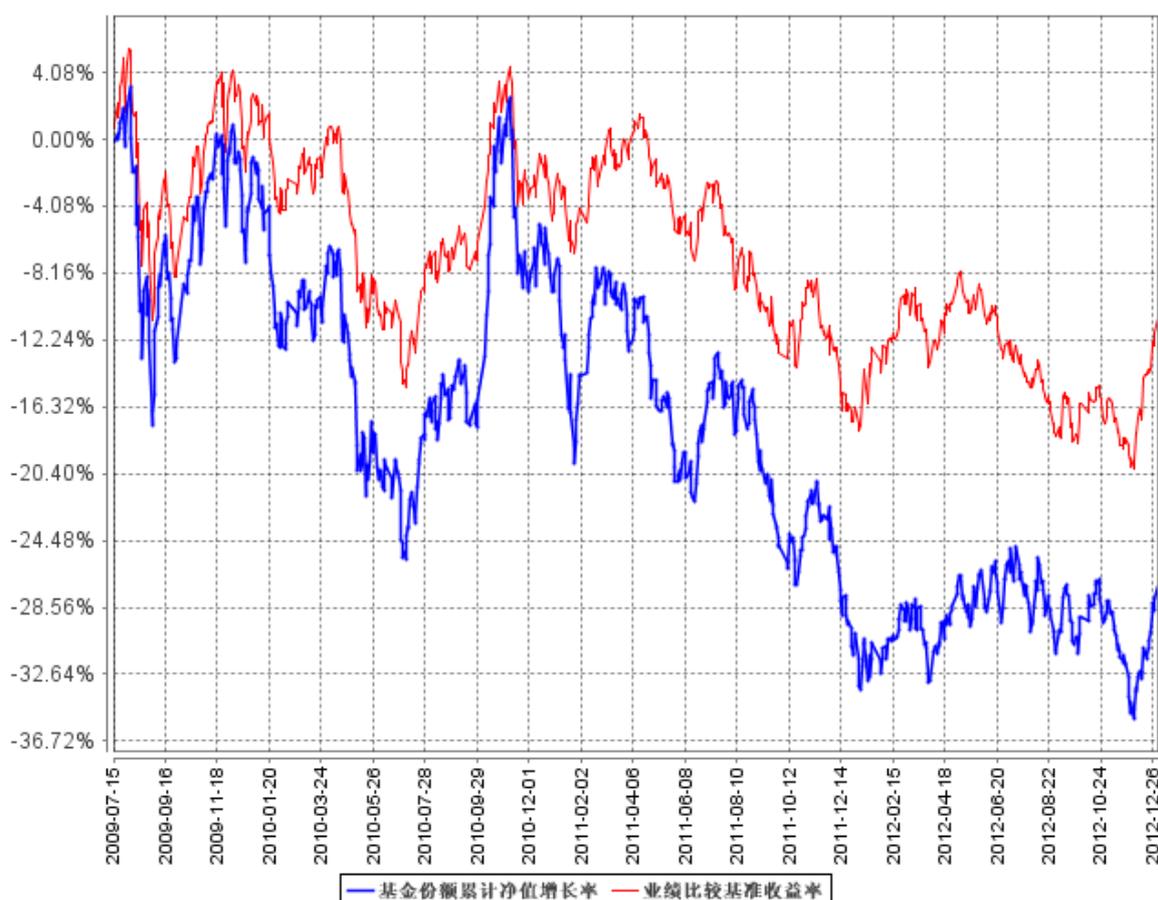
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.57%	0.90%	6.27%	0.77%	-3.70%	0.13%
过去六个月	-0.60%	0.99%	1.89%	0.74%	-2.49%	0.25%
过去一年	4.07%	1.06%	6.44%	0.76%	-2.37%	0.30%
过去三年	-26.57%	1.18%	-13.33%	0.84%	-13.24%	0.34%
自基金合同生效起至今	-27.33%	1.25%	-10.91%	0.91%	-16.42%	0.34%

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

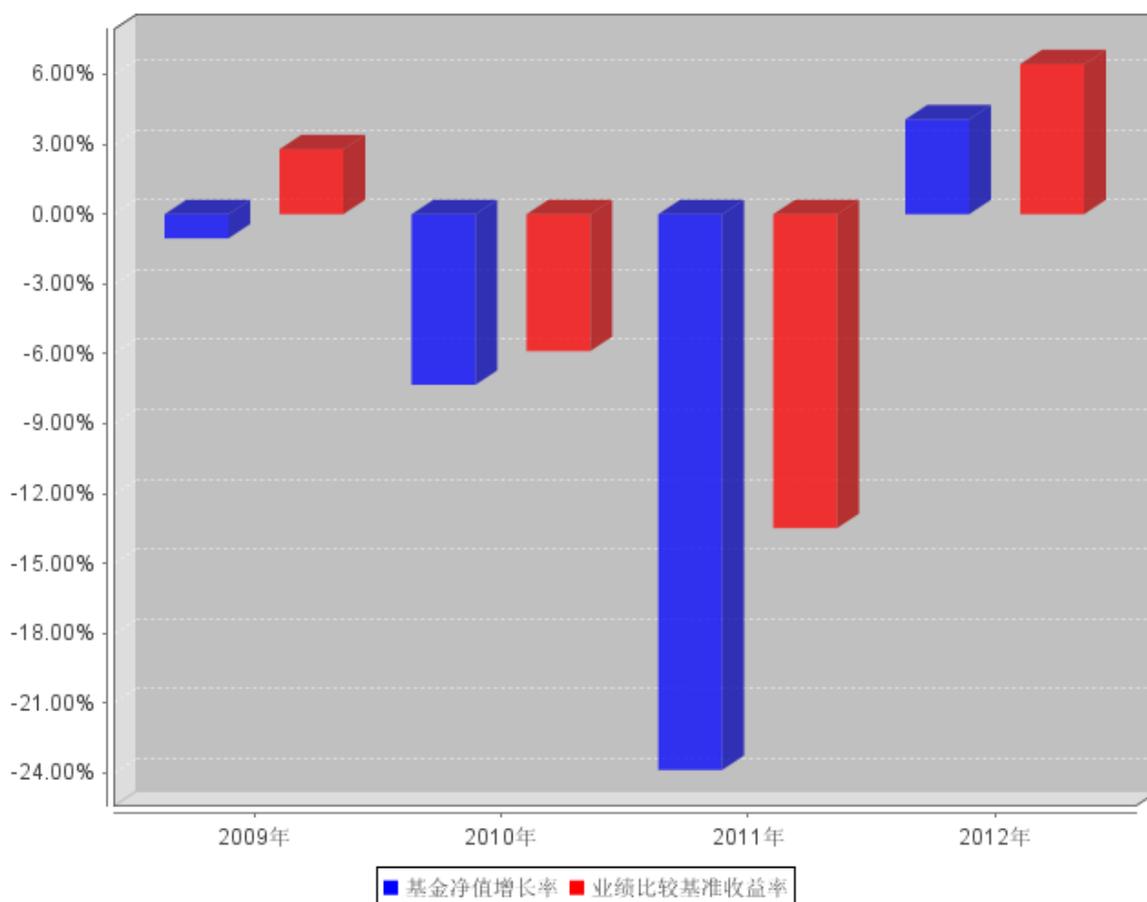
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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
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		
郭锋	华富价值增长基金基金经理	2010年12月27日	2012年12月19日	五年	香港大学工商管理学硕士、复旦大学国际企业管理专业本科，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。
郭晨	华富价值增长混合基金基金经理、华富竞争力优选基金基金经理、华富策略精选混合基金基金经理	2012年12月19日	-	五年	四川大学技术经济及管理专业硕士、研究生学历，历任平安资产管理有限责任公司投资绩效分析师、东吴基金管理有限公司金融工程研究员，2009年11月进入华富基金管理有限公司任华富中证100指数基金基金经理助理，2011年12月9日至2012年12月19日担任华富中小板指数增强型基金基金经理，2010年12月27日至2012年12月19日担任华富中证100指数基金基金经理。

注：郭锋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；郭晨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持。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 年的市场是一个 N 型走势，开头和结尾上涨，但时间较短，年中大多数时间，市场处于下跌之中，虽然上证综指最终勉强收出了阳线，但是投资者今年赚钱并不容易，心理上也相当的煎熬，上证综指一度跌破了 2000 点的关口，成交量极度萎缩，市场处于信心崩溃的边缘。

2012 年年初的反弹主要是对 2011 年熊市的一个修复，纠正当时对实体经济过于悲观的预期，市场预期政策放松和流动性的改善。二季度海外欧债危机严重，国内基本面也不乐观，GDP 增速仍处于探底的过程之中，通胀下行，上市公司的盈利非常不乐观，研究员不断地下调企业的盈利预测，另一方面宏观调控政策开始放松，稳增长的意图明显，二季度国内央行首次下调基准利率。在这种情况下，市场处于对基本面的忧虑和对政策刺激的纠结当中，不断的震荡，指数波动不大，但是市场的结构性机会明显，许多业绩明确，行业受经济周期影响较小的个股依然表现良好。三季度 GDP 同比增速继续探底，看不到回升的迹象，市场对经济预期悲观，微观层面上上市公司的半年报普遍不给力，研究员对上市公司的业绩预期不断下调进一步打击了投资者的信心。在政策上，三季度也没有出现之前市场预期的放松，政府继续强化对房地产市场的调控，严防房价报复性反弹，信贷在低位徘徊，银行担忧信用风险依然惜贷，企业层面也没有很强的信贷需求，去产能的过程在三季度持续，企业投资不断收缩。政府吸取了 08 年应对经济危机时宽松政策的教训，希望借此调整积极推进经济转型和结构调整。四季度的市场呈现出冰火两重天的格局，市场期待的十八大维稳行情在十月、十一月并没有如期到来，之后市场信心崩溃，不断下跌，一度击穿 2000 点，进入 12 月份之后，市场出现了戏剧性的变化，12 月份上证综指单月涨幅 14.6%，成交量显著

放大。进入四季度后，各项经济数据开始出现见底回升的态势，经济基本面触底已经逐步明确，PMI 数据开始回升，企业去库存的过程逐渐完成。政府为了稳定经济，也推出了一系列的措施，比如增加铁路等行业的基础设施建设，虽说此次不比 08、09 年四万亿措施来的猛，但是在经济转型的大背景下，适度刺激以稳定增长更合情合理。

2012 年的市场跌宕起伏，对本基金管理团队的业务水平和心理都是很大的考验。在经济不确定的情况下，本基金在仓位上并不激进，上半年市场较为活跃，本基金自下而上的寻找一些业绩增长确定、行业受经济周期影响较小，符合经济转型和结构调整的个股，如白酒、医药进行集中配置，下半年市场逐渐变差，本基金对前面获利较多的重仓股逐渐兑现，将行业和个股逐渐分散配置，增加银行等相对估值较低的品种进行防御也取得了不错的效果。

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 0.7267 元，累计份额净值为 0.7267 元；本报告期份额净值增长率为 4.07%，同期业绩比较基准收益率为 6.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2013 年，市场机会和风险并存，现在判断市场是否迎来了新一轮大牛市还为时尚早，经济触底企稳已经得到了市场的认同，最大的争议在于经济复苏的强度，一季度出现负面经济数据的可能性不大，同时一季度的流动性一般较为充裕，历史上看，一季度甚至上半年市场表现较好的概率是比较大的，因此市场在年初有进一步上冲的动力，估值修复过程完成之后的走势还取决于经济复苏的强度，如果弱于之前市场的预期，市场将难免出现调整。

中国经济在经历了 30 年的高速增长之后逐渐进入瓶颈期，前面那种粗放的增长模式已经不可持续，未来 GDP 增速下台阶是必然的，转型和调整是唯一出路，在这种大背景之下，我们认为中国资本市场的长期趋势以结构性行情为主，阿尔法收益成为市场投资的主流，同涨同跌的贝塔收益将越来越弱也越来越难以把握，这两年的市场已经初露端倪，这种背景之下，传统的强周期性行业的投资机会将越来越小，波动周期将越来越短，幅度也弱于从前，投资机会主要会集中在适合经济转型的新兴产业，消费类行业等，细分子行业的成长型投资机会多于大行业的整体机会，专业的机构投资者在这种趋势下也将越来越具有优势，本基金将以这种思路来主导未来的操作，我们希望能够把握这种趋势，安心对行业和上市公司的基本面做深入的研究，在中国后工业化的时代，寻找到能够由小变大，由弱变强的上市公司，在合适的时点买入，长期持有其股票获取收益，同时适度参与比较明确的周期性机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2012 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，新制定了基金交易席位管理办法、产品审核小组职责及产品开发工作流程、金融工程小组工作职责等制度，修订了基金从业人员投资证券投资基金管理办法、自有资金投资管理实施细则等制度。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投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益

冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 8,025,157.55 元，期末可供分配利润为-83,813,802.60 元。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，平安银行股份有限公司（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（2013）6-29 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	我们审计了后附的华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华富价值增长基金”）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	<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价值增长基金 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。	
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：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	27,089,914.05	57,592,143.58
结算备付金		1,919,822.46	1,264,518.57
存出保证金		500,000.00	1,989,332.20
交易性金融资产	7.4.7.2	144,397,688.73	160,318,622.95
其中：股票投资		135,529,388.73	154,643,822.95
基金投资		-	-
债券投资		8,868,300.00	5,674,800.00
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	20,000,150.00	10,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	65,797.74	39,399.21
应收股利		-	-
应收申购款		9,781.66	16,854.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		193,983,154.64	231,220,870.62
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,297,287.83	31,475,277.49
应付赎回款		274,950.27	64,393.24
应付管理人报酬		224,580.29	262,644.30
应付托管费		37,430.04	43,774.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	167,986.05	451,949.25
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	988,234.87	1,007,612.26
负债合计		6,990,469.35	33,305,650.60
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	257,309,675.37	283,419,298.48
未分配利润	7.4.7.10	-70,316,990.08	-85,504,078.46
所有者权益合计		186,992,685.29	197,915,220.02
负债和所有者权益总计		193,983,154.64	231,220,870.62

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7267 元，基金份额总额, 257, 309, 675. 37 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	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		13,894,003.71	-50,437,128.73
1. 利息收入		646,913.91	747,510.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	197,511.21	371,953.72
债券利息收入		104,969.93	24,087.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		344,432.77	351,468.52
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,852,926.29	-33,338,394.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-8,248,183.03	-31,549,244.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-163,597.30	-2,542,374.30
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	1,558,854.04	753,224.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	20,080,761.57	-17,875,906.74
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	19,254.52	29,662.29
减：二、费用		5,868,846.16	12,416,272.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,861,123.48	3,638,322.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	476,853.91	606,387.17
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,072,468.77	7,693,562.19
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	458,400.00	478,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,025,157.55	-62,853,401.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,025,157.55	-62,853,401.07

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：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）	283,419,298.48	-85,504,078.46	197,915,220.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,025,157.55	8,025,157.55
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）	-26,109,623.11	7,161,930.83	-18,947,692.28
其中：1. 基金申购款	20,688,023.48	-6,163,309.42	14,524,714.06
2. 基金赎回款	-46,797,646.59	13,325,240.25	-33,472,406.34
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）	257,309,675.37	-70,316,990.08	186,992,685.29
项目	上年度可比期间 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

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）验资并出具天健华证验（2009）综字第 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 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 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记入当期损益。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

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

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

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

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

自 2006 年 11 月 13 日起基金新投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分认为估值增值。

7.4.4.5.2 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘净价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

7.4.4.5.3 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

7.4.4.5.4 如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。债券利息收入在债券实际持有期内逐

日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的，可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

7.4.4.10.1 基金管理人报酬

根据《华富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 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	27,089,914.05	57,592,143.58
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	27,089,914.05	57,592,143.58

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	121,024,397.22	135,529,388.73	14,504,991.51	
债券	交易所市场	8,872,109.63	8,868,300.00	-3,809.63
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,872,109.63	8,868,300.00	-3,809.63
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	129,896,506.85	144,397,688.73	14,501,181.88	
项目	上年度末 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	

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 2012 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	20,000,150.00	-
合计	20,000,150.00	-
项目	上年度末 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	-

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 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,043.13	10,825.07
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	950.40	625.90
应收债券利息	45,172.61	22,408.77
应收买入返售证券利息	14,631.60	4,861.12
应收申购款利息	-	18.35
其他	-	660.00
合计	65,797.74	39,399.21

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 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

交易所市场应付交易费用	167,836.05	451,949.25
银行间市场应付交易费用	150.00	-
合计	167,986.05	451,949.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	685.59	62.98
应付信息披露费	360,000.00	360,000.00
应付审计费	80,000.00	100,000.00
应付债券税金	47,549.28	47,549.28
合计	988,234.87	1,007,612.26

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	283,419,298.48	283,419,298.48
本期申购	20,688,023.48	20,688,023.48
本期赎回（以“-”号填列）	-46,797,646.59	-46,797,646.59
本期末	257,309,675.37	257,309,675.37

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	-80,064,753.39	-5,439,325.07	-85,504,078.46
本期利润	-12,055,604.02	20,080,761.57	8,025,157.55
本期基金份额交易产生的变动数	8,306,554.81	-1,144,623.98	7,161,930.83
其中：基金申购款	-6,273,180.05	109,870.63	-6,163,309.42
基金赎回款	14,579,734.86	-1,254,494.61	13,325,240.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-83,813,802.60	13,496,812.52	-70,316,990.08

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
	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
活期存款利息收入	175,025.68	317,447.17
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	19,658.08	37,408.17
其他	2,827.45	17,098.38
合计	197,511.21	371,953.72

注：其他所列本期金额包括权证保证金利息收入 2,805.00 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 22.45 元；所列上年度可比期间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。

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
	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
卖出股票成交总额	692,825,423.06	2,524,596,085.82
减：卖出股票成本总额	701,073,606.09	2,556,145,330.41
买卖股票差价收入	-8,248,183.03	-31,549,244.59

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	33,681,594.50	280,267,209.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,743,019.41	282,253,578.91
减：应收利息总额	102,172.39	556,004.82
债券投资收益	-163,597.30	-2,542,374.30

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 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
股票投资产生的股利收益	1,558,854.04	753,224.44
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,558,854.04	753,224.44

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	20,080,761.57	-17,875,906.74
——股票投资	20,099,684.76	-17,895,453.97
——债券投资	-18,923.19	19,547.23
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	20,080,761.57	-17,875,906.74

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	5,644.34	15,200.17
转换费收入	13,610.18	14,462.12
合计	19,254.52	29,662.29

7.4.7.19 交易费用

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
----	-----------------------------	----------------------------------

	月 31 日	31 日
交易所市场交易费用	2,072,468.77	7,693,562.19
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,072,468.77	7,693,562.19

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	80,000.00	100,000.00
信息披露费	360,000.00	360,000.00
自营托管账户维护费	18,400.00	18,000.00
合计	458,400.00	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
平安银行股份有限公司	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

7.4.10 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 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	2,861,123.48	3,638,322.98
其中：支付销售机构的客户维护费	545,036.15	724,337.43

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 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	476,853.91	606,387.17

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 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
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	19.43%	17.64%
-----------------------	--------	--------

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	27,089,914.05	175,025.68	57,592,143.58	317,447.17

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（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
000002	万科A	2012年12月26日	重大事项停牌	10.12	2013年1月21日	11.13	420,000	3,729,330.66	4,250,400.00	

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发行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

本报告期末及上年度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 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
AAA	8,868,300.00	5,674,800.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	8,868,300.00	5,674,800.00
----	--------------	--------------

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 2012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	27,089,914.05	-	-	-	-	-	27,089,914.05
结算备付金	1,919,822.46	-	-	-	-	-	1,919,822.46
存出保证金	-	-	-	-	-	500,000.00	500,000.00

交易性金融资产		-3,087,300.00	5,781,000.00			-135,529,388.73	144,397,688.73
买入返售金融资产	20,000,150.00						20,000,150.00
应收利息						65,797.74	65,797.74
应收申购款						9,781.66	9,781.66
资产总计	49,009,886.51	3,087,300.00	5,781,000.00			-136,104,968.13	193,983,154.64
负债							
应付证券清算款						5,297,287.83	5,297,287.83
应付赎回款						274,950.27	274,950.27
应付管理人报酬						224,580.29	224,580.29
应付托管费						37,430.04	37,430.04
应付交易费用						167,986.05	167,986.05
应交税费							
其他负债						988,234.87	988,234.87
负债总计						6,990,469.35	6,990,469.35
利率敏感度缺口	49,009,886.51	3,087,300.00	5,781,000.00			-129,114,498.78	186,992,685.29
上年度末 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

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(2012 年 12 月 31 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 25 基点	77,949.65	-
	市场利率上升 25 基点	-76,774.05	-

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		上年度末 2011 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	135,529,388.73	72.48	154,643,822.95	78.14
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	8,868,300.00	4.74	5,674,800.00	2.87
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	144,397,688.73	77.22	160,318,622.95	81.00

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 (2012 年 12 月 31 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	5,961,844.14	7,049,041.25
	沪深 300 指数下降 5%	-5,961,844.14	-7,049,041.25

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（2012 年 12 月 31 日）	上年度末（2011 年 12 月 31 日）
	合计	2,932,611.73	3,289,678.27

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	2012 年 12 月 31 日公允价值	2011 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	140,147,288.73	160,318,622.95
第二层次	4,250,400.00	-
第三层次	-	-
合计	144,397,688.73	160,318,622.95

§ 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	135,529,388.73	69.87
	其中：股票	135,529,388.73	69.87
2	固定收益投资	8,868,300.00	4.57
	其中：债券	8,868,300.00	4.57
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,150.00	10.31

	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	29,009,736.51	14.95
6	其他各项资产	575,579.40	0.30
7	合计	193,983,154.64	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	2,231,230.00	1.19
B	采掘业	5,181,200.00	2.77
C	制造业	67,941,623.33	36.33
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	702,000.00	0.38
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,300,878.50	4.44
C5	电子	8,509,733.68	4.55
C6	金属、非金属	5,179,625.50	2.77
C7	机械、设备、仪表	21,598,978.37	11.55
C8	医药、生物制品	23,650,407.28	12.65
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,078,814.82	4.32
E	建筑业	4,299,000.00	2.30
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	3,653,600.00	1.95
H	批发和零售贸易	3,973,670.90	2.13
I	金融、保险业	14,300,150.00	7.65
J	房地产业	15,486,218.03	8.28
K	社会服务业	4,512,881.65	2.41
L	传播与文化产业	4,086,000.00	2.19
M	综合类	1,785,000.00	0.95
	合计	135,529,388.73	72.48

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	600016	民生银行	700,000	5,502,000.00	2.94

2	300228	富瑞特装	150,000	5,100,000.00	2.73
3	000002	万科A	420,000	4,250,400.00	2.27
4	600276	恒瑞医药	130,000	3,913,000.00	2.09
5	002230	科大讯飞	110,000	3,333,000.00	1.78
6	002250	联化科技	169,363	3,302,578.50	1.77
7	002028	思源电气	219,950	3,068,302.50	1.64
8	002325	洪涛股份	200,000	3,060,000.00	1.64
9	600535	天士力	55,000	3,039,850.00	1.63
10	601166	兴业银行	180,000	3,004,200.00	1.61
11	300136	信维通信	179,988	2,878,008.12	1.54
12	601139	深圳燃气	300,000	2,859,000.00	1.53
13	600011	华能国际	400,000	2,856,000.00	1.53
14	600340	华夏幸福	100,000	2,823,000.00	1.51
15	600048	保利地产	199,916	2,718,857.60	1.45
16	600315	上海家化	50,000	2,549,500.00	1.36
17	000651	格力电器	99,975	2,549,362.50	1.36
18	600027	华电国际	599,953	2,363,814.82	1.26
19	600517	置信电气	169,997	2,345,958.60	1.25
20	000661	长春高新	38,000	2,321,800.00	1.24
21	002653	海思科	80,000	2,200,000.00	1.18
22	000679	大连友谊	300,000	2,163,000.00	1.16
23	000898	鞍钢股份	550,000	2,134,000.00	1.14
24	000024	招商地产	69,998	2,092,240.22	1.12
25	300058	蓝色光标	90,000	2,070,000.00	1.11
26	300133	华策影视	120,000	2,016,000.00	1.08
27	002509	天广消防	140,000	1,993,600.00	1.07
28	600436	片仔癀	17,982	1,958,599.44	1.05
29	002236	大华股份	41,000	1,900,350.00	1.02
30	300070	碧水源	47,000	1,884,700.00	1.01
31	300115	长盈精密	69,902	1,871,975.56	1.00
32	002400	省广股份	80,000	1,848,800.00	0.99
33	600805	悦达投资	150,000	1,785,000.00	0.95
34	600256	广汇能源	100,000	1,639,000.00	0.88
35	600030	中信证券	120,000	1,603,200.00	0.86
36	600557	康缘药业	69,950	1,454,960.00	0.78
37	300124	汇川技术	59,963	1,436,113.85	0.77
38	300016	北陆药业	95,000	1,415,500.00	0.76
39	600104	上汽集团	80,000	1,411,200.00	0.75
40	601088	中国神华	55,000	1,394,250.00	0.75

41	000538	云南白药	20,000	1,360,000.00	0.73
42	002041	登海种业	54,925	1,296,230.00	0.69
43	600085	同仁堂	70,000	1,247,400.00	0.67
44	002273	水晶光电	60,000	1,243,800.00	0.67
45	300037	新宙邦	80,000	1,242,400.00	0.66
46	002482	广田股份	60,000	1,239,000.00	0.66
47	002271	东方雨虹	79,982	1,219,725.50	0.65
48	002038	双鹭药业	29,914	1,183,397.84	0.63
49	002603	以岭药业	50,000	1,163,500.00	0.62
50	600547	山东黄金	30,000	1,144,800.00	0.61
51	600585	海螺水泥	60,000	1,107,000.00	0.59
52	601628	中国人寿	50,000	1,070,000.00	0.57
53	600383	金地集团	150,000	1,053,000.00	0.56
54	601311	骆驼股份	120,000	1,050,000.00	0.56
55	000562	宏源证券	55,000	1,036,750.00	0.55
56	002353	杰瑞股份	20,000	952,800.00	0.51
57	600867	通化东宝	100,000	950,000.00	0.51
58	600157	永泰能源	100,000	941,000.00	0.50
59	002477	雏鹰农牧	50,000	935,000.00	0.50
60	300009	安科生物	80,000	916,800.00	0.49
61	002690	美亚光电	35,000	852,250.00	0.46
62	300159	新研股份	50,000	790,000.00	0.42
63	000776	广发证券	50,000	771,000.00	0.41
64	600489	中金黄金	45,000	748,350.00	0.40
65	002303	美盈森	40,000	702,000.00	0.38
66	000417	合肥百货	99,910	698,370.90	0.37
67	002408	齐翔腾达	40,000	670,400.00	0.36
68	600587	新华医疗	19,962	621,017.82	0.33
69	600703	三安光电	45,000	615,600.00	0.33
70	000501	鄂武商 A	50,000	575,000.00	0.31
71	002285	世联地产	39,999	559,586.01	0.30
72	601169	北京银行	60,000	558,000.00	0.30
73	600036	招商银行	40,000	550,000.00	0.29
74	600280	南京中商	15,000	537,300.00	0.29
75	300054	鼎龙股份	20,000	536,000.00	0.29
76	600518	康美药业	40,000	525,600.00	0.28
77	600581	八一钢铁	80,000	474,400.00	0.25
78	000581	威孚高科	11,949	381,173.10	0.20
79	600823	世茂股份	29,926	350,134.20	0.19

80	601117	中国化学	40,000	329,600.00	0.18
81	600406	国电南瑞	20,000	320,600.00	0.17
82	600019	宝钢股份	50,000	244,500.00	0.13
83	000069	华侨城 A	30,000	225,000.00	0.12
84	300347	泰格医药	3,947	224,781.65	0.12
85	600837	海通证券	20,000	205,000.00	0.11

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	600616	金枫酒业	22,883,942.02	11.56
2	600702	沱牌舍得	21,256,682.47	10.74
3	002447	壹桥苗业	17,878,350.28	9.03
4	300228	富瑞特装	14,407,714.44	7.28
5	600276	恒瑞医药	13,164,200.84	6.65
6	600519	贵州茅台	11,923,532.27	6.02
7	600030	中信证券	9,636,255.00	4.87
8	000979	中弘股份	8,816,625.07	4.45
9	600016	民生银行	8,788,483.00	4.44
10	600585	海螺水泥	8,360,095.55	4.22
11	000608	阳光股份	8,001,299.19	4.04
12	600315	上海家化	7,483,642.75	3.78
13	601601	中国太保	6,500,517.77	3.28
14	000401	冀东水泥	6,430,048.75	3.25
15	600887	伊利股份	5,876,132.00	2.97
16	601088	中国神华	5,824,730.02	2.94
17	600256	广汇能源	5,748,901.14	2.90
18	601628	中国人寿	5,534,786.60	2.80
19	002576	通达动力	5,489,968.52	2.77
20	000002	万科 A	5,465,079.02	2.76
21	601336	新华保险	5,366,568.62	2.71
22	002405	四维图新	5,149,522.60	2.60
23	000527	美的电器	5,081,405.25	2.57

24	600779	水井坊	4,860,631.94	2.46
25	600976	武汉健民	4,824,459.22	2.44
26	000895	双汇发展	4,822,890.00	2.44
27	000563	陕国投 A	4,719,119.27	2.38
28	002653	海思科	4,716,718.60	2.38
29	600867	通化东宝	4,684,738.93	2.37
30	002603	以岭药业	4,663,627.22	2.36
31	000738	中航动控	4,630,998.63	2.34
32	002106	莱宝高科	4,404,876.28	2.23
33	600141	兴发集团	4,352,211.33	2.20
34	000750	国海证券	4,306,461.57	2.18
35	002450	康得新	4,248,715.98	2.15
36	002140	东华科技	4,088,092.85	2.07
37	300257	开山股份	3,980,144.50	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	600702	沱牌舍得	23,591,458.84	11.92
2	600616	金枫酒业	22,115,367.53	11.17
3	600256	广汇能源	20,448,947.18	10.33
4	002447	壹桥苗业	20,093,718.52	10.15
5	600276	恒瑞医药	15,245,680.19	7.70
6	600406	国电南瑞	12,882,453.67	6.51
7	300228	富瑞特装	12,606,063.86	6.37
8	600519	贵州茅台	12,156,407.22	6.14
9	002603	以岭药业	10,578,460.28	5.34
10	000581	威孚高科	10,355,726.35	5.23
11	000979	中弘股份	9,380,258.09	4.74
12	600062	华润双鹤	9,071,230.73	4.58
13	000608	阳光股份	8,699,358.07	4.40
14	600030	中信证券	8,260,462.26	4.17
15	600036	招商银行	8,184,655.00	4.14
16	002266	浙富股份	7,243,000.55	3.66

17	000799	酒 鬼 酒	7,211,855.71	3.64
18	600585	海螺水泥	7,171,322.73	3.62
19	600104	上汽集团	7,050,380.07	3.56
20	000527	美的电器	6,676,215.26	3.37
21	601601	中国太保	6,290,947.26	3.18
22	600535	天士力	6,210,372.94	3.14
23	000401	冀东水泥	6,199,247.07	3.13
24	600887	伊利股份	6,020,374.96	3.04
25	600315	上海家化	5,599,048.30	2.83
26	002283	天润曲轴	5,310,642.51	2.68
27	002094	青岛金王	5,154,664.64	2.60
28	300218	安利股份	5,068,948.28	2.56
29	002576	通达动力	5,057,726.30	2.56
30	600048	保利地产	5,028,687.93	2.54
31	601336	新华保险	4,978,344.90	2.52
32	600976	武汉健民	4,897,640.26	2.47
33	600016	民生银行	4,890,090.12	2.47
34	000563	陕国投 A	4,816,140.06	2.43
35	000750	国海证券	4,793,519.70	2.42
36	601628	中国人寿	4,760,920.08	2.41
37	000738	中航动控	4,749,160.50	2.40
38	000895	双汇发展	4,672,412.10	2.36
39	002036	宜科科技	4,639,735.11	2.34
40	600141	兴发集团	4,603,371.41	2.33
41	002140	东华科技	4,580,516.81	2.31
42	601088	中国神华	4,558,460.75	2.30
43	600188	兖州煤业	4,513,214.29	2.28
44	600779	水井坊	4,426,420.09	2.24
45	002450	康得新	4,424,775.79	2.24
46	002405	四维图新	4,312,448.68	2.18
47	000002	万 科 A	4,155,316.02	2.10
48	600383	金地集团	4,116,898.93	2.08

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	661,859,487.11
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	692,825,423.06
--------------	----------------

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	8,868,300.00	4.74
8	其他	-	-
9	合计	8,868,300.00	4.74

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	5,781,000.00	3.09
2	110015	石化转债	30,000	3,087,300.00	1.65

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	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,797.74
5	应收申购款	9,781.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	575,579.40

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	5,781,000.00	3.09
2	110015	石化转债	3,087,300.00	1.65

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	4,250,400.00	2.27	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
5,533	46,504.55	90,345,977.89	35.11%	166,963,697.48	64.89%

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	-	-

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（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	283,419,298.48
本报告期基金总申购份额	20,688,023.48
减：本报告期基金总赎回份额	46,797,646.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	257,309,675.37

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。

13、2012 年 11 月 21 日，基金托管人平安银行股份有限公司收到《中国银监会关于平安银行孙建一、邵平任职资格的批复》（银监复〔2012〕679 号），核准孙建一平安银行董事长、邵平安银行行长的任职资格。此前收到《深圳银监局关于平安银行孙建一等任职资格的批复》（深银监复〔2012〕381 号），核准孙建一、邵平平安银行董事的任职资格。理查德·杰克逊（Richard

Jackson) 先生不再担任平安银行股份有限公司董事、行长职务,肖遂宁先生不再担任平安银行股份有限公司董事、董事长职务。11 月 28 日平安银行取得新的《企业法人营业执照》,法定代表人变更为孙建一。

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 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	
国信证券	2	611,845,812.52	45.17%	515,749.07	44.68%	-
申银万国	1	377,036,955.11	27.83%	321,676.70	27.86%	-
光大证券	1	296,255,570.28	21.87%	253,684.15	21.97%	-
齐鲁证券	1	69,546,572.26	5.13%	63,314.88	5.48%	-

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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比 例		券回购 成交总额 的比例		成交总额的 比例
国信证券	33,291,738.80	47.00%	569,000,000.00	39.90%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
光大证券	34,438,655.70	48.62%	562,000,000.00	39.41%	-	-
齐鲁证券	3,103,063.30	4.38%	295,000,000.00	20.69%	-	-

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。本报告期本基金撤销了厦门证券交易单元。

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基金改聘会计师事务所的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012年1月14日
2	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金2011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	2012年1月20日
3	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国建设银行电子渠道基金申购费率及定投申购优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012年2月16日
4	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2012年第1号）》及其摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012年3月1日
5	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加申银万国证券网上交易和电话委托申购费率优惠活动及开通定投业务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012年3月14日

6	《华富价值增长灵活配置型证券投资基金 2011 年年度报告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2012 年 3 月 30 日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加工商银行个人电子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	2012 年 3 月 31 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国泰君安证券开放式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	2012 年 4 月 9 日
9	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2012 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	2012 年 4 月 23 日
10	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东吴证券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	2012 年 4 月 27 日
11	《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	2012 年 5 月 16 日
12	《华富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2012 年 5 月 31 日
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机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	2012 年 6 月 29 日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信银行	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证	2012 年 6 月 29 日

	电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	券时报》上公告	
15	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2012 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	2012 年 7 月 18 日
16	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金托管人名称变更的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012 年 8 月 4 日
17	《华富价值增长灵活配置型证券投资基金 2012 年半年度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012 年 8 月 28 日
18	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2012 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	2012 年 8 月 30 日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012 年 8 月 31 日
20	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加杭州数米基金销售有限公司基金申购及转换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	2012 年 8 月 31 日
21	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中山证券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	2012 年 9 月 10 日
22	《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	2012 年 9 月 26 日
23	《华富价值增长灵活配置混合型	在《中国证券报》、	2012 年 10 月 26 日

	证券投资基金 2012 年第 3 季度报告》	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
24	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012 年 11 月 17 日
25	《华富基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012 年 12 月 22 日
26	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加农业银行为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012 年 12 月 24 日
27	《华富基金管理有限公司关于新增银联通网上交易平台的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2012 年 12 月 24 日
28	《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 2013 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	2012 年 12 月 28 日
29	《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中信建投证券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	2012 年 12 月 28 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 2 月 9 日，基金托管人深圳发展银行股份有限公司临时股东大会审议通过了《深圳发展银行股份有限公司关于更名的议案》，同意深圳发展银行股份有限公司的中文名称由“深圳发展银行股份有限公司”变更为“平安银行股份有限公司”，英文名称由“Shenzhen Development Bank Co., Ltd.”变更为“Ping An Bank Co., Ltd.”。

2012 年 4 月 26 日，深圳发展银行股份有限公司发布关于与平安集团等关联方持续性日常关

联交易的公告，具体内容见当日公告。

2012 年 4 月 26 日，收到《中国银监会关于深圳发展银行吸收合并平安银行的批复》（银监复〔2012〕192 号），同意深圳发展银行股份有限公司吸收合并平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”），平安银行法人资格终止，并将平安银行所属分支机构变更为本行分支机构。

2012 年 6 月 13 日，平安银行收到深圳市市场监督管理局出具的《企业注销通知书》，核准平安银行于 2012 年 6 月 12 日注销登记。平安银行注销后，其分支机构成为深圳发展银行股份有限公司的分支机构，其全部资产、负债、证照、许可、业务以及人员均由深发展依法承继，附着于其资产上的全部权利和义务亦由深圳发展银行股份有限公司依法享有和承担。

2012 年 6 月 15 日，深圳发展银行股份有限公司完成吸收合并平安银行的所有法律手续，深圳发展银行股份有限公司和平安银行（“原两行”）正式合并为一家银行。

2012 年 7 月，中国银行业监督管理委员会以《中国银监会关于深圳发展银行更名的批复》（银监复〔2012〕397 号）批准了深圳发展银行股份有限公司的名称变更。

2012 年 7 月 27 日，深圳发展银行股份有限公司在深圳市市场监督管理局办理完毕名称变更手续，并取得新的《企业法人营业执照》。

2012 年 8 月 2 日起，经深圳证券交易所核准，深圳发展银行股份有限公司证券简称发生变更，变更后的证券简称为“平安银行”，证券代码 000001 不变。

2012 年 11 月 7 日，平安银行股份有限公司对公司股东、关联方及公司尚未履行完毕的承诺情况进行专项披露，具体内容见平安银行股份有限公司公开披露信息。

§ 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。