

# 华富竞争力优选混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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       | 华富竞争力优选混合型证券投资基金   |
| 基金简称       | 华富竞争力优选混合          |
| 基金主代码      | 410001             |
| 交易代码       | 410001             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2005 年 3 月 2 日     |
| 基金管理人      | 华富基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,684,386,782.98 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略，对基金投资风险的控制遵循“事前防范、事中控制、事后评估”的风险控制程序，运用华富 PMC 选股系统，力求实现基金资产的中长期稳定增值                    |
| 投资策略   | 在资产配置方面，采用自上而下的方法，确定各类资产的权重；在行业及股票选择方面，利用自身开发的“华富 PMC 选股系统”进行行业及股票综合筛选；在债券选择方面，通过研究宏观经济、国家政策及收益率曲线，积极调整债券组合的久期结构。 |
| 业绩比较基准 | 60%×中信标普 300 指数+35%×中信标普全债指数+5%×同业存款利率  |
| 风险收益特征 | 本基金属于中等风险的混合型基金，其风险收益特征从长期平均来看，介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间。基金管理人通过适度主动的资产配置与积极主动的精选证券，实现风险限度内的合理回报。                     |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人            | 基金托管人                |
|---------|------|------------------|----------------------|
| 名称      |      | 华富基金管理有限公司       | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 满志弘              | 田青                   |
|         | 联系电话 | 021-68886996     | 010-67595096         |
|         | 电子邮箱 | manzh@hffund.com | tianqingl.zh@ccb.com |

|        |              |              |
|--------|--------------|--------------|
| 客户服务电话 | 400-700-8001 | 010-67595096 |
| 传真     | 021-68887997 | 010-66275853 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                       |
|---------------------|-----------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | 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       | -213,888,433.08 | -327,256,124.89 | -145,835,592.78  |
| 本期利润          | -62,305,675.79  | -509,195,125.56 | -106,057,452.08  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0361         | -0.2822         | -0.0520          |
| 本期基金份额净值增长率   | -7.19%          | -36.39%         | -5.75%           |
| 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  | -0.2017         | -0.0784         | 0.1033           |
| 期末基金资产净值      | 776,519,234.01  | 874,782,873.63  | 1,470,520,616.75 |
| 期末基金份额净值      | 0.4610          | 0.4967          | 0.7809           |

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

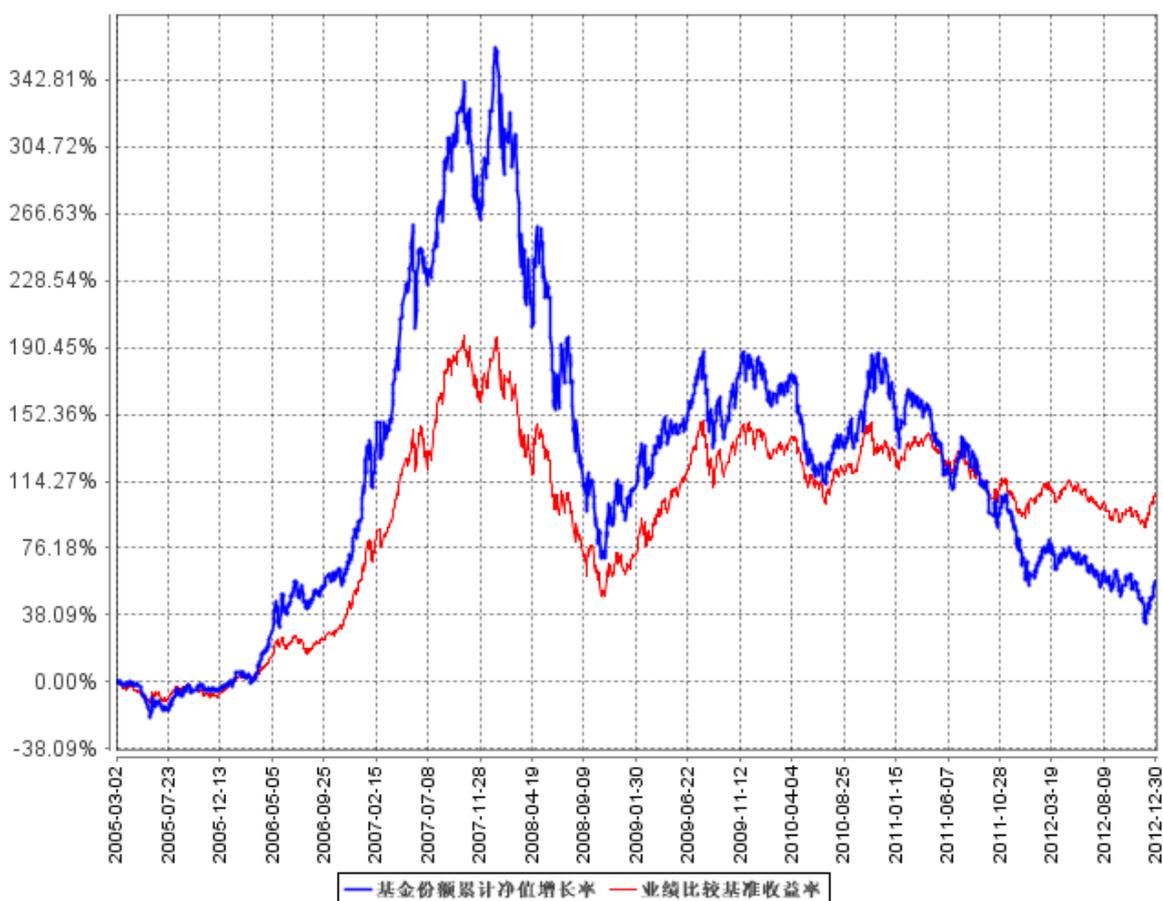
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.06%    | 1.34%       | 6.25%      | 0.75%         | -4.19% | 0.59% |

|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去六个月      | -3.48%  | 1.29% | 2.11%   | 0.73% | -5.59%  | 0.56% |
| 过去一年       | -7.19%  | 1.32% | 6.27%   | 0.75% | -13.46% | 0.57% |
| 过去三年       | -44.36% | 1.34% | -14.33% | 0.83% | -30.03% | 0.51% |
| 过去五年       | -62.75% | 1.71% | -26.26% | 1.17% | -36.49% | 0.54% |
| 自基金合同生效起至今 | 58.31%  | 1.65% | 108.99% | 1.13% | -50.68% | 0.52% |

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

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

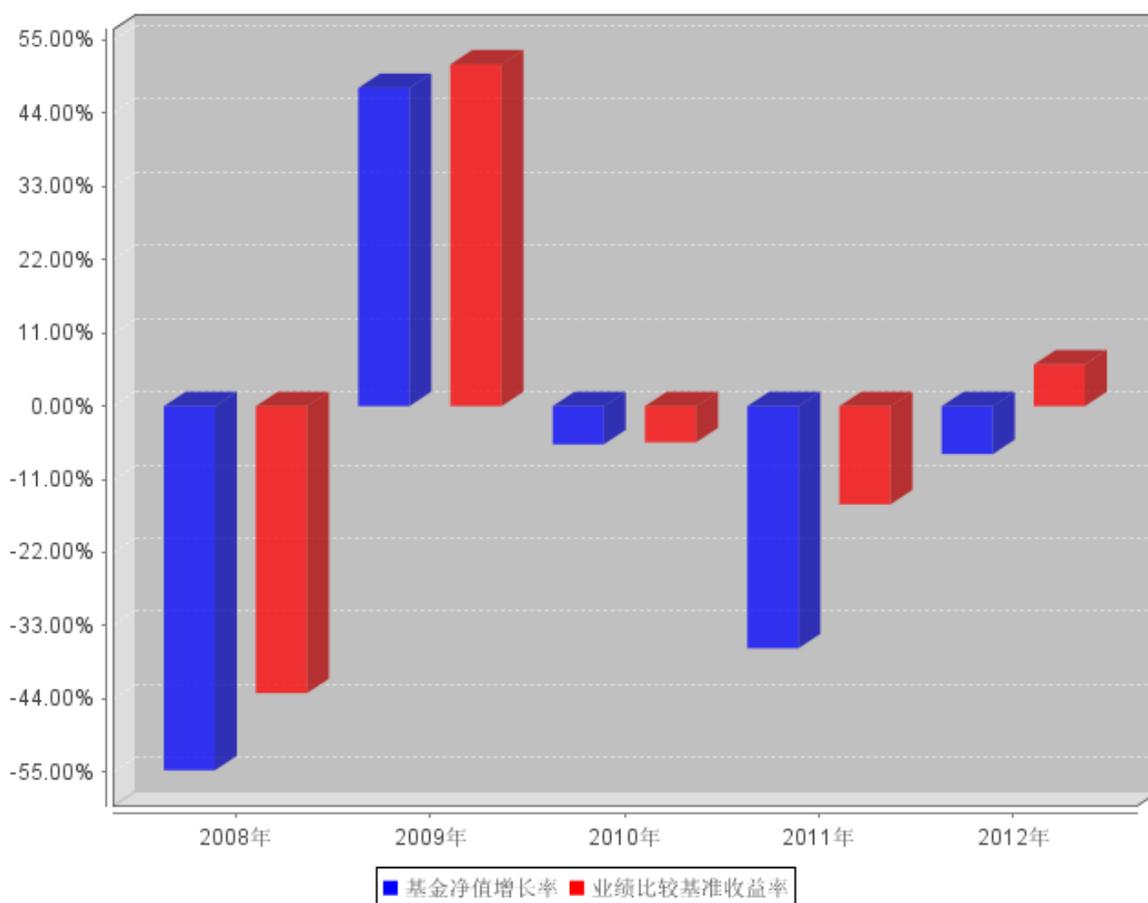
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每10份基金份额<br>分红数 | 现金形式发<br>放总额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>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、华富中小板指数增强型证券投资基金十只基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |             | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---|-----------------|-------------|--------|---|
|    |   | 任职日期            | 离任日期        |        |   |
| 张琦 | 华富竞争力优选基金基金经理                               | 2010年6月2日       | 2012年12月19日 | 八年     | 英国里丁大学投资银行专业硕士、研究生学历，历任光大证券有限公司研究员、银华基金管理有限公司投资经理，2010年4月加入我公司。   |
| 郭晨 | 华富竞争力优选基金基金经理、华富价值增长混合基金基金经理、华富策略精选混合基金基金经理 | 2012年7月4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。 |

|           |   |                         |          |           |   |
|-----------|---|-------------------------|----------|-----------|---|
| <p>龚炜</p> | <p>华富竞争力优选混合型基金经理、华富成长趋势股票型基金基金经理、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</p> | <p>2012 年 12 月 21 日</p> | <p>-</p> | <p>八年</p> | <p>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。</p> |
|-----------|---|-------------------------|----------|-----------|---|

注：张琦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、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、基本面优秀的公司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不够及时、力度也不够大。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，以及在部分重配的创业板个股上遭受了一定损失，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。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，本基金未进行仓位与持仓结构的大幅调整，坚持认为经济结构转型仍应该是主线，一些符合产业政策导向、成长性符合或者高于预期的中小市值股票将会持续强于指数的判断。具体操作上继续采取了淡化行业配置，主动寻找并长期持有在中国后工业化转型时代真正能够由小变大、由弱变强的行业和个股的策略。由于在配置结构上没有适时增加房地产、金融服务等反弹幅度大的周期性板块，因此净值增长不甚理想。

### 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 0.4610 元，累计份额净值为 1.5848 元；本报告期份额净值增长率为-7.19%，同期业绩比较基准收益率为 6.27%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济数据显示，中国经济已经逐步走出周期性的底部开始了缓慢的复苏。宏观经济回归常态仍是今年乃至未来一段时期的主要看点（行业增速、宏观政策回归常态），逐步树立中度通胀、中度增长是 2012 及以后若干年间经济运行格局大概率事件。宏观经济的组成结构在逐渐发生变

化，过去过分依赖投资对经济增长作主要贡献的局面正在改变，中国经济正在向后工业化时代转型，在这个过程中我们认为财政政策的使用空间会远远大于货币政策——财政政策可以精准打击，前几年过分宽松的货币政策其实是饮鸩止渴。那对于资本市场的机会来说，后面相当长的一个时间段里的主线就是紧跟财税政策等制度性的变化（减税、补贴等）而作出反应，另外中央、地方政府对于资本市场的作用的重新诠释以及新一届领导层主导的“新四化建设”过程中所带来的政治经济体制改革将会给中国经济以及中国资本市场的发展带来制度红利。

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 年行业配置策略计划：继续淡化行业配置，主动寻找并长期持有在中国后工业化转型时代真正能够由小变大、由弱变强的行业和个股，同时兼顾中期型行业估值修复过程中带来的轮动式交易性机会的把握。

#### 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-62,305,675.79，期末可供分配利润为-339,746,526.82。本报告期

内未进行利润分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是               |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见         |
| 审计报告编号     | 天健审（2013）6-24 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题  | 审计报告                        |
|---------|-----------------------------|
| 审计报告收件人 | 华富竞争力优选混合型证券投资基金全体持有人       |
| 引言段     | 我们审计了后附的华富竞争力优选混合型证券投资基金（以下 |

|              |   |    |
|--------------|---|----|
|              | 简称“华富竞争力基金”)财务报表,包括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竞争力基金的基金管理人华富基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;(2)选择和运用恰当的会计政策;(3)作出合理的会计估计。   |    |
| 注册会计师的责任段    | <p>我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> |    |
| 审计意见段        | 我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,在所有重大方面公允反映了华富竞争力基金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号新潮商务大厦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:华富竞争力优选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              | 本期末<br>2012 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日         |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                 |                                  |
| 银行存款            | 75,421,807.53                   | 86,605,307.55                    |
| 结算备付金           | 1,292,490.70                    | 6,598,894.89                     |
| 存出保证金           | 1,564,775.87                    | 2,914,850.86                     |
| 交易性金融资产         | 708,251,307.38                  | 745,194,890.50                   |
| 其中：股票投资         | 668,019,736.58                  | 692,361,385.70                   |
| 基金投资            | -                               | -                                |
| 债券投资            | 40,231,570.80                   | 52,833,504.80                    |
| 资产支持证券投资        | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | -                               | 49,500,274.25                    |
| 应收证券清算款         | -                               | -                                |
| 应收利息            | 245,345.27                      | 273,399.70                       |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | 77,711.58                       | 96,176.10                        |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| 资产总计            | 786,853,438.33                  | 891,183,793.85                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2012 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2011 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         | 5,094,146.18                    | 9,103,186.20                     |
| 应付赎回款           | 343,268.22                      | 62,391.81                        |
| 应付管理人报酬         | 911,566.68                      | 1,187,406.39                     |
| 应付托管费           | 151,927.77                      | 197,901.08                       |
| 应付销售服务费         | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 419,808.68                      | 2,453,791.21                     |
| 应交税费            | -                               | -                                |
| 应付利息            | -                               | -                                |
| 应付利润            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债         | -                               | -                                |
| 其他负债            | 3,413,486.79                    | 3,396,243.53                     |
| 负债合计            | 10,334,204.32                   | 16,400,920.22                    |
| <b>所有者权益：</b>   |                                 |                                  |
| 实收基金            | 919,164,782.49                  | 961,112,282.43                   |
| 未分配利润           | -142,645,548.48                 | -86,329,408.80                   |
| 所有者权益合计         | 776,519,234.01                  | 874,782,873.63                   |
| 负债和所有者权益总计      | 786,853,438.33                  | 891,183,793.85                   |

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4610 元，基金份额总额 1,684,386,782.98 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011<br>年 12 月 31 日 |
|----------------------------|---|--|
| <b>一、收入</b>                | -38,839,949.49                            | -458,961,862.80                                |
| 1. 利息收入                    | 1,789,477.98                              | 2,463,290.33                                   |
| 其中：存款利息收入                  | 917,819.49                                | 1,589,476.07                                   |
| 债券利息收入                     | 718,984.38                                | 859,164.68                                     |
| 资产支持证券利息收入                 | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入                 | 152,674.11                                | 14,649.58                                      |
| 其他利息收入                     | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | -192,281,447.22                           | -279,505,097.35                                |
| 其中：股票投资收益                  | -200,477,466.69                           | -280,843,330.73                                |
| 基金投资收益                     | -   | -  |
| 债券投资收益                     | 3,139,488.96                              | -1,564,969.71                                  |
| 资产支持证券投资收益                 | -   | -  |
| 衍生工具收益                     | -   | -  |
| 股利收益                       | 5,056,530.51                              | 2,903,203.09                                   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 151,582,757.29                            | -181,939,000.67                                |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 69,262.46                                 | 18,944.89                                      |
| <b>减：二、费用</b>              | 23,465,726.30                             | 50,233,262.76                                  |
| 1. 管理人报酬                   | 12,243,724.86                             | 17,916,251.28                                  |
| 2. 托管费                     | 2,040,620.82                              | 2,986,041.89                                   |
| 3. 销售服务费                   | -   | -  |
| 4. 交易费用                    | 8,696,263.90                              | 28,842,370.82                                  |
| 5. 利息支出                    | -   | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -   | -  |
| 6. 其他费用                    | 485,116.72                                | 488,598.77                                     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | -62,305,675.79                            | -509,195,125.56                                |
| 减：所得税费用                    | -   | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | -62,305,675.79                            | -509,195,125.56                                |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 961,112,282.43                              | -86,329,408.80  | 874,782,873.63   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -   | -62,305,675.79  | -62,305,675.79   |
| 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）      | -41,947,499.94                              | 5,989,536.11    | -35,957,963.83   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 13,403,361.99                               | -1,853,980.03   | 11,549,381.96    |
| 2. 基金赎回款                               | -55,350,861.93                              | 7,843,516.14    | -47,507,345.79   |
| 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）                        | 919,164,782.49                              | -142,645,548.48 | 776,519,234.01   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 |                 |                  |
|  | 实收基金  | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,027,672,985.79                            | 442,847,630.96  | 1,470,520,616.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -   | -509,195,125.56 | -509,195,125.56  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -66,560,703.36                              | -19,981,914.20  | -86,542,617.56   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 22,299,566.37                               | 5,306,322.18    | 27,605,888.55    |
| 2. 基金赎回款                               | -88,860,269.73                              | -25,288,236.38  | -114,148,506.11  |
| 四、本期向基金份额持有                            | -   | -               | -                |

|                             |                |                |                |
|-----------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） |                |                |                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）             | 961,112,282.43 | -86,329,408.80 | 874,782,873.63 |

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      | 姚怀然       | 陈大毅     |
| 基金管理人负责人 | 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

华富竞争力优选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《华富竞争力优选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基金字【2004】199 号文核准募集设立。本基金自 2005 年 1 月 4 日起公开向社会发行，至 2005 年 2 月 25 日募集结束。经安永大华会计师事务所有限责任公司验资并出具安永大华业字（2005）第 0015 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 600,803,457.07 元；募集资金的银行存款利息 303,413.67 元，折成基金份额，归投资人所有；设立募集期共募集 601,106,870.74 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司；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 2005 年 3 月 2 日生效，该日的基金份额为 601,106,870.74 份基金单位。

本基金已于 2007 年 6 月 12 日进行了基金份额拆分操作。本基金拆分前基金份额净值为 1.832556370 元，拆分比例为 1:1.832556370。本基金管理人按照 1.832556370 的拆分比例增加基金份额持有人持有的基金份额数。拆分后，基金份额净值变为 1.0000 元，相应地，本基金份额持有人原来每 1 份基金份额拆分后为 1.832556370 份，拆分后基金份额数保留到小数点后 2 位，本基金注册登记机构于 2007 年 6 月 13 日进行了变更登记。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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 |
| 中国建设银行股份有限公司       | 基金托管人、代销机构           |
| 华安证券股份有限公司（“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<br>2012年1月1日至2012年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |                      |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 华安证券  | 317,220,120.36              | 5.55%                | 1,704,660,423.84                 | 8.99%                |

##### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |                      |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 |
| 华安证券  | -                           | -                    | 2,890,943.60                     | 4.36%                |

##### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 7.4.8.1.4 权证交易

本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日      |                |          |                  |
|-------|----------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 华安证券  | 265,173.55                       | 5.47%          | -        | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |                |          |                  |

|      | 当期<br>佣金     | 占当期佣金<br>总量的比例<br>(%) | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例<br>(%) |
|------|--------------|-----------------------|------------|-------------------------|
| 华安证券 | 1,405,709.22 | 8.91%                 | 890,330.50 | 36.29%                  |

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<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31<br>日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 12,243,724.86                             | 17,916,251.28                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,882,555.66                              | 2,756,401.05                                   |

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<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31<br>日 |
|----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,040,620.82                              | 2,986,041.89                                   |

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （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

本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

### 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<br>2012 年 12 月 31 日 |                      | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日 |                      |
|------------------|-------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|                  | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 |
| 华安证券股份有限公司       | -                       | -                    | 7,148,185.30             | 0.41%                |
| 合肥兴泰控股集团<br>有限公司 | 9,162,317.04            | 0.54%                | 9,162,317.04             | 0.52%                |

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<br>名称        | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31<br>日 |            | 上年度可比期间<br>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       |
| 中国建设银行<br>股份有限公司 | 75,421,807.53                             | 874,552.76 | 86,605,307.55                               | 1,459,663.18 |

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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 | 708,251,307.38       | 708,735,365.38       |
| 第二层次 | -                    | 36,459,525.12        |
| 第三层次 | -                    | -                    |
| 合计   | 708,251,307.38       | 745,194,890.50       |

## § 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              | 668,019,736.58 | 84.90         |
|    | 其中：股票             | 668,019,736.58 | 84.90         |
| 2  | 固定收益投资            | 40,231,570.80  | 5.11          |
|    | 其中：债券             | 40,231,570.80  | 5.11          |
|    | 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      | 76,714,298.23  | 9.75          |
| 6  | 其他各项资产            | 1,887,832.72   | 0.24          |
| 7  | 合计                | 786,853,438.33 | 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       | 21,095,961.60  | 2.72          |
| B   | 采掘业            | -              | -             |
| C   | 制造业            | 315,610,551.25 | 40.64         |
| C0  | 食品、饮料          | -              | -             |
| 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    | 5,129,178.28   | 0.66          |
| C5  | 电子             | -              | -             |
| C6  | 金属、非金属         | 110,387,718.66 | 14.22         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 73,129,273.42  | 9.42          |
| C8  | 医药、生物制品        | 119,667,686.45 | 15.41         |
| C99 | 其他制造业          | 7,296,694.44   | 0.94          |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 39,238,739.46  | 5.05          |
| E   | 建筑业            | 4,818,000.00   | 0.62          |
| F   | 交通运输、仓储业       | 41,632,224.56  | 5.36          |
| G   | 信息技术业          | 96,783,502.21  | 12.46         |
| H   | 批发和零售贸易        | 8,823,114.00   | 1.14          |
| I   | 金融、保险业         | 65,971,765.80  | 8.50          |
| J   | 房地产业           | 20,173,258.07  | 2.60          |
| K   | 社会服务业          | 27,293,207.95  | 3.51          |
| L   | 传播与文化产业        | 26,579,411.68  | 3.42          |
| M   | 综合类            | -              | -             |
|     | 合计             | 668,019,736.58 | 86.03         |

## 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  | 601288 | 农业银行 | 12,700,000 | 35,560,000.00 | 4.58          |
| 2  | 002571 | 德力股份 | 1,433,277  | 26,601,621.12 | 3.43          |
| 3  | 000513 | 丽珠集团 | 693,933    | 24,148,868.40 | 3.11          |

|    |        |      |             |                  |       |
|----|--------|------|-------------|------------------|-------|
| 4  | 002271 | 东方雨虹 | 1, 513, 069 | 23, 074, 302. 25 | 2. 97 |
| 5  | 600686 | 金龙汽车 | 3, 377, 561 | 22, 866, 087. 97 | 2. 94 |
| 6  | 002447 | 壹桥苗业 | 941, 784    | 21, 095, 961. 60 | 2. 72 |
| 7  | 002230 | 科大讯飞 | 582, 209    | 17, 640, 932. 70 | 2. 27 |
| 8  | 002298 | 鑫龙电器 | 2, 042, 755 | 17, 240, 852. 20 | 2. 22 |
| 9  | 000996 | 中国中期 | 1, 162, 015 | 17, 011, 899. 60 | 2. 19 |
| 10 | 300104 | 乐视网  | 889, 892    | 16, 721, 070. 68 | 2. 15 |

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  | 601336 | 新华保险 | 74, 073, 295. 53 | 8. 47          |
| 2  | 600489 | 中金黄金 | 59, 186, 531. 89 | 6. 77          |
| 3  | 000001 | 平安银行 | 54, 132, 424. 86 | 6. 19          |
| 4  | 600048 | 保利地产 | 43, 944, 502. 94 | 5. 02          |
| 5  | 002155 | 辰州矿业 | 42, 743, 320. 58 | 4. 89          |
| 6  | 600858 | 银座股份 | 40, 546, 739. 87 | 4. 64          |
| 7  | 000776 | 广发证券 | 38, 362, 203. 67 | 4. 39          |
| 8  | 002182 | 云海金属 | 36, 697, 647. 80 | 4. 20          |
| 9  | 600086 | 东方金钰 | 35, 352, 019. 25 | 4. 04          |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 35, 016, 800. 00 | 4. 00          |
| 11 | 002477 | 雏鹰农牧 | 35, 003, 838. 82 | 4. 00          |
| 12 | 601808 | 中海油服 | 34, 553, 656. 90 | 3. 95          |
| 13 | 600875 | 东方电气 | 33, 892, 425. 12 | 3. 87          |
| 14 | 600208 | 新潮中宝 | 33, 836, 942. 25 | 3. 87          |
| 15 | 002465 | 海格通信 | 33, 527, 866. 41 | 3. 83          |
| 16 | 600895 | 张江高科 | 33, 475, 488. 30 | 3. 83          |
| 17 | 000750 | 国海证券 | 32, 294, 325. 64 | 3. 69          |
| 18 | 000666 | 经纬纺机 | 32, 058, 666. 99 | 3. 66          |
| 19 | 600383 | 金地集团 | 30, 740, 080. 27 | 3. 51          |
| 20 | 002673 | 西部证券 | 29, 825, 534. 52 | 3. 41          |
| 21 | 601166 | 兴业银行 | 29, 424, 372. 00 | 3. 36          |
| 22 | 600064 | 南京高科 | 28, 618, 065. 61 | 3. 27          |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 23 | 002447 | 壹桥苗业  | 27,365,265.70 | 3.13 |
| 24 | 601515 | 东风股份  | 27,342,324.90 | 3.13 |
| 25 | 600565 | 迪马股份  | 26,892,577.45 | 3.07 |
| 26 | 000413 | 宝 石 A | 26,812,886.10 | 3.07 |
| 27 | 601991 | 大唐发电  | 26,367,129.44 | 3.01 |
| 28 | 600773 | 西藏城投  | 26,090,028.67 | 2.98 |
| 29 | 600107 | 美尔雅   | 26,010,667.39 | 2.97 |
| 30 | 600749 | 西藏旅游  | 25,933,117.19 | 2.96 |
| 31 | 000523 | 广州浪奇  | 25,413,720.50 | 2.91 |
| 32 | 600104 | 上汽集团  | 25,405,419.65 | 2.90 |
| 33 | 002086 | 东方海洋  | 25,099,886.44 | 2.87 |
| 34 | 600433 | 冠豪高新  | 24,919,049.99 | 2.85 |
| 35 | 000996 | 中国中期  | 24,893,830.15 | 2.85 |
| 36 | 600138 | 中青旅   | 24,407,891.41 | 2.79 |
| 37 | 002271 | 东方雨虹  | 24,219,646.35 | 2.77 |
| 38 | 000415 | 渤海租赁  | 23,900,674.15 | 2.73 |
| 39 | 000513 | 丽珠集团  | 23,684,011.01 | 2.71 |
| 40 | 000421 | 南京中北  | 23,503,046.74 | 2.69 |
| 41 | 601377 | 兴业证券  | 22,742,087.34 | 2.60 |
| 42 | 600549 | 厦门钨业  | 22,350,527.30 | 2.55 |
| 43 | 600491 | 龙元建设  | 22,197,689.67 | 2.54 |
| 44 | 600387 | 海越股份  | 22,173,854.15 | 2.53 |
| 45 | 002571 | 德力股份  | 22,116,961.74 | 2.53 |
| 46 | 600704 | 物产中大  | 21,874,097.16 | 2.50 |
| 47 | 002314 | 雅致股份  | 20,862,998.99 | 2.38 |
| 48 | 600686 | 金龙汽车  | 20,793,378.89 | 2.38 |
| 49 | 000997 | 新 大 陆 | 20,778,580.37 | 2.38 |
| 50 | 300104 | 乐视网   | 20,456,065.17 | 2.34 |
| 51 | 600009 | 上海机场  | 20,335,180.30 | 2.32 |
| 52 | 600238 | 海南椰岛  | 20,012,180.92 | 2.29 |
| 53 | 002159 | 三特索道  | 19,799,664.41 | 2.26 |
| 54 | 000779 | 三毛派神  | 19,131,582.01 | 2.19 |
| 55 | 600724 | 宁波富达  | 18,594,974.26 | 2.13 |
| 56 | 002390 | 信邦制药  | 18,330,295.85 | 2.10 |
| 57 | 601139 | 深圳燃气  | 18,215,450.06 | 2.08 |
| 58 | 002407 | 多氟多   | 17,966,659.14 | 2.05 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 59 | 000848 | 承德露露 | 17,875,479.28 | 2.04 |
| 60 | 600707 | 彩虹股份 | 17,860,445.33 | 2.04 |
| 61 | 601666 | 平煤股份 | 17,852,147.75 | 2.04 |
| 62 | 000059 | 辽通化工 | 17,803,534.99 | 2.04 |
| 63 | 600128 | 弘业股份 | 17,624,536.55 | 2.01 |

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601336 | 新华保险 | 74,751,849.46 | 8.55           |
| 2  | 600489 | 中金黄金 | 59,104,757.44 | 6.76           |
| 3  | 000523 | 广州浪奇 | 54,877,283.97 | 6.27           |
| 4  | 001696 | 宗申动力 | 53,497,485.58 | 6.12           |
| 5  | 002283 | 天润曲轴 | 51,052,477.33 | 5.84           |
| 6  | 002477 | 雏鹰农牧 | 46,694,964.42 | 5.34           |
| 7  | 000001 | 平安银行 | 46,550,886.69 | 5.32           |
| 8  | 600048 | 保利地产 | 45,102,994.06 | 5.16           |
| 9  | 600702 | 沱牌舍得 | 44,219,623.88 | 5.05           |
| 10 | 000776 | 广发证券 | 41,587,682.51 | 4.75           |
| 11 | 600257 | 大湖股份 | 40,499,148.37 | 4.63           |
| 12 | 002155 | 辰州矿业 | 39,251,551.15 | 4.49           |
| 13 | 600086 | 东方金钰 | 38,648,054.32 | 4.42           |
| 14 | 600858 | 银座股份 | 36,658,905.24 | 4.19           |
| 15 | 300187 | 永清环保 | 35,245,982.00 | 4.03           |
| 16 | 002025 | 航天电器 | 34,987,400.58 | 4.00           |
| 17 | 601808 | 中海油服 | 34,121,670.97 | 3.90           |
| 18 | 600208 | 新湖中宝 | 34,075,245.97 | 3.90           |
| 19 | 600383 | 金地集团 | 33,335,771.35 | 3.81           |
| 20 | 600895 | 张江高科 | 32,954,856.76 | 3.77           |
| 21 | 300132 | 青松股份 | 31,959,541.55 | 3.65           |
| 22 | 000666 | 经纬纺机 | 31,791,710.06 | 3.63           |
| 23 | 000750 | 国海证券 | 31,750,095.03 | 3.63           |
| 24 | 601166 | 兴业银行 | 31,120,172.02 | 3.56           |
| 25 | 600433 | 冠豪高新 | 30,347,732.31 | 3.47           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 26 | 600875 | 东方电气  | 29,257,973.43 | 3.34 |
| 27 | 000727 | 华东科技  | 27,877,775.53 | 3.19 |
| 28 | 000415 | 渤海租赁  | 27,026,522.98 | 3.09 |
| 29 | 300022 | 吉峰农机  | 26,061,746.15 | 2.98 |
| 30 | 600104 | 上汽集团  | 25,528,326.58 | 2.92 |
| 31 | 300218 | 安利股份  | 25,360,726.95 | 2.90 |
| 32 | 600107 | 美尔雅   | 25,342,116.42 | 2.90 |
| 33 | 601991 | 大唐发电  | 25,069,076.40 | 2.87 |
| 34 | 600749 | 西藏旅游  | 24,764,488.44 | 2.83 |
| 35 | 600138 | 中青旅   | 24,578,749.88 | 2.81 |
| 36 | 002465 | 海格通信  | 24,434,699.33 | 2.79 |
| 37 | 600565 | 迪马股份  | 24,375,536.34 | 2.79 |
| 38 | 601377 | 兴业证券  | 23,961,571.00 | 2.74 |
| 39 | 002214 | 大立科技  | 23,899,889.69 | 2.73 |
| 40 | 600491 | 龙元建设  | 23,443,491.91 | 2.68 |
| 41 | 002059 | 云南旅游  | 23,300,678.14 | 2.66 |
| 42 | 002086 | 东方海洋  | 23,268,314.48 | 2.66 |
| 43 | 000413 | 宝 石 A | 23,095,916.41 | 2.64 |
| 44 | 600773 | 西藏城投  | 22,872,493.28 | 2.61 |
| 45 | 002329 | 皇氏乳业  | 22,605,039.16 | 2.58 |
| 46 | 601515 | 东风股份  | 22,539,408.91 | 2.58 |
| 47 | 000421 | 南京中北  | 21,188,054.42 | 2.42 |
| 48 | 600009 | 上海机场  | 20,721,645.24 | 2.37 |
| 49 | 600387 | 海越股份  | 20,309,832.69 | 2.32 |
| 50 | 002182 | 云海金属  | 20,189,163.15 | 2.31 |
| 51 | 600826 | 兰生股份  | 20,170,260.74 | 2.31 |
| 52 | 000059 | 辽通化工  | 19,871,227.27 | 2.27 |
| 53 | 000997 | 新 大 陆 | 19,615,275.05 | 2.24 |
| 54 | 600256 | 广汇能源  | 19,456,957.57 | 2.22 |
| 55 | 600064 | 南京高科  | 19,434,325.36 | 2.22 |
| 56 | 600704 | 物产中大  | 19,396,151.41 | 2.22 |
| 57 | 002635 | 安洁科技  | 18,977,872.60 | 2.17 |
| 58 | 600724 | 宁波富达  | 18,567,985.74 | 2.12 |
| 59 | 300055 | 万邦达   | 18,420,140.57 | 2.11 |
| 60 | 002229 | 鸿博股份  | 18,186,447.05 | 2.08 |
| 61 | 600528 | 中铁二局  | 17,915,569.32 | 2.05 |
| 62 | 000516 | 开元投资  | 17,582,766.57 | 2.01 |

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

用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 2,871,102,140.75 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,847,735,706.56 |

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      | 10,370,170.80 | 1.34         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债       | 29,861,400.00 | 3.85         |
| 8  | 其他        | -             | -            |
| 9  | 合计        | 40,231,570.80 | 5.18         |

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 110003 | 新钢转债   | 250,000 | 25,745,000.00 | 3.32         |
| 2  | 126008 | 08 上汽债 | 106,920 | 10,370,170.80 | 1.34         |
| 3  | 110015 | 石化转债   | 40,000  | 4,116,400.00  | 0.53         |

## 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

基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

**8.9.2** 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,564,775.87 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 245,345.27   |
| 5  | 应收申购款   | 77,711.58    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,887,832.72 |

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|---------------|
| 1  | 110003 | 新钢转债 | 25,745,000.00 | 3.32          |
| 2  | 110015 | 石化转债 | 4,116,400.00  | 0.53          |

### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 92,445       | 18,220.42     | 14,971,654.23 | 0.89%      | 1,669,415,128.75 | 99.11%     |

### 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<br>员持有本基金 | 299,141.24 | 0.0178%  |

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（2005年3月2日）基金份额总额 | 601,106,870.74   |
| 本报告期期初基金份额总额             | 1,761,256,583.35 |
| 本报告期基金总申购份额              | 24,561,786.55    |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 101,431,586.92   |
| 本报告期基金拆分变动份额             | -                |
| 本报告期期末基金份额总额             | 1,684,386,782.98 |

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 15 日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可（2012）961 号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可（2012）

1036 号)。

### 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 |    |
| 中信证券   | 2      | 1,420,387,998.45 | 24.85%       | 1,204,190.09 | 24.86%     | -  |
| 中信建投证券 | 1      | 891,073,961.67   | 15.59%       | 731,253.17   | 15.10%     | -  |
| 国金证券   | 2      | 665,891,895.30   | 11.65%       | 559,848.41   | 11.56%     | -  |
| 民生证券   | 2      | 468,586,262.66   | 8.20%        | 398,297.18   | 8.22%      | -  |
| 宏源证券   | 1      | 424,854,959.26   | 7.43%        | 373,911.23   | 7.72%      | -  |
| 华安证券   | 3      | 317,220,120.36   | 5.55%        | 265,173.55   | 5.47%      | -  |
| 长江证券   | 1      | 303,636,519.02   | 5.31%        | 259,276.36   | 5.35%      | -  |

|        |   |                |       |            |       |   |
|--------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 申银万国   | 1 | 250,539,483.41 | 4.38% | 218,720.04 | 4.52% | - |
| 光大证券   | 2 | 243,932,617.90 | 4.27% | 198,197.77 | 4.09% | - |
| 东北证券   | 1 | 237,847,087.18 | 4.16% | 210,475.18 | 4.35% | - |
| 中投证券   | 3 | 151,972,677.45 | 2.66% | 137,755.88 | 2.84% | - |
| 英大证券   | 1 | 144,170,719.09 | 2.52% | 117,140.08 | 2.42% | - |
| 齐鲁证券   | 1 | 59,244,315.72  | 1.04% | 53,936.01  | 1.11% | - |
| 国泰君安   | 1 | 55,441,781.85  | 0.97% | 47,124.88  | 0.97% | - |
| 方正证券   | 1 | 42,701,382.77  | 0.75% | 36,295.56  | 0.75% | - |
| 安信证券   | 2 | 16,154,710.23  | 0.28% | 13,125.69  | 0.27% | - |
| 西南证券   | 1 | 12,669,230.32  | 0.22% | 10,737.26  | 0.22% | - |
| 长城证券   | 1 | 9,578,794.27   | 0.17% | 8,117.96   | 0.17% | - |
| 新时代证券  | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 国海证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 中山证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 国信证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 广发华福证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 海通证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 首创证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 南京证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 世纪证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 金元证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 华泰证券   | 2 | -              | -     | -          | -     | - |
| 东兴证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 国联证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 华宝证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 华创证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 高华证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 第一创业证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 平安证券   | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 东吴证券   | 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 | 成交金额   | 占当期债券回购 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的 |
|      |      |             |        |         |      |            |

|        |               | 例       |   | 成交总额<br>的比例 |   | 比例 |
|--------|---------------|---------|---|-------------|---|----|
| 中信证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 中信建投证券 | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 国金证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 民生证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 宏源证券   | 14,554,796.87 | 100.00% | - | -           | - | -  |
| 华安证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 长江证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 申银万国   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 光大证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 东北证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 中投证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 英大证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 齐鲁证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 国泰君安   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 方正证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 安信证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 西南证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 长城证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 新时代证券  | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 国海证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 中山证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 国信证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 广发华福证券 | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 海通证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 首创证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 南京证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 世纪证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 金元证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 华泰证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 东兴证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 国联证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 华宝证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 华创证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 高华证券   | -             | -       | - | -           | - | -  |
| 第一创业证券 | -             | -       | - | -           | - | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |

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。其中华泰联合证券更名为华泰证券。本报告期本基金新增交易单元的情况分别是：金元证券、民生证券、海通证券各新增 1 个席位。本报告期本基金注销交易单元的情况分别是：东兴证券、广发华福证券、海通证券各注销 1 个席位。

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

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

2、2012 年 11 月 15 日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。