

华富竞争力优选混合型证券投资基金 2011 年年度报告

2011年12月31日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012年3月30日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 2011 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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§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.....	39
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.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48

8.9 投资组合报告附注	48
§9 基金份额持有人信息.....	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	50
§10 开放式基金份额变动.....	50
§11 重大事件揭示.....	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	54
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§13 备查文件目录.....	58
13.1 备查文件目录.....	58
13.2 存放地点.....	58
13.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	尹东
	联系电话	021-68886996	010-67595003
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴环	北京市西城区金融大街 25 号

	路 1000 号 31 层	
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	章宏韬	王洪章

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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-327,256,124.89	-145,835,592.78	290,842,931.85
本期利润	-509,195,125.56	-106,057,452.08	671,149,672.07
加权平均基金份额本期利润	-0.2822	-0.0520	0.2781
本期加权平均净值利润率	-42.78%	-7.06%	38.40%
本期基金份额净值增长率	-36.39%	-5.75%	47.79%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-138,129,215.22	194,574,977.53	366,206,191.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0784	0.1033	0.1704
期末基金资产净值	874,782,873.63	1,470,520,616.75	1,780,484,316.59
期末基金份额净值	0.4967	0.7809	0.8285
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	70.57%	168.17%	184.51%

注：1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2) 以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购

赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

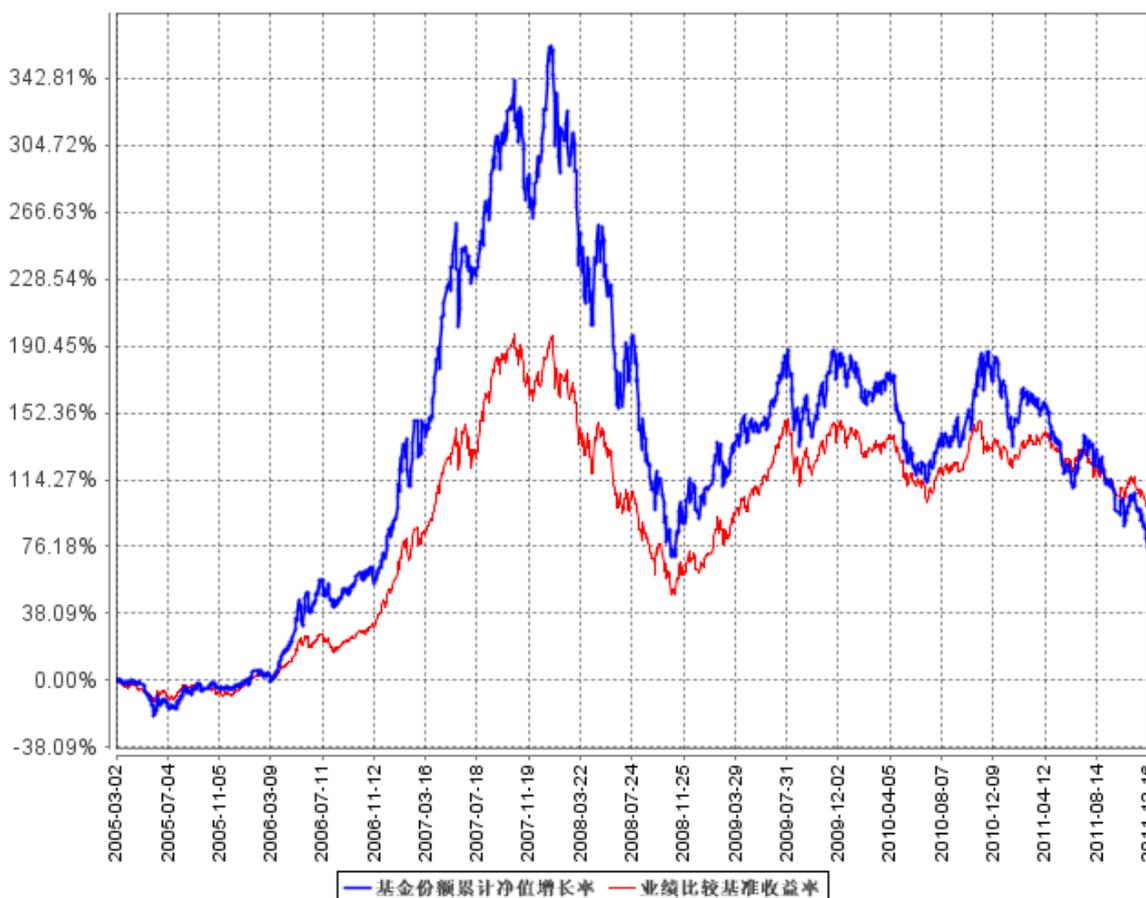
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.18%	1.40%	-4.34%	0.85%	-8.84%	0.55%
过去六个月	-22.67%	1.32%	-13.48%	0.82%	-9.19%	0.50%
过去一年	-36.39%	1.25%	-14.74%	0.78%	-21.65%	0.47%
过去三年	-11.40%	1.41%	22.00%	1.00%	-33.40%	0.41%
过去五年	-10.82%	1.83%	25.13%	1.29%	-35.95%	0.54%
自基金合同生效起至今	70.57%	1.70%	96.65%	1.18%	-26.08%	0.52%

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

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

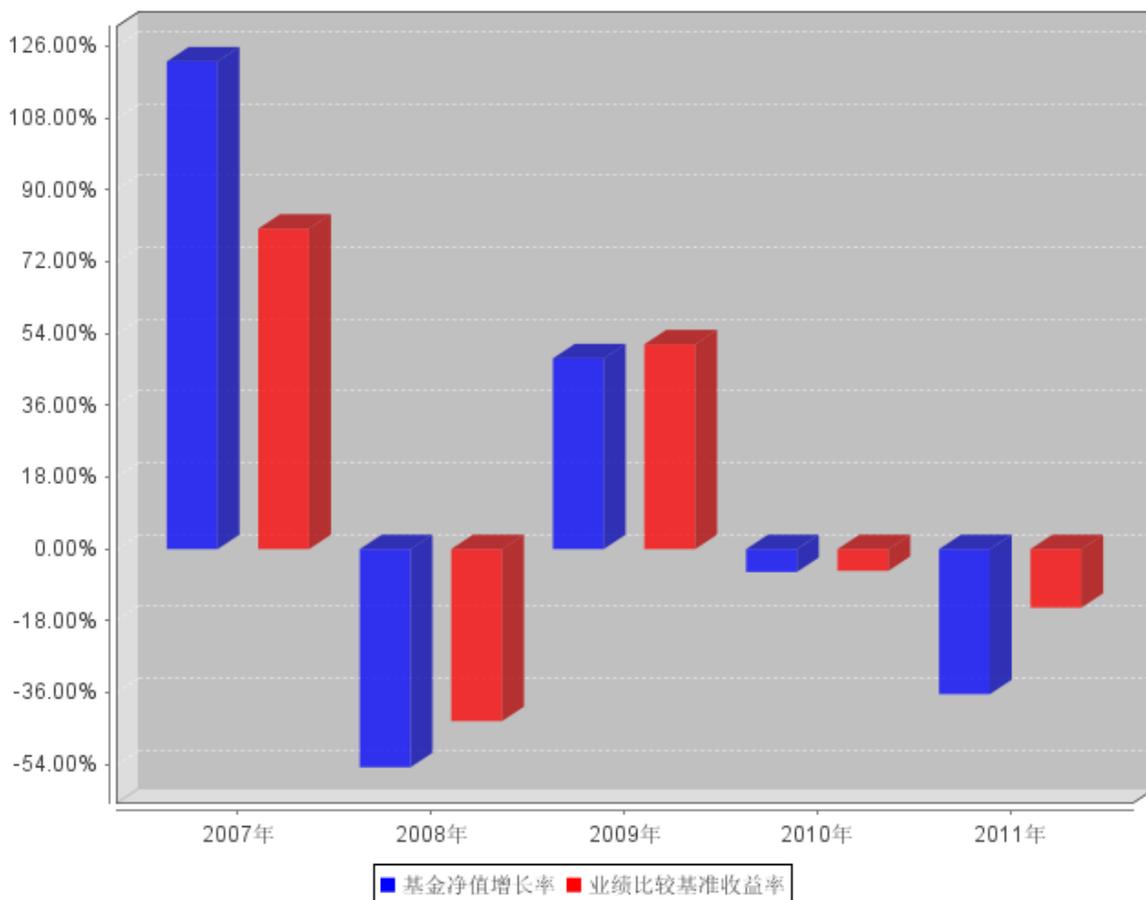
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2011年	-	-	-	-	
2010年	-	-	-	-	
2009年	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业，4月19日在上海正式注册成立，注册资本1.2亿元，公司股东为华安证券有限责任公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司。截止2011年12月31日，本

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张琦	华富竞争力优选基金经理	2010年6月2日	-	七年	英国里丁大学投资银行专业硕士、研究生学历，历任光大证券有限公司研究员、银华基金管理有限公司投资经理，2010年4月加入我公司。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长的基金合同，华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长都属于混合型基金，2011年，华富竞争力、华富策略精选和华富价值增长的净值增长率分别为-36.39%、-32.84%与-23.86%。三只基金的差异主要由资产配置和行业配置的差异造

成。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为发生。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年的股市表现乏力，本基金的表现欠佳，由于开局落后，希望通过重仓某一热点板块迅速改善业绩，心态失衡并且四处出击之下，却错过了上半年的水泥和下半年的传媒两大热点，在换手率高企的同时，业绩却每况愈下。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

2012 年外围市场的影响将会比较大，美国经济的恢复程度以及美元的走势对于周期类资源品至关重要，欧洲债务的流动性约束影响其次。美国因素中，还有一个独特的研究对象——页岩气，

它对于油价的影响至关重要，对整个于化工行业尤其是化肥、农药，以及农产品、新能源等都有根本性的深远影响。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011 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，新修订了股票池制度、注册登记业务规则等制度。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《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-509,195,125.56，期末可供分配利润为-138,129,215.22。本报告期内未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审(2012)6-21号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	华富竞争力优选混合型证券投资基金全体持有人	
引言段	我们审计了后附的华富竞争力优选混合型证券投资基金（以下简称“华富竞争力基金”）财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表，2011 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是华富竞争力基金的基金管理人华富基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了华富竞争力基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	曹小勤	李勤
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	杭州市西溪路 128 号新潮商务大厦 9 楼	
审计报告日期	2012 年 3 月 20 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	86,605,307.55	325,695,971.38
结算备付金		6,598,894.89	10,237,149.46
存出保证金		2,914,850.86	6,362,425.13
交易性金融资产	7.4.7.2	745,194,890.50	1,192,758,588.85
其中：股票投资		692,361,385.70	1,109,499,361.55
基金投资		-	-
债券投资		52,833,504.80	83,259,227.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	49,500,274.25	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	273,399.70	444,422.81
应收股利		-	-
应收申购款		96,176.10	516,501.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		891,183,793.85	1,536,015,059.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 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		9,103,186.20	55,824,719.81
应付赎回款		62,391.81	391,590.53
应付管理人报酬		1,187,406.39	1,940,374.21
应付托管费		197,901.08	323,395.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,453,791.21	4,955,403.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	3,396,243.53	2,058,958.61
负债合计		16,400,920.22	65,494,442.25
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	961,112,282.43	1,027,672,985.79
未分配利润	7.4.7.10	-86,329,408.80	442,847,630.96

所有者权益合计		874,782,873.63	1,470,520,616.75
负债和所有者权益总计		891,183,793.85	1,536,015,059.00

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

7.2 利润表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-458,961,862.80	-48,063,069.65
1. 利息收入		2,463,290.33	2,421,696.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,589,476.07	1,376,658.58
债券利息收入		859,164.68	992,306.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,649.58	52,731.31
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-279,505,097.35	-90,364,020.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-280,843,330.73	-108,771,657.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,564,969.71	8,968,947.72
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	2,903,203.09	9,438,689.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-181,939,000.67	39,778,140.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	18,944.89	101,113.74
减：二、费用		50,233,262.76	57,994,382.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	17,916,251.28	22,508,677.20
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,986,041.89	3,751,446.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	28,842,370.82	31,244,975.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	488,598.77	489,283.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-509,195,125.56	-106,057,452.08
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-509,195,125.56	-106,057,452.08
-------------------	--	-----------------	-----------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富竞争力优选混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,027,672,985.79	442,847,630.96	1,470,520,616.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-509,195,125.56	-509,195,125.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-66,560,703.36	-19,981,914.20	-86,542,617.56
其中：1. 基金申购款	22,299,566.37	5,306,322.18	27,605,888.55
2. 基金赎回款	-88,860,269.73	-25,288,236.38	-114,148,506.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	961,112,282.43	-86,329,408.80	874,782,873.63
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	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）	1,172,765,915.67	607,718,400.92	1,780,484,316.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-106,057,452.08	-106,057,452.08
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）	-145,092,929.88	-58,813,317.88	-203,906,247.76
其中：1. 基金申购款	30,650,000.19	10,677,115.94	41,327,116.13

2. 基金赎回款	-175,742,930.07	-69,490,433.82	-245,233,363.89
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）	1,027,672,985.79	442,847,630.96	1,470,520,616.75

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》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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记入当期损益，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

付息债，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《华富竞争力优选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《华富竞争力优选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。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。本基金收益每年最多分配 5 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20.00%。基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金当年亏损，则不进行收益分配。

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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日

活期存款	86,605,307.55	325,695,971.38
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	86,605,307.55	325,695,971.38

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	838,856,899.20	692,361,385.70	-146,495,513.50
债券	交易所市场	54,499,729.39	52,833,504.80
	银行间市场	-	-
	合计	54,499,729.39	52,833,504.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	893,356,628.59	745,194,890.50	-148,161,738.09
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,077,303,155.04	1,109,499,361.55	32,196,206.51
债券	交易所市场	81,678,171.23	83,259,227.30
	银行间市场	-	-
	合计	81,678,171.23	83,259,227.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,158,981,326.27	1,192,758,588.85	33,777,262.58

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 2011 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	49,500,274.25	-
合计	49,500,274.25	-
项目	上年度末 2010年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-

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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	21,346.74	54,199.73
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	3,266.46	3,941.30
应收债券利息	234,020.75	386,227.66
应收买入返售证券利息	14,649.58	-
应收申购款利息	46.54	-
其他	69.63	54.12
合计	273,399.70	444,422.81

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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,453,516.96	4,955,403.43
银行间市场应付交易费用	274.25	-
合计	2,453,791.21	4,955,403.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2011 年 12 月 31 日	2010 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	2,750,000.00	1,500,000.00
应付赎回费	49.53	173.81
应付债券税金	186,194.00	158,784.80
应付审计费	100,000.00	100,000.00
应付信息披露费	360,000.00	300,000.00
合计	3,396,243.53	2,058,958.61

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,883,229,090.66	1,027,672,985.79
本期申购	40,864,371.77	22,299,566.37
本期赎回（以“-”号填列）	-162,836,879.08	-88,860,269.73
本期末	1,761,256,583.35	961,112,282.43

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	194,574,977.53	248,272,653.43	442,847,630.96
本期利润	-327,256,124.89	-181,939,000.67	-509,195,125.56
本期基金份额交易产生的变动数	-5,448,067.86	-14,533,846.34	-19,981,914.20
其中：基金申购款	869,108.98	4,437,213.20	5,306,322.18
基金赎回款	-6,317,176.84	-18,971,059.54	-25,288,236.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-138,129,215.22	51,799,806.42	-86,329,408.80

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	1,459,663.18
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	127,100.96	103,334.83

其他	2,711.93	2,809.40
合计	1,589,476.07	1,376,658.58

注：其他所列本期金额包括权证保证金利息收入 2,214.61 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 497.32 元；所列上年度可比期间金额包括权证保证金利息收入 1,798.06 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 1,011.34 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 2011年1月1日至2011 年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010 年12月31日
卖出股票成交总额	9,463,229,125.21	10,364,109,216.97
减：卖出股票成本总额	9,744,072,455.94	10,472,880,874.24
买卖股票差价收入	-280,843,330.73	-108,771,657.27

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年 12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	46,151,860.92	83,968,172.85
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	47,416,195.36	74,521,044.86
减：应收利息总额	300,635.27	478,180.27
债券投资收益	-1,564,969.71	8,968,947.72

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内和上年度期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内和上年度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 2011年1月1日至2011年12	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月
----	-------------------------	-------------------------------

	月 31 日	31 日
股票投资产生的股利收益	2,903,203.09	9,438,689.12
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,903,203.09	9,438,689.12

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-181,939,000.67	39,778,140.70
——股票投资	-178,691,720.01	45,467,384.14
——债券投资	-3,247,280.66	-5,689,243.44
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-181,939,000.67	39,778,140.70

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	15,832.19	88,256.46
基金转换费收入	3,112.70	12,614.48
印花税返还	-	242.80
合计	18,944.89	101,113.74

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	28,842,370.82	31,244,975.88
银行间市场交易费用	-	-
合计	28,842,370.82	31,244,975.88

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	360,000.00	359,178.50
银行汇划费用	10,238.77	11,744.71
银行帐户维护费	360.00	360.00
自营托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	488,598.77	489,283.21

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券有限责任公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、代销机构
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰控股集团有限公司	基金管理人的股东

7.4.10 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

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华安证券	1,704,660,423.84	8.99%	651,130,209.49	3.20%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
华安证券	2,890,943.60	4.36%	-	-

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华安证券	1,405,709.22	8.91%	890,330.50	36.29%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华安证券	529,046.59	3.12%	94,031.59	1.90%

注：上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 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 2011年1月1日至2011年12 月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付	17,916,251.28	22,508,677.20

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	2,756,401.05	3,447,958.77

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,986,041.89	3,751,446.14

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	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	36,372,790.53
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	36,372,790.53
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

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

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末
	2011 年 12 月 31 日	2010 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例
华安证券有限 责任公司	7,148,185.30	0.41%	-	-
合肥兴泰控股 集团有限公司	9,162,317.04	0.52%	9,162,317.04	0.49%

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

7.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年12月31 日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行 股份有限公司	86,605,307.55	1,459,663.18	325,695,971.38	1,270,514.35

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.10.6 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（2011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
002214	大立科 技	2011年 11月10 日	重大 事项 停牌	29.84	2012年 2月29 日	34.11	807,168	28,341,808.70	24,085,89 3.12	-
600991	广汽长 丰	2011年 12月28	重大 事项	14.72	2012年 1月4日	15.11	840,600	12,409,138.00	12,373,63 2.00	-

		日	停牌						
--	--	---	----	--	--	--	--	--	--

7.4.12.3 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。

7.4.13 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公司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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	14,011,004.80	25,487,764.00
AAA 以下	38,822,500.00	57,771,463.30
未评级	-	-
合计	52,833,504.80	83,259,227.30

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。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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 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	86,605,307.55	-	-	-	-	-	86,605,307.55
结算备付金	6,598,894.89	-	-	-	-	-	6,598,894.89
存出保证金	140,741.00	-	-	-	-	2,774,109.86	2,914,850.86
交易性金融 资产	-	4,020,400.00	24,925,000.00	23,888,104.80	-	692,361,385.70	745,194,890.50
买入返售金 融资产	49,500,274.25	-	-	-	-	-	49,500,274.25
应收利息	-	-	-	-	-	273,399.70	273,399.70
应收申购款	96,176.10	-	-	-	-	-	96,176.10
资产总计	142,941,393.79	4,020,400.00	24,925,000.00	23,888,104.80	-	695,408,895.26	891,183,793.85
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	9,103,186.20	9,103,186.20
应付赎回款	-	-	-	-	-	62,391.81	62,391.81
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	1,187,406.39	1,187,406.39
应付托管费	-	-	-	-	-	197,901.08	197,901.08
应付交易费 用	-	-	-	-	-	2,453,791.21	2,453,791.21
其他负债	-	-	-	-	-	3,396,243.53	3,396,243.53
负债总计	-	-	-	-	-	16,400,920.22	16,400,920.22
利率敏感度 缺口	142,941,393.79	4,020,400.00	24,925,000.00	23,888,104.80	-	679,007,975.04	874,782,873.63
上年度末 2010 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	325,695,971.38	-	-	-	-	-	325,695,971.38
结算备付金	10,237,149.46	-	-	-	-	-	10,237,149.46
存出保证金	140,741.00	-	-	-	-	6,221,684.13	6,362,425.13
交易性金融 资产	-	1,158,912.50	57,917,349.00	24,182,965.80	-	1,109,499,361.55	1,192,758,588.85
应收利息	-	-	-	-	-	444,422.81	444,422.81
应收申购款	516,501.37	-	-	-	-	-	516,501.37
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	336,590,363.21	1,158,912.50	57,917,349.00	24,182,965.80	-	1,116,165,468.49	1,536,015,059.00
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	55,824,719.81	55,824,719.81

应付赎回款	-	-	-	-	391,590.53	391,590.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,940,374.21	1,940,374.21
应付托管费	-	-	-	-	323,395.66	323,395.66
应付交易费用	-	-	-	-	4,955,403.43	4,955,403.43
其他负债	-	-	-	-	2,058,958.61	2,058,958.61
负债总计	-	-	-	-	65,494,442.25	65,494,442.25
利率敏感度缺口	336,590,363.21	1,158,912.50	57,917,349.00	24,182,965.80	-1,050,671,026.24	1,470,520,616.75

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（2011年12月31日）	上年度末（2010年12月31日）
	市场利率下降25基点	103,081.93	177,862.73
	市场利率上升25基点	-102,391.61	-176,241.65

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 2011年12月31日		上年度末 2010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	692,361,385.70	79.15	1,109,499,361.55	75.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	52,833,504.80	6.04	83,259,227.30	5.66
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	745,194,890.50	85.19	1,192,758,588.85	81.11

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中信标普 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（2011 年 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	中信标普 300 指数上升 5%	37,061,528.04	37,560,401.49
	中信标普 300 指数下降 5%	-37,061,528.04	-37,560,401.49

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（2011 年 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	合计	25,778,194.23	32,033,983.37

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	2011 年 12 月 31 日公允价值	2010 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	708,735,365.38	1,162,473,747.45
第二层次	36,459,525.12	30,284,841.40
第三层次	-	-

合计	745,194,890.50	1,192,758,588.85
----	----------------	------------------

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	692,361,385.70	77.69
	其中：股票	692,361,385.70	77.69
2	固定收益投资	52,833,504.80	5.93
	其中：债券	52,833,504.80	5.93
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	49,500,274.25	5.55
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	93,204,202.44	10.46
6	其他各项资产	3,284,426.66	0.37
7	合计	891,183,793.85	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.9.3 其他各项资产构成。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	31,749,663.96	3.63
B	采掘业	-	-
C	制造业	432,453,647.18	49.44
C0	食品、饮料	40,191,522.35	4.59
C1	纺织、服装、皮毛	15,892,048.25	1.82
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	34,330,723.24	3.92
C4	石油、化学、塑胶、塑料	86,573,725.45	9.90
C5	电子	106,379,689.25	12.16
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	133,142,052.13	15.22
C8	医药、生物制品	15,943,886.51	1.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,390,670.89	1.87

F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	53,236,100.96	6.09
H	批发和零售贸易	56,910,228.09	6.51
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	101,621,074.62	11.62
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	692,361,385.70	79.15

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002283	天润曲轴	5,066,084	54,257,759.64	6.20
2	300187	永清环保	1,124,761	53,414,899.89	6.11
3	001696	宗申动力	7,665,090	46,603,747.20	5.33
4	300218	安利股份	1,865,589	32,181,410.25	3.68
5	300132	青松股份	2,211,350	30,958,900.00	3.54
6	300022	吉峰农机	2,515,163	29,704,075.03	3.40
7	002329	皇氏乳业	1,978,572	27,007,507.80	3.09
8	600257	大湖股份	4,258,052	26,527,663.96	3.03
9	002025	航天电器	1,953,957	25,166,966.16	2.88
10	002214	大立科技	807,168	24,085,893.12	2.75
11	000523	广州浪奇	4,506,426	23,433,415.20	2.68
12	002635	安洁科技	763,644	22,901,683.56	2.62
13	000727	华东科技	3,999,947	22,639,700.02	2.59
14	300055	万邦达	1,075,076	20,641,459.20	2.36
15	002059	云南旅游	1,880,224	18,332,184.00	2.10
16	002012	凯恩股份	1,438,220	18,035,278.80	2.06
17	300275	梅安森	505,494	17,490,092.40	2.00
18	002415	海康威视	402,580	17,310,940.00	1.98
19	300205	天喻信息	735,597	17,176,189.95	1.96
20	000516	开元投资	3,342,342	16,477,746.06	1.88
21	002036	宜科科技	1,284,725	15,892,048.25	1.82
22	600528	中铁二局	2,902,773	14,310,670.89	1.64
23	600702	沱牌舍得	792,785	13,184,014.55	1.51
24	600991	广汽长丰	840,600	12,373,632.00	1.41

25	600826	兰生股份	1,129,306	10,728,407.00	1.23
26	002229	鸿博股份	714,403	10,115,946.48	1.16
27	600062	双鹤药业	596,828	9,310,516.80	1.06
28	000598	兴蓉投资	1,106,739	9,152,731.53	1.05
29	300098	高新兴	423,200	9,031,088.00	1.03
30	600316	洪都航空	535,749	8,920,220.85	1.02
31	601311	骆驼股份	400,000	7,348,000.00	0.84
32	002603	以岭药业	172,789	6,633,369.71	0.76
33	002235	安妮股份	646,391	6,179,497.96	0.71
34	300050	世纪鼎利	282,462	3,813,237.00	0.44
35	300024	机器人	205,228	3,638,692.44	0.42
36	300087	荃银高科	200,000	3,582,000.00	0.41
37	300197	铁汉生态	50,000	2,080,000.00	0.24
38	300175	朗源股份	200,000	1,640,000.00	0.19
39	601117	中国化学	14,000	79,800.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600316	洪都航空	133,757,918.35	9.10
2	002049	晶源电子	127,053,713.52	8.64
3	000807	云铝股份	114,672,394.50	7.80
4	000629	攀钢钒钛	113,091,809.65	7.69
5	600702	沱牌舍得	111,272,306.94	7.57
6	600141	兴发集团	110,546,699.56	7.52
7	000969	安泰科技	107,509,670.82	7.31
8	600030	中信证券	105,024,525.02	7.14
9	600193	创兴资源	101,064,294.57	6.87
10	601398	工商银行	93,231,513.35	6.34
11	601006	大秦铁路	91,109,993.94	6.20
12	601668	中国建筑	90,196,400.00	6.13
13	600888	新疆众和	89,649,791.10	6.10
14	601311	骆驼股份	89,469,145.68	6.08
15	002009	天奇股份	86,934,390.04	5.91

16	601288	农业银行	85,957,000.00	5.85
17	002271	东方雨虹	83,653,761.21	5.69
18	600111	包钢稀土	81,774,098.09	5.56
19	002094	青岛金王	77,116,722.12	5.24
20	000779	三毛派神	76,943,800.65	5.23
21	300029	天龙光电	75,164,944.98	5.11
22	000861	海印股份	74,635,116.66	5.08
23	300068	南都电源	74,524,455.34	5.07
24	300197	铁汉生态	71,871,462.73	4.89
25	600395	盘江股份	70,502,193.50	4.79
26	000598	兴蓉投资	69,516,443.47	4.73
27	600048	保利地产	68,834,129.23	4.68
28	600068	葛洲坝	68,757,688.24	4.68
29	001696	宗申动力	68,190,216.46	4.64
30	000758	中色股份	67,990,449.39	4.62
31	002283	天润曲轴	67,529,276.88	4.59
32	000002	万科A	66,826,130.26	4.54
33	600830	香溢融通	65,936,582.37	4.48
34	600482	风帆股份	61,910,811.31	4.21
35	600595	中孚实业	61,582,049.92	4.19
36	600251	冠农股份	61,026,685.13	4.15
37	600773	西藏城投	59,541,346.42	4.05
38	600078	澄星股份	59,378,813.69	4.04
39	600516	方大炭素	58,245,148.60	3.96
40	300187	永清环保	57,558,108.37	3.91
41	600188	兖州煤业	57,290,762.38	3.90
42	600531	豫光金铅	56,606,168.35	3.85
43	600019	宝钢股份	56,223,818.36	3.82
44	601117	中国化学	55,827,758.21	3.80
45	600497	驰宏锌锗	55,782,954.69	3.79
46	601808	中海油服	54,232,807.93	3.69
47	600176	中国玻纤	53,045,836.33	3.61
48	600367	红星发展	52,772,111.85	3.59
49	601607	上海医药	52,203,183.05	3.55
50	601989	中国重工	50,389,333.87	3.43
51	601186	中国铁建	49,144,523.11	3.34

52	600600	青岛啤酒	48,592,104.06	3.30
53	000039	中集集团	48,251,707.00	3.28
54	000718	苏宁环球	48,220,902.33	3.28
55	600346	大橡塑	47,402,021.93	3.22
56	600528	中铁二局	47,232,919.90	3.21
57	300218	安利股份	46,277,661.62	3.15
58	600967	北方创业	46,144,082.29	3.14
59	600614	鼎立股份	45,956,259.05	3.13
60	000776	广发证券	45,772,852.31	3.11
61	002230	科大讯飞	45,338,172.66	3.08
62	000024	招商地产	44,819,041.58	3.05
63	600583	海油工程	44,792,319.74	3.05
64	300022	吉峰农机	44,301,943.60	3.01
65	600559	老白干酒	43,449,420.77	2.95
66	300178	腾邦国际	42,474,521.32	2.89
67	601958	金钼股份	42,222,000.09	2.87
68	000858	五粮液	41,659,185.72	2.83
69	300132	青松股份	41,593,603.62	2.83
70	000751	锌业股份	41,381,750.80	2.81
71	600362	江西铜业	41,104,968.26	2.80
72	600837	海通证券	40,692,778.97	2.77
73	300087	荃银高科	40,532,710.32	2.76
74	000998	隆平高科	40,469,420.25	2.75
75	000727	华东科技	40,464,467.26	2.75
76	300142	沃森生物	39,711,724.16	2.70
77	600420	现代制药	39,349,820.68	2.68
78	002428	云南锗业	39,289,699.75	2.67
79	600580	卧龙电气	39,107,035.31	2.66
80	601377	兴业证券	38,931,547.39	2.65
81	002225	濮耐股份	38,894,532.42	2.64
82	000050	深天马A	38,800,936.07	2.64
83	601216	内蒙君正	38,778,069.44	2.64
84	002480	新筑股份	38,743,898.05	2.63
85	600170	上海建工	38,270,727.88	2.60
86	600724	宁波富达	37,547,981.79	2.55
87	300021	大禹节水	37,522,684.39	2.55

88	000012	南玻A	37,474,010.29	2.55
89	600354	敦煌种业	37,091,152.64	2.52
90	000426	兴业矿业	36,897,786.16	2.51
91	000537	广宇发展	34,943,568.58	2.38
92	600257	大湖股份	34,881,684.86	2.37
93	600376	首开股份	33,513,296.83	2.28
94	600533	栖霞建设	33,341,857.44	2.27
95	002204	大连重工	33,090,335.31	2.25
96	000889	渤海物流	32,742,074.76	2.23
97	002104	恒宝股份	32,660,427.09	2.22
98	002121	科陆电子	32,252,045.32	2.19
99	002060	粤水电	32,242,361.70	2.19
100	300108	双龙股份	32,101,116.50	2.18
101	002190	成飞集成	31,600,439.96	2.15
102	600326	西藏天路	31,595,830.37	2.15
103	002618	丹邦科技	31,197,881.02	2.12
104	600312	平高电气	31,186,142.89	2.12
105	600805	悦达投资	30,730,260.37	2.09
106	300140	启源装备	30,711,345.80	2.09
107	601788	光大证券	30,694,392.72	2.09
108	601009	南京银行	30,639,649.27	2.08
109	600135	乐凯胶片	30,472,090.40	2.07
110	600309	烟台万华	29,949,716.44	2.04
111	600271	航天信息	29,819,458.62	2.03
112	000970	中科三环	29,659,881.90	2.02
113	002149	西部材料	29,649,266.62	2.02
114	600581	八一钢铁	29,616,951.55	2.01
115	002329	皇氏乳业	29,570,705.77	2.01
116	600795	国电电力	29,435,000.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	600141	兴发集团	135,109,159.15	9.19
2	002049	晶源电子	125,121,818.38	8.51
3	600316	洪都航空	115,503,112.02	7.85
4	000629	攀钢钒钛	112,680,940.99	7.66
5	000807	云铝股份	103,088,605.34	7.01
6	000969	安泰科技	100,935,842.31	6.86
7	300029	天龙光电	99,574,982.83	6.77
8	600030	中信证券	98,805,537.80	6.72
9	600702	沱牌舍得	97,418,770.86	6.62
10	600193	创兴资源	93,498,290.67	6.36
11	601398	工商银行	88,049,264.33	5.99
12	300197	铁汉生态	86,302,093.78	5.87
13	601808	中海油服	86,166,877.06	5.86
14	601006	大秦铁路	84,675,183.86	5.76
15	600111	包钢稀土	84,118,731.36	5.72
16	600888	新疆众和	82,780,283.69	5.63
17	601668	中国建筑	82,294,908.56	5.60
18	300068	南都电源	81,471,326.60	5.54
19	601288	农业银行	81,378,078.98	5.53
20	002271	东方雨虹	80,318,192.23	5.46
21	002009	天奇股份	79,386,792.63	5.40
22	601311	骆驼股份	75,901,482.13	5.16
23	000779	三毛派神	75,616,157.33	5.14
24	600516	方大炭素	74,078,508.28	5.04
25	000861	海印股份	72,962,119.38	4.96
26	002094	青岛金王	71,764,774.15	4.88
27	600068	葛洲坝	70,361,879.45	4.78
28	000598	兴蓉投资	69,416,366.43	4.72
29	600048	保利地产	68,369,947.29	4.65
30	000050	深天马A	67,233,513.33	4.57
31	000758	中色股份	66,847,214.85	4.55
32	600395	盘江股份	64,398,833.12	4.38
33	600078	澄星股份	64,323,684.60	4.37
34	000002	万科A	63,758,774.76	4.34
35	600773	西藏城投	62,525,144.30	4.25
36	600251	冠农股份	62,417,333.55	4.24
37	600830	香溢融通	61,271,153.65	4.17
38	600595	中孚实业	58,905,361.15	4.01

39	002230	科大讯飞	58,690,909.02	3.99
40	600019	宝钢股份	57,164,373.34	3.89
41	600188	兖州煤业	56,487,666.84	3.84
42	002277	友阿股份	56,030,861.44	3.81
43	600531	豫光金铅	55,462,830.09	3.77
44	601989	中国重工	53,759,663.26	3.66
45	600497	驰宏锌锗	53,316,526.76	3.63
46	600367	红星发展	52,534,158.88	3.57
47	002041	登海种业	52,188,111.90	3.55
48	601117	中国化学	51,844,576.26	3.53
49	601607	上海医药	49,790,907.05	3.39
50	600482	风帆股份	49,686,869.82	3.38
51	601186	中国铁建	49,465,421.89	3.36
52	000039	中集集团	48,540,797.90	3.30
53	600583	海油工程	48,398,443.34	3.29
54	600498	烽火通信	48,297,585.75	3.28
55	000718	苏宁环球	48,075,281.39	3.27
56	600496	精工钢构	47,865,721.52	3.26
57	600967	北方创业	47,751,123.80	3.25
58	600406	国电南瑞	47,737,242.64	3.25
59	600600	青岛啤酒	47,026,972.75	3.20
60	600533	栖霞建设	46,301,078.28	3.15
61	600581	八一钢铁	46,228,963.60	3.14
62	000998	隆平高科	45,703,075.37	3.11
63	600176	中国玻纤	45,504,563.98	3.09
64	000024	招商地产	44,450,225.16	3.02
65	600346	大橡塑	43,776,271.68	2.98
66	300021	大禹节水	43,552,964.79	2.96
67	000776	广发证券	42,575,614.18	2.90
68	002104	恒宝股份	42,517,290.66	2.89
69	002480	新筑股份	42,082,433.57	2.86
70	600614	鼎立股份	41,970,463.44	2.85
71	000751	锌业股份	40,330,774.56	2.74
72	601958	金钼股份	40,277,742.35	2.74
73	600837	海通证券	39,989,115.98	2.72
74	600559	老白干酒	39,511,577.79	2.69
75	300142	沃森生物	39,408,234.81	2.68
76	600366	宁波韵升	39,344,098.05	2.68

77	000858	五 粮 液	39,228,409.78	2.67
78	002428	云南锗业	38,941,590.29	2.65
79	600362	江西铜业	38,793,790.62	2.64
80	002225	濮耐股份	38,234,989.96	2.60
81	300087	荃银高科	38,191,921.31	2.60
82	601377	兴业证券	37,855,385.95	2.57
83	300178	腾邦国际	37,547,331.57	2.55
84	600511	国药股份	37,504,598.98	2.55
85	600354	敦煌种业	36,189,720.71	2.46
86	600580	卧龙电气	36,100,920.57	2.45
87	000012	南 玻 A	35,560,247.20	2.42
88	601216	内蒙君正	35,559,840.22	2.42
89	002060	粤 水 电	34,712,099.51	2.36
90	000537	广宇发展	34,699,620.55	2.36
91	600724	宁波富达	34,530,665.42	2.35
92	300018	中元华电	34,405,934.67	2.34
93	600326	西藏天路	34,343,942.17	2.34
94	600170	上海建工	33,612,945.18	2.29
95	600376	首开股份	33,307,684.32	2.27
96	002190	成飞集成	32,885,686.70	2.24
97	600420	现代制药	32,576,713.59	2.22
98	000426	兴业矿业	31,935,037.07	2.17
99	600271	航天信息	31,119,876.64	2.12
100	002204	大连重工	30,522,770.86	2.08
101	002121	科陆电子	30,342,312.24	2.06
102	600312	平高电气	29,924,879.23	2.03
103	600231	凌钢股份	29,871,384.74	2.03
104	002313	日海通讯	29,816,126.18	2.03
105	002618	丹邦科技	29,767,210.09	2.02
106	601009	南京银行	29,614,594.72	2.01
107	600309	烟台万华	29,489,056.29	2.01
108	600795	国电电力	29,480,579.90	2.00
109	600161	天坛生物	29,479,847.63	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,505,626,200.10
卖出股票收入（成交）总额	9,463,229,125.21

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、债转股及行权等获得的股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	23,888,104.80	2.73
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	28,945,400.00	3.31
7	其他	-	-
8	合计	52,833,504.80	6.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110003	新钢转债	250,000	24,925,000.00	2.85
2	115002	国安债 1	150,000	13,897,500.00	1.59
3	126008	08 上汽债	106,920	9,990,604.80	1.14
4	110015	石化转债	40,000	4,020,400.00	0.46

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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	2,914,850.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	273,399.70
5	应收申购款	96,176.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,284,426.66

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110003	新钢转债	24,925,000.00	2.85
2	110015	石化转债	4,020,400.00	0.46

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002214	大立科技	24,085,893.12	2.75	重大事项停牌

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
96,567	18,238.70	22,198,006.91	1.26%	1,739,058,576.44	98.74%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	299,141.24	0.0170%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

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

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，季雷先生不再担任华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，韩玮先生不再担任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理的职务。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘张钊先生为华富强化回报债券型证券投资基金的基金经理。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘胡伟先生为华富收益增强债券型证券投资基金的基金经理。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，曾刚先生不再担任华富强化回报债券型证券投资基金基金经理的职务。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，曾刚先生不再担任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理的职务。

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经公司董事会审议通过，同意将本基金的审计机构由天健正信会计师事务所变更为天健会计师事务所（特殊普通合伙），本基金本年度支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 10 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	2,179,938,210.96	11.49%	1,787,928.73	11.33%	-
光大证券	2	1,990,862,482.06	10.50%	1,619,925.30	10.27%	-

华安证券	3	1,704,660,423.84	8.99%	1,405,709.22	8.91%	-
国金证券	2	1,699,105,130.17	8.96%	1,392,637.08	8.83%	-
长江证券	1	1,558,386,281.49	8.22%	1,324,621.26	8.40%	-
中山证券	1	1,241,671,882.49	6.55%	1,055,416.99	6.69%	-
民生证券	1	1,185,182,785.99	6.25%	1,007,400.08	6.39%	-
新时代证券	1	1,005,774,634.93	5.30%	854,906.51	5.42%	-
安信证券	2	849,839,235.81	4.48%	690,499.83	4.38%	-
世纪证券	1	761,026,998.25	4.01%	646,864.85	4.10%	-
中信建投证券	1	667,225,247.34	3.52%	542,125.27	3.44%	-
宏源证券	1	531,247,684.52	2.80%	431,642.21	2.74%	-
申银万国	1	515,968,770.77	2.72%	438,572.22	2.78%	-
国泰君安	1	432,112,305.11	2.28%	367,295.04	2.33%	-
西南证券	1	363,014,728.59	1.91%	294,954.24	1.87%	-
长城证券	1	326,119,763.23	1.72%	264,974.87	1.68%	-
华宝证券	1	319,608,498.21	1.68%	271,664.60	1.72%	-
东北证券	1	318,847,481.36	1.68%	271,018.56	1.72%	-
第一创业证券	1	295,002,424.31	1.56%	250,748.90	1.59%	-
中投证券	3	253,124,716.50	1.33%	205,665.42	1.30%	-
国联证券	1	196,546,712.77	1.04%	167,064.41	1.06%	-
高华证券	1	177,396,392.97	0.94%	150,786.62	0.96%	-
华泰联合证券	2	141,410,329.78	0.75%	120,199.03	0.76%	-
英大证券	1	127,243,196.11	0.67%	103,386.14	0.66%	-
齐鲁证券	1	122,768,610.88	0.65%	104,353.16	0.66%	-
方正证券	1	4,770,396.87	0.03%	4,054.76	0.03%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

广发华福证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	11,065,365.98	16.70%	-	-	-	-
光大证券	11,051,031.20	16.67%	-	-	-	-
华安证券	2,890,943.60	4.36%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	19,090,781.58	28.81%	-	-	-	-
中山证券	11,968,151.10	18.06%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	10,207,700.00	15.40%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
广发华福证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。本报告期本基金新增交易单元的情况分别是：西南证券、华泰联合证券、英大证券、方正证券、东吴证券、国海证券各新增 1 个席位。本报告期本基金注销交易单元的情况是：民族证券注销 1 个席位。

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

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部分开放式基金参加日信证券网上交易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	2011 年 1 月 17 日
2	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加日信证券为为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 1 月 17 日
3	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 1 月 18 日
4	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳农村商业银行定期定额申购费率优惠活动公	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 1 月 20 日

	告》		
5	《华富竞争力优选混合型证券投资基金 2010 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	2011 年 1 月 21 日
6	《华富基金管理有限公司关于更 换董事长的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 1 月 26 日
7	《华富基金管理有限公司关于旗 下基金持有的停牌股票恢复市价 估值方法的提示性公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 2 月 1 日
8	《华富基金管理有限公司关于旗 下开放式基金增加上海农村商业 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	2011 年 2 月 23 日
9	《华富基金管理有限公司关于旗 下部分开放式基金参加上海农村 商业银行基金代销费率优惠活动的 公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 2 月 23 日
10	《华富基金管理有限公司关于旗 下开放式基金增加华宝证券为代 销机构的公告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 3 月 3 日
11	《华富竞争力优选混合型证券投 资基金 2010 年年度报告》	在《中国证券报》、 《上海证券报》、《证 券时报》上公告	2011 年 3 月 28 日
12	《华富竞争力优选混合型证券投 资基金招募说明书更新（2011 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	2011 年 4 月 16 日
13	《华富竞争力优选混合型证券投 资基金 2011 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	2011 年 4 月 22 日

14	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信证券开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年5月9日
15	《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	2011年5月26日
16	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加厦门证券网上交易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	2011年6月29日
17	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信银行网上银行、移动银行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	2011年7月4日
18	《华富竞争力优选混合型证券投资基金 2011 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	2011年7月20日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年8月9日
20	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年8月19日
21	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加东吴证券为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年8月19日
22	《华富竞争力优选混合型证券投资基金 2011 年半年度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年8月24日

23	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华宝证券网上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	2011年8月31日
24	《华富竞争力优选混合型证券投资基金招募说明书更新（2011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	2011年10月17日
25	《华富竞争力优选混合型证券投资基金2011年第3季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年10月24日
26	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华安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	2011年11月7日
27	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加国海证券为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年11月24日
28	《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	2011年11月26日
29	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年12月1日
30	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信万通证券开通定期定额投资业务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年12月7日
31	《关于华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金变更代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011年12月26日
32	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华夏银行	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证	2011年12月30日

	基金定投和网上银行基金申购费率优惠活动的公告》	券时报》上公告	
33	《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深圳发展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	2011 年 12 月 30 日
34	《华富基金管理有限公司关于在中国银行开立直销账户银行账户变更的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2011 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2011 年 10 月 28 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，根据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“本行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

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

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富竞争力优选混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富竞争力优选混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富竞争力优选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。