

# 华富中证 100 指数证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2018 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华富中证 100 指数
基金主代码	410008
交易代码	410008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 30 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	75,502,599.10 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资约束和数量化风险控制，力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%和年跟踪误差不超过 4%，以实现中证 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，本基金的标的指数为中证 100 指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略，即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率 $\times$ 95% + 一年期银行定期存款收益率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下，其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	陆志俊
	联系电话	021-68886996	95559
	电子邮箱	manzh@hffund.com	luzj@bankcomm.com

客户服务电话	400-700-8001	95559
传真	021-68887997	021-62701216

## 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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	7,341,081.19	1,423,427.58	36,146,681.01
本期利润	24,756,901.33	-2,386,084.80	6,413,332.30
加权平均基金份额本期利润	0.3567	-0.0685	0.0846
本期基金份额净值增长率	33.91%	-6.11%	0.08%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2594	0.0042	0.0696
期末基金资产净值	101,530,709.22	32,772,109.57	38,494,461.13
期末基金份额净值	1.3447	1.0042	1.0696

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	8.47%	0.85%	7.87%	0.86%	0.60%	-0.01%

过去六个月	16.29%	0.72%	12.46%	0.73%	3.83%	-0.01%
过去一年	33.91%	0.64%	28.63%	0.65%	5.28%	-0.01%
过去三年	25.83%	1.59%	18.48%	1.56%	7.35%	0.03%
过去五年	79.48%	1.49%	62.51%	1.47%	16.97%	0.02%
自基金合同生效起至今	34.47%	1.42%	20.98%	1.41%	13.49%	0.01%

注：业绩比较基准收益率=中证 100 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×5%，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

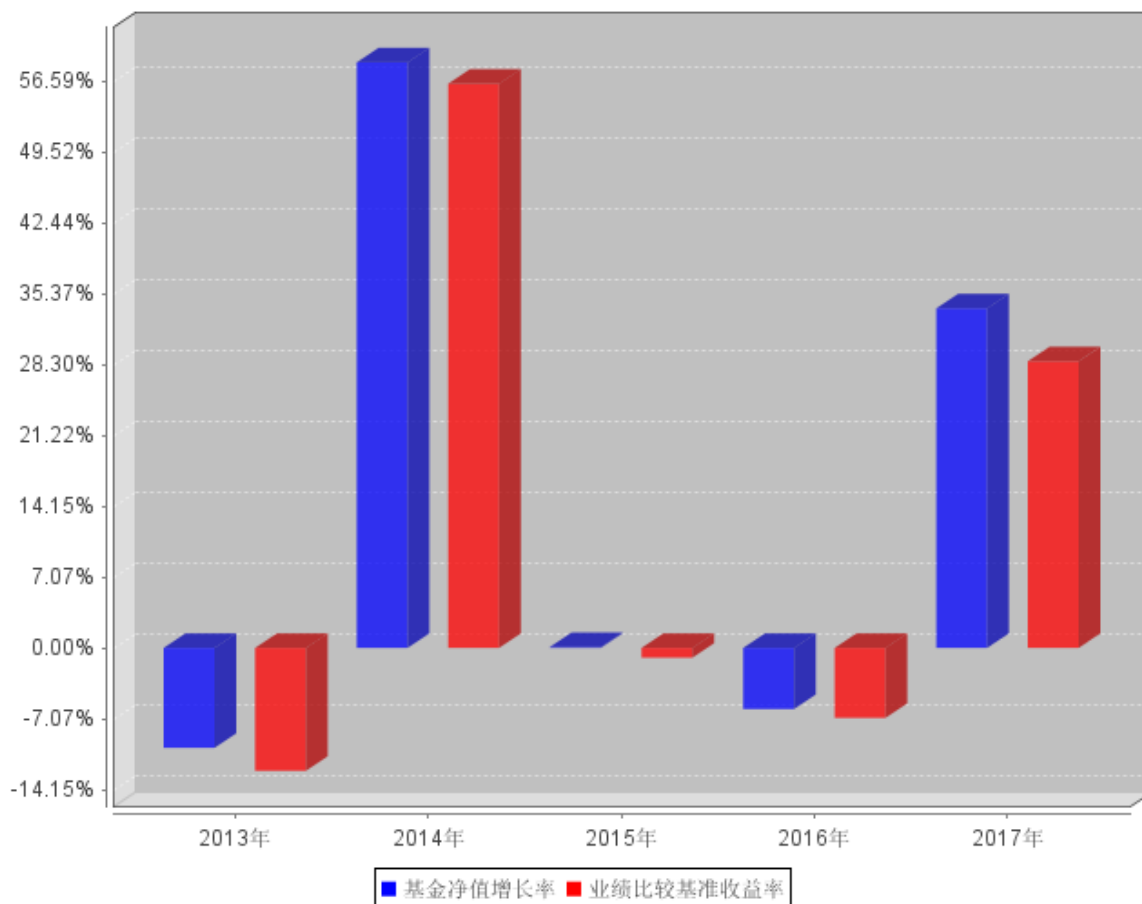
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据基金合同的规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的 90%~95%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 12 月 30 日至 2010 年 6 月 30 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

注：本基金未进行利润分配。

## § 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 日在上海正式成立。注册资本 2.5 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金融控股（集团）有限公司。截止 2017 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、华富成长趋势混合型证券投资基金、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、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富旺财保本混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享保本混合型证券投资基金、华富安福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金，共三十四只基金。

#### 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		
高靖瑜	华富中证 100 指数基金基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选灵活配置	2017 年 9 月 12 日	-	十七年	复旦大学金融学硕士，本科学历。历任金鼎综合证券（维京）股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员，2007 年 7 月加入华富基金管理有限公司，任行业研究员，2013 年 3 月 1 日至 2014 年 12 月 14 日任华富价值增长混合型基金基金经理助理，2014 年 12 月 15 日至 2016 年 1 月 12 日任华富策略精选灵活配置混合型基金经理。

	混合型 基金基 金经理、 华富中 小板指 数增强 型基金 基金基 金经理				
朱蓓	华富中 证 100 指 数基金 基金基 金经理、 华富量 子生命 力混合 型基金 基金基 金经理、 华富中 小板指 数增强 型基金 基金基 金经理	2012 年 12 月 19 日	2017 年 9 月 22 日	十年	上海交通大学安泰管理 学院会计学硕士、 研究生学历，曾担任 平安资产管理有限责 任公司量化投资部投 资经理助理，2009 年 11 月进入华富基金管 理有限公司，曾任金 融工程研究员、产品 设计经理。2011 年 4 月 1 日至 2017 年 9 月 22 日任华富量子 生命力混合型基金基 金经理，2012 年 12 月 19 日至 2017 年 9 月 22 日任华富中证 100 指数基金基金经 理，2012 年 12 月 19 日 至 2017 年 9 月 22 日 任华富中小板指数增 强型基金基金经理。

注：这里的任职日期指公司作出决定之日，这里的离职时间指中国基金业协会作出注销决定之日。

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

2017 年，经济总体平稳运行，略超预期。2017 年全年 GDP 同比 6.9%，预期 6.8%，四季度 GDP 同比 6.8%，预期 6.7%。从支出法看，2017 年最终消费支出、资本形成总额、货物和服务净出口对经济增长的贡献率分别为 58.8%、32.1%、9.1%，消费比投资贡献高出 26.7 个百分点。从 2018 年开年看，经济运行仍然平稳，1 月官方制造业 PMI 51.3，预期 51.6，前值 51.6，2017 年同期 51.3，制造业 PMI 数据虽略低于预期，但仍处 51 以上。PMI 连续 18 个月处于扩张区间，并高于 2012 年-2017 年六年均值 50.3。

2017 年，沪深 300 指数累计上涨 21.78%，创业板指累计下跌 10.67%；其中，四季度沪深 300 指数上涨 5.07%，创业板指下跌 6.12%。从全年看，食品饮料、家电等消费类行业业绩估值双升，涨幅居前；在供给侧改革的推动下，周期类产品价格回暖，相关行业个股业绩增长迅猛，表现也都排名前列；其他如电子、医药等行业也有个股的结构性行情。全年看，龙头企业、业绩成长较好、估值合理的公司成为全年的主线。

2017 年华富中证 100 基准涨跌幅为 28.63%，华富中证 100 涨跌幅为 33.91%，2017 年全年超额收益 5.28%，超额收益主要由两部分组成，一部分是由成分股分红导致的基准自然回落获得，另一部分是由打新策略的绝对收益获得的。2017 年在龙头白马股持续走强的大背景下，中证 100 指数获得了一个不错的投资回报，外加合理的辅佐策略作用下，2017 年呈现出强大的业绩表现，凸显龙头白马指数的优势。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2009 年 12 月 30 日正式成立。截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.3447 元，累计基金份额净值为 1.3447 元。本基金本报告期份额净值增长率为 33.91%，同期业

绩比较基准收益率为 28.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在国内持续推进供给侧改革、一带一路、国企制改革等政策的大背景下，大盘蓝筹无疑是最受益的板块。短期或中期的板块调整肯定也是在所难免的，所以长期仍是看好国家发展，看好大盘蓝筹，看好中证 100。

本基金是完全复制的指数基金，为投资者提供有效跟踪市场的投资工具，通过严格的投资约束和数量化风险控制，力争实现对业绩基准的有效跟踪。本基金增加了打新策略，在严格控制基金跟踪误差的前提下，适当优化基金的成本收益。我们将恪守基金合同的规定，保持对基准的紧密跟踪，使投资者分享中国经济长期快速增长的成果。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所（特殊普通合伙）进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富中证 100 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 24,756,901.33 元，期末可供分配利润为 19,587,519.63 元。本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2015 年 10 月 22 日起至本报告期中（2017 年 3 月 14 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于五千万元的情形，但至本报告期期末（2017 年 12 月 31 日）基金资产净值

已经高于 5000 万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对基金进行监控和操作。

## § 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

2017 年度，基金托管人在华富中证 100 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2017 年度，华富基金管理有限公司在华富中证 100 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2017 年度，由华富基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华富中证 100 指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审（2018）6-66 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	华富中证 100 指数证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华富中证 100 指数证券投资基金（以下简称华富中证 100 指数基金）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、持有人权益（基金净值）变动表，以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华富中证 100 指数基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和持有人权益（基金净值）变动。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华富中证 100 指数基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
其他信息	<p>华富中证 100 指数基金管理人（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华富中证 100 指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督华富中证 100 指数基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的

责任

重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，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。

(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华富中证 100 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华富中证 100 指数基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张建华	林晶
会计师事务所的地址	浙江省杭州市钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 层	
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华富中证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		706,423.01	1,014,538.72
结算备付金		143,906.56	1,041,250.61
存出保证金		4,577.73	1,550.02
交易性金融资产		100,762,030.06	31,049,599.25
其中：股票投资		95,620,532.46	31,049,599.25
基金投资		-	-
债券投资		5,141,497.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		124,406.20	735.61
应收股利		-	-
应收申购款		60,047.08	10,015.75
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		101,801,390.64	33,117,689.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 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		-	-
应付赎回款		78,100.79	76,541.37
应付管理人报酬		43,067.07	14,270.23
应付托管费		12,920.13	4,281.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		11,317.71	5,420.17
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		125,275.72	245,067.56
负债合计		270,681.42	345,580.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		75,502,599.10	32,634,574.05
未分配利润		26,028,110.12	137,535.52
所有者权益合计		101,530,709.22	32,772,109.57
负债和所有者权益总计		101,801,390.64	33,117,689.96

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 101,530,709.22 元，基金份额总额 75,502,599.10 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

## 7.2 利润表

会计主体：华富中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		25,579,088.47	-1,979,090.51
1.利息收入		193,579.87	32,846.38
其中：存款利息收入		20,698.24	29,737.22
债券利息收入		119,765.11	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		53,116.52	3,109.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,961,451.83	1,792,558.75
其中：股票投资收益		5,967,741.23	892,055.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,977.22	-
资产支持证券投资		-	-



贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,991,733.38	900,502.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		17,415,820.14	-3,809,512.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		8,236.63	5,016.74
<b>减：二、费用</b>		822,187.14	406,994.29
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	404,042.10	166,922.47
2. 托管费	7.4.8.2.2	121,212.71	50,076.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		139,033.84	34,880.06
5. 利息支出		32,823.49	-
其中：卖出回购金融资产支出		32,823.49	-
6. 其他费用		125,075.00	155,115.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		24,756,901.33	-2,386,084.80
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		24,756,901.33	-2,386,084.80

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	32,634,574.05	137,535.52	32,772,109.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	24,756,901.33	24,756,901.33
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	42,868,025.05	1,133,673.27	44,001,698.32

列)			
其中：1. 基金申购款	59,329,424.42	4,714,410.14	64,043,834.56
2. 基金赎回款	-16,461,399.37	-3,580,736.87	-20,042,136.24
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）	75,502,599.10	26,028,110.12	101,530,709.22
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	35,990,591.38	2,503,869.75	38,494,461.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-2,386,084.80	-2,386,084.80
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）	-3,356,017.33	19,750.57	-3,336,266.76
其中：1. 基金申购款	5,804,259.92	-194,131.43	5,610,128.49
2. 基金赎回款	-9,160,277.25	213,882.00	-8,946,395.25
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）	32,634,574.05	137,535.52	32,772,109.57

注：后附报表附注为本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	余海春	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

华富中证 100 指数型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可【2009】1158 号）核准，基金合同于 2009 年 12 月 30 日生

效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健光华（北京）会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健光华验（2009）综字第 070007 号）。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。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》的规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

#### **7.4.4 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 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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1 号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85 号）、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2015〕101 号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36 号）、《关于进一步明确全

面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税〔2016〕46 号）、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2016〕70 号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一） 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

（二） 对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

（三） 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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% 的个人所得税。

#### 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
交通银行股份有限公司	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

#### 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	75,835,189.05	72.42%	16,204,440.91	72.92%

##### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	4,299,434.80	37.77%	-	-

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华安证券	149,374,000.00	69.30%	11,000,000.00	100.00%

#### 7.4.8.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元发生的权证交易。

#### 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	70,570.49	72.84%	8,554.67	75.59%
关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	15,091.30	73.34%	4,395.44	81.09%

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	404,042.10	166,922.47
其中：支付销售机构的客户维护费	59,030.40	55,313.88

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.50% 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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	121,212.71	50,076.76

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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

注：本基金本报告期内和上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

注：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

注：本报告期末和上年度末没有其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
交通银行股份有限公司	706,423.01	7,660.62	1,014,538.72	3,367.68

注：1) 本表仅列示活期存款余额及产生利息。

2) 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2017 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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（2017 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

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,053	17,637.75	17,637.75	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.10.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017 年 12 月	2018 年 1 月	新债流通受限	100.00	100.00	607	60,700.00	60,700.00	-

		5 日	12 日							
--	--	-----	------	--	--	--	--	--	--	--

注：实际可流通日以该证券公告为准。

### 7.4.9.2 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
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大事项停牌	52.04	-	-	6,027	422,259.44	313,645.08	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事项停牌	3.91	2018 年 1 月 24 日	13.80	30,588	624,705.38	119,599.08	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项停牌	14.59	-	-	7,924	217,414.82	115,611.16	-

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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	2017 年 12 月 31 日公允价值	2016 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	95,037,896.19	30,394,211.03
第二层次	5,604,534.79	655,388.22
第三层次	119,599.08	-
合计	100,762,030.06	31,049,599.25

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号）的要求，本基金自 2015 年 3 月 30 日起，对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值（估值标准另有规定的除外），年末本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

## § 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	95,620,532.46	93.93
	其中：股票	95,620,532.46	93.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,141,497.60	5.05
	其中：债券	5,141,497.60	5.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	850,329.57	0.84
8	其他各项资产	189,031.01	0.19
9	合计	101,801,390.64	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 其他各项资产构成。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	3,196,887.46	3.15
C	制造业	31,581,976.78	31.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,713,210.21	2.67
E	建筑业	3,819,875.88	3.76
F	批发和零售业	560,215.07	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,992,766.04	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,720,494.38	1.69
J	金融业	43,587,595.42	42.93
K	房地产业	4,940,762.39	4.87
L	租赁和商务服务业	843,110.40	0.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	313,645.08	0.31
S	综合	-	-
	合计	95,270,539.11	93.83

注：本基金本报告期指数投资部分含拟于 2018 年 1 月 1 日调入中证 100 指数的备选成分股，具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	198,084.37	0.20

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,166.70	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	119,599.08	0.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	349,993.35	0.34

### 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

#### 8.3.1 指数投资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	601318	中国平安	132,594	9,278,928.12	9.14
2	600519	贵州茅台	6,150	4,289,563.50	4.22
3	600036	招商银行	126,252	3,663,833.04	3.61
4	000333	美的集团	55,604	3,082,129.72	3.04
5	601166	兴业银行	152,569	2,592,147.31	2.55
6	000651	格力电器	58,907	2,574,235.90	2.54
7	600016	民生银行	289,377	2,427,873.03	2.39
8	600887	伊利股份	74,402	2,395,000.38	2.36
9	601288	农业银行	588,914	2,255,540.62	2.22

10	600000	浦发银行	172,472	2,171,422.48	2.14
----	--------	------	---------	--------------	------

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 8.3.2 积极投资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	300104	乐视网	30,588	119,599.08	0.12
2	600485	信威集团	7,924	115,611.16	0.11
3	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.04
4	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.02
5	603161	科华控股	1,053	17,637.75	0.02

## 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	601318	中国平安	4,074,563.00	12.43
2	000651	格力电器	3,757,425.00	11.47
3	000002	万科A	3,051,020.00	9.31
4	600519	贵州茅台	2,957,237.70	9.02
5	600690	青岛海尔	2,196,994.00	6.70
6	600048	保利地产	2,139,641.00	6.53
7	601166	兴业银行	2,039,896.00	6.22
8	600036	招商银行	1,966,258.00	6.00
9	000333	美的集团	1,826,442.99	5.57
10	600016	民生银行	1,823,169.00	5.56
11	000001	平安银行	1,707,899.00	5.21
12	600000	浦发银行	1,681,145.00	5.13
13	000858	五粮液	1,593,348.26	4.86
14	601169	北京银行	1,542,381.00	4.71
15	601288	农业银行	1,507,214.00	4.60
16	601668	中国建筑	1,098,545.00	3.35

17	601688	华泰证券	1,033,892.00	3.15
18	600030	中信证券	1,004,488.00	3.07
19	600837	海通证券	990,503.00	3.02
20	600015	华夏银行	961,418.00	2.93
21	000776	广发证券	942,793.10	2.88
22	601988	中国银行	892,099.00	2.72
23	002415	海康威视	873,659.00	2.67
24	600887	伊利股份	854,290.00	2.61
25	601818	光大银行	801,603.00	2.45
26	600703	三安光电	792,832.00	2.42
27	601766	中国中车	787,766.00	2.40
28	600104	上汽集团	780,541.00	2.38
29	601398	工商银行	771,275.00	2.35
30	000725	京东方 A	737,949.00	2.25
31	600900	长江电力	732,392.00	2.23
32	600919	江苏银行	687,954.00	2.10
33	601211	国泰君安	679,692.00	2.07
34	600019	宝钢股份	679,486.47	2.07
35	601601	中国太保	668,784.00	2.04
36	002027	分众传媒	658,758.00	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	000651	格力电器	2,880,542.65	8.79
2	000002	万科A	2,777,069.17	8.47
3	600690	青岛海尔	1,902,549.42	5.81
4	600519	贵州茅台	1,734,210.35	5.29
5	600048	保利地产	1,677,352.82	5.12
6	601318	中国平安	1,488,985.34	4.54
7	000001	平安银行	1,163,716.15	3.55
8	000858	五粮液	1,111,173.96	3.39
9	000333	美的集团	690,370.62	2.11
10	601166	兴业银行	675,571.42	2.06

11	601169	北京银行	636,387.18	1.94
12	601688	华泰证券	634,576.50	1.94
13	000776	广发证券	611,585.18	1.87
14	600036	招商银行	610,544.55	1.86
15	600015	华夏银行	517,603.76	1.58
16	600000	浦发银行	481,738.72	1.47
17	601377	兴业证券	442,555.00	1.35
18	601288	农业银行	432,838.41	1.32
19	601766	中国中车	401,382.07	1.22
20	600886	国投电力	394,435.89	1.20

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	73,898,482.97
卖出股票收入（成交）总额	32,717,089.05

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	5,080,797.60	5.00
	其中：政策性金融债	5,080,797.60	5.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	60,700.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,141,497.60	5.06

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	108601	国开 1703	50,920	5,080,797.60	5.00
2	128024	宁行转债	607	60,700.00	0.06

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	4,577.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	124,406.20
5	应收申购款	60,047.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	189,031.01

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五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	300104	乐视网	119,599.08	0.12	重大事项停牌
2	600485	信威集团	115,611.16	0.11	重大事项停牌



3	603161	科华控股	17,637.75	0.02	新股流通受限
---	--------	------	-----------	------	--------

### 8.12.6 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
2,323	32,502.20	47,910,118.82	63.45%	27,592,480.28	36.55%

### 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年12月30日）基金份额总额	337,421,352.99
----------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	32,634,574.05
本报告期基金总申购份额	59,329,424.42
减:本报告期基金总赎回份额	16,461,399.37
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	75,502,599.10

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，因工作需要，增聘姚姣姣女士为华富货币市场基金基金经理。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣姣女士为华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金经理。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣姣女士为华富天益货币市场基金基金经理。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理的职务。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈启明先生为华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣姣女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，刘文正先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，刘文正先生不再担任华富智慧城市灵活配置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，因工作需要，增聘高靖瑜女士为华富策略精选灵活配置混合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，因工作需要，翁海波先生不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

11、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘高靖瑜女士为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

12、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，翁海波先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

13、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘龚炜先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

14、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘龚炜先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

15、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘翁海波先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

16、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘龚炜先生为华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

17、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘翁海波先生为华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

18、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富恒财分级债券型证券投资基金基金经理。

19、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘姚姣女士为华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

20、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘龚炜先生为华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理。

21、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

22、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘高靖瑜女士为华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理。

23、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘高靖瑜女士为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。

24、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，朱蓓女士不再担任华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理的职务。

25、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，朱蓓女士不再担任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理的职务。

26、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，朱蓓女士不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。

27、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，孔庆卿先生不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。

28、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 4 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、托管人的托管业务部门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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国信证券	1	28,877,214.09	27.58%	26,315.73	27.16%	-
华安证券	2	75,835,189.05	72.42%	70,570.49	72.84%	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、资讯服务能力强的一家券商租用了基金专用交易单元。本报告期本基金未新增交易单元。

### 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
国信证券	7,084,199.50	62.23%	66,185,000.00	30.70%	-	-
华安证券	4,299,434.80	37.77%	149,374,000.00	69.30%	-	-

注：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

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	3.15-12.31	0.00	47,910,118.82	0.00	47,910,118.82	63.45%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

无

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。