

## 华富中证100指数证券投资基金

## [2012] 第二季度报告

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  
报告送出日期:2012年7月18日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性承担个别及连带责任。

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2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等，保证本报告的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。

本报告财务数据未经审计。

报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称 华富中证100指数

基金代码 410008

交易代码 410008

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2009年12月30日

报告期末基金份额总额 247,707,071.97份

投资目标 在严格控制风险的前提下，通过投资于中证100指数成分股，力争实现基金资产的长期稳定增值，力争在扣除相关费用之后的收益率不低于中证100指数收益率的4%以上。

投资策略 本基金为指数型基金，本基金的投资对象为中证100指数，本基金的基本投资策略是通过投资于中证100指数成份股，力争在扣除相关费用之后的收益率不低于中证100指数收益率的4%以上。

业绩比较基准 中证100指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%

风险收益特征 风险收益特征属股票型基金，风险较高，预期收益较高。

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -2,278,457.37

2.本期利润 -46,573.11

3.期初平准基金份额本期利润 175,696,141.92

4.期末基金份额净值 0.7093

注:1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

3.2.1 本期报告期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 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.39% 1.02% 0.38% 1.02% 0.19% 0.00%

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

注:本基金报告期未持有积极投资部分股票。

3.3 报告期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

3.3.1 报告期按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组合

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000036 招商银行 740,648.00 8.08%

2 000006 平安银行 8,087,876.16 4.69%

3 000016 民生银行 1,345,591.00 4.59%

4 601166 兴业银行 466,534.00 3.45%

5 600000 浦发银行 708,523.00 3.28%

6 600519 前海人寿 21,485.00 2.92%

7 600030 中信证券 3,108,718.00 2.63%

8 600002 中国人寿 500,206.00 2.54%

9 601398 工商银行 1,061,064.00 2.49%

10 600837 海通证券 431,762.00 2.37%

注:本基金报告期未持有积极投资部分股票。

3.3.2 报告期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

3.3.3 报告期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组合

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000036 招商银行 740,648.00 8.08%

2 000006 平安银行 8,087,876.16 4.69%

3 000016 民生银行 1,345,591.00 4.59%

4 601166 兴业银行 466,534.00 3.45%

5 600000 浦发银行 708,523.00 3.28%

6 600519 前海人寿 21,485.00 2.92%

7 600030 中信证券 3,108,718.00 2.63%

8 600002 中国人寿 500,206.00 2.54%

9 601398 工商银行 1,061,064.00 2.49%

10 600837 海通证券 431,762.00 2.37%

注:本基金报告期未持有积极投资部分股票。

3.4 报告期内损益情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.3 报告期内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金额占当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资组合运作分析

本基金的持仓比例符合基金的资产配置和投资目标，实现了对有效跟踪。报告期内基金运作良好，跟踪偏离度和跟踪误差均符合基金合同的要求。

4.5 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。截止2012年6月30日，本基金份额净值为0.7093%，累计份额净值为0.7093%元，期间回报率-1.39%，同期回报率-9.5%。注:本基金于2009年12月30日至2010年6月30日，建仓期结束时各项资产配比符合基金合同约定。本报告期内，本基金严格执行了华富中证100指数证券投资基金基金合同的规定。

4.6 管理人报告

4.6.1 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.2 本报告期内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管理暂行制度》，对本基金的二级市场申购、二级市场价格偏离度、投资组合评估、交易记录等进行定期分析，对基金经理的交易行为进行合规性审查，确保基金经理的交易行为符合法律法规，未发现异常情况。

4.6.3 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.4 本报告期内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管理暂行制度》，对本基金的二级市场申购、二级市场价格偏离度、投资组合评估、交易记录等进行定期分析，对基金经理的交易行为进行合规性审查，确保基金经理的交易行为符合法律法规，未发现异常情况。

4.6.5 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.6 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.7 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.8 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.9 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.10 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.11 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.12 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.13 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.14 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.15 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.16 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.17 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.18 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.19 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.20 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.21 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.22 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.23 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.24 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.25 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.26 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.27 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.28 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.29 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.30 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.31 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.32 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.33 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.34 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.35 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.36 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.37 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。

4.6.38 本报告期内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，结合公司内部制度，制衡各基金经理对同一投资标的买卖，确保基金经理在投资决策过程中不存在利益输送和不公平交易的情况。