华富收益增强债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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
报告送出日期:2013年1月21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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2012年10月1日至2012年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富收益增强债券	
基金主代码	410004	
交易代码	410004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年5月28日	
报告期末基金份额总额	1,023,671,624.07份	
投资目标	本基金主要投资于固定收益类产品,在维持资产较高流动性、严格控制投资风险、获得债券稳定收益的基础上,积极利用各种稳健的金融工具和投资渠道,力争基金资产的持续增值。	
投资策略	本基金以系统化研究为基础,通过对固定收益类资产的主动配置获得稳定的债券总收益,并通过新股申购、转债投资等品种的主动投资提升基金资产的增值效率。投资策略主要包括纯固定收益、新股申购、转债投资等。	
业绩比较基准	中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,预期其长期平均风险和收益高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
下属两级基金的交易代码	410004	410005
报告期末下属两级基金的份额总额	616,380,747.67份	407,290,876.40份

§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10月1日-2012年12月31日)	
	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
1.本期已实现收益	-5,660,083.86	-4,305,437.67
2.本期利润	25,957,230.87	16,889,482.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0382	0.0364
4.期末基金资产净值	712,036,157.77	465,634,845.67
5.期末基金份额净值	1.1552	1.1432

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、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,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

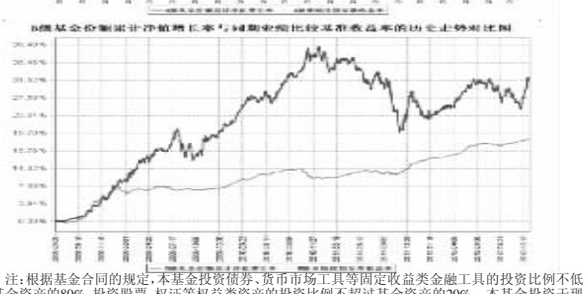
华富收益增强债券A

阶段	净值增长率(1)	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	3.59%	0.39%	1.02%	0.02%	2.57%	0.37%

华富收益增强债券B

阶段	净值增长率(1)	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	3.48%	0.39%	1.02%	0.02%	2.46%	0.37%

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:根据基金合同的规定,本基金投资债券、货币市场工具等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%,投资股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不直接在二级市场买入股票等权益类资产,但可以参与一级市场新股申购和新股增发,并持有因在一级市场申购所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票。本基金还可以持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。本基金建仓期为2008年5月28日至11月28日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡伟	华富收益增强债券基金基金经理、华富货币市场基金基金经理、公司固定收益部副总监	2011年10月10日	-	八年	中南财经政法大学经济学学士、本科学历,曾任珠海市商业银行资金营运部交易员、从事债券研究及债券交易工作,2006年11月加入华富基金管理有限公司,历任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理,现任华富基金管理有限公司固定收益部副总监、投资决策委员会成员、华富货币市场基金基金经理、华富收益增强债券型证券投资基金基金经理。

注:这里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,对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度,国内经济触底回升,通胀维持较低水平,市场风险情绪有所上升。央行四季度继续维持逆回购的操作方式动态调节市场资金水平,年末资金利率波动幅度低于往年。

四季度,广义基金继续发力,推动信用债供需两,信用事件和个券降级时有发生,交易所低等级债净值下跌明显。受益于经济数据的好转以及风险情绪的上升,权益类以及转债表现较优。

本基金四季度受益于权益类及转债的表现,组合净值大幅提升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2008年5月28日正式成立。截止到2012年12月31日,华富收益增强A类基金份额净值为1.1552元,累计份额净值为1.3272元,本报告期的份额累计净值增长率为3.59%,同期业绩比较基准收益率为1.02%;华富收益增强B基金份额净值为1.1432元,累计份额净值为1.3052元,本报告期的份额累计净值增长率为3.48%,同期业绩比较基准收益率为1.02%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年,在以城镇化为主题的投资推动下,国内经济将继续保持温和复苏的态势,全年GDP预计将在8%左右;通胀水平总体可控,预计CPI在3%左右,呈现前低后高。货币政策方面,央行将继续采取稳健的货币政策,不排除通过降准来替代部分逆回购操作量,流动性整体中性偏宽松。基本面对债市而言相对中性,我们判断未来债券投资收益来源更多来持有期票息,短端品种收益相对确定,短融以及3-5年中等评级信用债配置价值较优,未来信用债风险识别和防范仍将是工作的重点。转债品种的机会成本已大为下降,信用债替代的需求抬升,看好估值较低弹性较好的转债品种。权益类2013年存在结构性的投资机会,我们将继续精选个股,做好大类资产的配置,力争实现较为稳定的投资业绩。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位,在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,发挥管理人的综合优势,积极稳健地做好配置策略,均衡投资,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	199,962,206.28	9.92
	其中:股票	199,962,206.28	9.92
2	固定收益投资	1,683,738,017.30	83.50
	其中:债券	1,675,785,017.30	83.11
	资产支持证券	7,953,000.00	0.39
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	89,672,764.46	4.45
6	其他资产	42,993,494.24	2.13
7	合计	2,016,366,482.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	32,246,237.88	2.74
C	制造业	117,444,685.00	9.97
C0	食品、饮料	44,232,000.00	3.76
C1	纺织、服装、皮毛	19,266,000.00	1.64
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,560,645.00	0.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	23,834,000.00	2.02
C5	电子	10,463,040.00	0.89
C6	金属、非金属	8,505,000.00	0.72
C7	机械、设备、仪表	7,584,000.00	0.64
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,964,800.00	0.34
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	23,958,000.00	2.03
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	10,186,483.40	0.86
L	传播与文化产业	10,653,600.00	0.90
M	综合类	1,508,400.00	0.13
	合计	199,962,206.28	16.98

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300146	汤臣倍健	760,000	44,232,000.00	3.76
2	300212	易华录	600,000	18,252,000.00	1.55
3	002683	宏大爆破	1,200,000	17,988,000.00	1.53
4	002250	联化科技	780,000	15,210,000.00	1.29
5	600028	中国石化	2,060,439	14,258,237.88	1.21
6	002687	乔治白	600,000	11,358,000.00	0.96
7	002475	立讯精密	378,000	10,463,040.00	0.89
8	601098	中南传媒	1,000,000	8,940,000.00	0.76
9	600143	金发科技	1,600,000	8,624,000.00	0.73
10	000630	铜陵有色	450,000	8,505,000.00	0.72

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,937,000.00	8.49
	其中:政策性金融债	99,937,000.00	8.49
4	企业债券	988,629,187.60	83.95
5	企业短期融资券	20,064,000.00	1.70
6	中期票据	20,001,000.00	1.70
7	可转债	547,153,829.70	46.46
8	其他	-	-
9	合计	1,675,785,017.30	142.30

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	1,375,120	141,513,599.20	12.02
2	113003	重工转债	1,033,200	109,291,896.00	9.28
3	113002	工行转债	850,000	93,143,000.00	7.91
4	113001	中行转债	900,000	86,715,000.00	7.36
5	110018	国电转债	680,720	76,676,300.80	6.51

5.6 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	061205001	12上元1A	100,000	7,953,000.00	0.68

5.7 报告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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	7,794,494.37
3	应收股利	-
4	应收利息	34,828,073.15
5	应收申购款	120,926.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,993,494.24

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	141,513,599.20	12.02
2	113003	重工转债	109,291,896.00	9.28
3	113002	工行转债	93,143,000.00	7.91
4	113001	中行转债	86,715,000.00	7.36
5	110018	国电转债	76,676,300.80	6.51
6	110013	国投转债	18,802,318.70	1.60
7	110016	川投转债	11,843,964.00	1.01

5.8.5 报告期末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的情况。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
本报告期期初基金份额总额	786,286,036.33	491,711,643.02
本报告期期间基金总申购份额	2,244,793.28	8,243,783.72
减:本报告期期间基金总赎回份额	172,150,081.94	92,664,550.34
本报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	616,380,747.67	407,290,876.40

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、华富收益增强债券型证券投资基金基金合同

2、华富收益增强债券型证券投资基金托管协议

3、华富收益增强债券型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富收益增强债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

7.3 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。

华富中小板指数增强型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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
报告送出日期:2013年1月21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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2012年10月1日至2012年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中小板指数增强
基金主代码	410010
交易代码	410010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月9日
报告期末基金份额总额	66,597,505.54份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,以被动跟踪标的指数为主,力争控制本基金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0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础之上,力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	作为指数增强型基金,本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上,采用适度的主动投资辅助提高收益,降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法,按照标的指数的成分股组成及其权重构建指数化投资组合,并按照标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股,在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。
业绩比较基准	中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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。
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

§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10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,610,156.51
2.本期利润	-964,292.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0132
4.期末基金资产净值	61,385,133.23
5.期末基金份额净值	0.922

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。

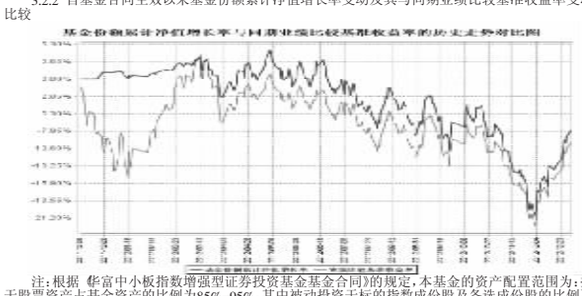
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率①	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	-1.18%	1.28%	-0.47%	1.23%	-0.71%	0.05%

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:根据《华富中小板指数增强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:投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为2011年12月9日到2012年6月9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《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭晨	华富竞争力优选基金基金经理、华富策略精选混合基金基金经理、华富价值增长混合基金基金经理	2011年12月9日	2012年12月19日	五年	四川大学技术经济及管理专业硕士、研究生学历,历任平安资产管理有限责任公司投资绩效分析师、东吴基金管理有限公司金融工程研究员,2009年11月进入华富基金管理有限公司任华富中证100指数基金基金经理助理,2011年12月9日至2012年12月19日担任华富中小板指数增强型基金基金经理,2010年12月27日至2012年12月19日担任华富中证100指数基金基金经理。
朱蓓	华富中证100指数基金基金经理、华富量子生命力基金基金经理、华富中小板指数增强基金基金经理	2012年12月19日	-	五年	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,华富基金金融工程研究员、产品设计经理。

注:郭晨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议作出注销决定之日;朱蓓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,对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度的市场呈现出冰火两重天的格局,市场期待的十八大维稳行情在十月、十一月并没有如期到来,十八大结束之后,市场信心崩溃,不断下跌,一度击穿2000点,最低达到1949点,一些个股的跌幅更是巨大,尤其以中小板创业板股票为甚。进入12月份之后,市场出现了戏剧性的变化,在基本面和政策面并没有太大的变化的背景之下,12月份上证综指单月涨幅14.6%,成交量显著放大,以银行为代表的大盘蓝筹领涨,市场的信心仿佛一夜之间就回来了。

市场戏剧性的走势还是与经济基本面密切相关的,进入四季度后,各项经济数据开始出现见底回升的态势,经济基本面触底已经逐步明确,PMI数据开始回升,企业去库存的过程逐渐完成,许多行业的库存数据已处于底部。政府为了稳定经济增长,也推出了一系列的措施,比如增加铁路等行业的基础设施建设,虽说此次不比08、09年四万亿措施来的猛,但是在经济转型的大背景下,适度刺激以稳定增长更合情合理。在这样的背景之下,股市继续下滑明显不符合逻辑,但是究竟在什么点位和时间节点出现反弹是很难预测的。市场在拐点出现之前的下跌和信心崩溃非常惨烈,出现反弹之后究竟如何判断,这些都在四季度强烈的考验基金管理团队的心理和业务水平。

作为中小板指数增强型基金,本基金的仓位和结构会严格按照基金合同的要求进行配置,将跟踪误差控制在基金合同要求的范围内,同时力争实现超越比较基准的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2011年12月9日正式成立。截止2012年12月31日,本基金份额净值为0.922元,累计份额净值为0.922元。报告期,本基金份额净值增长率为-1.18%,同期业绩比较基准收益率为-0.47%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年一季度,我们认为2012年12月的反弹趋势有望进一步延续,海外方面,美国"财政悬崖"危机在最后一刻得以解决,欧债危机在不断朝积极的方向发展;国内方面,经济开始回暖,出口趋势企稳回升,政治环境较为稳定。宏观方面的一系列利好信息有助于提振市场信心,配合以目前较充裕的流动性,都将有助于股市一季度继续向好。一季度,随着上市公司年报的相继披露,个股行情可能出现分化,绩优个股或受市场关注。

作为中小板指数增强型基金,本基金的仓位和结构会严格按照基金合同的要求进行配置,将跟踪误差控制在基金合同要求的范围内,同时力争实现超越比较基准的投资收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	57,993,824.09	92.90
	其中:股票	57,993,824.09	92.90
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,166,992.19	6.68
6	其他资产	265,571.92	0.43
7	合计	62,426,388.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,800,336.18	2.93
B	采掘业	4,157,196.23	6.77
C	制造业	31,073,450.23	50.62
C0	食品、饮料	4,504,083.18	7.34
C1	纺织、服装、皮毛	799,632.14	1.30
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	351,788.47	0.57
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,067,094.19	8.25
C5	电子	6,663,370.49	10.86
C6	金属、非金属	915,133.94	1.49
C7	机械、设备、仪表	6,644,140.31	10.82
C8	医药、生物制品	5,637,711.46	9.18
C99	其他制造业	490,496.05	0.80
D	电力、煤气及水的生产和供应业	254,893.98	0.42
E	建筑业	2,562,330.07	4.17
F	交通运输、仓储业	193,462.17	0.32
G	信息技术业	3,279,047.53	5.34
H	批发和零售贸易	4,686,559.05	7.63
I	金融、保险业	2,437,448.10	3.97
J	房地产业	1,739,108.79	2.83
K	社会服务业	776,930.52	1.27
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	52,960,762.85	86.28

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	318,507.52	0.52
C	制造业	3,185,053.72	5.19
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	865,337.50	1.41
C5	电子	538,931.20	0.88
C6	金属、非金属	1,208,126.50	1.97
C7	机械、设备、仪表	253,120.00	0.41
C8	医药、生物制品	319,538.52	0.52
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	252,300.00	0.41
E	建筑业	662,000.00	1.08
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	248,950.00	0.41
I	金融、保险业	366,250.00	0.60
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	5,033,061.24	8.20

5.3 报告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

5.3.1 报告期末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002024	苏宁电器	608,656	4,047,562.40	6.59
2	002304	洋河股份	33,774	3,153,478.38	5.14
3	002236	大华股份	41,406	1,919,168.10	3.13
4	002155	辰州矿业	90,832	1,823,906.56	2.97
5	002142	宁波银行	162,432	1,731,525.12	2.82
6	002081	金螳螂	33,680	1,482,593.60	2.42
7	002422	科伦药业	26,462	1,482,401.24	2.41
8	002241	歌尔声学	38,387	1,447,189.90	2.36
9	002385	大北农	62,528	1,350,604.80	2.20
10	002230	科大讯飞	42,247	1,280,084.10	2.09

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002271	东方雨虹	56,146	856,226.50	1.39
2	002250	联化科技	35,125	684,937.50	1.12
3	002375	亚厦股份	25,000	662,000.00	1.08
4	300088	长信科技	35,456	538,931.20	0.88
5	002673	西部证券	25,000	366,250.00	0.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	915.59
5	应收申购款	14,656.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	265,571.92

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	88,640,744.05
本报告期期间基金总申购份额	8,585,982.75
减:本报告期期间基金总赎回份额	30,629,221.26
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	66,597,505.54

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同

2、华富中小板指数增强型证券投资基金托管协议

3、华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富中小板指数增强型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

7.3 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。

华富中证100指数证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:2013年1月21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、准确性和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2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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、