

# 华富成长趋势股票型证券投资基金

## 2012] 第一季度报告

基金管理人:华富基金管理有限公司  
基金托管人:招商银行股份有限公司  
报告送出日期:2012年4月23日

### § 1 重要提示

基金管理人和董事会对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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月20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本基金，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1月1日至2012年3月31日。

### § 2 基金产品概况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金简称       | 华富成长趋势股票          |
| 基金主代码      | 410003            |
| 交易代码       | 410003            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2007年3月19日        |
| 报告期末基金份额总额 | 1,998,700,665.20份 |

用事业、医药、食品等；若政策微调的效果较好，可提前布局受益于经济复苏的建材、家电、电子等行业。我们仍然认为股价估值水平已经与成熟市场接轨，因此保持较高的配置比例。二季度我们将更加重视从产业资本的角度选择投资对象，精选消费股和成长股进行重点投资。

### § 3 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             | 852,401,358.23 | 82.34        |
| 其中：股票             | 852,401,358.23   | 82.34          |              |
| 2 固定收益投资          | 5,427,731.20     | 0.52           |              |
| 其中：债券             | 5,427,731.20     | 0.52           |              |
| 3 货币衍生品投资         | -                | -              |              |
| 4 其他返售资金资产        | 91,000,000.00    | 8.79           |              |
| 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    | 56,873,195.78    | 5.49           |              |
| 6 其他资产            | 29,559,044.89    | 2.86           |              |
| 7 合计              | 1,035,261,330.10 | 100.00         |              |

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 本基金报告期内基金份额净值增长率及其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② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|--------|--------|------------|-------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -2.37% | 1.32%  | 3.72%      | 1.20%       | -6.09% | 0.12% |

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：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。

#### 3.3 主要财务指标和基金净值表现

##### 3.3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2012年1月1日 - 2012年3月31日) |
|-----------------|-----------------------------|
| 1.本期已实现收益       | -100,718,343.80             |
| 2.本期利润          | -24,920,279.44              |
| 3.加权平均基金份额本期利润率 | -0.0124                     |
| 4.期末基金份额净值      | 1,027,949,373.83            |
| 5.期末基金资产净值      | 5,015,413.00                |

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。

#### 3.3.2 基金净值表现

##### 3.3.2.1 本基金报告期内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

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。

#### 3.3.3 其他资产构成

注：根据《华富成长趋势股票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60%-95%，债券的配置比例为3%-35%，权证的配置比例为3%，现金或者到期日在一年内的政府债券的配置比例不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2007年3月19日至3月19日，建仓期结束时本基金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成长趋势股票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助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

陈德义 华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理 2009年9月8日 - 八年

注：这里的任职日期指公司决定之日，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 管理人对报告期内基金运作合规性的说明

本报告期内，本基金认真遵守《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，未发现明显异常情况，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时间进行，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

本基金管理人在报告期内严格执行了《证券投资基金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。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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内无异常交易行为发生。

4.4 报告期内基金管理人的诚信记录

本基金报告期内无诚信记录。

§ 5 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期初基金份额总额 2,016,154,397.20

本报告期期间基金申购份额 3,330,568.68

本报告期期间基金赎回份额 20,784,299.68

本报告期期间基金拆分变动份额 -

本报告期末基金份额总额 1,998,700,666.20

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金资产净值 2,016,154,397.20

本报告期期间基金申购金额 3,330,568.68

本报告期期间基金赎回金额 20,784,299.68

本报告期期间基金拆分变动金额 -

本报告期末基金资产净值 1,998,700,666.20

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1. 华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同

2. 华富成长趋势股票型证券投资基金托管协议

3. 华富成长趋势股票型证券投资基金招募说明书

4. 报告期内华富成长趋势股票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

7.3 查阅方式

投资者可于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。

4.5 报告期内基金的绩效表现

本基金于2007年3月19日正式成立。截止2012年3月31日，本基金份额净值为5,015.413元，累计份额净值为5,015.413元。

报告期，本基金份额净值增长率为-2.37%，同期业绩比较基准收益率为3.72%。

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。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

本基金于2012年1月1日至2012年3月31日。

### § 2 基金产品概况

基金管理人:华富基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2012年4月23日

§ 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1月1日 - 2012年3月31日) |
|-----------------|-----------------------------|
| 1.本期已实现收益       | -100,718,343.80             |
| 2.本期利润          | -24,920,279.44              |
| 3.加权平均基金份额本期利润率 | -0.0124                     |
| 4.期末基金份额净值      | 1,027,949,373.83            |
| 5.期末基金资产净值      | 5,015,413.00                |

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 本基金报告期内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

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。

#### 3.3 其他资产构成

注：根据《华富成长趋势股票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60%-95%，债券的配置比例为3%-35%，权证的配置比例为3%，现金或者到期日在一年内的政府债券的配置比例不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2007年3月19日至3月19日，建仓期结束时本基金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成长趋势股票型证券投资基金基金合同的规定。

§ 4 管理人报告