

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
送信日期:2013年8月26日

§ 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、完整性承担责任个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认,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的规定,于2013年8月23日复核了本报告书中的财务指标、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。

本半年度报告摘要半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称:华富中小板指数增强型证券投资基金

基金主代码:410001

交易代码:410001

契约型开放式

基金合同生效日:2011年12月9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:69,080,019.67份

基金合同存续期:不定期

2.2 基金产品说明

本基金为股票指数增强型基金,以被动跟踪标的指数为主,力图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1.75%。在分享中小板市场平均收益的基础上,力图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。

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,按照标的成分股所占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定期调整。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。

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

姓名 张志高 田青

信息披露负责人 联系电话 021-68886996 010-67595096

电子邮件 manzh@hfund.com tianqinh.1zh@ccb.com

客户服务电话 400-700-8001 010-67595096

传真 021-68887997 010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.hfund.com

基金半年度报告备置地点:基金管理人及基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)

本期已实现收益 2,108,180.87

本期利润 2,826,829.11

加权平均基金份额本期利润 0.0546

本期基金份额净值增长率 4.88%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.0330

期末基金份额净值 66,799,804.88

期末基金份额净值 0.967

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减去公允价值变动收益。

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将低于所列示数据。

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"期末可供分配利润"即为本报告期最后一日,即6月30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(%) 基金份额净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -11.20% 1.85% -11.87% 2.00% 0.67% -0.15%

过去三个月 -2.32% 1.52% -2.94% 1.55% 0.62% -0.03%

过去六个月 4.88% 1.46% 4.96% 1.44% -0.08% 0.02%

过去一年 -1.83% 1.36% 0.12% 1.34% -1.95% 0.02%

自基金合同生效起至今 -3.30% 1.18% -5.18% 1.36% 1.88% -0.18%

注:业绩比较基准收益率=中小板指数收益率×90%+一年期银行定期存款利率(税后)×10%,业绩比较基准在每个交易日实时平衡。

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与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

图示:华富中小板指数增强型证券投资基金基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

注:本基金根据《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%;其余金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金申购期为2011年12月9日至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]147号文核准开业,于2013年1月19日在渤海证券正式挂牌,注册资金1亿元,公司股东为渤海证券股份有限公司,安徽省信投担保有限公司和渤海兴华股权投资有限公司。截止2013年6月30日,本基金管理人华富基金管理有限公司管理的华富稳健优势债券型证券投资基金、华富收益增强型债券型证券投资基金、华富策略增长型证券投资基金、华富回报型债券型证券投资基金、华富回报型增强型证券投资基金、华富量化对冲型证券投资基金、华富量化回报型增强型证券投资基金、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和华富深保合型证券投资基金十一只基金。

4.2 基金经理/基金经理助理的管理情况

基金经理对报告期内本基金运作情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.5 报告期内基金的利润分配情况

本基金于2011年5月20日成立,2013年6月30日,本基金份额净值为0.967元,累计份额净值为0.967元。报告期末,本基金份额净值增长率为-94.88%,同期业绩比较基准收益率为4.96%。

4.6 管理人对报告期内基金的估值政策的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.8 管理人对报告期内基金的费用计提、开支情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.9 管理人对报告期内基金的税收情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.10 管理人对报告期内基金的费用调整情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.11 管理人对报告期内基金的费用豁免情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.12 管理人对报告期内基金的费用计提、开支情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.13 管理人对报告期内基金的费用调整情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.14 管理人对报告期内基金的费用豁免情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.15 管理人对报告期内基金的费用计提、开支情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.16 管理人对报告期内基金的费用调整情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.17 管理人对报告期内基金的费用豁免情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.18 管理人对报告期内基金的费用计提、开支情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.19 管理人对报告期内基金的费用调整情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.20 管理人对报告期内基金的费用豁免情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.21 管理人对报告期内基金的费用计提、开支情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.22 管理人对报告期内基金的费用调整情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.23 管理人对报告期内基金的费用豁免情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.24 管理人对报告期内基金的费用计提、开支情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.25 管理人对报告期内基金的费用调整情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.26 管理人对报告期内基金的费用豁免情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.27 管理人对报告期内基金的费用计提、开支情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.28 管理人对报告期内基金的费用调整情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。

4.29 管理人对报告期内基金的费用豁免情况的说明

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》等相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋取利益,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。