

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：2014年8月25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、准确性完整性负连带法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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2014年8月22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。

基金经理的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。

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

本报告附注为财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	华富中证100指数
基金代码	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
报告期末基金资产总额	153,861,941.11元
基金份额净值	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动指数化投资方法严控产品的投资风险和最大化基金收益，力争在扣除相关费用后实现不低于35%的回报率差额，以实现对中证100指数的投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即按照中证100指数的构成比例，将基金资产投资于该指数包含的所有股票，使基金的收益与指数收益相一致。并根据指数成份股的构成比例及权重定期调整持仓，并根据指数成份股的变动情况适时进行调整。同时，本基金将根据市场环境的变化，结合宏观经济形势、政策变化、行业景气度、个股基本面等综合因素，对投资组合进行适当的调整，以期获得超越基准的收益。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，具有较高风险，预期收益和风险均高于混合型基金、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
地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1088号	上海市浦东新区陆家嘴环路1088号
信息披露负责人	021-68806996	95555
联系电话	021-68806996	95555
电子邮箱	marsh@hfund.com	c_wang@bankcomm.com
客户服务电话	400-700-8001	95555
传真	021-68879979	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年报报告书的管理人互联网网址	http://www.hfund.com
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

报告期(2014年1月1日—2014年6月30日)		本期末		上年度末	
本期已实现收益	-8,923,243.26				
本期利润	-7,671,024.99				
加权平均基金份额本期利润	-0.0460				
基金总资产的净值增长率	-6.39%				
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2014年6月30日)				
期末可供分配基金份额利润	-0.0687				
期末基金资产净值	97,133,673.88				
期末基金资产净值	0.0413				

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)扣减相关费用后的余额，本期利润为期初实现收益加上本期公允价值变动收益。

2)以上所述基金绩效指标不包括个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用等)，计入费用后实际收益将低于所列数字。

3)期末可供分配利润指指标的计算方法为采用期末资产负债表中未分配利润加上未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数，表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日。

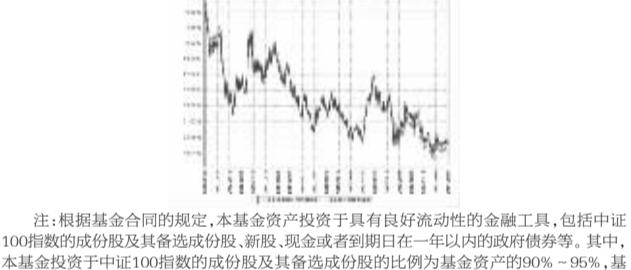
## 3.2 基金净值表现

## 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(%)	份额净值增 长标准差(%)	业绩比较基 准收益率(%)	收益差百分 差(%)	①-③	②-④
过去一个月	0.60%	0.73%	-2.0%	0.73%	0.80%	0.60%
过去三个月	1.79%	0.96%	0.90%	0.86%	0.99%	0.60%
过去六个月	-3.49%	0.99%	-7.05%	0.99%	0.60%	0.00%
过去一年	-2.74%	1.15%	-4.04%	1.15%	1.30%	0.00%
过去三年	-23.76%	1.23%	-27.44%	1.23%	3.68%	0.00%
过去五年	-36.87%	1.29%	-39.29%	1.28%	2.42%	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时更新。

3.2.2 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指数的成份股及其他备选成份股、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货币市场基金的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金建仓时间为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。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》的相关规定。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

## 4.1.1 基金管理人及基金经理的经验证

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字[2004]47号文核准开业，4月19日在上海市正式注册成立，注册资本1亿元，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控股(集团)有限公司。截止2014年6月30日，本公司管理人管理了华富竞争优势优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强收益型证券投资基金、华富量化配置混合型证券投资基金、华富增强型回报债券型证券投资基金、华富量化平衡型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本基金混合型证券投资基金、华富恒生债券型证券投资基金、华富恒富分级证券投资基金和华富恒分级债券型证券投资基金十四只基金。

## 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		说明
		任职日期	离任日期	
朱蔚	华富中证100指数 基金经理 华富货币基金 基金经理 华富指数 基金经理 华富债券 基金经理	2012年12月19日	-	七年

注：任职日期为公司作出决定之日。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情况的说明

本报告期内，本公司认真遵循《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《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等有关规定，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易制度》，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、事后分析反馈的全流程管理。在制度流程上确保各环节同享同一信息知情权，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 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 报告期内本基金投资策略和运作分析

二季度宏观数据显示经济略有改善，投资和出口增速均小幅改善，工业增加值增速微升，显示宏观经济回暖。与此同时，工业生产主要营业收入和财政收入增速双双反弹，反映经济反弹的基础并不牢固。上半年沪深300指数下跌7.08%，表现较好的三个行业分别为信息服务、信息技术、机械设备，表现最差的三个行业为采掘、农林牧渔、食品饮料。

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管理，力争实现对业绩基准的有效跟踪。

本基金将严格遵守基金合同的有关规定，将严格控制基金净值相对于业绩基准的偏离度，从而实现对业绩基准的有效跟踪。

4.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于2006年2月16日颁布的《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《中国证券投资基金会会计核算业务指引》、《华富中证100指数型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

4.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年年度报告所披露的企业会计准则与最近一期年度报告相一致。

4.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

4.4.5 会计差错更正的说明

4.4.6 税项

本基金2010年12月30日正式成立，截至2014年6月30日，本基金份额净值为0.6313元，累计基金份额净值为0.6313元。本基金本报告期份额净值增长率为-6.39%，同期业绩比

较基准收益率为-7.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济的主要压力来自于房地产市场景气度下行，由此引发的房地产投资增速下行的过程将继续，而制造投资也将带来了较大的不确定性。或是由于“稳增长”政策措施迟迟没有效果，行业景气度持续低迷，从而导致经济下行压力增大。

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误差，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制定了相关制度和流程。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，保证估值结果不对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会由公司总经理、副总经理、监察稽核部负责人及基金经理组成。估值委员会每年度对基金估值政策和方法进行评估，形成书面报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何利益冲突，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关联交易协议。

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《证券投资基金运作管理办法》和《华富中证100指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期利润为-7,671,024.99元，期末可供分配利润为-56,728,267.33元。

本报告期内未进行利润分配。

4.8 管理人对报告期内基金净值表现的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富中证100指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告