

华富中证100指数证券投资基金

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：2017年3月29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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。
本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。
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摘要。

本报告期自2016年01月01日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金简称	华富中100指数
基金主代码	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	32,634,574.09份
基金会计核算存续期间	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金在进行货币市场投资化后，通过严格的风险控制和资产配置的优化，力争在风险较低的情况下，为投资者提供一个相对稳定的、具有较高收益的理财产品。
投资策略	本基金在进行货币市场投资化后，通过严格的风险控制和资产配置的优化，力争在风险较低的情况下，为投资者提供一个相对稳定的、具有较高收益的理财产品。
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	本基金属于股票型证券投资基金，属于高风险、较高收益的理财产品。一般情况下，其风险和收益大于混合型基金，但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人	
项目	基金管理人
名称	华富基金管理有限公司
联系人	胡泓云
客户服务电话	021-68989096
传真	59659
客户服务电话	mnzh@hfmut.com
客户服务电话	400-700-8001
客户服务电话	021-62701216

2.4 信息披露方式	
基金基本信息年度报告的管理人互联网网址	http://www.hfmut.com
基金年审报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§ 3 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元			
3.1 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期期初基金资产	1,422,427.08	36,146,681.01	-11,893,015.6
本期利润	-2,386,084.80	6,413,332.30	52,722,844.40
平均基金份额本期利润	-0.0665	0.0846	0.3380
本期基金份额净值增长率	-6.11%	0.08%	58.47%
3.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
本期可供分配基金份额利润	0.0042	0.0066	-0.0316
期末基金资产净值	32,772,109.57	38,494,461.12	141,401,067.00
期末基金份额净值	1.0042	1.0086	1.0687

注：1)本报告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；扣除相关费用后的余额，即费用后实际收益水平要低于所列数字。

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笔费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计上费用后实际收益水平要低于所列数字。

3)期初可供分配利润，采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低值，即“期初”指报告期最后一日，即2016年12月31日。

3.2 基金的基本表现

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	业绩比较基准收益率	差额(%)	差额(%)
过去三个月	2.52%	0.69%	2.89%	0.03%
过去六个月	7.78%	0.72%	6.95%	0.01%
过去一年	-6.11%	1.26%	-4.89%	1.10%
过去二年	48.90%	1.71%	44.01%	1.68%
过去五年	50.01%	1.66%	39.97%	1.03%
自基金成立以来	150.0%	1.50%	139.5%	1.0%

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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

3.2.2 过去五年基金成立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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

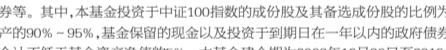
3.2.3 过去五年基金成立以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

3.2.4 过去五年基金成立以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

3.2.5 过去五年基金成立以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

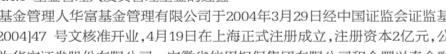
3.2.6 过去五年基金成立以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

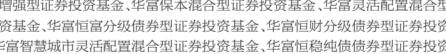
3.2.7 过去五年基金成立以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

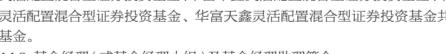
3.2.8 过去五年基金成立以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

3.2.9 过去五年基金成立以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分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为基金资产的5%~10%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的1%~5%。本基金在建仓期（2009年12月30日至2010年4月30日）建仓期间，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指数的成分股及备选成分股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

3.2.10 过去五年基金成立以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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指数的成分股及备选成分股、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指数的成分股及其备选成分股