华富中小板指数增强型证券投资基金

【2015】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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4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2015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2015年1月1日至2015年3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	7,306,990.86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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	1,678,350.99
2.本期利润	4,021,133.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.4763
4.期末基金资产净值	12,521,951.07
5.期末基金份额净值	1.714

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。

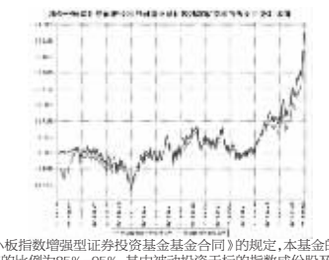
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	38.45%	1.42%	41.29%	1.37%	-2.84%	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,本基金严格执行了《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		
朱蓓	华富中小板指数增强型基金基金经理、华富量子生命力股票型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理	2012年12月19日	-	八年	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,2009年11月进入华富基金管理有限公司,曾任金融工程研究员、产品设计经理。

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

一季度除银行板块外,市场出现了普涨,特别是以传媒、互联网为代表的成长股,出现了比较强势的补涨。一季度沪深300指数上涨14.6%,表现较好的三个行业分别为计算机、传媒、纺织服装,表现最差的三个行业为银行、非银金融、食品饮料。

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2015年3月31日,本基金份额净值为1.714元,累计份额净值为1.714元。报告期,本基金份额净值增长率为38.45%,同期业绩比较基准收益率为41.29%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年下半年以来,美元持续走强,今年3月份以后进入调整,有助于热钱回流入新兴市场。国内宏观经济数据依然走弱,但股市的赚钱效应已经引发了民间资金主动式流入证券市场。二季度我们对市场依然乐观,但随着年报的披露和IPO的集中重启,市场或出现震荡回调,但不影响长期上涨趋势。

整体而言,行业配置上,从大蓝筹角度关注券商、保险、银行、公用事业;从高成长角度关注国防军工,计算机,传媒;从新型消费兴起角度关注互联网信息消费、体育、医药健康、节能环保;从行业集中度加速提升角度关注农林牧渔。从主题角度特别关注“十三五”相对“十二五”有变化的细分领域,特别是国企改革、迪斯尼领域等。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从2014年9月4日起至本报告期末(2015年3月31日),本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于五千万元的情形,至本报告期期末(2015年3月31日)基金资产净值仍低于5000万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》,积极采取相关措施,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§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	10,968,751.35	82.75
	其中:股票	10,968,751.35	82.75
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,723,183.65	13.00
7	其他资产	563,348.78	4.25
8	合计	13,255,283.78	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	149,077.60	1.19
B	采矿业	69,692.80	0.56
C	制造业	7,193,128.60	57.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	532,267.46	4.25
F	批发和零售业	648,235.86	5.18
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,188,299.45	9.49
J	金融业	508,414.97	4.06
K	房地产业	108,608.75	0.87
L	租赁和商务服务业	479,174.91	3.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	91,850.95	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,968,751.35	87.60

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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	苏宁云商	36,348	475,068.36	3.79
2	002415	海康威视	11,718	359,742.60	2.87
3	002202	金风科技	13,753	262,132.18	2.09
4	002450	康得新	6,866	261,937.90	2.09
5	002081	金螳螂	7,174	252,309.58	2.01
6	002230	科大讯飞	4,840	251,680.00	2.01
7	002594	比亚迪	4,625	242,350.00	1.94
8	002065	东华软件	7,077	218,679.30	1.75
9	002241	歌尔声学	6,393	212,886.90	1.70
10	002142	宁波银行	10,711	191,191.35	1.53

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,685.77
2	应收证券清算款	514,604.06
3	应收股利	-
4	应收利息	430.83
5	应收申购款	32,628.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	563,348.78

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	9,659,701.13
报告期期间基金总申购份额	6,845,681.01
减:报告期期间基金总赎回份额	9,198,391.28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	7,306,990.86

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§8 备查文件目录

8.1 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

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 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

【2015】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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4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2015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。

本报告期自2015年1月1日至2015年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证100指数
基金主代码	410008
交易代码	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
报告期末基金份额总额	99,999,561.95份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争控制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0.35%和年跟踪误差不超过4%,以实现对中证100指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,本基金的标的指数为中证100指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略,即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
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	交通银行股份有限公司

§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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	10,339,683.15
2.本期利润	8,622,646.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0719
4.期末基金资产净值	115,025,252.95
5.期末基金份额净值	1.1503

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	7.64%	1.96%	7.94%	1.96%	-0.30%	0.00%

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到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为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		
朱蓓	华富中证100指数基金基金经理、华富量子生命力股票型基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理	2012年12月19日	-	八年	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,2009年11月进入华富基金管理有限公司,曾任金融工程研究员、产品设计经理。

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

一季度除银行板块外,市场出现了普涨,特别是以传媒、互联网为代表的成长股,出现了比较强势的补涨。一季度沪深300指数上涨14.6%,表现较好的三个行业分别为计算机、传媒、纺织服装,表现最差的三个行业为银行、非银金融、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控制,力争实现对业绩基准的有效跟踪。我们将恪守基金合同的规定,保持对基准的紧密跟踪,使投资者分享中国经济长期快速增长的成果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2009年12月30日正式成立。截止2015年3月31日,本基金份额净值为1.1503元,累计份额净值为1.1503元。报告期,本基金份额净值增长率为7.64%,同期业绩比较基准收益率为7.94%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年下半年以来,美元持续走强,今年3月份以后进入调整,有助于热钱回流入新兴市场。国内宏观经济数据依然走弱,但股市的赚钱效应已经引发了民间资金主动式流入证券市场。二季度我们对市场依然乐观,但随着年报的披露和IPO的集中重启,市场或出现震荡回调,但不影响长期上涨趋势。

整体而言,行业配置上,从大蓝筹角度关注券商、保险、银行、公用事业;从高成长角度关注国防军工,计算机,传媒;从新型消费兴起角度关注互联网信息消费、体育、医药健康、节能环保;从行业集中度加速提升角度关注农林牧渔。从主题角度特别关注“十三五”相对“十二五”有变化的细分领域,特别是国企改革、迪斯尼领域等。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	108,992,483.05	92.94
	其中:股票	108,992,483.05	92.94
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,919,615.37	5.90
7	其他资产	1,361,420.72	1.16
8	合计	117,273,519.14	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

序号	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	采矿业	4,505,704.04	3.92
C	制造业	29,862,246.07	25.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,504,277.82	2.18
E	建筑业	6,259,157.19	5.44
F	批发和零售业	1,040,934.01	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,184,613.63	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,955,550.29	1.70
J	金融业	55,048,394.91	47.86
K	房地产业	4,594,791.87	3.99
L	租赁和商务服务业	422,281.92	0.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	614,531.30	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	108,992,483.05	94.76

注:本基金本报告期指数投资部分含拟于2015年4月1日调入中证100指数的备选成分股,具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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	601318	中国平安	91,071	7,125,395.04	6.19
2	600016	民生银行	495,920	4,810,424.00	4.18
3	600036	招商银行	291,022	4,531,212.54	3.94
4	600030	中信证券	137,084	4,499,096.88	3.91
5	601166	兴业银行	200,485	3,680,904.60	3.20
6	600837	海通证券	142,774	3,342,339.34	2.91
7	600000	浦发银行	197,369	3,116,456.51	2.71
8	000002	万 科A	172,110	2,378,560.20	2.07
9	601988	中国银行	531,583	2,328,333.54	2.02
10	601818	光大银行	457,655	2,164,708.15	1.88

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,252.92
2	应收证券清算款	433,798.49
3	应收股利	-
4	应收利息	3,626.80
5	应收申购款	910,742.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,361,420.72

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	132,366,592.94
报告期期间基金总申购份额	23,034,773.45
减:报告期期间基金总赎回份额	55,401,804.44
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	99,999,561.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、华富中证100指数证券投资基金基金合同

2、华富中证100指数证券投资基金托管协议

3、华富中证100指数证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富中证100指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 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。

华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015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2015年1月1日至2015年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富智慧城市灵活配置混合
基金主代码	000757
交易代码	000757
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月31日
报告期末基金份额总额	833,827,339.55份
投资目标	本基金通过深入研究并积极投资与智慧城市相关的优质上市公司,分享其发展和成长的机会,力求获取超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及智慧城市相关行业的发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	131,713,401.82
2.本期利润	365,011,838.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.3264
4.期末基金资产净值	1,147,089,924.34
5.期末基金份额净值	1.376

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
自基金合同生效起至今	39.98%	1.52%	7.83%	0.92%	32.15%	0.60%

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《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%,投资于本合同界定的智慧城市相关证券不低于非现金基金资产的80%;其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资比例不得超过基金资产净值的3%;保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为2014年10月31日到2015年4月31日。本报告期,本基金仍在建仓期内。

§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		
龚炜	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、华富成长趋势股票型基金基金经理、华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理、公司公募投资决策委员会主席、公司总经理助理、投研总监兼基金投资部总监	2014年10月31日	-	十一年	安徽财经大学金融学硕士,研究生学历,历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监,2012年9月加入华富基金管理有限公司,曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监,2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。
刘文正	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选混合型基金基金经理、华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理、研究发展部总监助理	2014年11月17日	-	十一年	工商管理硕士,研究生学历。历任天治基金管理有限公司系统管理员、行业研究员,2010年9月加入华富基金管理有限公司,曾任研究发展部行业研究员、华富竞争力优选混合型基金基金经理助理。
王翔	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理	2014年11月19日	-	五年	墨尔本大学工程管理学硕士,研究生学历。2010年3月加入华富基金管理有限公司,先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员,2014年5月12日至2014年11月18日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理助理。

注:龚炜的任职日期指该基金成立之日,刘文正、王翔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