

信息披露 Disclosure

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:2014年4月22日
§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及高级管理人员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2014年4月21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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期内2014年1月1日至2014年3月31日。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华富策略精选混合
基金主代码	410006
交易代码	410006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月24日
报告期末基金份额总额	79,325,643.36份
投资目标	本基金运用充分的复合投资策略，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，力争使基金的长期投资收益超越基准收益。依据风险-收益匹配原则进行整体投资，本基金采用包括资产配置策略、行业配置策略和个股精选策略在内的多层次复合策略进行整体投资，高层策略是规模风险，底层策略是捕捉收益。
投资策略	本基金的基本思想是在充分控制风险的前提下实现收益。依据风险-收益匹配原则进行整体投资，本基金采用包括资产配置策略、行业配置策略和个股精选策略在内的多层次复合策略进行整体投资，高层策略是规模风险，底层策略是捕捉收益。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金属于平衡配置类证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	4,998,812.69
2.本期利润	393,591.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062
4.期末基金份额净值	67,394,954.02
5.期末可供分配基金份额净值	68,084.96

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.所述基金绩效指标不包括持有人认购或交易基金的费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期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(%)	业绩比较基准(%)	业绩比较基准收益率(%)
过去三个月	1.94%	-4.44%	0.72%
单利年化(%)	1.47%	-3.95%	0.75%

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



注:根据《华富策略精选灵活配置混合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：股票占基金总资产的30%-80%，现金占基金净资产净值的3%-5%，债券、现金、货币市场工具以及国家外汇管理局允许基金投资的其它金融工具占基金总资产的0%-70%，其中，基金保留的现金以及投资于货币市场基金的比例不得超过基金净资产净值的5%。本基金建仓期为2008年12月24日到2009年6月24日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金报告期内，本基金严格执行了《华富

§ 4 投资组合报告

4.1 公司基本情况

基金管理人的董事会及高级管理人员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2014年4月21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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期内2014年1月1日至2014年3月31日。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金的基本情况

基金名称 华富策略精选混合型证券投资基金

基金简称 华富策略精选混合

基金主代码 410006

交易代码 410006

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2008年7月24日

报告期末基金份额总额 79,325,643.36份

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	4,998,812.69
2.本期利润	393,591.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062
4.期末基金份额净值	67,394,954.02
5.期末可供分配基金份额净值	68,084.96

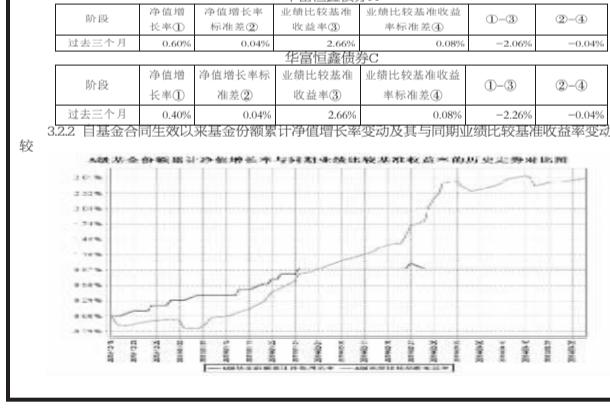
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或交易基金的费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期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(%)	业绩比较基准(%)	业绩比较基准收益率(%)
过去三个月	1.94%	-4.44%	0.72%
单利年化(%)	1.47%	-3.95%	0.75%

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



注:根据《华富策略精选灵活配置混合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：股票占基金总资产的30%-80%，现金占基金净资产净值的3%-5%，债券、现金、货币市场工具以及国家外汇管理局允许基金投资的其它金融工具占基金总资产的0%-70%，其中，基金保留的现金以及投资于货币市场基金的比例不得超过基金净资产净值的5%。本基金建仓期为2008年12月24日到2009年6月24日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金报告期内，本基金严格执行了《华富

§ 4 投资组合报告

4.1 公司基本情况

基金管理人的董事会及高级管理人员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2014年4月21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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期内2014年1月1日至2014年3月31日。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金的基本情况

基金名称 华富策略精选混合型证券投资基金

基金简称 华富策略精选混合

基金主代码 410006

交易代码 410006

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2008年7月24日

报告期末基金份额总额 168,676,220.59份

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-2,255,393.64
2.本期利润	-9,462,555.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0546
4.期末基金份额净值	104,614,004.13
5.期末可供分配基金份额净值	0.6202

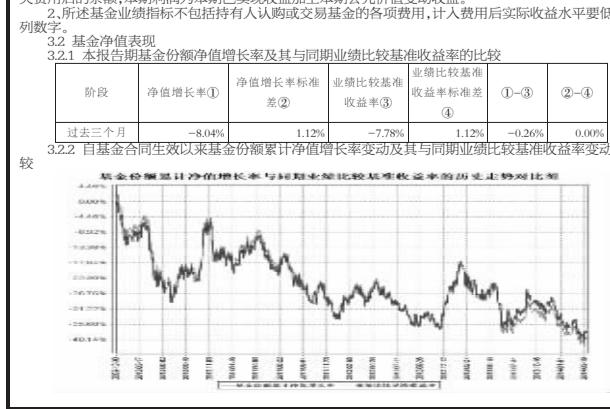
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或交易基金的费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期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(%)	业绩比较基准(%)	业绩比较基准收益率(%)
过去三个月	-8.04%	1.12%	-7.76%
单利年化(%)	1.12%	-7.76%	1.12%

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



注:这里的任职日期指该基金成立之日，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指标的专项说明

本报告期内，本基金管理人认真遵照《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的规定，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纳入公司公平交易管理中，实行事前控制、预警监控、事后评估的反馈的精细化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均享受公平待遇，通过严格的公平交易制度，促进公平交易。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人认真遵照《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的规定，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纳入公司公平交易管理中，实行事前控制、预警监控、事后评估的反馈的精细化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均享受公平待遇，通过严格的公平交易制度，促进公平交易。

4.4 报告期内基金的投顾策略和运作分析

今年1-2月份经济大幅下滑，原因是产出缺口扩大的带来的资金利率上升和价格水平反弹，导致了需求的回落。一季度沪深300指数下跌7.28%，其中表现最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、家用电器。

本基金是完全指数的指数基金，为投资者提供有效跟踪市场的投资工具，通过严格的投資约束和数量化风险管理，力求实现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 基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度国内经济受到央行公开市场操作、汇率政策、外储美联储加息等影响，预计整体流动性继续陷入回流。从目前国内公布的一系列经济数

华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金
2014 第一季度报告