

华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金

[2014]第一季度报告

基金管理人：华商基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
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对本基金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责任。

基金托管人承诺以诚实信用、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。投资人投资有风险，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。

本基金尚未进行收益分配。

本报告书财务数据未经审计。

本报告书自2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	532,734,725.02	92.70
		532,734,725.02	92.70
2	固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-	
货币支持证券	-	-	
3 贵金属投资	-	-	
4 金融衍生品投资	-	-	
5 其他投资	-	-	
其中：买入返售的买入返售金融资产	-	-	
6 银行存款和结算备付金合计	38,132,041.62	6.64	
7 其他资产	3,794,860.26	0.66	
8 合计	574,661,626.90	100.00	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、渔、矿业	19,452,977.26	3.41	
B 采矿业	-	-	
C 制造业	354,645,027.59	62.09	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,900,279.12	2.26	
E 建筑业	-	-	
F 批发零售业	90,089,489.32	15.77	
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	
H 餐饮住宿业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	
J 金融业	-	-	
K 房地产业	-	-	
L 租赁和商务服务业	55,646,951.73	9.74	
M 科学研究、技术服务业	-	-	
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-	
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	532,734,726.90	93.27	

注：(1)本基金本期实现收益扣减基金本期利息收入、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，即为本期可供分配的现金收益。

(2)所述企业债收益率指标不包括持有人认购或交易基金份额的费用，计算时未考虑实际收益水平要低于所列示。

3.2 基金净值增长情况

3.2.1 本基金份额份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金 2014年趋势图

华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金 2014年趋势图