

华富中证100指数证券投资基金

[2014] 第三季度报告

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:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金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2014年10月23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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:华富中证100指数

基金代码: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1月30日

报告期末基金份额总额:145,901,848,807.00份

基金合同生效日起基金资产净值:16,451,395,111.00元

基金合同生效日起基金净值:0.1108元

基金份额净值:0.1108元

基金份额净值增长率:1.43%

基金份额净值增长率标准差:0.98%

业绩比较基准收益率:10.10%

业绩比较基准收益率标准差:0.67%

过去三个月:4.33%

过去一年:0.31%

过去三年:10.99%

过去五年:9.83%

过去十年:0.90%

成立以来:0.98%

注:本基金本报告期指报告期起始日至报告期结束日的期间。

2. 所述基金业绩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要低于不计费用后的余额。

3.2.1 本基金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① 净值增长标准差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:10.99% 0.90% 9.83% 0.90% 1.16% 0.08%

过去一年:10.99% 0.90% 9.83% 0.90% 1.16% 0.08%

过去三年:10.99% 0.90% 9.83% 0.90% 1.16% 0.08%

过去五年:10.99% 0.90% 9.83% 0.90% 1.16% 0.08%

过去十年:10.99% 0.90% 9.83% 0.90% 1.16% 0.08%

成立以来:10.99% 0.90% 9.83% 0.90% 1.16% 0.08%

注:本基金本报告期指报告期起始日至报告期结束日的期间。

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对比图

基金合同累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势图

注:根据基金合同的规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证100指数的成分股及具备选股成分在一年以内的政府债券等。其中,本基金投资于中证100指数的成分股及具备选股成分的比例为基金资产的90%~96%,基金保留的现金以及现金类资产到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,建仓结束时各资产配置比例符合合同约定。在本报告期内,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。

5.4 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

朱蓓 华富中证100指数证券投资基金基金经理 2012年1月19日 - 七年

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》的有关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内,基金管理人遵照《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,招募说明书的说明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规基金合同的行为。

4.3 小企业金融服务执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金交易制度指导意见》等有关规定,对本基金的交易行为始终按照基金合同,招募说明书的说明和公司制度的规定进行。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,并保持组合的独立投资决策权。

4.4 公司交易制度执行情况

本基金报告期内,公司交易制度严格执行,未发现有不公平交易和利益输送的情况。

4.5 报告期内本基金的内部控制情况

本基金于2009年12月30日正式成立。截至2014年9月30日,本基金份额净值为0.7007元,累计份额净值为0.7007元。报告期内,本基金份额净值增长率为10.99%,同期业绩比较基准收益率为0.83%。

4.6 公司的行业分析

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.7 公司的行业配置

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.8 投资组合情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.9 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.10 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.11 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.12 其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.13 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.14 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.15 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.16 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.17 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.18 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.19 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.20 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.21 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.22 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.23 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.24 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.25 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.26 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.27 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.28 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.29 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.30 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.31 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.32 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.33 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.34 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.35 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.36 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.37 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.38 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.39 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.40 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.41 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.42 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.43 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.44 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.45 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.46 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.47 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.48 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.49 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.50 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.51 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.52 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.53 报告期内本基金的其他情况

本基金在宏观经济分析的基础上,结合对行业基本面的分析,对行业进行配置,并根据宏观经济形势的变化,适时调整行业配置比例。

4.54