

华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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7月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质的真实性、准确性、完整性、承担个别及连带责任。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用其持有的资产，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。

本报告期间为2015年4月1日至2015年6月30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	000057
交易代码	000057
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	73,912,602.50份

投资目标 本基金通过深入研究和积极把握智慧城市相关的投资机会，力求实现资产的长期增值。

投资策略 本基金通过定量与定性的方法分析宏观经济、证券市场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率与风险，据此合理制定资产配置比例，同时适时调整各资产类别的权重，以期在相对稳定的净值基础上，力争投资组合的稳定增长。

业绩比较基准 深证300指数收益率*60%+中证全债指数收益率*40%

风险收益特征 本基金属混合型基金，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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	398,123,284.68
2.期利润	318,399,618.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.3797
4.期末基金份额净值	1,133,590,969.76
5.期末基金份额净值	1.533

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.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

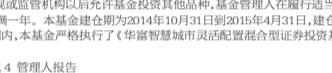
3.基金净值表现

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变动的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去三个月 22.88% 3.11% 6.80% 1.31% 16.08% 3.80%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率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%，投资于大中小板股票的比例范围不高于非基金总资产的90%；其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、股指期货等金融工具，投资比例不超过基金净资产的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高于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构允许本基金投资其他品种，基金管理人可以在履行适当程序后，可以将旗下产品投资范围扩大至股票、债券、权证、货币市场工具、股指期货等金融工具。

本基金合同生效时间为2014年10月31日至2015年4月31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，本基金报告期未按合同约定比例配置资产。

本基金合同生效时间为2014年10月31日至2015年4月31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，本基金报告期未