华富保本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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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4月1日至2015年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富保本混合
基金主代码	000028
交易代码	000028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
报告期末基金份额总额	143,316,120.92份
投资目标	本基金采取恒定比例组合保险策略CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance),通过动态调整资产组合,在确保本金安全的前提下,力争实现保本周期内基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金遵循长期投资的基本原则,融合国际化的风险管理工具与本土化的价值投资实践,利用避险技术进行风险跨期管理,在此基础上,坚持以价值发现为核心的投资研究理念,寻找中国经济成长和资本市场发展过程中的中长期投资机遇,最大限度地追求本金安全与财富增值的动态平衡。
业绩比较基准	本基金在保本周期内的业绩比较基准为:三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金保证人	中海信达担保有限公司

§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4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	21,267,495.96
2.本期利润	15,196,024.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.1009
4.期末基金资产净值	183,172,269.00
5.期末基金份额净值	1.278

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。

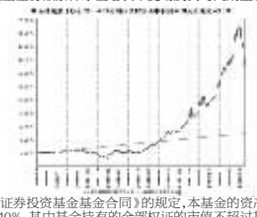
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	8.39%	1.22%	0.83%	0.01%	7.56%	1.21%

3.2.2 目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《华富保本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、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或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%;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2013年4月24日到2013年10月24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《华富保本混合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		
胡伟	华富保本混合型基金经理、华富收益增强债券型基金经理、华富恒富分级债券型基金经理、华富恒财分级债券型基金经理、华富恒稳纯债债券型基金经理、华富旺财保本混合型基金基金经理、公司公募投资决策委员会成员、公司总经理助理、固定收益部总监	2013年4月24日	-	十一年	中南财经政法大学经济学学士、本科学历,曾任珠海市商业银行资金营运部交易员,从事债券研究及债券交易工作,2006年11月加入华富基金管理有限公司,曾任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监,2009年10月19日至2014年11月17日任华富货币市场基金基金经理,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。
张惠	华富保本混合型基金基金经理、华富旺财保本混合型基金经理经理	2014年11月19日	-	八年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历,2007年6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、固收研究员,2012年5月21日至2014年3月19日任华富策略精选混合型基金基金经理助理,2014年3月20日至2014年11月18日任华富保本混合型基金基金经理助理。

注:胡伟的任职日期指该基金成立之日,张惠的任职日期指公司决定之日。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

二季度中国经济较一季度继续下滑,GDP可能跌破7%,外贸出口下滑幅度略有扩大,进口增长回落幅度减弱,但依然下滑超过10%,PMI维持在50.2,但是依然在荣枯线,显示实体经济生产相当低迷。需求方面,固定投资下滑至11.4%,财政支持基建的力度低于预期,楼市回暖尚未拉动新开工投资,房地产投资仅有5%。全球范围,日本6月PMI下滑显著,欧元区PMI继续回暖,美国6月PMI和就业数据持续向好、消费信心好转,欧美经济好转的迹象越来越明显,或将制约欧美央行未来货币宽松的力度。二季度海外债券利率反弹显著,美国和德国十年国债均上行超过20BP,一度在5月给国内带来巨大的压力,6月份由于半年末,还有新股压力,资金面略显紧张,7天回购一度反弹至4.8%,央行降准降息齐发,为了稳定资金利率重启逆回购,并且持续下调利率,资金面再次宽松,7天利率下行至2.7%附近。

2015年二季度债市表现平稳,10年期国债收益率自5月反弹后维持在3.6%附近,10年期金融债收益率维持在4.09%附近,5年、7年期AA企业债6月收益率分别反弹6-7BP,利率曲线维持陡峭化。

2015年二季度,权益市场大幅波动,股票市场在6月初冲上5000点后大幅回调,月末跌破4000点。中证转债指数下跌11.5%,为历史罕见。

本基金在二季度适时降低了转债仓位,增加了风险资产仓位,加仓了部分创业板成长个股,但是在月末的市场回调中未及时降低权益资产仓位,因此,本季度基金业绩仅小幅增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2013年4月24日成立。截止2015年6月30日,本基金份额净值为1.278元,累计份额净值为1.428元。报告期,本基金份额净值增长率为8.39%,同期业绩比较基准收益率为0.83%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,经济虽然低迷但有望见底,货币政策继续维持宽松格局。上半年猪价反弹较快对下半年的通胀预期会有所修复,而三季度美联储加息也是大概率事件,总体而言我们认为债券牛市行情仍未走完,但面临的不确定因素在增多,阶段性波动将会比较频繁。在新常态的经济增长背景下,基于政府对经济的一系列托底行为,经济断崖式下行风险较低,6月份以来权益市场的大幅下跌,在政府一系列“组合拳”的影响下,短期底部也已形成,未来在市场恢复常态运行后,可以逐步增加超跌的价值股的配置。转债市场。由于存量转债较少且溢价率过高,短期机会不大,未来继续关注新发转债的机会。

三季度,本基金继续维持现有信用配置和票息策略,保持一定的杠杆适度套息。我们将继续做好大类资产的配置,优化风险资产以及安全资产的比重,努力实现本金的保值增值。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位,在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,发挥管理人的综合优势,积极稳健地做好配置策略,均衡投资,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

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	69,655,064.46	31.05
	其中:股票	69,655,064.46	31.05
2	固定收益投资	142,956,080.40	63.72
	其中:债券	142,956,080.40	63.72
	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	4,960,231.73	2.21
7	其他资产	6,779,019.92	3.02
8	合计	224,350,396.51	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、牧、渔业	3,108,000.00	1.70
B	采矿业	-	-
C	制造业	32,735,728.50	17.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,059,802.36	4.40
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	-	-
J	金融业	18,377,033.60	10.03
K	房地产业	2,500,000.00	1.36
L	租赁和商务服务业	4,874,500.00	2.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	69,655,064.46	38.03

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

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	600016	民生银行	796,940	7,921,583.60	4.32
2	601166	兴业银行	300,000	5,175,000.00	2.83
3	600196	复星医药	170,000	4,919,800.00	2.69
4	600976	健民集团	139,909	4,762,502.36	2.60
5	600872	中炬高新	200,000	4,632,000.00	2.53
6	601233	桐昆股份	160,000	3,193,600.00	1.74
7	600108	亚盛集团	300,000	3,108,000.00	1.70
8	002196	方正电机	120,000	2,798,400.00	1.53
9	000861	海印股份	130,000	2,793,700.00	1.53
10	002146	荣盛发展	200,000	2,500,000.00	1.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,585,050.00	6.32
	其中:政策性金融债	11,585,050.00	6.32
4	企业债券	131,371,030.40	71.72
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	142,956,080.40	78.04

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124367	11锦城发	150,000	15,706,500.00	8.57
2	112051	11报喜02	130,100	13,648,791.00	7.45
3	098082	09华西债	135,000	13,559,400.00	7.40
4	122276	13魏桥01	100,000	10,639,000.00	5.81
5	112193	13美邦01	101,080	10,617,443.20	5.80

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	55,011.24
2	应收证券清算款	2,998,529.04
3	应收股利	-
4	应收利息	3,499,502.91
5	应收申购款	225,976.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,779,019.92

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600872	中炬高新	4,632,000.00	2.53	重大事项停牌

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	157,733,364.43
报告期期间基金总申购份额	44,042,417.10
减:报告期期间基金总赎回份额	58,459,660.61
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	143,316,120.92

§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、华富保本混合型证券投资基金基金合同

2、华富保本混合型证券投资基金托管协议

3、华富保本混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富保本混合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。

华富策略精选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:中国建设银行股份有限公司
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7月17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4月1日至2015年6月30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12月24日
报告期末基金份额总额	18,927,364.09份
投资目标	本基金将运用多层次的复合投资策略,在严格控制风险并保证充分流动性的前提下,力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略的基本思想是在充分控制风险的前提下实现高收益。依据风险-收益-投资策略关系原理,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投资策略进行实际投资,高层策略作用是规避风险,低层策略用于提高收益。
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	本基金属于灵活配置混合型证券投资基金,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4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	61,266,188.32
2.本期利润	34,269,456.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.6437
4.期末基金资产净值	32,841,836.38
5.期末基金份额净值	1.7352

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。

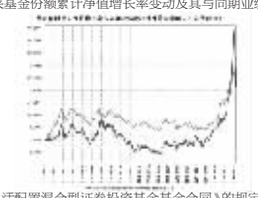
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	20.67%	3.16%	7.14%	1.57%	13.53%	1.59%

3.2.2 目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:股票占基金资产的30%~80%,权证占基金资产净值的0~3%,债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具占基金资产的5%~70%,其中,基金保留的现金以及投资于到期日一年期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。本报告期内,本基金严格执行了《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。

§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		
刘文正	华富策略精选混合型基金基金经理、华富智慧城市灵活配置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	2013年6月7日	2015年5月27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,2013年6月7日至2015年5月27日任华富策略精选混合型基金基金经理。
高靖瑜	华富策略精选混合型基金基金经理	2014年12月15日	-	十五年	复旦大学金融学硕士,本科学历。历任金鼎综合证券(维京)股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员,2007年7月加入华富基金管理有限公司,任行业研究员,2013年3月1日至2014年12月14日任华富价值增长混合型基金基金经理助理。

注:刘文正的任职日期指公司作出决定之日,离任日期指中国基金业协会作出注销决定之日;高靖瑜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

二季度沪深300指数累计上涨10.41%,创业板指数上涨22.42%,市场整体异常活跃,成交放量,上证指数创下5178.19点新高,但自此之后市场开始大幅回调。二季度前期,除大盘蓝筹外,其余行业全面走强;6月初,15年以来走势最强的计算机行率先出现调整,进而蔓延到所有行业,调整中银行等蓝筹成为避风港湾。

本基金组合在二季度中结构偏成长,配置主要集中在计算机、通信、传媒、机械、医药等新兴行业,参与了国企改革、京津冀、新能源等主题板块的投资,在前期取得一定收益;季末时虽然有一定蓝筹配置,但比例较低,在回调中有所受伤。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2008年12月24日正式成立。截止2015年6月30日,本基金份额净值为1.7352元,累计份额净值为1.8952元。报告期,本基金份额净值增长率为20.67%,同期业绩比较基准收益率为7.14%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从二季度公布的数据看,中国经济较一季度继续环比下滑,预计GDP可能跌破7%;外贸出口下滑幅度略有扩大,进口增长回落幅度减弱,但依然下滑超过10%;PMI维持在50.2,依然在荣枯线,显示实体经济生产相当低迷;需求方面,固定投资下滑至11.4%,财政支持基建的力度低于预期,楼市回暖尚未拉动新开工投资;在这样的形势下,我们预计下半年稳增长方面还是可能有政策加码。6月下半月市场整体出现大幅回调,其中主要以概念、故事推动股价的上市公司股价尤其脆弱,我们认为经历此次调整后市场参与方风险意识将加强,后期将对上市公司基本面更为关注,同时,市场经过大幅回调之后,整体和上市公司个体的风险都得到较大释放,后期投资选择会地将大大增加。从投资方向上讲,考虑经济发展阶段,我们还是更为看好符合未来战略方向的新兴产业,我们选择成长与改革的大方向将不会改变。

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	26,350,850.00	73.53
	其中:股票	26,350,850.00	73.53
2	固定收益投资	2,690,220.00	7.51
	其中:债券	2,690,220.00	7.51
	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	5,936,384.90	16.57
7	其他资产	857,297.29	2.39
8	合计	35,834,752.19	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、牧、渔业	-	-
B	采矿业	938,560.00	2.86
C	制造业	20,258,510.00	61.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	937,920.00	2.86
G	交通运输、仓储和邮政业	11,970.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,899,910.00	11.87
J	金融业	68,680.00	0.21
K	房地产业	235,300.00	0.72
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	26,350,850.00	80.24

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

代码	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	600155	宝硕股份	220,000	4,901,600.00	14.92
2	300038	梅泰诺	56,000	2,518,880.00	7.67
3	002367	康力电梯	100,000	2,090,000.00	6.36
4	300101	振芯科技	35,000	1,946,000.00	5.93
5	300059	东方财富	29,000	1,829,610.00	5.57
6	002196	方正电机	75,000	1,749,000.00	5.33
7	002612	朗姿股份	23,000	1,551,350.00	4.72
8	300400	劲拓股份	33,000	1,522,620.00	4.64
9	002030	达安基因	26,400	1,169,520.00	3.56
10	300299	富春通信	40,000	1,063,200.00	3.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,690,220.00	8.19
8	其他	-	-
9	合计	2,690,220.00	8.19

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113007	吉视转债	8,000	991,120.00	3.02
2	113008	电气转债	5,000	905,200.00	2.76
3	128009	歌尔转债	5,000	793,900.00	2.42

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:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 “宝硕股份(600155)”的发行主体河北宝硕股份有限公司于2014年7月1日收到中国证监会行政处罚决定书(2014)69号。宝硕股份存在未按规定披露控股股东及关联方占用资金事项、未按规定披露为其他公司提供担保事项、相关定期报告虚增利润、货币资金虚假记载、人为调整2006年半年度报告报表等违法事实。

本基金投资于“宝硕股份(600155)”的决策程序说明:基于“宝硕股份(600155)”基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于“宝硕股份(600155)”股票,其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

报告期内本基金投资的前十名证券中其他九名证券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	101,716.27
2	应收证券清算款	665,262.30
3	应收股利	-
4	应收利息	5,156.67
5	应收申购款	85,162.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	857,297.29

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113007	吉视转债	991,120.00	3.02
2	128009	歌尔转债	793,900.00	2.42

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600155	宝硕股份	4,901,600.00	14.92	长期停牌
2	002367	康力电梯	2,090,000.00	6.36	长期停牌

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	86,871,252.39
报告期期间基金总申购份额	30,135,246.26
减:报告期期间基金总赎回份额	98,079,134.56
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	18,927,364.09

§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、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同

2、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富策略精选灵活配置混合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。

华富成长趋势股票型证券投资基金

【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:招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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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4月1日至2015年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富成长趋势股票
基金主代码	410003
交易代码	410003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月19日
报告期末基金份额总额	1,450,664,583.47份
投资目标	精选符合中国经济增长新趋势、能持续为股东创造价值的公司,采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略,在风险限度内,力争实现基金资产的长期稳定增值。