华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20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10月1日至2015年12月31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	000757
交易代码	000757
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	632,349,959.60份
投资目标	本基金通过深入研究并积极投资与智慧城市相关的优质上市公司,分享其发展和成长的机会,力求获取超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以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与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	97,438,123.05
2.本期利润	241,924,976.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.3599
4.期末基金资产净值	914,380,744.45
5.期末基金份额净值	1.446

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。

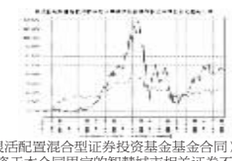
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	30.27%	2.38%	9.64%	0.83%	20.63%	1.55%

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%,投资于本合同界定的智慧城市相关证券不低于非现金基金资产的80%;其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资比例不得超过基金资产净值的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低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为2014年10月31日到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,本基金严格执行了《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。

§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		
龚炜	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理,华富竞争力优选混合型基金基金经理,华富成长趋势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,公司公募投资决策委员会主席,公司副总经理	41943	-	十一年	安徽财经大学金融学硕士,研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监,2012年9月加入华富基金管理有限公司,曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理,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。
刘文正	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、基金投资部副总监	41960	-	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,研究发展部总监助理。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。
王翔	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理,华富成长趋势混合型基金基金经理	41962	-	五年	墨尔本大学工程管理学硕士、研究生学历。2010年3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,2014年5月12日至2014年11月18日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理助理。

注:龚炜的任职日期指该基金成立之日,刘文正、王翔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

四季度上证指数上涨15.93%,深圳成分指数上涨26.8%,创业板指数上涨30.32%,四季度市场总体度看市场维持了超跌反弹,指数在股灾后出现了相对稳健的估值修复行情,很多主题热度较高,如新能源汽车、VR等。去杠杆、去融资对新兴产业影响较大,在去杠杆告一段落之后市场人气逐步得到恢复。市场四季度出现较好的机会,但很多个股出现较大涨幅和很多主题超涨引发的泡沫给市场风险也带来较大调整风险。16年看很多主题如国企改革、迪斯尼、体育、环保、军工等行业有望较好表现。互联网、计算机、传媒等为主的新兴产业反弹后泡沫较大,需要经过充分调整后才能迎来较好的投资机会。但长期来看新兴产业仍然是本基金重点进攻的方向。回顾四季度看经济数据相对表现一直都较差,PM1和GDP增速一路下行,政府容忍度也不断下移,政府更多的工作仍然在反腐,最新的经济工作会议对淘汰落后产能有了进一步措施。因此总体看前周期品种出现了短暂反弹、新兴产业又被大幅去沪沫;因此大行情的时机尚在孕育。

本基金四季度维持了前期思路,分散了行业配置,延续了一直以来的是“一轴加两翼”的格局,四季度主要配置了跟智慧城市相关性较高的智慧城市标的,但不局限于科技股,包括传统的智慧城市的一部分都加大了配置力度。另外体育、医药、互联网、信息安全、军工和环保也都有配置。操作层面看换手较高是由于加强了对热点和主题的配置力度,总体收效一般。由于经济下行数据较为确定和政府反腐力度较大,经济刺激方案迟迟没有退出,因此对于强周期品的配置基本上没有。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2014年10月31日正式成立。截止2015年12月31日,本基金份额净值为1.446元,累计份额净值为1.646元。报告期,本基金份额净值增长率为30.27%,同期业绩比较基准收益率为9.64%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最新公布的经济数据看 ,显示经济仍在底部,目前在政府也对经济表现出来稳增长的意愿,政府工作的重点未来有望在稳增长上采取刺激手段,全年看国企改革有序推进,总体看相关标的都有较好表现,很多行业机会表现也较好,年底和年初看政策密集期国企改革有望进一步发酵,另外,新一届政府围绕民生有望有较大的刺激政策。对于一些价格弹性较大的品种要更加关注。如维生素、猪肉、基层工业品等;最新的政府工作会议明确了淘汰落后产能重视,为经济大环境的持续改善提供了更大的想象空间。人民币短期快速贬值也有效的测试和释放风险。在短期证监会去杠杆和融资等利空集中释放后,短期市场出现了较大幅度的调整,增加了16年的投资难度,但有效的降低了市场短期的风险。因此就总体的宏观经济环境看,强周期品种可能存在较好的左侧投资机会,但具体空间有待于未来确定的刺激政策。资金面看也在持续改善中。

结合宏观环境看是市场,在政府稳增长的预期下,市场预期会有微刺激和强刺激的政策出台,本基金认为未来的主要机会仍然在新兴产业的领域,加大对智慧城市相关标的配置。短期超跌成长股有较强反弹需求,长期看确定成长的优质成长股仍然是本基金配置的重点。

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基金资产净值低于五千万的情形。

§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	849,865,582.04	92.44
	其中:股票	849,865,582.04	92.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	55,176,248.87	6.00
8	其他资产	14,291,400.97	1.55
9	合计	919,333,231.88	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	-	-
C	制造业	426,479,170.09	46.64
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	115,930,740.33	12.68
G	交通运输、仓储和邮政业	25,765,109.22	2.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	209,121,970.02	22.87
J	金融业	-	-
K	房地产业	55,351,474.00	6.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,217,118.38	1.88
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	849,865,582.04	92.94

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	600153	建发股份	5,941,269	87,277,241.61	9.54
2	603333	明星电缆	4,000,000	38,480,000.00	4.21
3	002018	华信国际	1,197,354	36,639,032.40	4.01
4	002405	四维图新	840,330	32,604,804.00	3.57
5	300365	恒华科技	759,161	32,545,232.07	3.56
6	300016	北陆药业	855,638	30,383,705.38	3.32
7	300075	数字政通	969,164	30,383,291.40	3.32
8	300127	银河磁体	1,587,313	28,857,350.34	3.16
9	600729	重庆百货	979,272	28,653,498.72	3.13
10	600391	成发科技	547,627	28,399,936.22	3.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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:本报告期末本基金无股指期货投资。

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	950,229.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,078.58
5	应收申购款	13,295,092.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,291,400.97

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	600153	建发股份	87,277,241.61	9.54	临时停牌
2	002018	华信国际	36,639,032.40	4.01	临时停牌
3	300365	恒华科技	32,545,232.07	3.56	临时停牌
4	600729	重庆百货	28,653,498.72	3.13	临时停牌

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	715,881,256.03
报告期期间基金总申购份额	172,139,554.33
减:报告期期间基金总赎回份额	255,670,850.76
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	632,349,959.60

§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、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同

2、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富智慧城市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。

华富中小板指数增强型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月20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10月1日至2015年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中小板指数增强
基金主代码	410010
交易代码	410010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月9日
报告期末基金份额总额	5,023,068.10份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,以被动跟踪标的指数为主,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础之上,力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	作为指数增强型基金,本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上,采用适度的主动投资辅助提高收益,降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法,按照标的指数的成分股组成及其权重构建指数化投资组合,并按照标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股,在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。
业绩比较基准	中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-78,127.47
2.本期利润	1,919,069.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.3537
4.期末基金资产净值	8,722,394.28
5.期末基金份额净值	1.736

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。

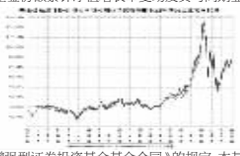
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	24.44%	2.01%	21.38%	1.85%	3.06%	0.16%

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较



注:根据《华富中小板指数增强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:投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券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2011年12月9日到2012年6月9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《华富中小板指数增强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		
朱蓓	华富中小板指数增强型基金基金经理、华富量子生命力混合型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理	41262	-	八年	上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历,曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理,2009年11月进入华富基金管理有限公司,曾任金融工程研究员、产品设计经理。

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

自2015年6月份以来,市场进入牛熊转换市场。国庆后,市场开始反弹,一直延续到年底。我们认为市场会继续下跌,并创出新低,四季度以来的反弹与2009年类似。

四季度沪深300指数上涨16.5%,涨幅较大的三个行业分别为电子、房地产、计算机,涨幅较小的三个行业为钢铁、交通运输、国防军工 。

作为中小板指数增强型基金,本基金的仓位和结构会严格按照基金合同的要求进行配置,将跟踪误差控制在基金合同要求的范围内,同时力争实现超越比较基准的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2011年12月9日正式成立。截止2015年12月31日,本基金份额净值为1.736元,累计份额净值为1.736元。报告期,本基金份额净值增长率为24.44%,同期业绩比较基准收益率为21.38%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年底前汇率市场出现巨大波动,人民币快速贬值。证监会为了稳定市场,减小波动,增加了市场熔断机制,对股指期货交易时间和涨跌停进行了修改,但事实上南辕北辙,并未改变市场下跌趋势,我们认为市场的疲软走势仍会保持相当一段时间。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从2014年9月4日起至本报告期末(2015年12月31日),本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于五千万元的情形,至本报告期期末(2015年12月31日)基金资产净值仍低于5000万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》,积极采取相关措施,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§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	7,653,061.44	80.42
	其中:股票	7,653,061.44	80.42
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,300,000.00	13.66
	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	555,749.82	5.84
7	其他资产	7,362.94	0.08
8	合计	9,516,174.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	89,155.00	1.02
B	采矿业	36,930.92	0.42
C	制造业	4,796,181.36	54.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	242,379.25	2.78
F	批发和零售业	308,351.52	3.54
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	863,029.16	9.89
J	金融业	496,756.02	5.70
K	房地产业	91,755.66	1.05
L	租赁和商务服务业	310,006.36	3.55
M	科学研究和技术服务业	19,890.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	78,136.08	0.90
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	7,332,571.33	84.07

5.2.2 报告期末积极投资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	20,517.32	0.24
B	采掘业	-	-
C	制造业	156,161.62	1.79
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	60,854.19	0.70
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	75,463.18	0.87
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,493.80	0.09
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	320,490.11	3.67

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

5.3.1 报告期末指数投资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	002024	苏宁云商	18,448	248,125.60	2.84
2	002450	康得新	5,475	208,597.50	2.39
3	002415	海康威视	6,018	206,959.02	2.37
4	002202	金风科技	7,553	172,132.87	1.97
5	002594	比亚迪	2,425	156,170.00	1.79
6	002304	洋河股份	2,247	154,009.38	1.77
7	002230	科大讯飞	3,960	146,718.00	1.68
8	002673	西部证券	4,442	146,186.22	1.68
9	002183	怡亚通	3,163	145,687.78	1.67
10	002142	宁波银行	9,013	139,791.63	1.60

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002091	江苏国泰	1,267	33,664.19	0.39
2	002612	朗姿股份	395	29,806.70	0.34
3	002349	精华制药	754	29,179.80	0.33
4	600576	万好万家	1,000	27,190.00	0.31
5	002055	得润电子	691	26,714.06	0.31

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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 深圳证券交易所于2015年1月9日发布《关于对獐子岛集团股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》,对獐子岛(002069)的发行主体獐子岛集团股份有限公司及相关当事人给予通报批评的处分,决定称獐子岛未充分披露冷水团对于公司经营可能产生的重大风险,未及时完整披露公司生产经营重大变化,深交所给予公司和相关当事人通报批评的处分。该证券属于本基金积极投资部分的前十名。

本基金投资于“獐子岛(002069)”的决策程序说明:基于獐子岛基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于“獐子岛”,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	5,317.76
2	应收证券清算款	253.50
3	应收股利	-
4	应收利息	150.59
5	应收申购款	1,641.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,362.94

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	002612	朗姿股份	29,806.70	0.34	临时停牌

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	5,594,834.33
报告期期间基金总申购份额	1,199,022.88
减:报告期期间基金总赎回份额	1,770,789.11
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	5,023,068.10

§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、华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同

2、华富中小板指数增强型证券投资基金托管协议

3、华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富中小板指数增强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。

华富中证100指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20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。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证100指数
基金主代码	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12月30日
报告期末基金份额总额	35,990,591.38份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争控制净值增长率与业