华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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:2013年10月24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2013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2013年7月1日至2013年9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	66,174,705.00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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	1,550,184.35
2.本期利润	6,372,970.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0931
4.期末基金资产净值	56,003,905.38
5.期末基金份额净值	0.8463

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。

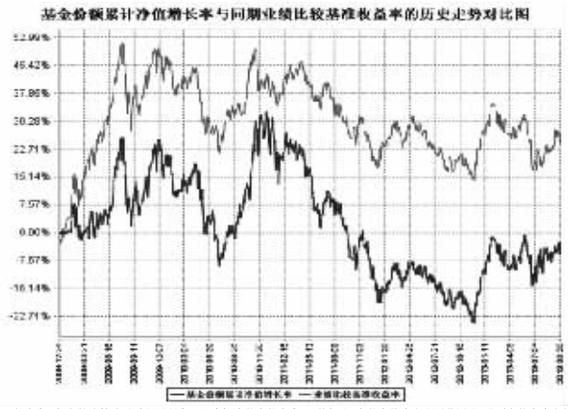
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	12.21%	1.45%	5.91%	0.86%	6.30%	0.59%

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		
郭晨	华富策略精选混合型基金基金经理、华富价值增长混合型基金基金经理	2012年12月19日	-	六年	四川大学技术经济及管理专业硕士,研究生学历,历任平安资产管理有限责任公司投资绩效分析师、东吴基金管理有限公司金融工程研究员,2009年11月进入华富基金管理有限公司,任华富中证100指数基金基金经理助理,2011年12月9日至2012年12月19日担任华富中小板指数增强型基金基金经理,2010年12月27日至2012年12月19日担任华富中证100指数基金基金经理。
刘文正	华富策略精选混合型基金基金经理	2013年6月7日	-	九年	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,先后担任行业研究员、研究部总监助理、华富竞争力优选混合型基金基金经理助理。

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或交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度沪深300指数累计上涨13.35%,以创业板为代表的成长股维持了较好的表现,创业板指数季度涨幅30%以上。其中传媒指数上涨70%以上,TMT仍然维持活跃。回顾三季度经济数据从PMI看经济维持前期的温和复苏局面,流动性也未有较大改变,央行仍然以短期市场操作手段逆回购为主。市场机会主要表现在以传媒、去IOE、自贸区、二胎、土地流转、上海国企改制等主题上。前周期品由于经济没有较大改善数据,因此总体表现平淡。

本基金在三季度前期由于对经济数据相对较为乐观增加了地产、建材等周期品配置,由于经济数据和流动性迟迟没有较大改善,而且政府的容忍度在下移,因此在切合改革预期的大背景下调整超配了信息技术、节能环保、化工等行业,减持了银行、房地产、建材等。由于市场跌幅较大,二期对经济相对悲观,从而催生了成长股的机会,另外市场对经济转型、调结构和改革红利预期较强,因此小股票有了较好表现。

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2013年9月30日,本基金份额净值为0.8463元,累计份额净值为1.0063元。报告期,本基金份额净值增长率为12.21%,同期业绩比较基准收益率为5.91%。

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9月份PMI回升偏弱有上月的51略升至51.1,虽然连续3个月回升,创出6个月新高,但远逊于历年9月的1.7%环比增幅,显然经济旺季不旺的特征,因此较弱的经济数据反映了经济复苏相对缓慢的特征,且上层对经济增速的容忍度一再下移。预计短期内经济难有较大表现,流动性方面,国家反向调控、QE退出延后等使得短期流动性比预期好,因此结合8月份外汇占款转正已经显示出流动性不再那么悲观,另外市场中的融资融券业务也一定程度上增加了活跃资金的供给,四季度看房地产不确定性较高,市场对房产税等政策的调控预期在加强。

我们预期四季度经济依旧延续弱复苏,在十一届三中全会前总体安全,市场将围绕改革预期的方向不断演绎,投资主线是寻找改革和转型红利的标的,可以关注的主题有土改、二胎、养老、金改和国有企业改革等主题。另外,三季报行情也将为全年的估值切换行情拉开序幕。能有持续高成长的优质公司可能提前开始估值切换。主题机会的把握将紧紧围绕改革的方向布局。在行业的配置上维持TMT、节能环保、化工等配置,坚定看好成长股为代表的新兴产业。

§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	44,212,404.90	78.16
	其中:股票	44,212,404.90	78.16
2	固定收益投资	8,012,651.30	14.16
	其中:债券	8,012,651.30	14.16
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	4,287,610.18	7.58
6	其他资产	56,471.84	0.10
7	合计	56,569,138.22	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	951,480.00	1.70
C	制造业	18,203,636.22	32.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,246,776.00	4.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,412,094.00	6.09
G	交通运输、仓储和邮政业	685,356.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,763,747.16	15.65
J	金融业	2,994,109.00	5.35
K	房地产业	1,751,375.00	3.13
L	租赁和商务服务业	996,757.00	1.78
M	科学研究和技术服务业	727,339.80	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	1,209,660.48	2.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	948,064.00	1.69
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	747,600.00	1.33
S	综合	574,410.24	1.03
	合计	44,212,404.90	78.95

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	600387	海越股份	194,200	3,412,094.00	6.09
2	300335	迪森股份	101,800	1,978,992.00	3.53
3	000800	一汽轿车	142,300	1,888,321.00	3.37
4	002230	科大讯飞	39,000	1,857,180.00	3.32
5	002080	中材科技	123,725	1,815,045.75	3.24
6	000917	电广传媒	96,700	1,808,290.00	3.23
7	600000	浦发银行	173,500	1,750,615.00	3.13
8	300182	捷成股份	46,000	1,707,980.00	3.05
9	002557	洽洽食品	63,100	1,408,392.00	2.51
10	300017	网宿科技	24,520	1,397,640.00	2.50

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	8,012,651.30	14.31
8	其他	-	-
9	合计	8,012,651.30	14.31

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	113001	中行转债	20,000	2,000,600.00	3.57
2	110015	石化转债	20,270	1,984,230.30	3.54
3	110018	国电转债	16,610	1,808,164.60	3.23
4	113002	工行转债	10,070	1,116,058.10	1.99
5	110023	民生转债	10,430	1,103,598.30	1.97

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本报告期内本基金无股指期货投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本报告期内本基金无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,410.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,133.59
5	应收申购款	5,927.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,471.84

5.10.4 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	113001	中行转债	2,000,600.00	3.57
2	110015	石化转债	1,984,230.30	3.54
3	110018	国电转债	1,808,164.60	3.23
4	113002	工行转债	1,116,058.10	1.99
5	110023	民生转债	1,103,598.30	1.97

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 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	70,325,269.45
报告期期间基金总申购份额	492,172.91
减:报告期期间基金总赎回份额	4,642,737.36
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	66,174,705.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注: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

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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:2013年10月24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2013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2013年7月1日至2013年9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	1,813,362,911.39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。
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的。在行业及股票选择方面,本基金"自下而上"地以可持续增值企业为目标进行三次股票筛选来寻找价值被低估的优势企业,结合"自上而下"精选最优行业,动态寻找优势企业与景气行业的最佳结合,构建投资组合,以追求基金资产的中长期稳定增值。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数+20%×中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。
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

§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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	20,956,962.18
2.本期利润	262,345,193.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.1424
4.期末基金资产净值	1,204,743,794.57
5.期末基金份额净值	0.6644

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。

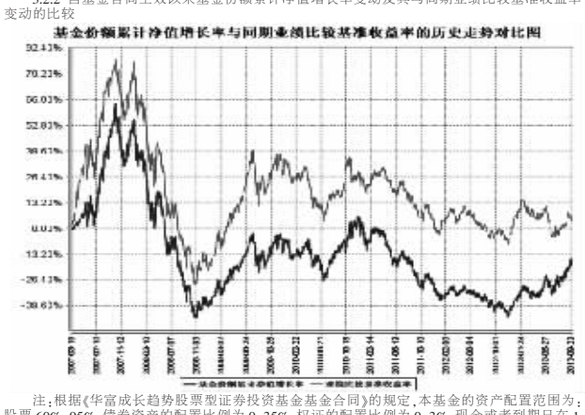
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	27.35%	1.61%	8.65%	1.12%	18.70%	0.49%

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《华富成长趋势股票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60%~95%,债券资产的配置比例为0~35%,权证的配置比例为0~3%,现金或者到期日在1年以内的政府债券的配置比例不低于基金资产净值的5%,本基金建仓期为2007年3月19日至9月19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《华富成长趋势股票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	华富成长趋势股票型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、公司投资决策委员会成员、公司投研总监兼基金投资部总监	2012年12月21日	-	九年	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,任研究发展部金融工程研究员。

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或交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年第三季度国内经济逐步趋稳,资金最紧张的时刻已过去,政策"稳增长"预期进一步增强,政府陆续提出了支持铁路、城市基础设施、棚户区改造、4G、环保等领域的增长措施。随着新一届政府不断强化改革与转型,市场对经济复苏程度的预期中枢缓慢下移,容忍度有所提高,经济增长对市场的边际作用逐步减弱。A股投资者更加重视经济的结构转型前景,转型预期逐步升温,上证指数震荡上行,三季度上涨了9.88%。本基金三季度的投资操作中更多关注市场上的结构性机会,仓位方面未做大的变化,净值表现较好。行业表现方面,传媒、计算机等信息消费类行业涨幅居前,而白酒、煤炭,有色等的行业受行业周期影响,表现一般。三季度本基金逢高减持了地产、银行、原料药等相关行业个股,增持了计算机、传媒等行业,总体效果不错。由于随着经济结构的转型,投资组合的配置更需要着重考察行业基本面。未来配置上需要兼顾成长和价值的匹配,短期伴随着成长股的大幅上涨,价值股的低估值优势逐步显现,配置策略上会平衡低估值价值股和成长股的配置权重,力争持续取得超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2007年3月19日正式成立。截止2013年9月30日,本基金份额净值为0.6644元,累计份额净值为0.9544元。报告期,本基金份额净值增长率为27.35%,同期业绩比较基准收益率为8.65%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年7月30日召开的中央政治局会议提出"积极稳妥推进以人为核心的新型城镇化,促进房地产市场平稳健康发展"可以视为进一步"稳增长"的信号。而9月29日中国(上海)自贸区挂牌成立,其意义堪比深圳特区的成立,显示新政府的改革精神,是普惠式的中长期利好。

三季度美联储退出QE的预期导致新兴市场进口需求萎缩,由于美国货币政策的不确定性增加,这可能也会继续影响我国四季度出口形势。同时,欧元区联手应对主权债务危机,使欧洲经济有望继续缓慢复苏。与此同时世界银行报告则认为中国经济增长将进一步放缓,下调了中国今明两年GDP增速到7.5%和7.7%,建议中国经济仍然需要坚决转向消费驱动型增长。

从已公告的A股公司三季报预报来看,业绩下滑数量接近一半,上市公司应对经济减速的抗风险能力仍需加强,业绩因素将限制市场的整体的反弹空间。四季度我们将增强对市场和政策的前瞻性研究,积极关注基本面的改变。由于9月PPI、CPI已经分别回升到-1.3%和3.1%,货币政策将趋中性偏紧。整体市场而言由于经济复苏预期和改革红利预期向好,本基金管理人维持对市场谨慎乐观的判断,向上空间主要看房地产投资好转幅度,向下恐慌仍旧来自于货币政策和美国QE退出带来的全球流动性收紧。未来本基金将主要关注两条主线上的投资机会:一方面是改革和转型预期,重点关注环保新能源、传媒,计算机和电子等行业板块;另一方面是低估值结合确定性收益,重点关注农林牧渔,汽车等行业板块。

§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	1,138,170,737.93	94.20
	其中:股票	1,138,170,737.93	94.20
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	69,542,892.90	5.76
6	其他资产	530,809.52	0.04
7	合计	1,208,244,440.35	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	54,941,293.00	4.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	586,178,075.89	48.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,197,286.16	2.67
E	建筑业	9,972,072.00	0.83
F	批发和零售业	56,746,707.50	4.71
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	277,378,364.86	23.02
J	金融业	53,015,712.52	4.40
K	房地产业	28,490,000.00	2.36
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	39,251,226.00	3.26
S	综合	-	-
	合计	1,138,170,737.93	94.47

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	600637	百视通	1,499,810	78,515,053.50	6.52
2	300002	神州泰岳	1,831,186	70,335,854.26	5.84
3	600686	金龙汽车	6,320,270	60,358,578.50	5.01
4	002080	中材科技	3,999,863	58,677,990.21	4.87
5	600387	海越股份	3,229,750	56,746,707.50	4.71
6	300226	上海钢联	1,043,483	44,243,679.20	3.67
7	000800	一汽轿车	3,199,999	42,463,986.73	3.52
8	600633	浙报传媒	805,980	39,251,226.00	3.26
9	600416	湘电股份	5,499,980	37,894,862.20	3.15
10	600797	浙大网新	5,299,915	35,297,433.90	2.93

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名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名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名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本报告期内本基金无股指期货投资。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	373,768.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,538.14
5	应收申购款	142,502.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	530,809.52

5.10.4 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.

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 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	1,861,752,149.68
报告期期间基金总申购份额	10,871,065.63
减:报告期期间基金总赎回份额	59,260,303.92
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,813,362,911.39

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注: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、华富成长趋势股票型证券投资基金基金合同

2、华富成长趋势股票型证券投资基金托管协议

3、华富成长趋势股票型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富成长趋势股票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。

华夏回报证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十四日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏回报混合	
基金主代码	002001	
交易代码	002001	002002
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年9月5日	
报告期末基金份额总额	7,875,796,587.14份	
投资目标	尽量避免基金资产损失,追求每年较高的绝对回报。	
投资策略	正确判断市场走势,合理配置股票和债券等投资工具的比例,准确选择具有投资价值的股票品种和债券品种进行投资,可以在尽量避免基金资产损失的前提下实现基金每年较高的绝对回报。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为绝对回报标准,为同期一年期定期存款利率。	
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金,低于股票基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	

§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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	464,232,030.52
2.本期利润	1,491,307,204.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.1884
4.期末基金资产净值	11,823,838,605.88
5.期末基金份额净值	1.501

注:①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。

②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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	14.14%	0.90%	0.76%	0.00%	13.38%	0.90%

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

§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