

华富保本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

1.1 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。
 基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合比例等信息,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,也不保证基金资产净值不受损失,投资者自行承担投资风险,基金业绩并不构成对投资者的投资建议。
 本报告所载数据截至2013年9月30日。
 本报告期为2013年7月1日起至2013年9月30日。

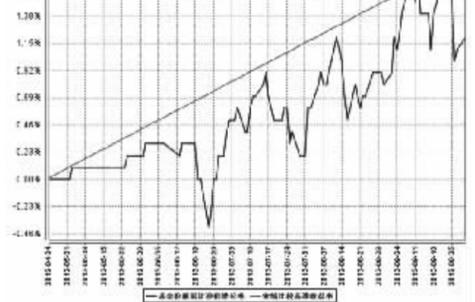
基金产品概况	
基金名称	华富保本混合
基金代码	000028
交易代码	000028
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
报告期基金资产总额	395,309,448.42元
投资目标	本基金采取定投资策略,通过资产配置(CPI、GDP、PPI、PMI、CPI、PPI、PMI、CPI、PPI、PMI)动态调整资产配置,力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在保本的前提下,通过动态调整资产配置,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金在保本前提下的业绩比较基准为:三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金,属于证券投资基金中低风险品种。投资者投资于本基金资产净值不低于基金份额净值发行时存款类金融资产,保本金额为投资者投资于本基金资产净值。
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
基金联系人	中国建设银行股份有限公司

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日至2013年9月30日)	
1.本期已实现收益	2,807,628.31
2.本期利润	4,162,257.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0090
4.期末基金资产净值	400,077,194.34
5.期末基金份额总额	1,012

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.本基金本报告期无基金份额持有人认购或交易的各项费用,计入费用后实际收益水平低于所列数字。
 3.2.2 本基金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	1.00%	0.19%	1.06%	0.01%	-0.06%	0.18%

基金业绩累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:报告期内本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图,以净值增长率减去业绩比较基准收益率为基准,正值表示基金净值增长率高于业绩比较基准收益率,负值表示基金净值增长率低于业绩比较基准收益率。

4.1 基金管理人及基金经理简介				
姓名	职务	任本基金的高级管理期限	证券从业年限	说明
胡伟	华富保本混合型证券投资基金基金经理	2013年4月24日	九年	中国政法大学金融学硕士,本科学历,曾任珠海中保基金资产管理部副经理,从事基金行业多年,2006年11月加入华富基金管理有限公司,担任基金经理,2007年12月担任基金经理,2013年4月24日担任基金经理。

注:证券从业年限为基金成立之日起至报告期末的计算标准,上述从业年限均通过中国证监会基金从业人员资格管理系统查询。
 4.2 管理人及基金经理人基金从业资格情况
 本报告期内,基金管理人及基金经理人符合中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规对基金管理人及基金经理人从业资格的要求,不存在违法违规或受到中国证监会行政处罚的情况。
 4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易专项说明
 本报告期内,基金管理人严格执行中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规,公平对待所有基金份额持有人,不存在不公平对待基金份额持有人的情况。
 4.3.2 公平交易专项说明
 本报告期内,基金管理人严格执行中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规,公平对待所有基金份额持有人,不存在不公平对待基金份额持有人的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
 三季度,中国宏观经济运行平稳,通胀压力有所缓解,但中长期来看,通胀压力依然较大,货币政策在稳增长和防通胀之间保持平衡,流动性保持宽松,市场整体呈现震荡格局,结构性机会依然较多。本基金在保本的前提下,通过动态调整资产配置,力求实现基金资产的长期增值。

4.5 报告期内基金业绩比较基准的说明
 本基金业绩比较基准为:三年期银行定期存款税后收益率。

4.6 报告期内基金资产净值变动情况
 截至2013年9月30日,本基金资产净值为400,077,194.34元,基金份额净值为1.012元,基金份额总额为1,012份。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

4.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

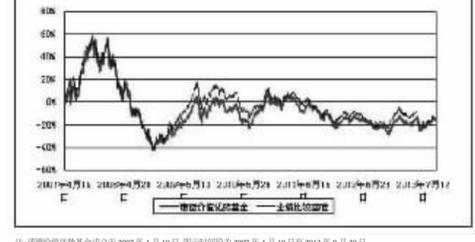
基金产品概况	
基金名称	诺德价值优势股票
基金代码	570001
交易代码	570001
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2007年4月19日
报告期基金资产总额	2,602,131,600.40元
投资目标	本基金为主动型股票基金,投资于具有持续增长潜力的上市公司,分享中国宏观经济和资本市场长期成长,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下的投资策略,通过动态调整资产配置,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	80%沪深300指数+20%上证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中高风险品种,长期平均的风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,低于其他类型基金。
基金管理人	诺德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

3.1 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日至2013年9月30日)	
1.本期已实现收益	-7,388,040.26
2.本期利润	244,327,528.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0920
4.期末基金资产净值	2,189,322,466.38
5.期末基金份额总额	1,041.4

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.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动损益扣除相关费用后的余额,本期利润为本期公允价值变动收益加上本期公允价值变动收益。
 3.2.2 本基金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
2013年7月1日至2013年9月30日	12.22%	1.09%	7.00%	1.15%	4.52%	-0.12%

基金业绩累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:报告期内本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图,以净值增长率减去业绩比较基准收益率为基准,正值表示基金净值增长率高于业绩比较基准收益率,负值表示基金净值增长率低于业绩比较基准收益率。

4.1 基金管理人及基金经理简介				
姓名	职务	任本基金的高级管理期限	证券从业年限	说明
薛峰	诺德价值优势股票基金基金经理	2011-11-7	6	上海财经大学硕士,2007年3月加入诺德基金管理有限公司,先后从事风险控制和管理研究工作,2011年11月担任基金经理,2011年11月担任基金经理,2011年11月担任基金经理。

注:证券从业年限为基金成立之日起至报告期末的计算标准,上述从业年限均通过中国证监会基金从业人员资格管理系统查询。
 4.2 管理人及基金经理人基金从业资格情况
 本报告期内,基金管理人及基金经理人符合中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规对基金管理人及基金经理人从业资格的要求,不存在违法违规或受到中国证监会行政处罚的情况。
 4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易专项说明
 本报告期内,基金管理人严格执行中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规,公平对待所有基金份额持有人,不存在不公平对待基金份额持有人的情况。
 4.3.2 公平交易专项说明
 本报告期内,基金管理人严格执行中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规,公平对待所有基金份额持有人,不存在不公平对待基金份额持有人的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
 三季度,中国经济运行平稳,通胀压力有所缓解,但中长期来看,通胀压力依然较大,货币政策在稳增长和防通胀之间保持平衡,流动性保持宽松,市场整体呈现震荡格局,结构性机会依然较多。本基金在保本的前提下,通过动态调整资产配置,力求实现基金资产的长期增值。

4.5 报告期内基金业绩比较基准的说明
 本基金业绩比较基准为:80%沪深300指数+20%上证国债指数。

4.6 报告期内基金资产净值变动情况
 截至2013年9月30日,本基金资产净值为2,189,322,466.38元,基金份额净值为1.0414元,基金份额总额为1,041.4份。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

4.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

华富中小板指数增强型证券投资基金

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

1.1 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。
 基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合比例等信息,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,也不保证基金资产净值不受损失,投资者自行承担投资风险,基金业绩并不构成对投资者的投资建议。
 本报告所载数据截至2013年9月30日。
 本报告期为2013年7月1日起至2013年9月30日。

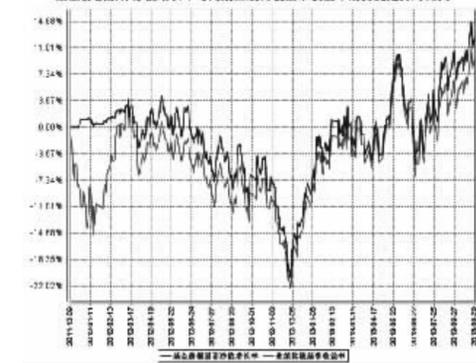
基金产品概况	
基金名称	华富中小板指数增强
基金代码	410010
交易代码	410010
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2013年12月9日
报告期基金资产总额	39,883,138.48元
投资目标	本基金为股票型基金,通过动态调整资产配置,力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下的投资策略,通过动态调整资产配置,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中高风险品种,长期平均的风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,低于其他类型基金。
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

3.1 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日至2013年9月30日)	
1.本期已实现收益	4,265,674.75
2.本期利润	10,362,872.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.2013
4.期末基金资产净值	44,961,099.22
5.期末基金份额总额	1,127

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.本期公允价值变动收益指基金本期公允价值变动损益扣除相关费用后的余额,本期利润为本期公允价值变动收益加上本期公允价值变动收益。
 3.2.2 本基金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	16.55%	1.42%	15.75%	1.49%	0.80%	-0.01%

基金业绩累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:报告期内本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图,以净值增长率减去业绩比较基准收益率为基准,正值表示基金净值增长率高于业绩比较基准收益率,负值表示基金净值增长率低于业绩比较基准收益率。

4.1 基金管理人及基金经理简介				
姓名	职务	任本基金的高级管理期限	证券从业年限	说明
宋国	华富中小板指数增强基金基金经理	2012-12-19	六年	上海交通大学管理学硕士,曾任平安资产管理部副经理,2009年11月加入华富基金管理有限公司,任基金经理,2012年12月19日担任基金经理。

注:证券从业年限为基金成立之日起至报告期末的计算标准,上述从业年限均通过中国证监会基金从业人员资格管理系统查询。
 4.2 管理人及基金经理人基金从业资格情况
 本报告期内,基金管理人及基金经理人符合中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规对基金管理人及基金经理人从业资格的要求,不存在违法违规或受到中国证监会行政处罚的情况。
 4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易专项说明
 本报告期内,基金管理人严格执行中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规,公平对待所有基金份额持有人,不存在不公平对待基金份额持有人的情况。
 4.3.2 公平交易专项说明
 本报告期内,基金管理人严格执行中国证监会《证券投资基金法》及相关法律法规,公平对待所有基金份额持有人,不存在不公平对待基金份额持有人的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
 三季度,中国经济运行平稳,通胀压力有所缓解,但中长期来看,通胀压力依然较大,货币政策在稳增长和防通胀之间保持平衡,流动性保持宽松,市场整体呈现震荡格局,结构性机会依然较多。本基金在保本的前提下,通过动态调整资产配置,力求实现基金资产的长期增值。

4.5 报告期内基金业绩比较基准的说明
 本基金业绩比较基准为:中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%。

4.6 报告期内基金资产净值变动情况
 截至2013年9月30日,本基金资产净值为39,883,138.48元,基金份额净值为1.127元,基金份额总额为1,127份。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

4.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
 本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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	28,898,554.83	1.32
B	采矿业	33,009,069.46	1.51
C	制造业	794,549,378.28	36.29
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	21,068,577.31	0.96
E	建筑业	46,564,371.59	2.13
F	批发和零售业	89,911,513.87	4.11
G	交通运输、仓储和邮政业	11,902,294.80	0.54
H	住宿和餐饮业	30,441,669.66	1.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,397,586.66	2.51
J	金融业	39,068,487.49	1.78
K	房地产业	51,899,374.48	2.37
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	27,253,500.06	1.24
P	其他	-	-
Q	其他	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,530,729.76	0.71
S	合计	-	-
合计		1,748,905,507.32	79.88

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	601818	光大银行	38,922,448	110,930,116.80	5.07
2	601328	交通银行	22,709,946	68,059,767.80	4.48
3	600605	青岛海尔	6,706,175	98,329,251.00	4.08
4	601166	兴业银行	7,034,125	78,370,062.76	3.50
5	601998	中信银行	18,099,728	71,248,972.20	3.23
6	600155	华鲁恒升	7,644,023	57,109,851.81	2.61
7	600877	伊利股份	1,166,800	52,132,624.00	2.38
8	601988	中国银行	17,799,802	49,483,449.56	2.26
9	000015	中兴通讯	1,218,027	44,287,461.72	2.02
10	600060	海信电器	3,018,207	35,374,440.84	1.62

5.1 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	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	3,146,713.00	0.14	
2	央行票据	-	-	
3	金融债券	59,925,000.00	2.74	
4	企业债券	59,925,000.00	2.74	
5	中期票据	156,621,075.00	7.15	
6	可转换债券	-	-	
7	其他	-	-	
8	其他	-	-	
9	合计	-	-	
合计			10.03	

5.2 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债券投资明细				
序号	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	3,146,713.00	0.14	
2	央行票据	-	-	
3	金融债券	59,925,000.00	2.74	
4	企业债券	59,925,000.00	2.74	
5	中期票据	156,621,075.00	7.15	
6	可转换债券	-	-	
7	其他	-	-	
8	其他	-	-	
9	合计	-	-	
合计			10.03	

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权证投资明细					
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	118022	13债付息22	300,000	30,021,000.00	1.37
3	118214	13债付息14	300,000	29,940,000.00	1.35
4	112059	11债付息	190,180	19,401,400.00	0.89
5	124041	12债付息	100,000	10,180,000.00	0.46

注:1.本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
 2.本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债券投资明细
 3.本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权证投资明细

4.本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.本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债券投资明细
 6.本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权证投资明细

7.本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
 8.本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债券投资明细
 9.本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权证投资明细

10.本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
 11.本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债券投资明细
 12.本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权证投资明细

13.本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
 14.本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债券投资明细
 15.本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权证投资明细

16.本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
 17.本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债券投资明细
 18.本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权证投资明细

19.本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
 20.本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债券投资明细
 21.本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权证投资明细

22.本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
 23.本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债券投资明细
 24.本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权证投资明细