华富强化回报债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年7月19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2014年7月18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2014年4月1日至2014年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富强化回报债券(场内简称:华富强债)
基金主代码	164105
交易代码	164105
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2010年9月8日
报告期末基金份额总额	528,723,069.83份
投资目标	在控制风险的基础上,力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素,研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险,以确定各类金融资产的配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	734,624.39
2.本期利润	28,876,195.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0488
4.期末基金资产净值	560,499,064.63
5.期末基金份额净值	1.060

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。

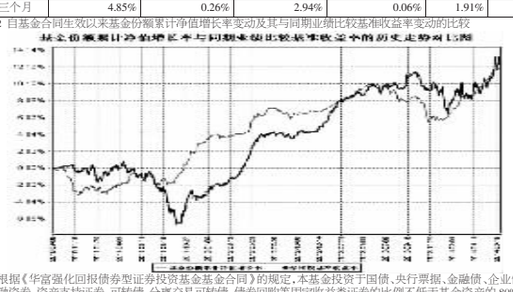
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.85%	0.26%	2.94%	0.06%	1.91%	0.20%

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《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%。本基金还可以参与新股申购、股票增发和要约收购类股票投资,并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于非固定收益类证券的比例不超过基金资产的20%。在封闭期结束后,本基金保留的现金以及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%。本基金建仓期为2010年9月8日到2011年3月8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《华富强化回报债券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		
尹培俊	华富强化回报债券型基金基金经理、华富货币市场基金基金经理	2014年3月6日	-	八年	华东师范大学经济学学士,本科学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理,2012年加入华富基金管理有限公司,曾任固定收益部信用研究员。

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,债券市场整体表现突出。伴随着4-5月份经济数据的持续低迷,以及定向降准、再贷款、存贷比口径调整等微刺激、稳增长政策的持续出台,市场在4月下旬开始呈现牛市氛围,利率债、高等级信用债、城投债、高收益债、转债各类资产轮番表现。二季度,本基金减仓利率债、适度加仓中长久期信用债、止盈部分阶段获利较好的可转债品种,较好地把握了各类资产轮动的节奏,净值表现有所恢复。随着稳增长和货币政策的微调,市场对信用风险担忧有所下降,二季度高收益债的表现超出我们的预期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2010年9月8日正式成立。截止2014年6月30日,本基金份额净值为1.0600元,累计份额净值为1.1310元。报告期,本基金本季度净值增长率为4.85%,同期业绩比较基准收益率为2.94%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在定向政策发力的带动下,经济数据短期已经有所好转,展望下半年,在外需复苏拉动出口、政府加快财政支出进度以及基建投资增速加快的情况下,能够一定程度上对冲房地产市场销售和投资的低迷,经济有望企稳小幅回升。资金层面,定向降准将推动信用扩张,广义流动性将有所回升,贷款、非标等资产可能分流货币市场资金,下半年银行间资金面宽松局面或略有收紧,但货币政策基调仍偏松,下半年资金面仍有望维持相对宽松。

在经济回暖的背景下,短期市场情绪仍有不同风险资产进一步表现。利率债短期利好出尽,预计将继续震荡整理;下半年信用债的资本利得空间已经相对有限,预计将以票息收益为主。策略上本基金将继续以持有中高等级信用债为主,转债部分波段操作以获取超额收益。

本基金将在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,稳健地做好配置策略,均衡投资,降低业绩波动,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

§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	56,826,882.98	5.68
	其中:股票	56,826,882.98	5.68
2	固定收益投资	868,907,825.11	86.90
	其中:债券	868,907,825.11	86.90
	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	37,210,005.76	3.72
6	其他资产	36,924,631.61	3.69
7	合计	999,869,345.46	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	9,046,500.00	1.61
C	制造业	47,780,382.98	8.52
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	-	-
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	-	-
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	-	-
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	56,826,882.98	10.14

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	600085	同仁堂	973,096	16,961,063.28	3.03
2	601989	XD中国重	3,300,000	15,906,000.00	2.84
3	002683	宏大爆破	370,000	9,046,500.00	1.61
4	600422	昆明制药	394,970	8,298,319.70	1.48
5	600143	金发科技	1,500,000	6,615,000.00	1.18

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	30,000,000.00	5.35
	其中:政策性金融债	30,000,000.00	5.35
4	企业债券	655,514,141.95	116.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,847,000.00	1.76
7	可转债	173,546,683.16	30.96
8	其他	-	-
9	合计	868,907,825.11	155.02

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	1380269	13哈高新债	500,000	51,320,000.00	9.16
2	122618	12统众债	500,000	50,750,000.00	9.05
3	113003	重工转债	431,030	48,947,766.80	8.73
4	122867	11石城投	359,990	36,358,990.00	6.49
5	122200	12晋兰花	340,000	33,762,000.00	6.02

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国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 石化转债的发行主体中国石油化工股份有限公司(以下简称"中国石化")于2014年1月12日发布《中国石油化工股份有限公司公告》,公告称2013年11月22日凌晨,中国石化位于青岛经济技术开发区的东黄复线原油管道发生破裂,导致原油泄漏,部分原油漏入市政排水渠道;当日上午市政排水渠道发生爆炸,导致周边行人、居民、捡拾人员伤亡的重大事故。国务院于近日将该起"山东省青岛市11?22中石化东黄输油管道泄漏爆炸"事故认定为一起特别重大责任事故,并对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

本基金投资于"石化转债(110015)"的决策程序说明:基于石化转债基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于"石化转债"债券,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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	36,221.57
2	应收证券清算款	20,019,753.55
3	应收股利	-
4	应收利息	16,839,315.13
5	应收申购款	1,488.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	27,852.67
8	其他	-
9	合计	36,924,631.61

5.9.4 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	113003	重工转债	48,947,766.80	8.73
2	113005	平安转债	32,963,583.80	5.88
3	110012	海运转债	24,282,699.00	4.33
4	110024	隧道转债	21,580,000.00	3.85
5	110018	国电转债	17,463,602.40	3.12
6	110015	石化转债	17,324,866.20	3.09
7	110022	同仁转债	6,290,900.00	1.12
8	127001	海直转债	2,496,132.80	0.45
9	128001	泰尔转债	1,268,981.16	0.23
10	110019	恒丰转债	928,151.00	0.17

5.9.5 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。

5.9.6 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	674,014,129.43
报告期期间基金总申购份额	35,823.52
减:报告期期间基金总赎回份额	145,326,883.12
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	528,723,069.83

§7 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、华富强化回报债券型证券投资基金基金合同

2、华富强化回报债券型证券投资基金托管协议

3、华富强化回报债券型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富强化回报债券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。

华富竞争力优选混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年7月19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2014年7月18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2014年4月1日至2014年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富竞争力优选混合
基金主代码	410001
交易代码	410001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年3月2日
报告期末基金份额总额	1,683,598,220.64份
投资目标	本基金采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略,对基金投资风险的控制遵循"事前防范、事中控制、事后评估"的风险控制程序,运用华富PMC选股系统,力求实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在资产配置方面,采用自上而下的方法,确定各类资产的权重;在行业及股票选择方面,利用自身开发的"华富PMC选股系统"进行行业及股票综合筛选;在债券选择方面,通过研究宏观经济、国家政策及收益率曲线,积极调整债券组合的久期结构。
业绩比较基准	60%×中信标普300指数+35%×中信标普全债指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金属于中等风险的混合型基金,其风险收益特征从长期平均来看,介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间。基金管理人通过适度主动的资产配置与积极主动的精选证券,实现风险限度内的合理回报。
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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-45,945,656.18
2.本期利润	6,903,857.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0039
4.期末基金资产净值	1,063,135,961.77
5.期末基金份额净值	0.6315

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。

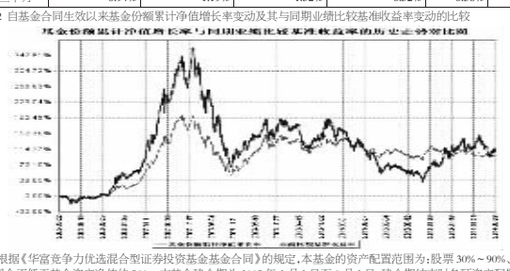
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.94%	1.19%	1.52%	0.52%	-0.58%	0.67%

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《华富竞争力优选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30%~90%、债券5%~65%、现金不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2005年3月2日至9月2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《华富竞争力优选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	华富竞争力优选混合型基金基金经理、华富成长趋势股票型基金基金经理、华富恒鑫债券型基金基金经理、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	-	十年	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。

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

2014年二季度经济受益于制造业PMI企稳向好,与制造业相关的生产性服务业回升明显,消费淡季使得消费类服务业有所回调,建筑业高位趋缓,仍然相对稳定,房地产偏淡低迷。总体来言,为企业"松绑"、"减负"、增活力等局部微刺激政策效应有所体现。A股二季度上证上涨了0.74%,深成指上涨2.14%,创业板指先下跌后上涨5.79%。本基金季初以来,在经济增速下行风险预期加大后,仓位方面略作下降,减持了部分高估的TMT行业板块的个股,增持了工业智能、新能源、医疗服务、石油石化、军工等相关行业板块,市场的表现和预计相对一致,但由于整体仓位高于同类平均水平,因此二季度基金净值表现居于中游。根据我们的观测,市场上涨的主基调仍是企业创新和变革的预期驱动,但相比2013年把握绝对收益机会的难度大幅增加,投资机会主要表现为对企业商业模式革新和个股业绩超预期增长带来的股价持续上涨的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2005年3月2日正式成立。截止2014年6月30日,本基金份额净值为0.6315元,累计份额净值为1.8973元。报告期,本基金份额净值增长率为0.94%,同期业绩比较基准收益率为1.52%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度统计局PMI和汇丰PMI双双回暖,源于内需企稳和外需复苏的双重影响。国内稳增长措施效果逐步显现,部分对冲了房地产投资下滑,内需有所企稳。而年初以来外需温和复苏,对出口也有所提振。需求企稳背景下,产成品库存去化加速,企业可能正在加快生产,同时适时补充原材料库存。

从海外看二季度美国非农就业增长水平看,尽管美就业改善超预期,但估计美央行仍然没有必要立即开始收紧政策。目前美国就业数据仍没到经济过热阶段,离美国央行设定的阈值还有一段距离,当前仍然是享受经济复苏所带来信心增长、流动性增长、资产价格强势的蜜月期。

三季度我们对政策微刺激的强度仍需持续跟踪,预期三季度流动性维持相对宽松,结构型机会可能会层出不穷。中长期来看,未来本基金仍将主要关注"一条主线+两个飞翼"上的投资机会——即自下而上的"新兴产业经济转型"+自上而下的"改革+安全"。如果说以固定资产投资加上入WTO后外贸快速增长实现了中国经济"原始积累"是过去10年中国资本市场演绎的主线,那么经济转型就是未来10年的主线。另外,"十八大"关于安全和改革的顶层设计也将为未来制度红利的持续释放奠定了坚实的基础,这些都是中国经济更稳健、更健康的发展所必需的断动力来源。不分市值大小、不论行业所属、均衡配置、有安全边际的成长性投资将是本基金追求的基本理念,具体展开,本基金成长类行业将重点选择传媒、环保、新能源、计算机等进行配置;主题类机会上重点关注诸如上地改革、国企改革、国防军工等进行配置。

§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	891,018,148.52	83.37
	其中:股票	891,018,148.52	83.37
2	固定收益投资	55,373,200.00	5.18
	其中:债券	55,373,200.00	5.18
	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	120,780,298.48	11.30
6	其他资产	1,572,040.95	0.15
7	合计	1,068,743,687.95	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	29,538,668.80	2.78
C	制造业	378,426,044.43	35.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,555,055.48	0.52
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	79,042,391.91	7.43
G	交通运输、仓储和邮政业	28,910,000.00	2.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	239,693,806.06	22.55
J	金融业	26,592,181.84	2.50
K	房地产业	39,508,000.00	3.72
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	32,656,000.00	3.07
R	文化、体育和娱乐业	31,096,000.00	2.92
S	综合	-	-
	合计	891,018,148.52	83.81

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	300104	乐视网	1,975,000	86,702,500.00	8.16
2	600387	海越股份	3,846,665	58,007,708.20	5.46
3	600416	湘电股份	6,008,370	57,500,100.90	5.41
4	002018	华星化工	6,608,816	56,042,759.68	5.27
5	002439	启明星辰	2,399,768	51,331,037.52	4.83
6	300226	上海钢联	1,300,000	48,412,000.00	4.55
7	000590	紫光古汉	2,584,618	36,804,960.32	3.46
8	300145	南方泵业	1,800,000	33,984,000.00	3.20
9	600763	通策医疗	800,000	32,656,000.00	3.07
10	300024	机器人	1,100,053	32,341,558.20	3.04

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	40,000,000.00	3.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	15,373,200.00	1.45
8	其他	-	-
9	合计	55,373,200.00	5.21

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	122288	13东吴债	400,000	40,000,000.00	3.76
2	113003	重工转债	70,000	7,949,200.00	0.75
3	110023	民生转债	80,000	7,424,000.00	0.70

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:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

紫光古汉(000590)于2013年7月25日发布《关于收到深圳证券交易所处分决定的公告》,公告称紫光古汉于2013年7月24日收到深圳证券交易所下发的《关于对紫光古汉集团股份有限公司及相关当事人给予处分的决定》(深证上[2013]233号),因紫光古汉2005年至2008年年度报告会计信息存在虚假记载、且未如实披露《合资协议之补充协议》签订并实际执行相关情况,深圳证券交易所决定对紫光古汉给予公开谴责的处分。

本基金投资于"紫光古汉(000590)"的决策程序说明:基于紫光古汉基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于"紫光古汉"股票,其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

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	295,322.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,259,090.40
5	应收申购款	17,627.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,572,040.95

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	113003	重工转债	7,949,200.00	0.75
2	110023	民生转债	7,424,000.00	0.70

5.10.5 报告期末前十名股票中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未存在流通受限情况。

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	1,863,845,900.42
报告期期间基金总申购份额	25,114,981.54
减:报告期期间基金总赎回份额	205,362,661.32
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	1,683,598,220.64

§7 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、华富竞争力优选混合型证券投资基金基金合同

2、华富竞争力优选混合型证券投资基金托管协议

3、华富竞争力优选混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富竞争力优选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。

华富量子生命力股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19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。

基金托管人平安银行股份有限公司据本基金合同规定,于2014年7月18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2014年4月1日至2014年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富量子生命力股票
基金主代码	410009
交易代码	410009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月1日
报告期末基金份额总额	69,400,641.57份
投资目标	本基金主要采用数量化投资方法,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金从市场估值的驱动因素出发进行资产配置,通过寻找与市场走势相关性最大的因子组合,构建市场趋势预测模型,对市场未来1-3个月整体估值水平进行预测,实现基金在股票、债券及现金之间的合理配置。本基金采用自下而上的选股策略,实行组合个股精选以及行业权重优化的全程数量化投资模式,主要投资于综合资质优良、价值相对低估,能为股东创造持续稳健回报的公司。选股模型严格遵循"价值投资"理念,围绕价值和价格两大因素,通过公司资质和估值情绪双层筛选机制,逐级筛选股票,并最终确定股票投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。一般情况下,其预期风险和预期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	平安银行股份有限公司

§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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,311,345.82
2.