华富量子生命力股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人平安银行股份有限公司据本基金合同规定,于2014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2014年7月1日至2014年9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	63,289,711.70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7月1日 — 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	1,687,092.90
2.本期利润	8,186,122.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.1233
4.期末基金资产净值	54,321,069.35
5.期末基金份额净值	0.8583

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	17.25%	1.10%	10.23%	0.67%	7.02%	0.43%

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《华富量子生命力股票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为60%-95%,债券、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0%-40%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,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2011年4月1日到2011年10月1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《华富量子生命力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		
朱蓉	华富量子生命力股票型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理	2011年4月1日	-	七年	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。
孔庆卿	华富量子生命力股票型基金基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理	2013年8月30日	-	五年	英国曼彻斯特大学统计学博士,博士研究生学历,2009年8月进入华富基金管理有限公司,曾任金融工程研究员,华富中小板指数增强型基金基金经理助理、华富中证100指数基金基金经理助理。

注:朱蓉的任职日期指该基金成立之日,孔庆卿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》,对证券的一级市场中购、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

9月中国制造业采购经理指数(PMI)为51.1,与上月持平。从微观数据看,钢铁、水泥价格仍无起色,房地产销售增速仍在下滑。综合来看,内需仍在萎缩,并无好转表现。相比之下,外需的改善更加符合实际,中采和汇丰PMI新出口订单指数皆回升。2014年3季度沪深300指数上涨13.20%,创业板指数上涨9.69%。表现最好的三个行业为国防军工、农林牧渔、纺织服装,表现最差的三个行业为银行、家电、传媒。

3季度,量子生命力在符合量化模型的基础上,对医药、机械、国防军工等板块做了一定的主动投资。操作中,我们遵循量化投资理念,加强了对成长股的研究,不断优化夜间的投资组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2011年4月1日正式成立。截止2014年9月30日,本基金份额净值为0.8583元,累计份额净值为0.8583元。报告期,本基金份额净值增长率为17.25%,同期业绩比较基准收益率为10.23%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

9月官方PMI指数与上月持平,对外贸易增速超出市场预期,进出口总值同比增长11.3%,其中出口同比增长15.3%,进口同比增长7.0%。外需好转或对经济略有支撑,但难以弥补内需的持续萎缩。9月30日央行推出的救房市政策力度空前,利好地产和经济,短期缓解经济失速风险,提升风险偏好;四中全会已确定于10月20日-23日召开,改革正在提速,预计四中全会将为改革提供坚实的政治保障,因此托底式的宽松或将延续。价格指数继续下跌,继续去库存的压力仍在,经济或在弱稳定区间运行,继续关注业绩稳定成长且估值相对较低的白马股,以及以政府为主导的相关主题板块,如铁路投资、棚户区改造、国企改革等,此外仍需关注国防安全、信息安全相关的行业及个股。

§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	50,558,191.92	92.06
	其中:股票	50,558,191.92	92.06
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	-	-
	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	4,064,935.89	7.40
7	其他资产	293,138.34	0.53
8	合计	54,916,266.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	898,048.34	1.65
B	采矿业	653,400.00	1.20
C	制造业	28,248,025.04	52.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,939,780.00	3.57
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,627,800.00	4.84
G	交通运输、仓储和邮政业	1,058,945.80	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,060,393.00	22.20
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,080,000.00	1.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	801,104.22	1.47
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	1,190,695.52	2.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	50,558,191.92	93.07

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	300183	东软载波	30,000	1,580,700.00	2.91
2	600845	宝信软件	40,000	1,511,600.00	2.78
3	600416	湘电股份	119,968	1,511,596.80	2.78
4	300299	富春通信	105,000	1,470,000.00	2.71
5	002425	凯撒股份	100,000	1,422,000.00	2.62
6	600298	安琪酵母	70,000	1,332,100.00	2.45
7	300199	翰宇药业	40,000	1,254,400.00	2.31
8	300150	世纪瑞尔	70,000	1,208,200.00	2.22
9	300347	泰格医药	34,928	1,190,695.52	2.19
10	600886	国投电力	170,000	1,178,100.00	2.17

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:本基金本报告期内未投资股指期货

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货

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	269,312.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,517.81
5	应收申购款	22,308.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	293,138.34

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	600845	宝信软件	1,511,600.00	2.78	重大事项停牌
2	300299	富春通信	1,470,000.00	2.71	重大事项停牌
3	300183	东软载波	1,580,700.00	2.91	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	69,400,641.57
报告期期间基金总申购份额	892,217.63
减:报告期期间基金总赎回份额	7,003,147.50
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	63,289,711.70

§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

报告期期初基金份额总额	10,007,750.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末基金管理人持有的本基金份额	10,007,750.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	15.81

注:关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定,符合公允性要求,申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

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、华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同

2、华富量子生命力股票型证券投资基金托管协议

3、华富量子生命力股票型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富量子生命力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。

华富强化回报债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014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2014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2014年7月1日至2014年9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	201,840,920.31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7月1日 — 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	6,596,520.39
2.本期利润	30,190,444.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0908
4.期末基金资产净值	234,285,363.52
5.期末基金份额净值	1.161

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	9.53%	0.29%	1.56%	0.06%	7.97%	0.23%

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》,对证券的一级市场中购、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

三季度,债券市场整体仍然维持慢牛走势。7月份在基本面预期好转及资金面偏紧的情况下,债市出现短期调整。但随着8月份高频数据和宏观数据不及预期、央行定向投放5000亿元SLF和连续两次14天正回购利率的下调、银行存款偏离度考核等利好因素的刺激,资金利率大幅回落,利率债、信用债收益率均持续下行,而受益于改革预期、资金利率下降等因素影响,市场风险偏好不断提升,股票、可转债等风险资产表现突出。本基金在三季度仍以中高等级城投债为主,看重票息收益,同时对获利较好的部分可转债品种继续止盈,存量股票部分小幅止盈,较好地把握了三季度风险资产上涨的机会。

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9月30日,本基金份额净值为1.1610元,累计份额净值为1.232元。报告期,本基金本季度净值增长率为9.53%,同期业绩比较基准收益率为1.56%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受制于实体经济融资需求偏弱、银行低迷的放贷、制造业、基建和房地产投资的投资增速全面下行,虽然近期取消限购、房贷政策调整等房地产政策陆续出台,但短期经济增长下行的压力依然较大。由于偏紧的货币条件以及偏弱的经济基本面,后续通胀的压力仍然有限。

资金面来看,5000亿元定向SLF和正回购利率的持续下调引导资金利率下行的目标明确,四季度央行货币政策仍将维持适度宽松,银行间资金面预期将维持宽松格局。

在经济基本面持续疲弱的背景下,债市整体风险仍然可控,但短期来看利率债收益率大幅下行和曲线过度平坦化,长端利率债不再具备优势,中短久期相对防御价值更大。信用债短期利率风险不大,信用基本面也较为稳定,但目前较低的利差空间可以将关注重心继续转向票息。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	40,614,440.76	9.64
	其中:股票	40,614,440.76	9.64
2	固定收益投资	348,863,479.14	82.81
	其中:债券	348,863,479.14	82.81
	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	17,453,118.56	4.14
7	其他资产	14,326,176.65	3.40
8	合计	421,257,215.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	11,107,055.76	4.74
C	制造业	29,507,385.00	12.59
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	40,614,440.76	17.34

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	601989	中国重工	2,800,000	18,368,000.00	7.84
2	002683	宏大爆破	348,402	11,107,055.76	4.74
3	600422	昆明制药	250,000	6,947,500.00	2.97
4	600085	同仁堂	220,000	4,166,800.00	1.78
5	603306	华懋科技	1,000	21,050.00	0.01
6	002730	电光科技	500	4,035.00	0.00

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	19,866,000.00	8.48
	其中:政策性金融债	19,866,000.00	8.48
4	企业债券	290,033,703.90	123.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,886,000.00	4.22
7	可转债	29,077,775.24	12.41
8	其他	-	-
9	合计	348,863,479.14	148.91

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	1380338	13金利源债	200,000	20,872,000.00	8.91
2	1480303	14蔡家湖债	200,000	20,740,000.00	8.85
3	1480370	14神木债	200,000	20,616,000.00	8.80
4	122618	12纯众债	200,000	20,580,000.00	8.78
5	122572	12蓉投控	199,990	20,318,984.00	8.67

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

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	47,715.49
2	应收证券清算款	6,194,795.66
3	应收股利	-
4	应收利息	8,057,040.46
5	应收申购款	12,698.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	13,926.63
8	其他	-
9	合计	14,326,176.65

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	113005	平安转债	15,872,439.00	6.77
2	110012	海运转债	4,483,600.00	1.91

5.10.5 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	002730	电光科技	4,035.00	0.00	新股锁定

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	528,723,069.83
报告期期间基金总申购份额	1,847,334.10
减:报告期期间基金总赎回份额	328,729,483.62
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	201,840,920.31

§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。

华富中证100指数证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30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	145,901,848.80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绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%和年跟踪误差不超过4%,以实现对中证100指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,本基金的标的指数为中证100指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略,即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,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	交通银行股份有限公司

§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7月1日 — 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,657,650.99
2.本期利润	10,502,459.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0698
4.期末基金资产净值	102,227,388.75
5.期末基金份额净值	0.7007

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	10.99%	0.90%	9.83%	0.90%	1.16%	0.00%

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:根据基金合同的规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证100指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的90%~95%,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2009年12月30日至2010年6月30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《华富中证100指数证券投资基金基金合同》的相关规定。

§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		
朱蓉	华富中证100指数基金基金经理、华富量子生命力股票型基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理	2012年12月19日	-	七年	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