景顺长城景丰货币市场基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31日

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月22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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月21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2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城景丰货币	
场内简称	-	
基金主代码	000701	
交易代码	000701	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月16日	
报告期末基金份额总额	2,606,041,828.87份	
投资目标	本基金在保持基金资产安全性和高流动性的基础上,通过运用各种投资工具及投资策略,力争获取高于上绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金根据对短期利率变动的合理预判,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,综合分析宏观经济指标,包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等,对短期利率走势进行综合判断,同时分析央行公开市场操作、上流资金的短期投资偏好、债券供给、货币市场与资本市场资金互动等,并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。预期市场利率水平上升,适度缩短投资组合的平均剩余期限,以降低组合下跌风险;预期市场利率水平下降,适度延长投资组合的平均剩余期限,以分享债券价格上升的收益。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城景丰货币A	景顺长城景丰货币B
下属分级基金的交易代码	000701	000707
报告期末下属分级基金的份额总额	206,463.85份	2,605,835,365.02份

§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10月1日 - 2014年12月31日）	
	景顺长城景丰货币A	景顺长城景丰货币B
1. 本期已实现收益	2,880.59	11,322,959.33
2.本期利润	2,880.59	11,322,959.33
3.期末基金资产净值	206,463.85	2,605,835,365.02

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、上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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景丰货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0447%	0.0037%	0.3403%	0.0000%	0.7044%	0.0037%

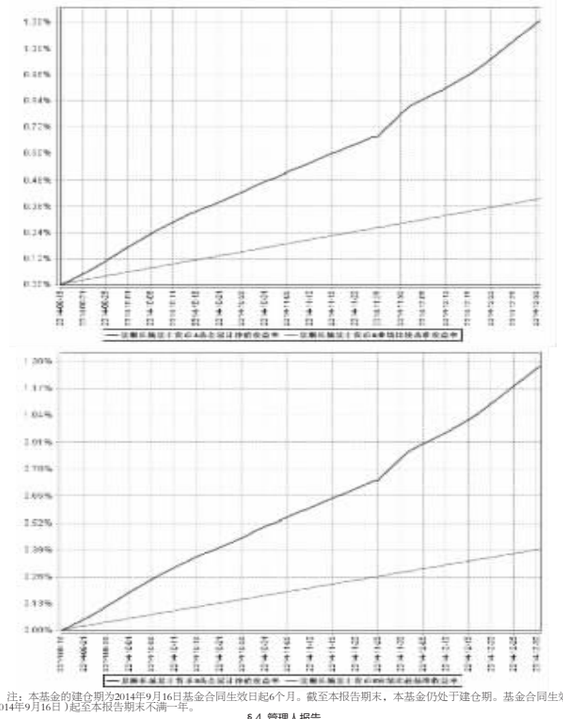
注:本基金的收益分配为每日分配,按月结转份额。

景顺长城景丰货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1065%	0.0037%	0.3403%	0.0000%	0.7662%	0.0037%

注:本基金的收益分配为每日分配,按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的建仓期为2014年9月16日基金合同生效日起6个月。截至本报告期末,本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2014年9月16日）起至本报告期末不满一年。

§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		
毛从容	景顺长城景颐双利债券型基金、景益货币市场基金、鑫月薪定期支付债券型基金、景丰货币市场基金基金经理、景系列基金基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城货币市场基金）,固定收益部投资总监	2014年9月16日	-	14	经济学硕士,曾任职于交通银行、长城证券金融研究所,着重于宏观和债券市场的研究,并担任金融研究所债券业务小组组长。2003年3月加入本公司,担任研究员等职务;自2005年6月起担任基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）;对此后的非首任基金经理,“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期,“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）;

2、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。

3、毛从容女士于2014年12月26日离任景顺长城景益货币市场基金基金经理。

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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城景丰货币市场基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4季度以来,经济基本面仍然疲弱,工业增加值和固定资产投资增速继续下滑,唯有消费增速略有改善;CPI和PPI显示通缩压力,虽然短期有地产销售回暖带来的经济改善预期,但地产周期的回落趋势难于撼动,在地方政府融资平台清理整顿的大背景下,明年政府投资托底经济存在不确定性。在此背景下债券市场大幅波动,先在货币政策宽松降息预期推动下市场加速上涨,受新股因素扰动,资金面季节性紧张、货币政策有些透支、股市火爆分流债市资金,特别是中证登提高企业债回购门槛和地方债甄别大限临近引发债券市场大幅调整,收益率一度快速上行超过100BP,AA级投债波动区间在5.0-7.0%,年底债券市场出现企稳迹象,4季度货币市场层面也波动加大,整体收益率水平也明显抬升,交易所7天回购均值5%附近,年底一个月国业存款利率上升至7%以上。

虽然经济基本面偏弱,收益率先快速下行有些透支后反弹,本基金4季度明显压低久期,短融的吸引力下降,增加回购和存款的投资比例,在新股的周期性发行中寻找利率的高点进行再投资。

中期来看,中国经济潜在增速中枢下移,结构性问题突出已达成共识,以往地产和基建拉动的投资驱动模式已经不可持续,转型方向是以创新投资为主的新型模式。在新常态下,实体经济和地产投资在未来几年可能是处在逐步收缩的状态,实体经济对资币的需求也会比过去要收缩不少,过去以财政扶持、银行贷款、影子银行输血实体经济,未来以资产证券化等市场化方式解决融资问题,也是实体经济提升效率、加杠杆的资源重新有效配置过程。实体企业对利率变化开始敏感,盈利增速下滑使得实体企业无法接受高利率的资金成本,降低社会融资成本存在必要性。目前国家实施“一路一带”走出去战略,这是中国输出产能、输出生产力的途径,试图从亚洲基础设施一体化逐步到亚洲经济一体化,甚至到未来亚洲货币的一体化,要求人民币汇率需保持相对强势的走势,这些都需要低利率的市场环境。

短期货币政策正从宽货币向宽信贷转化,宽信贷的边际变化对债市可能不利。但实体企业融资需求较弱,且社会融资成本依然较高,央行货币政策仍将以宽松为主,降息甚至降准的可能性仍然较大。资金面,虽然新股IPO等因素有扰动,整体1季度资金面相对宽松。

展望2015年第1季度的债券市场,基本面和政策面决定债券市场方向未变,利率仍处下行周期,信用债面临分化,关注新股发行、央行公开市场操作和时点性的投资机会。

本基金将坚持一贯以来的稳健操作风格,强化投资风险控制,密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况。前期受资金面紧张及城投债价值重估影响,短期品种和信用产品调整幅度尤为突出,1季度资金面有望回归平稳,短期品种和信用产品的交易性机会也更为确定。策略上保持适度久期,根据客户资金流的变化,把握新股发行节奏带来的时点机会,重点配置回购和同业存款,持续保持对组合的信用风险和流动性风险的关注,努力为投资人创造安全稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年4季度,景丰货币A净值收益率为1.0447%,高于业绩比较基准收益率0.7044%;景丰货币B净值收益率为1.1065%,高于业绩比较基准收益率0.7662%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	固定收益投资	210,602,623.00	8.06
	其中:债券	210,602,623.00	8.06
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,093,802,090.70	41.87
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,286,393,461.90	49.24
4	其他资产	21,651,468.75	0.83
5	合计	2,612,449,644.35	100.00

注:银行存款和结算备付金中包含定期存款1,265,000,000.00元。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	0.00
	其中:买断式回购融资	0.00
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	38
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内,本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	54.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	28.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	2.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天（含）	1.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.80	-

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	摊余成本（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	120,084,551.18	4.61
	其中:政策性金融债	120,084,551.18	4.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,518,071.82	3.47
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	210,602,623.00	8.08
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本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	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	140204	14国开04	550,000	54,987,993.05	2.11
2	140410	14农发10	500,000	50,074,040.91	1.92
3	041469029	14丰台国资CP001	200,000	20,157,383.50	0.77
4	041454038	14恒远CP001	200,000	20,127,170.49	0.77
5	041464045	14岱海CP001	200,000	20,105,032.23	0.77
6	041452043	14红豆CP002	100,000	10,063,265.77	0.39
7	041469047	14顺鑫CP002	100,000	10,057,139.43	0.39
8	011499041	14徐工SCP002	100,000	10,008,080.40	0.38
9	140213	14国开13	100,000	10,007,432.74	0.38
10	140207	14国开07	50,000	5,015,084.48	0.19

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0653%
报告期内偏离度的最低值	-0.0442%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0190%

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值为1.0000元。

5.8.2 本报告期内,本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,也不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	10,009,997.22
3	应收利息	11,641,471.53
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,651,468.75

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	景顺长城景丰货币A	景顺长城景丰货币B
报告期期初基金份额总额	447,036.01	305,813,591.11
报告期期间基金总申购份额	303,225.96	2,310,841,536.54
减:报告期期间基金总赎回份额	543,798.12	10,819,762.63
报告期期末基金份额总额	206,463.85	2,605,835,365.02

注:总申购份额含红利在投资份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准景顺长城景丰货币市场基金设立的文件;

2、《景顺长城景丰货币市场基金基金合同》;

3、《景顺长城景丰货币市场基金招募说明书》;

4、《景顺长城景丰货币市场基金托管协议》;

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2015年1月22日

华富中小板指数增强型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年1月22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2015年1月21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10月1日至2014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	9,659,701.13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（2014年10月1日 - 2014年12月31日）
1.本期已实现收益	3,438,171.36
2.本期利润	-197,456.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0147
4.期末基金资产净值	11,954,139.56
5.期末基金份额净值	1.238

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	1.73%	1.31%	-2.19%	1.25%	3.92%	0.06%

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		
朱蕾	华富中小板指数增强型基金基金经理、华富量子生命力股票型基金基金经理。华富中证100指数基金基金经理	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。

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4.4 运作分析

四季度延续了三季度以来的牛市行情,印证了我们之前对市场的乐观判断。金融股一枝独秀,带领市场指数频创今年以来新高。四季度沪深300指数上涨44.2%,表现较好的三个行业分别为非银金融、建筑装饰、银行,表现最差的三个行业为电子、轻工制造、休闲服务。

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2014年12月31日,本基金份额净值为1.2380元,累计份额净值为1.2380元。报告期,本基金份额净值增长率为1.73%,同期业绩比较基准收益率为-2.19%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来,在宽松的货币条件和宏观经济企稳预期下,股市吸引力逐渐提升,再加上“赚钱效应”逐步吸引增量资金,“存量资金博弈格局”的逐步打破提升市场风险偏好而降低股权风险溢价的“阀值”,蓝筹股的吸引力提升,同时在经济完全恢复前,题材与新兴行业成长股也容易成为投资热点。

整体而言,行业配置上,从大蓝筹角度关注券商、保险、银行、公用事业;从高成长角度关注国防军工、计算机、传媒;从新型消费兴起角度关注互联网信息消费、体育、医药健康、节能环保;从行业集中度加速提升角度关注农林牧渔。从主题角度特别关注“十三五”相对“十二五”有变化的细分领域,特别是国企改革、迪斯尼领域等。

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（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（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	10,879,595.87	84.94
	其中:股票	10,879,595.87	84.94
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	1,000,000.00	7.81
	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	716,398.23	5.59
7	其他资产	213,177.80	1.66
8	合计	12,809,171.90	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	175,114.90	1.46
B	采矿业	94,726.24	0.79
C	制造业	6,707,545.82	56.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	456,519.23	3.82
F	批发和零售业	592,335.80	4.96
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	862,121.49	7.21
J	金融业	594,619.08	4.97
K	房地产业	120,897.66	1.01
L	租赁和商务服务业	378,520.18	3.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	87,496.48	0.73
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	10,069,896.88	84.24

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	200,299.00	1.68
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	609,399.99	5.10
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	809,698.99	6.77

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	50,831	457,479.00	3.83
2	002415	海康威视	15,528	347,361.36	2.91
3	002202	金风科技	19,560	276,382.80	2.31
4	002450	康得新	9,490	274,925.30	2.30
5	002304	洋河股份	3,301	260,944.05	2.18
6	002241	歌尔声学	9,337	229,036.61	1.92
7	002142	宁波银行	14,061	221,179.53	1.85
8	002594	比亚迪	5,556	211,961.40	1.77
9	002673	西部证券	5,299	198,447.55	1.66
10	002230	科大讯飞	6,905	184,018.25	1.54

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	600240	华业地产	61,001	609,399.99	5.10
2	002470	金正大	2,200	59,180.00	0.50
3	002179	中航光电	2,100	49,308.00	0.41
4	002603	以岭药业	1,600	46,656.00	0.39
5	002424	贵州百灵	1,100	45,155.00	0.38

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 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	22,910.47
2	应收证券清算款	156,785.95
3	应收股利	-
4	应收利息	231.93
5	应收申购款	33,249.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	213,177.80

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	600240	华业地产	609,399.99	5.10	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	25,520,659.15
报告期期间基金总申购份额	3,081,085.33
减:报告期期间基金总赎回份额	18,942,043.35
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	9,659,701.13

§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 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年1月22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2015年1月21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10月1日至2014年12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称