

华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金 2015 年度

第 4 季度报告

公告日期：2016-01-21

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金产品概况](#)

[基金基本情况](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[☑ 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](#)

[☑ 自基金合同生效以来基金累计份额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](#)

[其他指标](#)

[管理人报告](#)

[基金经理（或基金经理小组）简介](#)

[报告期内本基金运作遵规守信情况说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[☑ 公平交易专项说明](#)

[☑ 公平交易制度和控制方法](#)

[☑ 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较](#)

[☑ 异常交易行为的专项说明](#)

[报告期内基金的投资策略和业绩表现说明](#)

[☑ 报告期内基金的业绩表现](#)

[☑ 报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[☑ 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明](#)

[投资组合报告](#)

[报告期末基金资产组合情况](#)

[报告期末按行业分类的股票投资组合](#)

[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](#)

[报告期末按债券品种分类的债券投资组合](#)

[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](#)

[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贵金属投资明细](#)

[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](#)

[报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#)

[☑ 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细](#)

[☑ 本基金投资股指期货的投资政策](#)

- 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- ☐ 本期国债期货投资政策
- ☐ 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
- ☐ 本期国债期货投资评价
- 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
- 投资组合报告附注
- ☐ 受到调查以及处罚情况
- ☐ 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
- ☐ 其他资产构成
- ☐ 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
- ☐ 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- ☐ 投资组合报告附注的其他文字描述部分
- 开放式基金份额变动
- 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
- 基金管理人持有本基金份额变动情况
- 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
- 影响投资者决策的其他重要信息
- 备查文件目录

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 1 月 20 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 2015 年 10 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。

基金基本情况

项目 数值

基金简称 华富健康文娱灵活配置混合

场内简称 -

基金主代码 001563

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2015-08-04

报告期末基金份额总额 103,302,473.11

投资目标 本基金通过深入研究并积极投资于健康文娱主题相关的优质上市公司，精选个股，分享其发展和成长的机会，力求超额收益与长期资本增值。

投资策略 本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及健康文娱相关行业的发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

业绩比较基准 沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

基金管理人 华富基金管理有限公司

基金托管人 上海浦东发展银行股份有限公司

基金保证人 -

主要财务指标

单位：人民币元

项目 2015-10-01 至 2015-12-31(元)

本期已实现收益 17,380,599.36

本期利润 36,367,680.48

加权平均基金份额本期利润 0.2573

期末基金资产净值 125,227,340.31

期末基金份额净值 1.212

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。

基金净值表现

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	21.08%	1.71%	9.20%	0.84%	11.88%	0.87%

自基金合同生效以来基金累计份额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《华富健康文娱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：股票投资比例为基金资产的 0%-95%，投资于本基金合同界定的健康文娱主题相关证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法

规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2015 年 8 月 4 日到 2016 年 2 月 4 日。本报告期，本基金仍在建仓期内。

其他指标

单位：元

序号 其他指标 报告期（2015-10-01 至 2015-12-31）

序号 其他指标 报告期（2015-12-31）

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		

陈启明	华富健康文娱灵活配置混合型基金经理、华富价值增长混合型基金经理、华富竞争力优选混合基金基金经理，研究发展部副总监	2015-08-04	- 九年	复旦大学会计学硕士，本科学历，历任日盛嘉富证券上海代表处研究员、群益证券上海代表处研究员、中银国际证券产品经理，2010 年 2 月加入华富基金管理有限公司，任行业研究员、2013 年 3 月 1 日至 2014 年 9 月 25 日任成长趋势股票型基金基金经理助理。
-----	--	------------	------	--

高靖瑜	华富健康文娱灵活配置混合型基金经理、华富策略精选混合型基金经理	2015-08-04	- 十五年	复旦大学金融学硕士，本科学历。历任金鼎综合证券（维京）股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员，2007 年 7 月加入华富基金管理有限公司，任行业研究员，2013 年 3 月 1 日至 2014 年 12 月 14 日任华富价值增长混合型基金经理助理。
-----	---------------------------------	------------	-------	---

注：这里的任职日期指基金成立之日。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。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

公平交易专项说明

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。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

本基金于 2015 年 8 月 4 日正式成立。截止 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.212 元，累计份额净值为 1.212 元。报告期，本基金份额净值增长率为 21.08%，同期业绩比较基准收益率为 9.20%。

报告期内基金投资策略和运作分析

四季度沪深 300 指数累计上涨 16.49%，创业板指累计上涨 30.32%，市场延续 9 月的反弹趋势，创业板表现尤佳；从成交看，也是创业板聚集了大部分人气，环比成交略增，蓝筹板块成交萎缩。不过总体看四季度市场波段震荡加剧，题材和热点持续性较弱，市场缺乏主线和合力。

本基金四季度持仓中仍以健康与文娱这两大基金主题相关行业配置为主，重点配置行业包括生物医药、传媒、计算机、农业等，结构中更偏重成长股，较为受益。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年四季度中国经济名义 GDP 增速依然在下滑趋势中，先导指标 PMI 较为低迷，PPI 继续收缩，新开工投资、铁路货运量、用电量、工业利润等数据均体现出单边下跌迹象，所以在终端 CPI 上，即使 15 年一二线楼市回暖，但是依然无力提振通货膨胀率。人民币汇率在加入 SDR 后出现剧烈贬值，释放出央行需要维持区域主导货币的双向波动的市场化属性；另外，美联储 12 月加息开启新一轮利率上行周期，也给人民币汇率带来较大压力。

展望 2016 年，汇率压力、供给侧改革等，给货币端和经济端都带来一定压力，整体经济环境偏弱，市场风险偏好有所下降，我们后期投资将更侧重选择行业趋势以及公司业绩均向上的标的，希望通过时点的把握取得更好地收益。行业上还是更倾向于趋势向上的行业，供给侧出清带来的周期行业波段性机会也会重点关注。

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益类投资	112,604,121.66	88.99
	其中：股票	112,604,121.66	88.99
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	13,665,755.03	10.80
7	其他资产	267,536.97	0.21
8	合计	126,537,413.66	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

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	6,294,600.00	5.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	45,344,259.36	36.21
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	13,926,008.24	11.12
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	14,551,786.50	11.62
J	金融业	8,261,600.00	6.60
K	房地产业	4,433,600.00	3.54
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,263,000.00	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,459,077.04	1.96
R	文化、体育和娱乐业	11,882,440.52	9.49
S	综合	4,187,750.00	3.34
	合计	112,604,121.66	89.92

报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

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

金额单位：元

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	600420	现代制药	150,000	6,265,500.00	5.00
2	002439	启明星辰	167,000	5,344,000.00	4.27
3	300336	新文化	120,000	5,040,000.00	4.02
4	600276	恒瑞医药	100,000	4,912,000.00	3.92
5	002117	东港股份	100,000	4,602,000.00	3.67
6	601688	华泰证券	230,000	4,535,600.00	3.62
7	300007	汉威电子	130,000	4,446,000.00	3.55
8	600158	中体产业	170,000	4,433,600.00	3.54
9	002714	牧原股份	90,000	4,236,300.00	3.38
10	600701	工大高新	175,000	4,187,750.00	3.34

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

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（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

金额单位：元

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

(%)

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

金额单位：元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	-------	-------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

金额单位：元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
----	----	----------	---------	-----------	------

公允价值变动总额合计(元) -

股指期货投资本期收益(元) -

股指期货投资本期公允价值变动(元) -

本报告期末本基金无股指期货投资。

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
----	----	----------	---------	-----------	--------

公允价值变动总额合计(元) -

国债期货投资本期收益（元） -

国债期货投资本期公允价值变动(元) -

本基金本报告期内未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

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

单位：元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。
其他资产构成

单位：元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	74,603.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,671.84
5	应收申购款	184,261.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	267,536.97

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

单位：

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	600420	现代制药	6,265,500.00	5.00	长期停牌
2	300336	新文化	5,040,000.00	4.02	临时停牌

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。
开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目	数值
报告期期初基金份额总额	244,555,772.82
报告期期间基金总申购份额	13,024,511.23
报告期期间总赎回份额	154,277,810.94
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	103,302,473.11

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	份额总额(份)
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,600.00
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
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,002,600.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	9.68

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
合计			-		

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。
影响投资者决策的其他重要信息

-

备查文件目录

- 1、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富健康文娱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
存放地点

基金管理人、基金托管人处

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。