

华富保本混合型证券投资基金 2013 年年度 报告

2013 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2014 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2014 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2013 年 04 月 24 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
8.6 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.....	42
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	42
8.8 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.....	42

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
8.11 投资组合报告附注	43
§9 基金份额持有人信息.....	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
§10 开放式基金份额变动.....	44
§11 重大事件揭示.....	45
11.1 基金份额持有人大会决议	45
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
11.4 基金投资策略的改变	46
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
11.8 其他重大事件	47
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§13 备查文件目录.....	51
13.1 备查文件目录	51
13.2 存放地点	51
13.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富保本混合型证券投资基金
基金简称	华富保本混合
基金主代码	000028
交易代码	000028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 24 日
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
报告期末基金份额总额	356,563,751.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取恒定比例组合保险策略 CPPI (Constant Proportion Portfolio Insurance)，通过动态调整资产组合，在确保本金安全的前提下，力争实现保本周期内基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金遵循长期投资的基本原则，融合国际化的风险管理工具与本土化的价值投资实践，利用避险技术进行风险跨期管理，在此基础上，坚持以价值发现为核心的投资研究理念，寻找中国经济成长和资本市场发展过程中的中长期投资机遇，最大限度地追求本金安全与财富增值的动态平衡。
业绩比较基准	本基金在保本周期内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基金产品，属证券投资基金中的低风险品种。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	廖原
	联系电话	021-68886996	021-61618888
	电子邮箱	manzh@hffund.com	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95528

传真	021-68887997	021-63602540
注册地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	上海市中山东一路 12 号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	章宏韬	吉晓辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	杭州市西溪路 128 号新湖商务大厦 9 楼
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层
基金保证人	中海信达担保有限公司	北京市市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 3101

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013 年 4 月 24 日 (基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日	2012 年	2011 年
本期已实现收益	4,857,254.36	-	-
本期利润	-3,181,005.81	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0075	-	-
本期加权平均净值利润率	-0.75%	-	-
本期基金份额净值增长率	-1.10%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	-3,856,649.10	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0108	-	-

期末基金资产净值	352,707,102.67	-	-
期末基金份额净值	0.989	-	-
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-1.10%	-	-

注：1) 本基金合同生效未满一年。

2) 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。

3) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

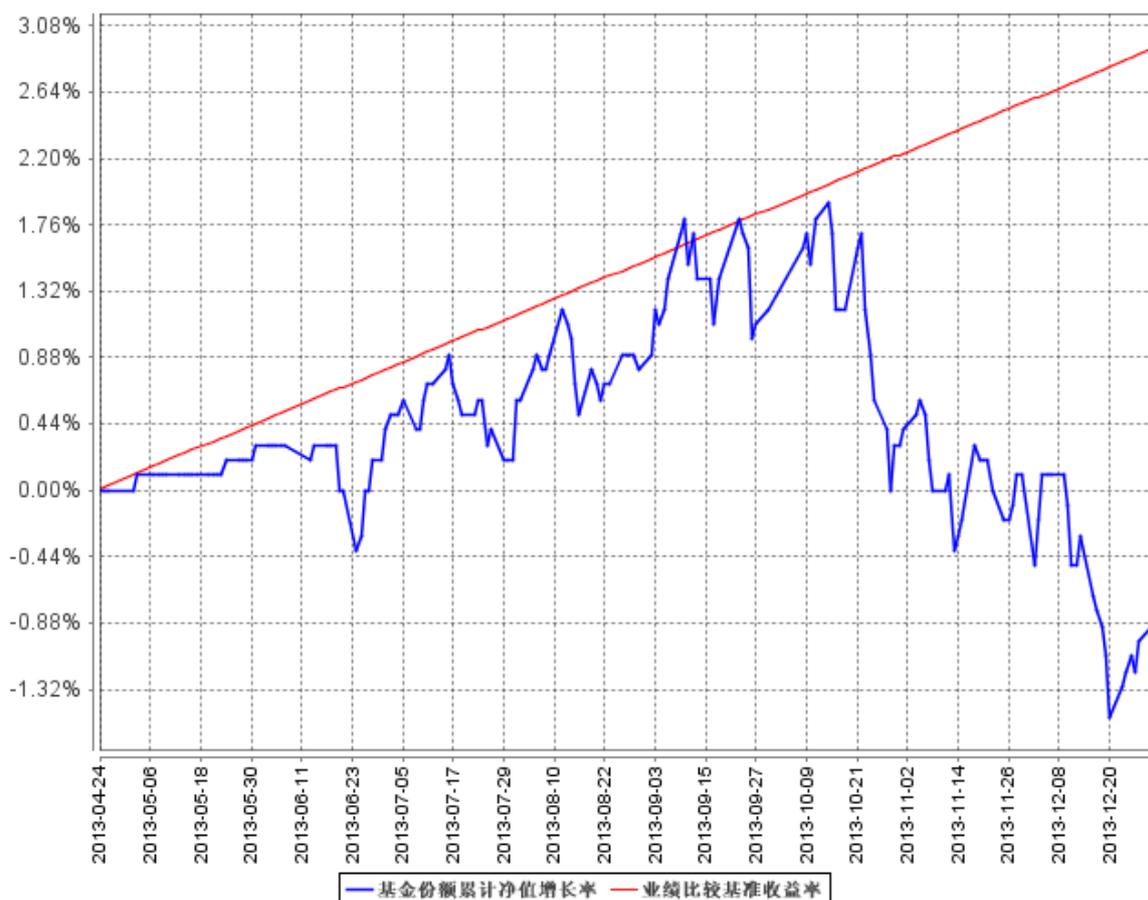
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-2.27%	0.24%	1.05%	0.01%	-3.32%	0.23%
过去六个月	-1.30%	0.22%	2.13%	0.01%	-3.43%	0.21%
自基金合同生效起至今	-1.10%	0.19%	2.93%	0.01%	-4.03%	0.18%

注：本基金在保本周期内的业绩比较基准=三年期银行定期存款税后收益率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

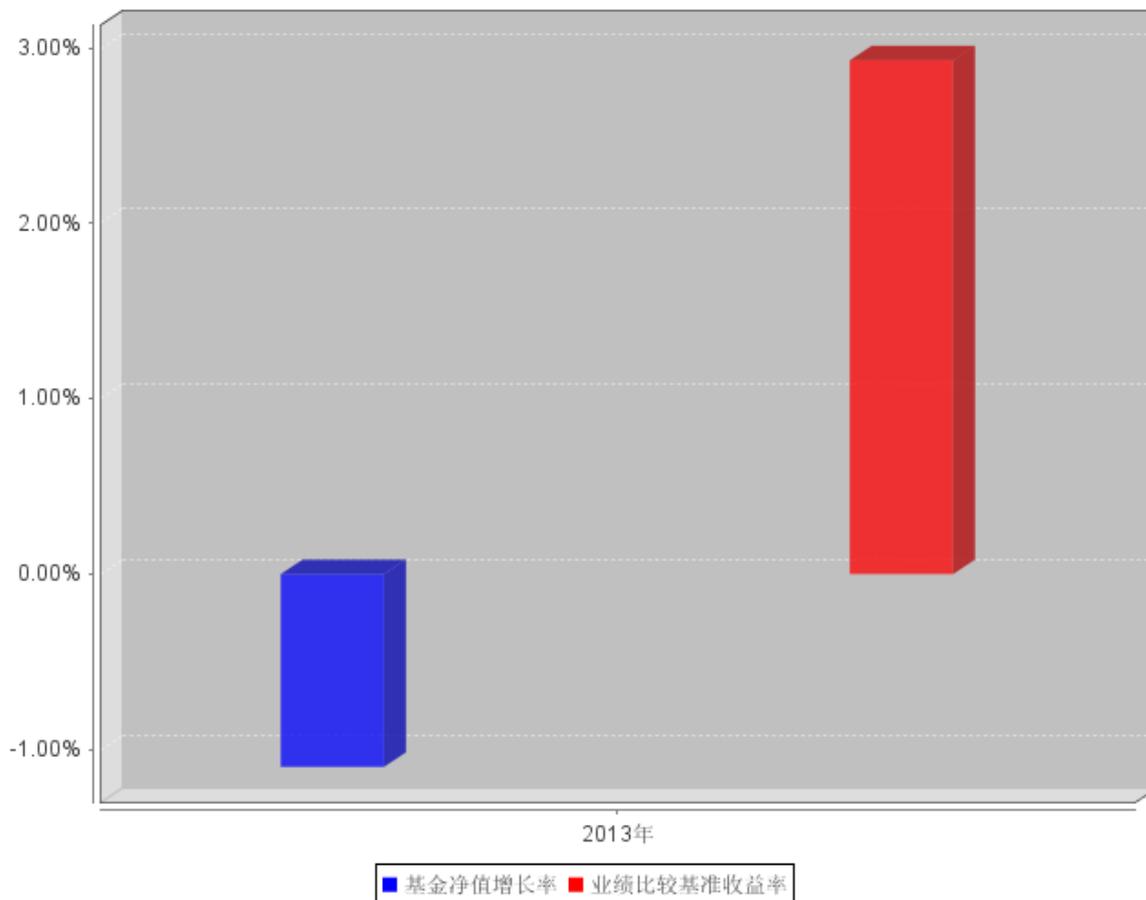
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富保本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、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或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%；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。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2013 年 4 月 24 日到 2013 年 10 月 24 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《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1) 上述比较期间为 2013 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日。

2) 按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2013年度	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号

文核准开业，4月19日在上海正式注册成立，注册资本1.2亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰控股集团有限公司。截止2013年12月31日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富恒鑫债券型证券投资基金十二只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡伟	华富保本混合型基金经理、华富货币市场基金基金经理、华富收益增强债券型基金经理、华富恒鑫债券型基金基金经理、公司投资决策委员会成员、固定收益部总监	2013年4月24日	-	九年	中南财经政法大学经济学学士、本科学历，曾任珠海市商业银行资金营运部交易员，从事债券研究及债券交易工作，2006年11月加入华富基金管理有限公司，曾任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理，固定收益部副总监。

注：这里的任职日期指该基金成立之日。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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体

控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年中国经济经历了流动性拐点，伴随美联储缩减 QE 和逆回购的启动，外部资金趋势收紧导致海外局势日益动荡，从而制约国内货币政策，冲击国内流动性。另一方面，经济基本面因素日趋恶化，2013 年经济增长继续中枢下行，名义 GDP 增速不足 10%，为近五年来新低，而 CPI 则受制于经济降温和猪价低迷未现大幅上涨。然而，受楼市火热和土地市场升温带动，2013 年地方土地财政收入创新高，一方面缓解了地方债务压力，另一方面也给予了影子银行顺应 107 号文加快转变的契机。我们认为，流动性、基本面和债务，三大因素仍将影响 2014 年。

2013 年债券市场先扬后抑。债市在 6 月“钱荒”、信用评级下调、地方债务审计等不利影响下，债券收益率出现大幅上行，调整幅度超市场预期。而权益市场则以创业板为代表的新兴产业成长类个股大幅上涨，转债品种以中小盘品种表现较优。

2013 年 4 月本基金成立以来，我们根据对市场的判断逐步增加了中短久期的债券资产。当安全垫有所提升之后增加了对风险资产的投资比例。但由于下半年纯债及转债的大幅下跌对本基金业绩造成了拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2013 年 4 月 24 日正式成立。截止 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.989 元，累计份额净值为 0.989 元。自基金合同生效起至今，本基金份额净值增长率为-1.10%，同期业绩比较基准收益率为 2.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 2014 年一季度的形势来看，我们预计今年 GDP 将前低后高。全年增长 7-7.5%；CPI 上半年不高下半年不低，全年增长 3%左右，经济基本面对债市偏正面。房地产市场 2014 年预计将步入下行周期，信托风险加快暴露，银行将被动收紧银根对冲风险，从而倒逼影子银行加快转表。美联储维持基准利率上升，日元贬值，欧元区负利率，一并决定了 2014 年外围局势更加混乱，新兴市场遭遇流动性负反馈，中国央行被迫出手干预或是常态。由于 2014 年的政策基调仍是改革，所以下半年除非经济超预期下滑，或者债务危机爆发，否则中央不会出台刺激政策，而地方债务自主化或成为财政分权的契机。

上述因素决定今年债市的趋势。新年开局，对经济的悲观预期，对流动性改善的预期，以及对银行缩减非标的预期，导致债券收益率出现快速下行，短端利率大幅下降带动前期过度扁平化的曲线自我修复，利率品和中长端信用债反弹，机构配置盘涌现令债市出现罕见的火热行情。我

们认为 2014 年债市的结构机会将始终存在，利率债、短融、3-5 年高评级信用债以及超跌的产业债的配置价值较高。转债品种而言，我们将重点挖掘中小转债，中线持有存在促转股预期的品种，而大盘转债仍以波段操作为主。2014 年，权益市场将延续结构性机会，自下而上精选个股依旧是重点研究的方向。我们将继续做好大类资产的配置，优化风险资产以及安全资产的比重，努力实现本金的保值增值。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位，在较低风险程度下，认真研究各个潜在投资领域的机会，发挥管理人的综合优势，积极稳健地做好配置策略，均衡投资，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2013 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、加强内部控制制度建设，完善内部控制环境。根据业务发展的需要，新制定了非公募产品审核委员会议事规则、内幕交易防控制度等制度，修订了公司财务管理制度、重大新闻事件监测、预警与处理流程等制度。从强化合规意识、树立规范概念、优化业务流程、防范业务风险入手，全程监督和促进各部门的制度更新工作。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所（特殊普通合伙）进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-3,181,005.81元，期末可供分配利润为-3,856,649.10元。本报告期内未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富保本混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人

复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审(2014)6-38号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富保本混合型证券投资基金全体持有人
引言段	我们审计了后附的华富保本混合型证券投资基金(以下简称“华富保本混合基金”)财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表,2013年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是华富保本混合基金的基金管理人华富基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;(2)选择和运用恰当的会计政策;(3)作出合理的会计估计。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,在所有重大方面公允反映了华富保本混合基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况。

注册会计师的姓名	曹小勤	林晶
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	杭州市西溪路 128 号新湖商务大厦 9 楼	
审计报告日期	2014 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华富保本混合型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	690,367.40	-
结算备付金		4,604,737.45	-
存出保证金		104,180.51	-
交易性金融资产	7.4.7.2	380,505,924.16	-
其中：股票投资		35,474,227.26	-
基金投资		-	-
债券投资		345,031,696.90	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,185,395.22	-
应收利息	7.4.7.5	6,753,683.54	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,051.31	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		395,848,339.59	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		41,000,000.00	-
应付证券清算款		783,439.50	-
应付赎回款		506,274.58	-

应付管理人报酬		368,132.72	-
应付托管费		61,355.46	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	74,285.62	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	347,749.04	-
负债合计		43,141,236.92	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	356,563,751.77	-
未分配利润	7.4.7.10	-3,856,649.10	-
所有者权益合计		352,707,102.67	-
负债和所有者权益总计		395,848,339.59	-

注：本基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效，无上年度可比期间。报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.989 元，基金份额总额 356,563,751.77 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.2 利润表

会计主体：华富保本混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 4 月 24 日(基 金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入		2,118,016.82	-
1. 利息收入		11,320,742.11	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,087,855.41	-
债券利息收入		6,890,371.40	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,342,515.30	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,040,222.86	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	946,788.42	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,269,426.28	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	282,415.00	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-8,038,260.17	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	875,757.74	-
减：二、费用		5,299,022.63	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,504,767.39	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	584,127.96	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	220,109.10	-
5. 利息支出		629,260.00	-
其中：卖出回购金融资产支出		629,260.00	-
6. 其他费用	7.4.7.20	360,758.18	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,181,005.81	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,181,005.81	-

注：本基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效，无上年度可比期间。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富保本混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	526,218,773.24	-	526,218,773.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,181,005.81	-3,181,005.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-169,655,021.47	-675,643.29	-170,330,664.76
其中：1. 基金申购款	4,966,525.60	13,420.08	4,979,945.68
2. 基金赎回款	-174,621,547.07	-689,063.37	-175,310,610.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-	-

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	356,563,751.77	-3,856,649.10	352,707,102.67
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效，无上年度可比期间。报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 章宏韬 姚怀然 陈大毅
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华富保本混合型投资基金由华富基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富保本混合型投资基金基金合同》发起，经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]69 号文批准募集设立。本基金自 2013 年 3 月 18 日起公开向社会发行，至 2013 年 4 月 19 日募集结束。经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具天健验（2013）6-3 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本次募集的净认购金额为 525,975,505.95 元人民币，有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计 243,267.29 元人民币，折成基金份额，归投资人所有。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为华富基金

管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司；有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效，该日的基金份额为 526,218,773.24 份基金单位。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华富保本混合型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2013 年 4 月 24 日至 2013 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

7.4.4.4.1 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

7.4.4.4.1.1 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.4.1.2 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于获得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减权证确定的成本确认债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

7.4.4.4.1.3 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证按附注 7.4.4.4.1.2 所示的方法确认权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.4.2 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

7.4.4.4.3 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用

直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

7.4.4.5.1 股票投资

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

首次公开发行但未上市股票采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

本基金投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

7.4.4.5.2 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的债券按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘净价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易

日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。银行间同业市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

7.4.4.5.3 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

7.4.4.5.4 如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利

润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的，可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

7.4.4.10.1 基金管理人报酬

根据《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%的年费率逐日计提，按月支付。

7.4.4.10.2 基金托管费

根据《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率逐日计提，按月支付。

7.4.4.10.3 到期后费用

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“华富安鑫债券型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 0.7%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.10.4 其他费用

除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权；收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，由基金管理人承担该项费用；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 50%，基金合同生效满 6 个月后，若每季度最后一个自然日每 10 份基金份额的可供分配利润不低于 0.20 元，则基金须进行收益分配并以该日作为收益分配基准日；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；本基金收益分配方式分为两种：（1）保本周期内：仅采用现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；（2）若变更为“华富安鑫债券型证券投资基金”后：基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的

通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策问题的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国税总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项如下：

7.4.6.1 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

7.4.6.2 基金买卖股票、债券的差价收入，从 2004 年 1 月 1 日起，继续免征收营业税。

7.4.6.3 对基金买卖股票、债券的差价收入，从 2004 年 1 月 1 日起，继续免征收企业所得税；对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20.00%的个人所得税。

7.4.6.4 根据财政部、国税总局、证监会发布之《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，从 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

7.4.6.5 基金买卖股票，经国务院批准，从 2008 年 4 月 24 日起证券（股票）交易印花税率由 3%调整为 1%。经国务院批准，从 2008 年 9 月 19 日起，对证券交易印花税政策进行调整，由双边征收改为向卖方单边征收，税率保持 1%。

7.4.6.6 基金作为流通股股东，在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	690,367.40	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	690,367.40	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	36,129,387.63	35,474,227.26	-655,160.37
债券	交易所市场	172,366,921.24	167,424,696.90
	银行间市场	180,047,875.46	177,607,000.00
	合计	352,414,796.70	345,031,696.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	388,544,184.33	380,505,924.16	-8,038,260.17

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	496.40	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,279.42	-
应收债券利息	6,750,856.13	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	51.59	-
合计	6,753,683.54	-

注：其他所列金额为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	73,310.62	-
银行间市场应付交易费用	975.00	-
合计	74,285.62	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,749.04	-
应付审计费	70,000.00	-
应付信息披露费	270,000.00	-
合计	347,749.04	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	526,218,773.24	526,218,773.24
本期申购	4,966,525.60	4,966,525.60
本期赎回(以“-”号填列)	-174,621,547.07	-174,621,547.07
本期末	356,563,751.77	356,563,751.77

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,857,254.36	-8,038,260.17	-3,181,005.81
本期基金份额交易产生的变动数	-1,206,286.11	530,642.82	-675,643.29
其中：基金申购款	41,438.23	-28,018.15	13,420.08
基金赎回款	-1,247,724.34	558,660.97	-689,063.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,650,968.25	-7,507,617.35	-3,856,649.10

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	333,662.60	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,714,172.78	-
结算备付金利息收入	39,520.22	-
其他	499.81	-
合计	2,087,855.41	-

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入，其他所列金额为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	59,911,578.61	-
减：卖出股票成本总额	58,964,790.19	-
买卖股票差价收入	946,788.42	-

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	170,985,857.50	-
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	171,275,505.08	-
减：应收利息总额	2,979,778.70	-
债券投资收益	-3,269,426.28	-

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
股票投资产生的股利收益	282,415.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	282,415.00	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
1. 交易性金融资产	-8,038,260.17	-
——股票投资	-655,160.37	-
——债券投资	-7,383,099.80	-
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-8,038,260.17	-

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
基金赎回费收入	872,594.35	-
基金转换费收入	3,163.39	-
合计	875,757.74	-

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	215,909.10	-
银行间市场交易费用	4,200.00	-
合计	220,109.10	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	-
信息披露费	270,000.00	-
银行汇划费用	9,358.18	-
债券帐户维护费	10,500.00	-
其他	900.00	-
合计	360,758.18	-

注：其他所列金额为证券账户开户费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、代销机构
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰控股集团有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,504,767.39	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,014,524.14	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	584,127.96	-

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

上海浦东发展 银行股份有限 公司	690,367.40	333,662.60	-	-
------------------------	------------	------------	---	---

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 41,000,000.00 元，于 2014 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
A-1	89,571,000.00	-
A-1 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	89,571,000.00	-

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券、一年期以内的资产支持证券等债券基金可投资的短期信用产品。信用等级按期末评级结果列示。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
AAA	109,740,420.00	-
AAA 以下	215,293,276.90	-
其中低于 AA 以下	10,300,000.00	-

未评级	0.00	-
合计	325,033,696.90	-

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	690,367.40	-	-	-	-	-	690,367.40
结算备付金	4,604,737.45	-	-	-	-	-	4,604,737.45

存出保证金	104,180.51	-	-	-	-	-	104,180.51
交易性金融资产	19,998,000.00	19,072,000.00	133,643,465.30	127,168,581.60	45,149,650.00	35,474,227.26	380,505,924.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,185,395.22	3,185,395.22
应收利息	-	-	-	-	-	6,753,683.54	6,753,683.54
应收申购款	-	-	-	-	-	4,051.31	4,051.31
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	25,397,285.36	19,072,000.00	133,643,465.30	127,168,581.60	45,149,650.00	45,417,357.33	395,848,339.59
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	41,000,000.00	-	-	-	-	-	41,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	783,439.50	783,439.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	506,274.58	506,274.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	368,132.72	368,132.72
应付托管费	-	-	-	-	-	61,355.46	61,355.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	74,285.62	74,285.62
其他负债	-	-	-	-	-	347,749.04	347,749.04
负债总计	41,000,000.00	-	-	-	-	2,141,236.92	43,141,236.92
利率敏感度缺口	-15,602,714.64	19,072,000.00	133,643,465.30	127,168,581.60	45,149,650.00	43,276,120.41	352,707,102.67

注：本基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效，无上年度可比期间。本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013 年 12 月 31 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 基点	2,846,921.22	-
2. 市场利率上升 25 基点	-2,811,598.60		

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	35,474,227.26	10.06	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	345,031,696.90	97.82	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	380,505,924.16	107.88	-	-

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2013 年 12 月 31 日，股票类权益资产占基金资产净值的比例为 10.06%，因此若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

7.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 (95%)		
	2. 观察期 (1 年)		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末 (2013 年 12 月 31 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	合计	1,778,301.13	-

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据“财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好 2010 年年报工作的通知 (财会 (2010) 25 号)” (以下简称“通知”) 要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产

或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依
据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，
以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，
年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

类别	2013 年 12 月 31 日公允价值	2012 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	202,898,924.16	-
第二层次	177,607,000.00	-
第三层次	-	-
合计	380,505,924.16	-

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	35,474,227.26	8.96
	其中：股票	35,474,227.26	8.96
2	固定收益投资	345,031,696.90	87.16
	其中：债券	345,031,696.90	87.16
	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	5,295,104.85	1.34
6	其他各项资产	10,047,310.58	2.54
7	合计	395,848,339.59	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.11.3 期末其他各项资产构成。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,883,000.00	1.67
C	制造业	26,363,227.26	7.47
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	3,228,000.00	0.92
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	35,474,227.26	10.06

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600517	置信电气	350,000	5,180,000.00	1.47
2	000525	红太阳	299,942	4,499,130.00	1.28
3	000939	凯迪电力	700,000	4,319,000.00	1.22
4	002191	劲嘉股份	199,912	2,762,783.84	0.78
5	600422	昆明制药	106,338	2,508,513.42	0.71
6	600089	特变电工	220,000	2,358,400.00	0.67
7	002007	华兰生物	80,000	2,296,000.00	0.65
8	000816	江淮动力	490,000	2,146,200.00	0.61
9	600827	友谊股份	200,000	1,974,000.00	0.56
10	600893	航空动力	90,000	1,721,700.00	0.49
11	002683	宏大爆破	50,000	1,564,000.00	0.44
12	600276	恒瑞医药	40,000	1,519,200.00	0.43

13	600196	复星医药	70,000	1,371,300.00	0.39
14	000417	合肥百货	200,000	1,254,000.00	0.36

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	6,920,000.00	1.96
2	600517	置信电气	6,679,753.57	1.89
3	600016	民生银行	6,311,000.00	1.79
4	601928	凤凰传媒	6,299,520.00	1.79
5	600518	康美药业	5,772,567.21	1.64
6	600500	中化国际	4,856,325.00	1.38
7	000525	红太阳	4,766,768.34	1.35
8	000939	凯迪电力	4,185,359.57	1.19
9	002080	中材科技	3,980,210.96	1.13
10	600612	老凤祥	3,363,725.08	0.95
11	600276	恒瑞医药	3,088,815.57	0.88
12	600804	鹏博士	3,001,800.00	0.85
13	600521	华海药业	2,933,953.43	0.83
14	600422	昆明制药	2,761,597.86	0.78
15	002191	劲嘉股份	2,760,913.56	0.78
16	600089	特变电工	2,702,637.86	0.77
17	601888	中国国旅	2,504,000.00	0.71
18	000816	江淮动力	2,202,606.00	0.62
19	000731	四川美丰	2,102,660.00	0.60
20	002007	华兰生物	2,056,092.00	0.58

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	601928	凤凰传媒	7,492,628.38	2.12
2	600028	中国石化	6,515,616.21	1.85
3	600016	民生银行	6,345,000.00	1.80
4	600500	中化国际	5,484,948.05	1.56
5	600518	康美药业	5,386,188.33	1.53
6	002080	中材科技	3,723,789.00	1.06
7	600612	老凤祥	3,378,506.09	0.96
8	601888	中国国旅	3,208,068.49	0.91
9	600804	鹏博士	3,149,397.23	0.89
10	600521	华海药业	2,690,839.00	0.76
11	000731	四川美丰	1,980,000.00	0.56
12	600276	恒瑞医药	1,963,282.23	0.56
13	000888	峨眉山A	1,666,386.40	0.47
14	002154	报喜鸟	1,441,801.00	0.41
15	600635	大众公用	1,236,562.80	0.35
16	600517	置信电气	1,184,894.96	0.34
17	002140	东华科技	1,009,430.00	0.29
18	600697	欧亚集团	939,590.44	0.27
19	600416	湘电股份	735,810.00	0.21
20	002269	美邦服饰	378,840.00	0.11

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	95,094,177.82
卖出股票收入（成交）总额	59,911,578.61

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,998,000.00	5.67
	其中：政策性金融债	19,998,000.00	5.67

4	企业债券	162,631,231.60	46.11
5	企业短期融资券	89,571,000.00	25.40
6	中期票据	9,687,000.00	2.75
7	可转债	63,144,465.30	17.90
8	其他	-	-
9	合计	345,031,696.90	97.82

8.6 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：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130201	13 国开 01	200,000	19,998,000.00	5.67
2	041364016	13 鄂联投 CP001	200,000	19,926,000.00	5.65
3	041359038	13 广州港 CP001	200,000	19,898,000.00	5.64
4	041354031	13 中轻 CP001	200,000	19,880,000.00	5.64
5	041360042	13 七匹狼 CP001	200,000	19,876,000.00	5.64

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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、抢险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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	104,180.51
2	应收证券清算款	3,185,395.22
3	应收股利	-
4	应收利息	6,753,683.54
5	应收申购款	4,051.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,047,310.58

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	19,072,000.00	5.41
2	110020	南山转债	17,844,165.30	5.06
3	113001	中行转债	11,559,600.00	3.28
4	113003	重工转债	10,953,820.00	3.11

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,830	125,994.26	50,319,671.72	14.11%	306,244,080.05	85.89%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	141,655.58	0.0397%

注：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金份额；本报告期末本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 4 月 24 日）基金份额总额	526,218,773.24
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,966,525.60
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	174,621,547.07
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	356,563,751.77

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，陈德义先生不再担任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理的职务。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，陈德义先生不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，郭晨先生不再担任华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理的职务。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任胡伟先生为华富保本混合型证券投资基金基金经理。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘刘文正先生为华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘孔庆卿先生为华富量子生命力股票型证券投资基金基金经理。

7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘王光力先生为华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。

8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任胡伟先生为华富恒鑫债券型证券投资基金基金经理。

9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任龚炜先生为华富恒鑫债券型证券投资基金基金经理。

10、经华富基金管理有限公司股东会 2013 年度会议审议通过，增聘总经理姚怀然先生为公司董事会成员。

11、经华富基金管理有限公司第三届董事会第十九次会议审议通过，聘任陈大毅先生为华富基金管理有限公司副总经理。

12、经华富基金管理有限公司股东会 2013 年第三次临时会议审议通过，杨新潮先生不再担任公司董事职务，选举董建平先生为第四届董事会非独立董事。

13、2013 年 5 月基金托管人设立总行资产托管与养老金业务部，承接原资产托管部、养老金部的职责。原资产托管部总经理李桦同志任资产托管与养老金业务部负责人。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 7 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券		2 152, 244, 158. 57	100. 00%	137, 582. 76	100. 00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
民生证券	235, 346, 288. 46	100. 00%	6, 030, 600, 000. 00	100. 00%	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字

[2007]48 号), 我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序, 比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后, 选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。本报告期本基金新增交易单元的情况: 民生证券新增了两个席位。

2) 债券交易中的企业债及可分离债的成交金额按净价统计, 可转债的成交金额按全价统计。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《华富保本混合型证券投资基金基金份额发售公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年3月13日
2	《华富保本混合型证券投资基金招募说明书》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年3月13日
3	《华富保本混合型证券投资基金托管协议》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年3月13日
4	《华富保本混合型证券投资基金基金合同》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年3月13日
5	《关于华富保本混合型证券投资基金增加代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年3月18日
6	《关于华富保本混合型证券投资基金增加平安银行股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年3月20日
7	《关于华富保本混合型证券投资基金增加代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年3月22日
8	《关于华富保本混合型证券投资	在《中国证券报》、	2013年3月27日

	基金增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告》	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
9	《华富保本混合型证券投资基金基金合同生效公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 4 月 25 日
10	《华富保本混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定投业务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 5 月 22 日
11	《关于华富保本混合型证券投资基金增加代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 5 月 29 日
12	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 5 月 29 日
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加长量基金销售投资顾问有限公司基金申购费率及转换费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 5 月 29 日
14	《华富基金新增易宝支付一易购通网上交易平台的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 6 月 24 日
15	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加西南证券股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 6 月 25 日
16	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加国盛证券有限责任公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 7 月 1 日

17	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国盛证券有限责任公司基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年7月1日
18	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年7月3日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海天天基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年7月3日
20	《华富保本混合型证券投资基金2013年第2季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年7月19日
21	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳农村商业银行自助渠道基金申购、定投费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年7月30日
22	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年8月17日
23	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海利得基金销售有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013年8月17日
24	《华富保本混合型证券投资基金2013年半年度报告》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证	2013年8月26日

		券时报》上公告	
25	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加万银财富（北京）基金销售有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 9 月 25 日
26	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加万银财富（北京）基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 9 月 25 日
27	《华富基金管理有限公司关于旗下开放式基金增加徽商银行股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 10 月 11 日
28	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加徽商银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 10 月 11 日
29	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加徽商银行股份有限公司基金定投申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 10 月 21 日
30	《华富保本混合型证券投资基金 2013 年第 3 季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 10 月 24 日
31	《华富基金管理公司关于暂停系统的通知》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 11 月 22 日
32	《华富保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2013 年第 1 号）》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 12 月 6 日

33	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 12 月 24 日
34	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 12 月 24 日
35	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安银行 2014 年基金代销业务费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2013 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华富保本混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富保本混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富保本混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富保本混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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。