

# 华富保本混合型证券投资基金 2014 年半年 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 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。本半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 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.6 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.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	35
7.8 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贵金属投资明细.....	35
7.9 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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	35
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	37
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>37</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
10.2 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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	39
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>42</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>42</b>
12.1 备查文件目录.....	42
12.2 存放地点.....	42
12.3 查阅方式.....	42

## § 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	287,660,139.06 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,769,715.53
本期利润	13,660,509.99
加权平均基金份额本期利润	0.0415
本期加权平均净值利润率	4.13%
本期基金份额净值增长率	4.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	7,121,882.63
期末可供分配基金份额利润	0.0248
期末基金资产净值	296,862,699.31
期末基金份额净值	1.032
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	3.20%
-------------	-------

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) 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。

3) 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 6 月 30 日。

### 3.2 基金净值表现

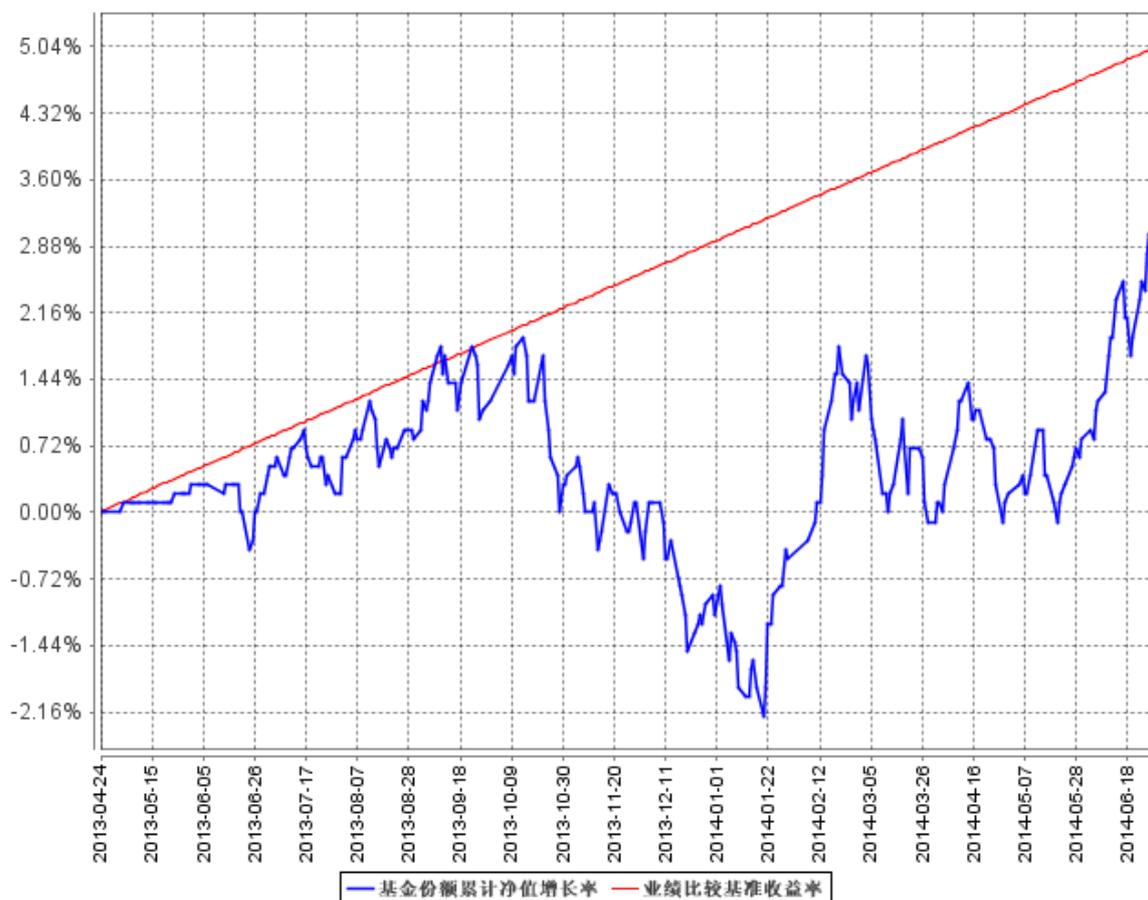
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	2.38%	0.23%	0.34%	0.01%	2.04%	0.22%
过去三个月	3.30%	0.23%	1.02%	0.01%	2.28%	0.22%
过去六个月	4.35%	0.27%	2.05%	0.01%	2.30%	0.26%
过去一年	2.99%	0.24%	4.22%	0.01%	-1.23%	0.23%
自基金合同生效起至今	3.20%	0.23%	5.04%	0.01%	-1.84%	0.22%

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。

## § 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 2014 年 6 月 30 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、华富恒富分级债券型证券投资基金和华富恒财分级债券型证券投资基金十四只基金。

#### 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、华富货币市场基金经理、华富收益增强债券型基金经理、华富恒鑫债券型基金经理、华富恒富分级债券型基金经理、华富恒财分级债券型基金经理、公司投资决策委员会成员、固定收益部总监	2013 年 4 月 24 日	-	十年	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。
张惠	华富保本混合型基金经理助理兼固定收益研究员	2014 年 3 月 20 日	-	七年	合肥工业大学产业经济学硕士，研究生学历，2007 年 6 月加入华富基金管理有限公司，先后担任助理行业研究员，行

					业研究员,2012年5月21日至2014年3月19日任华富策略精选混合型基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注：胡伟的任职日期为该基金成立之日，张惠的任职日期为公司作出决定之日，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 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

2014 年上半年，中国经济整体波澜不惊，温和通胀结合定向宽松，有利于实体经济的改革和转型。一季度受制于去年下半年的钱荒、反腐以及调控的滞后效应，地方新开工均现停滞，居民消费和固定资产投资均持续低迷，经济增速处于 7.5% 区间下限，官方 PMI 持续在 50 以下。二季度，房地产销售和投资出现大幅度下滑，楼市调整升温，国务院出台了一系列稳增长的定向宽松措施，以对冲宏观经济的下行压力，保持社会稳定和就业民生。一如我们年初的判断，2014 年的基本面整体利于债市。

上半年的债券市场呈现牛市格局。一季度随着央行调控思路的变化，银行主动收缩非标，市场资金利率回到 2-3% 的低位，银行债券配置需求大增，利率债和城投债价格大幅反弹。进入二季度，在短暂的季末调整后，伴随经济数据 4-5 月的持续低迷以及国务院稳增长政策的出台，市场对于超日债违约带来的负面冲击逐渐消化后，债券市场在 4 月下旬牛市行情延续，各期限利率品种、城投债以及垃圾债价格均有大幅度的上涨。

上半年本基金对利率债进行了波段操作，并增加了中长久期的信用债投资比例；在转债方面，继续持有中长期受益于国企改革及低估值的转债品种，减持了部分银行类转债。权益方面，继续坚持自下而上，价值兼顾成长的精选个股策略，上半年组合净值提升明显。

#### 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 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0320 元，累计份额净值为 1.0320 元。报告期，本基金份额净值增长率为 4.35%，同期业绩比较基准收益率为 2.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，社会融资成本居高不下仍将制约地方投资和债务扩张，因此 2014 年的经济难有好的表现，但是考虑政府仍将持续定向宽松来托底经济，预计也不会爆发大的系统风险和债务危机，全年增长 7.5% 是可控的。进入三季度，国内进入经济淡季，8-9 月美联储亦将继续退出 QE，因此央行货币政策除了延续调结构的立场，同时也更注重稳定汇率和跨境资金的波动，引导市场资金利率的稳定和可控。6 月份随着稳增长政策的发力，7-8 月的经济数据和信贷投放环比改善，短期会带来债市的调整，下半年我们将更关注安全资产端持有期票息收益对组合的贡献。可转债方面，由于 A 股持续的持续弱势，蓝筹股短期难以摆脱底部，下半年 IPO 供给压力较小，股市再次大幅下跌概率不大，而改革和转型等各种主题机会则会层出不穷，我们将重点把握相关主题转债的交易机会。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。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。

#### **4.7 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 13,660,509.99 元，期末可供分配利润为 7,121,882.63 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	504,131.47	690,367.40
结算备付金		7,429,062.13	4,604,737.45
存出保证金		68,970.04	104,180.51
交易性金融资产	6.4.7.2	372,380,361.20	380,505,924.16
其中：股票投资		39,851,872.60	35,474,227.26
基金投资		-	-
债券投资		332,528,488.60	345,031,696.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		481,118.34	3,185,395.22
应收利息	6.4.7.5	6,593,085.28	6,753,683.54
应收股利		-	-
应收申购款		7,312.24	4,051.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		387,464,040.70	395,848,339.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		87,499,964.20	41,000,000.00
应付证券清算款		2,881.07	783,439.50
应付赎回款		2,455,474.36	506,274.58
应付管理人报酬		297,937.40	368,132.72
应付托管费		49,656.26	61,355.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	64,447.65	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	6.4.7.8	230,980.45	347,749.04
负债合计		90,601,341.39	43,141,236.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	287,660,139.06	356,563,751.77
未分配利润	6.4.7.10	9,202,560.25	-3,856,649.10
所有者权益合计		296,862,699.31	352,707,102.67
负债和所有者权益总计		387,464,040.70	395,848,339.59

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.032 元，基金份额总额 287,660,139.06 份。

后附表附注为本财务报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：华富保本混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 4 月 24 日(基 金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		17,980,956.53	2,461,489.78
1.利息收入		9,423,109.39	3,682,377.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	110,292.06	1,708,348.92
债券利息收入		9,312,817.33	569,374.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,404,653.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-698,247.92	3,550.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-876,244.36	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	18,463.07	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	159,533.37	3,550.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	8,890,794.46	-1,688,162.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	365,300.60	463,724.62
<b>减：二、费用</b>		4,320,446.54	1,376,897.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,970,391.93	1,084,218.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	328,398.68	180,703.08

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	179,905.95	15,625.24
5. 利息支出		1,624,530.53	438.88
其中：卖出回购金融资产支出		1,624,530.53	438.88
6. 其他费用	6.4.7.19	217,219.45	95,912.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,660,509.99	1,084,592.07
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,660,509.99	1,084,592.07

注：后附表附注为本财务报表的组成部分。

### 6.3 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	356,563,751.77	-3,856,649.10	352,707,102.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,660,509.99	13,660,509.99
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）	-68,903,612.71	-601,300.64	-69,504,913.35
其中：1.基金申购款	3,709,045.60	-6,072.60	3,702,973.00
2.基金赎回款	-72,612,658.31	-595,228.04	-73,207,886.35
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）	287,660,139.06	9,202,560.25	296,862,699.31
项目	上年度可比期间 2013 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 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)	-	1,084,592.07	1,084,592.07
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)	-91,532,280.24	-179,763.17	-91,712,043.41
其中：1.基金申购款	1,034,624.67	2,587.84	1,037,212.51
2.基金赎回款	-92,566,904.91	-182,351.01	-92,749,255.92
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)	434,686,493.00	904,828.90	435,591,321.90

注：后附表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 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。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2014 半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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本报告期本基金会计政策无变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本报告期本基金会计估计无变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本报告期本基金无重大会计差错。

#### **6.4.6 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：

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。

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。

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。

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。

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%。

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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	504,131.47
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	504,131.47

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	39,992,139.93	39,851,872.60	-140,267.33	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	207,646,060.15	208,008,788.60	362,728.45
	银行间市场	123,889,626.83	124,519,700.00	630,073.17
	合计	331,535,686.98	332,528,488.60	992,801.62
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	371,527,826.91	372,380,361.20	852,534.29	

### 6.4.7.3 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。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无期末买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	14,383.57
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	3,343.10
应收债券利息	6,575,326.58
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.03
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	31.00
合计	6,593,085.28

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	62,331.80
银行间市场应付交易费用	2,115.85
合计	64,447.65

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	37,583.76
应付审计费	34,712.18
应付信息披露费	158,684.51
合计	230,980.45

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	356,563,751.77	356,563,751.77
本期申购	3,709,045.60	3,709,045.60
本期赎回(以“-”号填列)	-72,612,658.31	-72,612,658.31
本期末	287,660,139.06	287,660,139.06

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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
上年度末	3,650,968.25	-7,507,617.35	-3,856,649.10
本期利润	4,769,715.53	8,890,794.46	13,660,509.99
本期基金份额交易产生的变动数	-1,298,801.15	697,500.51	-601,300.64
其中：基金申购款	50,793.64	-56,866.24	-6,072.60
基金赎回款	-1,349,594.79	754,366.75	-595,228.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,121,882.63	2,080,677.62	9,202,560.25

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	48,702.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	60,894.55
其他	695.35

合计	110,292.06
----	------------

注：其他所列本期金额包括结算保证金利息收入 694.32，申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 1.03 元。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	56,998,604.27
减：卖出股票成本总额	57,874,848.63
买卖股票差价收入	-876,244.36

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	255,698,344.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	249,540,323.64
减：应收利息总额	6,139,557.62
债券投资收益	18,463.07

#### 6.4.7.13.1 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。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	159,533.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	159,533.37

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	8,890,794.46
——股票投资	514,893.04
——债券投资	8,375,901.42
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	8,890,794.46

### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	364,808.99
转换费收入	491.61
合计	365,300.60

### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	177,504.70
银行间市场交易费用	2,401.25
合计	179,905.95

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	158,684.51
债券帐户维护费	18,600.00
银行汇划费用	5,222.76

合计	217,219.45
----	------------

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

无

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年4月24日(基金合同生效日) 至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,970,391.93	1,084,218.47
其中：支付销售机构的客户维护费	676,736.57	290,726.99

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）。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费		328,398.68		180,703.08

注：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。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）。

### 6.4.10.3 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。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末和上年度末基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

### 6.4.10.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年4月24日(基金合同生效日)至2013年6月30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	504,131.47	48,702.16	139,806.91	288,920.08

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

### 6.4.10.6 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。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603369	今世缘	2014 年 6 月 25 日	2014 年 7 月 3 日	新股流通受限	16.93	16.93	5,105	86,427.65	86,427.65	-
002727	一心堂	2014 年 6 月 25 日	2014 年 7 月 2 日	新股流通受限	12.20	12.20	4,394	53,606.80	53,606.80	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
112209	14 雏鹰债	2014 年 6 月 26 日	-	新债未上市	100.00	100.00	50,000	5,000,000.00	5,000,000.00	-
124740	14 青经开	2014 年 5 月 5 日	-	新债未上市	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	-
124727	14 渝保税	2014 年 4 月 25 日	2014 年 7 月 28 日	新债未上市	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	-

### 6.4.12.2 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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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 87,499,964.20 元，其中 15,999,964.20 元于 2014 年 7 月 1 日到期，71,500,000.00 元于 2014 年 7 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
A-1	10,066,000.00	89,571,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	10,066,000.00	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。

**6.4.13.2 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 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
AAA	86,603,360.00	109,740,420.00
AAA 以下	225,903,128.60	215,293,276.90
其中低于 AA 以下	24,958,400.00	10,300,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	312,506,488.60	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。

**6.4.13.3 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 6.4.12 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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

**6.4.13.4 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。

**6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月 30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	504,131.47	-	-	-	-	-	504,131.47
结算备付金	7,429,062.13	-	-	-	-	-	7,429,062.13
存出保证金	68,970.04	-	-	-	-	-	68,970.04
交易性金融资产	-4,100,200.00	85,168,142.40	152,646,146.20	90,614,000.00	39,851,872.60	372,380,361.20	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	481,118.34	481,118.34
应收利息	-	-	-	-	-	6,593,085.28	6,593,085.28
应收申购款	-	-	-	-	-	7,312.24	7,312.24
资产总计	8,002,163.64	4,100,200.00	85,168,142.40	152,646,146.20	90,614,000.00	46,933,388.46	387,464,040.70
负债							
卖出回购金融资产款	87,499,964.20	-	-	-	-	-	87,499,964.20
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,881.07	2,881.07
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,455,474.36	2,455,474.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	297,937.40	297,937.40
应付托管费	-	-	-	-	-	49,656.26	49,656.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	64,447.65	64,447.65
其他负债	-	-	-	-	-	230,980.45	230,980.45
负债总计	87,499,964.20	-	-	-	-	3,101,377.19	90,601,341.39
利率敏感度缺口	-79,497,800.56	4,100,200.00	85,168,142.40	152,646,146.20	90,614,000.00	43,832,011.27	296,862,699.31
上年度末 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	-	-	-	-	-	3,185,395.22	3,185,395.22

算款							
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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	2,432,555.12	2,846,921.22
	市场利率上升 25 基点	-2,403,791.19	-2,811,598.60

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	39,851,872.60	13.42	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	332,528,488.60	112.01	345,031,696.90	97.82
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	372,380,361.20	125.44	380,505,924.16	107.88

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，股票类权益资产占基金资产净值的比例为 13.42%，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。

#### 6.4.13.4.3 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 (2014 年 6 月 30 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)
	合计	1,901,441.22	1,778,301.13

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	39,851,872.60	10.29
	其中：股票	39,851,872.60	10.29
2	固定收益投资	332,528,488.60	85.82
	其中：债券	332,528,488.60	85.82
	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	7,933,193.60	2.05
7	其他各项资产	7,150,485.90	1.85
8	合计	387,464,040.70	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.12.3 期末其他各项资产构成。

### 7.2 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,792,421.75	3.97
C	制造业	21,026,425.99	7.08
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	3,347,024.86	1.13
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	3,686,000.00	1.24
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	39,851,872.60	13.42

### 7.3 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	000939	凯迪电力	900,000	6,660,000.00	2.24
2	002683	宏大爆破	209,915	5,132,421.75	1.73
3	300307	慈星股份	400,000	4,240,000.00	1.43
4	601299	中国北车	800,000	3,632,000.00	1.22
5	600196	复星医药	170,000	3,432,300.00	1.16
6	002094	青岛金王	299,911	3,418,985.40	1.15
7	600827	百联股份	299,947	3,293,418.06	1.11
8	600312	平高电气	199,901	2,786,619.94	0.94
9	600089	特变电工	268,400	2,278,716.00	0.77
10	601318	中国平安	50,000	1,967,000.00	0.66
11	600030	中信证券	150,000	1,719,000.00	0.58
12	002631	德尔家居	139,900	1,151,377.00	0.39
13	603369	今世缘	5,105	86,427.65	0.03
14	002727	一心堂	4,394	53,606.80	0.02

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	600827	百联股份	4,798,809.82	1.36
2	601808	中海油服	4,520,669.32	1.28
3	000816	江淮动力	4,518,712.87	1.28

4	002683	宏大爆破	4,517,401.54	1.28
5	000726	鲁泰A	4,499,743.54	1.28
6	000858	五粮液	4,370,753.39	1.24
7	300307	慈星股份	4,073,576.57	1.15
8	601299	中国北车	3,947,951.12	1.12
9	600585	海螺水泥	3,456,058.00	0.98
10	002094	青岛金王	3,043,793.65	0.86
11	600352	浙江龙盛	2,969,715.96	0.84
12	002191	劲嘉股份	2,607,246.64	0.74
13	600312	平高电气	2,603,169.34	0.74
14	601318	中国平安	2,067,535.12	0.59
15	600010	包钢股份	1,992,000.00	0.56
16	000939	凯迪电力	1,946,205.10	0.55
17	600030	中信证券	1,858,000.00	0.53
18	600196	复星医药	1,851,000.00	0.52
19	002631	德尔家居	1,253,599.50	0.36
20	600089	特变电工	333,960.00	0.09

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。

#### 7.4.2 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	000816	江淮动力	6,253,588.63	1.77
2	600517	置信电气	6,146,182.79	1.74
3	002191	劲嘉股份	5,724,284.50	1.62
4	000726	鲁泰A	4,598,868.00	1.30
5	000858	五粮液	4,171,998.99	1.18
6	000525	红太阳	4,111,669.97	1.17
7	600352	浙江龙盛	3,719,230.46	1.05
8	601808	中海油服	3,684,575.28	1.04
9	600827	百联股份	3,406,599.22	0.97
10	600585	海螺水泥	3,321,773.35	0.94
11	600422	昆明制药	2,388,155.28	0.68
12	002007	华兰生物	2,093,219.00	0.59
13	600010	包钢股份	1,968,000.00	0.56

14	600893	航空动力	1,850,580.04	0.52
15	600276	恒瑞医药	1,436,236.00	0.41
16	000417	合肥百货	1,095,801.00	0.31
17	000939	凯迪电力	641,436.76	0.18
18	000063	中兴通讯	250,000.00	0.07
19	603699	纽威股份	23,330.00	0.01
20	300381	溢多利	20,800.00	0.01

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。

### 7.4.3 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	61,737,600.93
卖出股票收入（成交）总额	56,998,604.27

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。

### 7.5 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	20,022,000.00	6.74
	其中：政策性金融债	20,022,000.00	6.74
4	企业债券	233,062,146.20	78.51
5	企业短期融资券	10,066,000.00	3.39
6	中期票据	10,198,000.00	3.44
7	可转债	59,180,342.40	19.94
8	其他	-	-
9	合计	332,528,488.60	112.01

### 7.6 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

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	110015	石化转债	200,000	21,594,000.00	7.27

2	1380299	13 锡城发债	200,000	20,346,000.00	6.85
3	1180038	11 锡盟债	200,000	20,272,000.00	6.83
4	130243	13 国开 43	200,000	20,022,000.00	6.74
5	122235	12 芜湖港	200,000	19,790,000.00	6.67

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

12 芜湖港的发行主体芜湖港储运股份有限公司于 2014 年 4 月 15 日发布《关于最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施及整改情况的公告》，公告称 2013 年 9 月 5 日至 12 日，中国证券监督管理委员会检查组对公司开展了年报专项检查，并于 2013 年 11 月 6 日向公司出具了《监管关注函》。

本基金关于投资于“石化转债（110015）”、“12 芜湖港（122235）”的决策程序说明：基

于石化转债、12 芜湖港基本面及其投资价值研究，本基金投资于“石化转债”、“12 芜湖港”债券的决策流程符合公司投资管理制度相关规定。

除上述情况外，报告期内本基金投资的前十名证券中其他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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	68,970.04
2	应收证券清算款	481,118.34
3	应收股利	-
4	应收利息	6,593,085.28
5	应收申购款	7,312.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,150,485.90

### 7.12.4 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	21,594,000.00	7.27
2	110020	南山转债	18,609,782.40	6.27
3	113003	重工转债	14,876,360.00	5.01
4	110024	隧道转债	4,100,200.00	1.38

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
2,410	119,361.05	47,578,995.10	16.54%	240,081,143.96	83.46%

### 8.2 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	131,754.59	0.0458%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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

## § 9 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
本报告期期初基金份额总额	356,563,751.77
本报告期基金总申购份额	3,709,045.60
减：本报告期基金总赎回份额	72,612,658.31
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	287,660,139.06
-------------	----------------

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 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，聘任胡伟先生为华富恒富分级债券型证券投资基金的基金经理。

2、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财分级债券型证券投资基金的基金经理。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘尹培俊先生为华富货币市场基金的基金经理。

4、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，张钊先生不再担任华富强化回报债券型证券投资基金基金经理的职务。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任尹培俊先生为华富强化回报债券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，因个人原因，郭晨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。

7、经上海浦东发展银行股份有限公司决定，其资产托管与养老金业务部原总经理李桦同志自 2014 年 4 月起不再担任其资产托管与养老金业务部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	118,165,945.75	100.00%	106,044.20	100.00%	-

#### 10.7.2 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	122,252,517.46	100.00%	10,096,020,000.00	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。

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。

3) 本报告期本基金交易单元没有发生变化。

### 10.8 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	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证	2014年1月11日

		券时报》上公告	
2	《华富保本混合型证券投资基金 2013 年第 4 季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2014 年 1 月 20 日
3	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加中期时代基金销售（北京）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	2014 年 2 月 26 日
4	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中期时代基金销售（北京）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	2014 年 2 月 26 日
5	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加北京增财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	2014 年 3 月 4 日
6	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京增财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	2014 年 3 月 4 日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券手机客户端申购场外开放式基金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	2014 年 3 月 14 日
8	《华富保本混合型证券投资基金 2013 年年度报告》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2014 年 3 月 26 日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加北京钱景财富基金投资管理有限公司为代销机构的公	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2014 年 4 月 17 日

	告》		
10	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加北京钱景财富投资管理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	2014 年 4 月 17 日
11	《华富保本混合型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2014 年 4 月 22 日
12	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加一路财富（北京）信息科技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	2014 年 4 月 30 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一路财富（北京）信息科技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	2014 年 4 月 30 日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加中国国际期货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	2014 年 5 月 20 日
15	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国国际期货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	2014 年 5 月 20 日
16	《华富保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2014 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	2014 年 6 月 6 日
17	《华富基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2014 年 6 月 12 日

	况的公告》		
18	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华夏银行手机银行交易渠道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	2014 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 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。