

# 华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2014 年年度报告摘要

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

送出日期：2015 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 30 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华富价值增长混合
基金主代码	410007
交易代码	410007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 15 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
报告期末基金份额总额	98,711,585.06 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于价值相对低估且能为股东创造持续稳定回报的公司，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用较为灵活的投资策略。在资产配置中，本基金采用自上而下的方式，通过分析证券市场投资环境，预测股票市场和债券市场未来收益和风险，确定资产配置方案；在股票选择中，本基金采用定量分析、定性分析和实地调研等方法，自下而上，精选个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于灵活配置混合型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	张波
	联系电话	021-68886996	0755-22168073
	电子邮箱	manzh@hffund.com	ZHANGB0746@pingan.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95511
传真		021-68887997	0755-82080406

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	48,087,618.62	49,325,558.86	-12,055,604.02
本期利润	40,269,139.68	49,777,248.84	8,025,157.55
加权平均基金份额本期利润	0.2620	0.1994	0.0298
本期基金份额净值增长率	28.60%	26.72%	4.07%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1843	-0.1229	-0.3257
期末基金资产净值	116,905,870.66	227,723,564.41	186,992,685.29
期末基金份额净值	1.1843	0.9209	0.7267

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 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

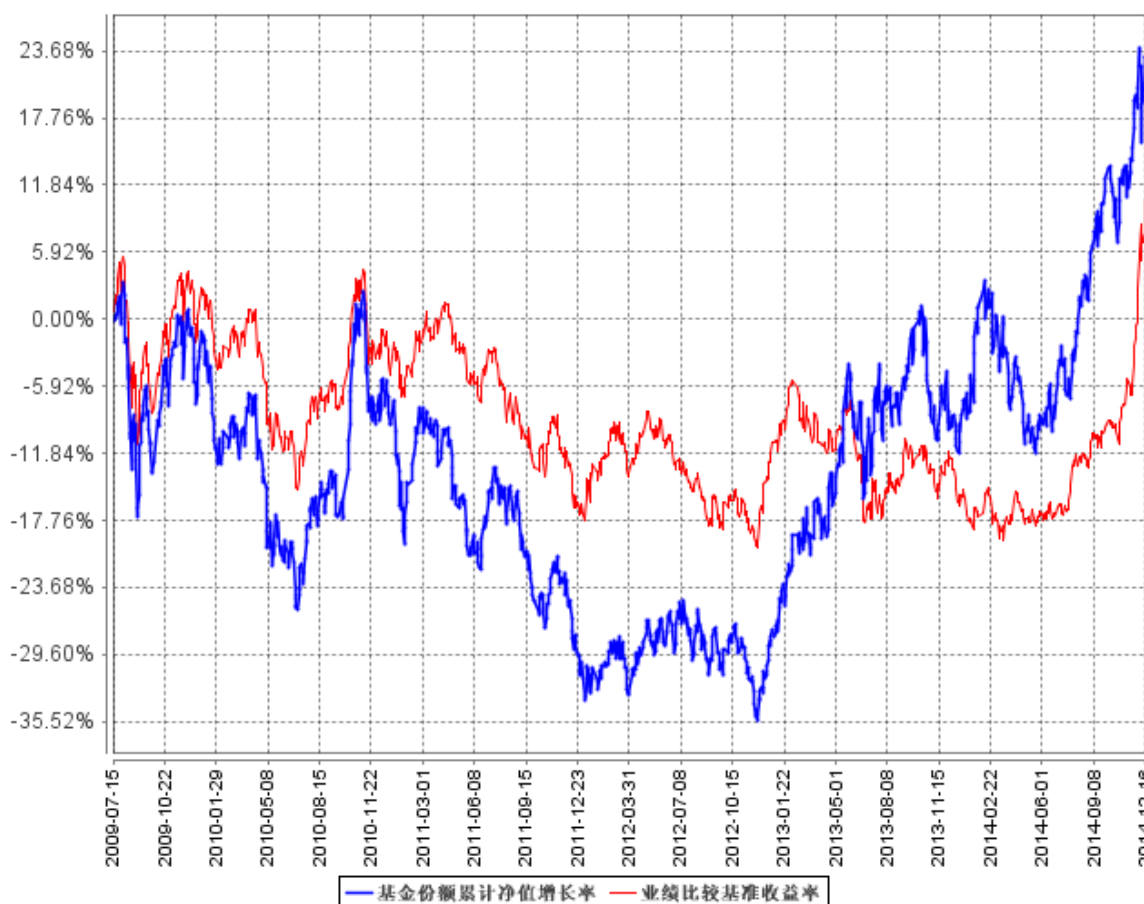
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.43%	1.44%	26.42%	0.99%	-20.99%	0.45%
过去六个月	25.68%	1.21%	37.12%	0.80%	-11.44%	0.41%
过去一年	28.60%	1.21%	34.35%	0.73%	-5.75%	0.48%

过去三年	69.60%	1.24%	36.51%	0.78%	33.09%	0.46%
过去五年	19.67%	1.24%	11.16%	0.82%	8.51%	0.42%
自基金合同生效起至今	18.43%	1.28%	14.26%	0.87%	4.17%	0.41%

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%，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

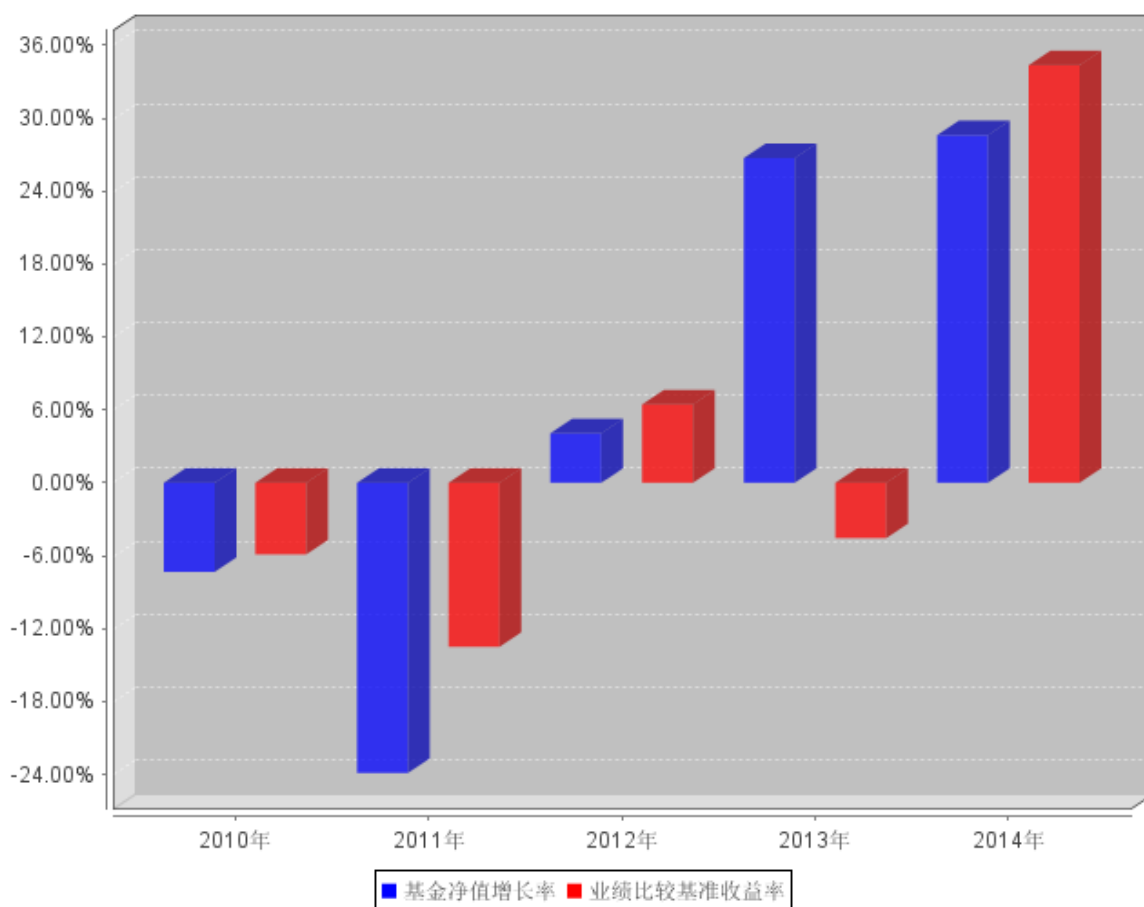
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票投资占基金资产的比例为 30%-80%；债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-70%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 7 月 15 日到 2010 年 1 月 15 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《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

### 3.2.3 过去五年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

过去五年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



### 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
2014年度	-	-	-	-	
2013年度	-	-	-	-	
2012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 2014 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、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富分级债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金十六只基金。

#### 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		
郭晨	华富价值增长混合型基金经理	2012 年 12 月 19 日	2014 年 10 月 9 日	七年	四川大学技术经济及管理专业硕士、研究生学历，历任平安资产管理有限责任公司投资绩效分析师、东吴基金管理有限公司金融工程研究员，2009 年 11 月进入华富基金管理有限公司，曾任华富中证 100 指数基金基金经理助理，2011 年 12 月 9 日至 2012 年 12 月 19 日担任华富中小板指数增强型基金基金经理，2010 年 12 月 27 日至 2012 年 12 月 19 日担任华富中证 100 指数基金基金经理，2012 年 7 月 4 日至 2013 年 8 月 19 日担任华富竞争力优选混合型基金经理，2012 年 12 月 19 日至 2014 年 2 月 20 日担任华富策略精选混合型基金经理

					经理，2012 年 12 月 19 日至 2014 年 10 月 9 日任华富价值增长混合型基金经理。
陈启明	华富价值增长混合型基金经理	2014 年 9 月 26 日	-	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	华富价值增长混合型基金经理助理兼行业研究员	2013 年 3 月 1 日	2014 年 12 月 14 日	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：郭晨的任职日期指公司作出决定之日，离任日期指中国基金业协会作出注销决定之日。陈启明的任职日期指公司作出决定之日。高靖瑜基金经理助理的任职日期、离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、



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

2014 年 A 股市场出现了大幅上升行情，在非银金融、银行、建筑等大蓝筹板块的带动下上证综指从 2115.98 点上涨到 3234.68 点，升幅达到 52.87%，市场风格也在整个一年中出现了较大变化，前三个季度创业板、中小板等成长类板块表现明显超越大盘蓝筹股。而由于经济数据持续低于预期，为响应国务院降低社会融资成本的精神，2014 年 11 月 21 日，央行宣布非对称降息，此次降息时点早于预期，表明央行在政策调控上更加注重提前应对。在降息前后市场风格出现了大扭转，大盘蓝筹股表现突出，中信非银金融指数单季度上升幅度达到 116.78%，建筑、银行板块涨幅超过 60%，建材、钢铁等行业也表现优秀，而代表小股票的创业板指和中小板指数在 2014 年最后一个季度均出现了下跌。风格的突变一方面由于市场利率的持续下行以及央行 11 月份的降息彻底激活了市场增强了投资者信心，导致增量资金大踏步入市，估值低廉的大盘蓝筹股成为资金配置的首选；另一方面，过去两年蓝筹股受到持续打压导致的过度低估，也是不可忽略的主要因素之一。

从基本面角度，全年的经济基本面虽然仍然低迷，生产者价格指数持续下跌，实体经济面临严峻挑战，伴随实体经济的变化和各种改革政策的出台，投资者心理经历复杂的变动，A 股经历了大幅变化的一年。预期差的持续出现，实体经济现状、流动性、改革政策力度和股东套现等多重因素的交织，投资的操作难度加大。整体而言，基本面优秀的成长类企业和受益降息的大金融板块在 2014 年得到市场资金最大的青睐，全年涨幅最大的板块是非银行金融、房地产和计算机等行业。

本基金始终致力于寻找受益于经济转型的标的，自下而上的寻找一些业绩增长确定、行业受经济周期影响较小，符合经济转型和结构调整的个股作为主力配置，考虑到成长股经历了一年多

的大幅上涨，基本面被预期的比较充分，估值和市值也都达到了一定的瓶颈，本基金在 2014 年前三个季度持续加仓成长股的基础上，从四季度开始减持了部分前期涨幅较大，未来空间有限的成长股，重新寻找一些还未被市场充分发掘的个股，增加了部分大盘蓝筹的配置，参与一些主题的投资，使基金组合更加均衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为 1.1843 元，累计份额净值为 1.1843 元；本报告期份额净值增长率为 28.60%，同期业绩比较基准收益率为 34.35%。

### 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 2015 年，个人对市场维持偏乐观的判断，大盘蓝筹股和成长股应该都有机会。虽然短期大盘股涨幅较大，但是考察本轮行情的核心因素，认为未来均衡化配置将会更加适合市场风格。经济下滑初期，大盘蓝筹股受经济基本面影响较大，出现了估值和业绩的双杀，但是随着市场对于宏观面继续下行风险相对较小达成一致，蓝筹股估值面迎来改善空间；而成长股经过连续大涨后估值相对偏高，只有未来业绩真正体现高成长，通过高速成长拉低估值，才有继续表现的机会。因此总体来看，价值和成长都具备投资机会。

从经济基本面来看，2014 年全年中国经济在新常态之下保持了平稳运行，呈现出增长平稳结构优化、质量提升民生改善的良好态势。全年国内生产总值比上一年增长 7.4%，一至四季度分别同比增长 7.4%、7.5%、7.3%和 7.3%。分产业来看，第一产业比上年增长 4.1%，第二产业增加 7.3%，第三产业增加值增长 8.1%，第三产业增加值远高于第一产业和第二产业，达到全年总体经济增长目标。整体而言，2014 年是改革元年，上半年定方案，下半年到 2015 年改革攻坚，重点在后面。预期国内 2015 年宏观经济仍然低迷，在这一背景下，虽然原材料下跌和利率下行对盈利增长构成一定的正面支撑，但整体上未来企业盈利增速仍将下行。基本面持续下行，政策面的宽松随之而来，2014 年底的降息等举措已经向市场表明了保增长的决心，不排除后续刺激措施的持续出台可能，同时沪港通开通，个股期权、深港通提上议事日程等，有利于大盘蓝筹股的逐步走强。中小盘成长股的走势在未来可能很难出现一致性的大面积上涨，争议会逐步加大，个人会区分的去看待相关行业，对于前两年涨幅较大，预期比较充分，未来行业增速逐渐走下坡路的个股予以回避，但是是一些行业刚刚启动或者依然保持强劲增长的新兴产业，如互联网、移动互联网、体育等，本基金将持续看好。毕竟新兴产业的成长股是中国长期经济发展的希望，本基金始终保持关注。另外其他相关主题可能会围绕国企改革，军工等展开。

本基金仍将坚持自下而上的选股策略，保持对行业和上市公司的基本面做深入的研究，坚定

持有长期看好的成长品种，对于大盘蓝筹股，在经济转型的背景之下，我们将用更为宽阔的视野去寻找受益于转型的蓝筹公司。

#### 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。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《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 40,269,139.68 元，期末可供分配利润为 18,194,285.60 元。本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 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。

### § 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，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华富价值增长基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本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、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（2015）6-46 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	华富价值增长灵活配置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价值增长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华富价值增长基金”）财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表，2014 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	编制和公允列报财务报表是华富价值增长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）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，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	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

	<p>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	<p>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价值增长基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
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	2015 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	17,640,306.63	14,616,892.96
结算备付金	414,340.13	2,598,668.83
存出保证金	559,520.30	530,847.62
交易性金融资产	109,837,076.61	167,769,500.09
其中：股票投资	92,199,666.61	152,727,400.09
基金投资	-	-
债券投资	17,637,410.00	15,042,100.00
资产支持证券投资	-	-

贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	34,000,000.00
应收证券清算款	-	9,714,967.84
应收利息	76,268.34	48,423.87
应收股利	-	-
应收申购款	6,457.49	14,121.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	128,533,969.50	229,293,422.24
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2014 年 12 月 31 日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	10,379,813.59	174,639.70
应付赎回款	258,391.32	237,465.65
应付管理人报酬	162,187.10	286,729.69
应付托管费	27,031.18	47,788.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	400,376.91	355,469.77
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	400,298.74	467,764.73
负债合计	11,628,098.84	1,569,857.83
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	98,711,585.06	247,281,246.90
未分配利润	18,194,285.60	-19,557,682.49
所有者权益合计	116,905,870.66	227,723,564.41
负债和所有者权益总计	128,533,969.50	229,293,422.24

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1843 元，基金份额总额 98,711,585.06 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	45,640,687.77	56,095,620.91
1. 利息收入	637,207.45	774,855.43
其中：存款利息收入	156,550.12	174,216.21
债券利息收入	51,102.40	112,770.29
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	429,554.93	487,868.93
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	52,757,425.85	54,829,470.61
其中：股票投资收益	51,232,541.18	53,135,325.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	864,629.81	558,525.87
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	660,254.86	1,135,619.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-7,818,478.94	451,689.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	64,533.41	39,604.89
<b>减：二、费用</b>	5,371,548.09	6,318,372.07
1. 管理人报酬	2,322,166.35	3,309,099.10
2. 托管费	387,027.71	551,516.51
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,243,954.03	2,019,356.46
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	418,400.00	438,400.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	40,269,139.68	49,777,248.84
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	40,269,139.68	49,777,248.84

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	247,281,246.90	-19,557,682.49	227,723,564.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	40,269,139.68	40,269,139.68
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）	-148,569,661.84	-2,517,171.59	-151,086,833.43
其中：1. 基金申购款	40,107,657.12	3,113,414.37	43,221,071.49
2. 基金赎回款	-188,677,318.96	-5,630,585.96	-194,307,904.92
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）	98,711,585.06	18,194,285.60	116,905,870.66
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 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）	257,309,675.37	-70,316,990.08	186,992,685.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	49,777,248.84	49,777,248.84
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）	-10,028,428.47	982,058.75	-9,046,369.72
其中：1. 基金申购款	67,747,793.52	-5,086,121.16	62,661,672.36
2. 基金赎回款	-77,776,221.99	6,068,179.91	-71,708,042.08
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）	247,281,246.90	-19,557,682.49	227,723,564.41

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

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]309号文批准募集设立。本基金自2009年5月25日起公开向社会发行，至2009年7月10日募集结束。经天健光华（北京）会计师事务所验资并出具《验资报告》（天健华证验（2009）综字第070003号）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人民币678,852,520.44元，有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计人民币269,382.24元，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，基金托管人为平安银行股份有限公司；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2009年7月15日生效，该日的基金份额为679,121,902.68份基金单位。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金根据《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》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12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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。

### 7.4.5 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《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》（财税[2002]128号）、《关于证券投资基金税收政策问题的通知》（财税[2004]78号）、《关于股权分置试点改革有

关税收政策问题的通知》(财税[2005]103号)、《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》(财税[2007]84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[2008]1号)、《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》(财税[2012]85号)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)交易印花税税率由现行的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,由现行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 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
平安银行股份有限公司	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

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 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本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,322,166.35	3,309,099.10
其中：支付销售机构的客户维护费	417,309.95	590,269.94

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%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）。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	387,027.71	551,516.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%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）。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内和上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2009 年 7 月 15 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	34,000,388.89	50,000,388.89
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	34,000,388.89	16,000,000.00
期末持有的基金份额	0.00	34,000,388.89

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	13.7500%
-----------------------	---------	----------

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

#### 7.4.8.4.2 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除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

#### 7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
平安银行股份有限公司	17,640,306.63	123,175.12	14,616,892.96	145,757.47

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 7.4.8.6 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和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末没有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002312	三泰电子	2014年12月3日	重大事项停牌	23.89	2015年3月6日	26.28	70,000	1,353,736.72	1,672,300.00	-
002396	星网锐捷	2014年10月20日	重大事项停牌	27.31	2015年2月9日	30.04	50,000	1,512,500.00	1,365,500.00	-
000663	永安林业	2014年12月24日	重大事项停牌	13.41	-	-	100,000	1,498,491.00	1,341,000.00	-
002507	涪陵榨菜	2014年12月	重大事项	28.80	2015年3月	31.68	39,513	1,030,931.00	1,137,970.00	-

		月 22 日	停牌		月 23 日			5.94	4.40	
300183	东软载波	2014 年 9 月 29 日	重大事项停牌	54.78	2015 年 1 月 5 日	47.42	69,982	2,404,582.39	3,833,613.96	-

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.10 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	2014 年 12 月 31 日公允价值	2013 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	100,486,688.25	162,934,910.20
第二层次	9,350,388.36	4,834,589.89
第三层次	-	-
合计	109,837,076.61	167,769,500.09

## § 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	92,199,666.61	71.73
	其中：股票	92,199,666.61	71.73
2	固定收益投资	17,637,410.00	13.72
	其中：债券	17,637,410.00	13.72
	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	18,054,646.76	14.05
7	其他各项资产	642,246.13	0.50
8	合计	128,533,969.50	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 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	2,314,665.63	1.98
B	采矿业	1,392,410.00	1.19
C	制造业	45,946,159.39	39.30
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	10,688,131.00	9.14
G	交通运输、仓储和邮政业	3,359,835.40	2.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,413,404.64	13.18
J	金融业	778,500.00	0.67
K	房地产业	6,674,200.55	5.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,084,600.00	0.93
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	4,547,760.00	3.89
	合计	92,199,666.61	78.87

### 8.3 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：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	300226	上海钢联	134,000	8,089,580.00	6.92
2	000100	TCL 集团	1,880,000	7,144,000.00	6.11
3	600153	建发股份	550,000	5,599,000.00	4.79
4	002393	力生制药	158,056	5,062,533.68	4.33
5	000651	格力电器	118,000	4,380,160.00	3.75
6	300183	东软载波	69,982	3,833,613.96	3.28
7	300162	雷曼光电	63,900	3,578,400.00	3.06
8	601018	宁波港	730,399	3,359,835.40	2.87
9	002665	首航节能	85,000	3,326,050.00	2.85
10	600827	百联股份	170,000	3,041,300.00	2.60

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

### 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	600153	建发股份	12,731,297.24	5.59
2	601788	光大证券	9,479,052.28	4.16
3	002312	三泰电子	8,685,107.85	3.81
4	000100	TCL 集团	8,492,200.00	3.73
5	300150	世纪瑞尔	8,387,904.62	3.68
6	600016	民生银行	8,156,292.48	3.58
7	000685	中山公用	7,308,248.14	3.21
8	300296	利亚德	7,301,141.79	3.21
9	600015	华夏银行	7,224,303.78	3.17
10	002587	奥拓电子	6,817,313.05	2.99
11	002683	宏大爆破	6,616,873.86	2.91
12	600028	中国石化	6,563,701.43	2.88



13	300289	利德曼	6,123,555.95	2.69
14	600835	上海机电	5,631,931.34	2.47
15	601628	中国人寿	5,631,919.96	2.47
16	600446	金证股份	5,625,225.37	2.47
17	600000	浦发银行	5,598,160.03	2.46
18	002117	东港股份	5,480,469.64	2.41
19	002364	中恒电气	5,417,743.71	2.38
20	000970	中科三环	5,379,762.45	2.36
21	002393	力生制药	5,368,902.22	2.36
22	000623	吉林敖东	5,340,184.52	2.35
23	002599	盛通股份	5,317,490.06	2.34
24	600150	中国船舶	5,309,768.59	2.33
25	600395	盘江股份	5,185,672.90	2.28
26	300113	顺网科技	5,114,014.40	2.25
27	002460	赣锋锂业	5,060,495.70	2.22
28	002416	爱施德	4,933,322.12	2.17
29	600030	中信证券	4,854,302.64	2.13
30	300170	汉得信息	4,663,847.44	2.05
31	601688	华泰证券	4,564,712.00	2.00

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	002117	东港股份	10,856,803.41	4.77
2	601788	光大证券	10,759,428.00	4.72
3	300058	蓝色光标	10,177,666.72	4.47
4	600016	民生银行	10,122,000.00	4.44
5	600153	建发股份	9,585,042.59	4.21
6	300335	迪森股份	9,463,635.27	4.16
7	600387	海越股份	9,263,415.88	4.07
8	002683	宏大爆破	9,167,748.75	4.03
9	300150	世纪瑞尔	9,139,613.73	4.01
10	300295	三六五网	8,385,456.59	3.68
11	300296	利亚德	8,380,081.57	3.68

12	002648	卫星石化	7,920,482.56	3.48
13	002312	三泰电子	7,678,397.22	3.37
14	002587	奥拓电子	7,307,532.68	3.21
15	000685	中山公用	7,281,963.46	3.20
16	600872	中炬高新	7,107,832.21	3.12
17	000623	吉林敖东	6,791,975.68	2.98
18	600028	中国石化	6,761,778.98	2.97
19	600446	金证股份	6,626,600.45	2.91
20	600015	华夏银行	6,425,590.98	2.82
21	002520	日发精机	6,361,427.98	2.79
22	300007	汉威电子	6,085,788.86	2.67
23	002364	中恒电气	6,071,030.46	2.67
24	600703	三安光电	6,047,861.28	2.66
25	601628	中国人寿	6,021,266.27	2.64
26	300289	利德曼	5,881,931.18	2.58
27	002400	省广股份	5,834,794.93	2.56
28	002460	赣锋锂业	5,589,282.60	2.45
29	600150	中国船舶	5,440,813.54	2.39
30	300113	顺网科技	5,358,772.01	2.35
31	002416	爱施德	5,330,377.63	2.34
32	600395	盘江股份	5,297,390.45	2.33
33	600835	上海机电	5,288,280.57	2.32
34	600000	浦发银行	5,232,000.00	2.30
35	300323	华灿光电	5,231,644.48	2.30
36	000661	长春高新	5,003,983.76	2.20
37	002599	盛通股份	5,000,342.81	2.20
38	600305	恒顺醋业	4,938,349.98	2.17
39	002568	百润股份	4,870,893.99	2.14
40	000970	中科三环	4,832,070.32	2.12
41	601688	华泰证券	4,810,117.00	2.11
42	300021	大禹节水	4,793,279.89	2.10
43	600270	外运发展	4,758,034.59	2.09
44	600416	湘电股份	4,725,813.57	2.08
45	300170	汉得信息	4,641,038.56	2.04
46	002353	杰瑞股份	4,606,877.77	2.02

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	677,714,567.43
卖出股票收入（成交）总额	777,900,548.89

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、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	-	-
	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	17,637,410.00	15.09
8	其他	-	-
9	合计	17,637,410.00	15.09

### 8.6 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	40,000	5,396,800.00	4.62
2	110023	民生转债	33,000	4,562,910.00	3.90
3	128005	齐翔转债	25,000	3,243,700.00	2.77
4	126729	燕京转债	20,000	2,554,920.00	2.19
5	113001	中行转债	12,000	1,879,080.00	1.61

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

**8.12.2** 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。

### 8.12.3 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	559,520.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	76,268.34
5	应收申购款	6,457.49

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	642,246.13

### 8.12.4 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	5,396,800.00	4.62
2	110023	民生转债	4,562,910.00	3.90
3	128005	齐翔转债	3,243,700.00	2.77
4	126729	燕京转债	2,554,920.00	2.19
5	113001	中行转债	1,879,080.00	1.61

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300183	东软载波	3,833,613.96	3.28	重大事项停牌

### 8.12.6 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。

## § 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
2,990	33,013.91	41,885,323.34	42.43%	56,826,261.72	57.57%

## 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	0.00	0.0000%

## 9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年7月15日）基金份额总额	679,121,902.68
本报告期期初基金份额总额	247,281,246.90
本报告期基金总申购份额	40,107,657.12
减：本报告期基金总赎回份额	188,677,318.96
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	98,711,585.06

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。

## § 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、2014年2月7日，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策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

2、2014 年 2 月 10 日，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，增聘胡伟先生为华富恒财分级债券型证券投资基金基金经理。

3、2014 年 2 月 21 日，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，增聘尹培俊先生为华富货币市场基金、华富强化回报债券型证券投资基金基金经理。

4、2014 年 3 月 7 日，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，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、2014 年 5 月 12 日，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，增聘龚炜先生为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、2014 年 7 月 4 日，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，增聘胡伟先生为华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金经理。

7、2014 年 8 月 12 日，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，增聘孔庆卿先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

8、2014 年 9 月 15 日，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，增聘陈启明先生为华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

9、2014 年 9 月 26 日，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价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

10、2014 年 11 月 4 日，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，增聘刘文正先生为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

11、2014 年 11 月 4 日，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，增聘王翔先生为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

12、2014 年 11 月 4 日，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，增聘张惠女士为华富保本混合型证券投资基金基金经理。

13、2014 年 11 月 5 日，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，胡伟先生不再担任华富货币市场基金基金经理的职务。

14、2014 年 12 月 2 日，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，增聘高靖瑜女士为华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

15、本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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 8 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	
川财证券	1	437,051,437.56	30.04%	386,747.10	29.86%	-
光大证券	1	268,471,424.27	18.45%	244,416.02	18.87%	-
齐鲁证券	1	245,135,836.63	16.85%	216,395.20	16.71%	-
国海证券	1	243,617,547.61	16.74%	215,577.78	16.64%	-
国信证券	2	166,680,342.43	11.46%	148,847.81	11.49%	-
申银万国	1	94,084,227.82	6.47%	83,255.04	6.43%	-

注：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。本报告期本基金无交易单元变化。

### 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
川财证券	16,265,410.74	16.93%	-	-	-	-
光大证券	53,472,452.70	55.67%	483,000,000.00	28.26%	-	-
齐鲁证券	5,712,840.00	5.95%	726,000,000.00	42.48%	-	-
国海证券	2,416,242.70	2.52%	-	-	-	-
国信证券	18,188,998.67	18.94%	500,000,000.00	29.26%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。