

# 华富保本混合型证券投资基金 2015 年年度 报告摘要

2015 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：2016 年 3 月 29 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 28 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 2015 年 01 月 01 日起至 2015 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	134,491,345.19 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

## 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	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
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	2015 年	2014 年	2013 年 4 月 24 日 (基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	40,943,242.25	26,457,314.16	4,857,254.36
本期利润	28,641,795.10	50,143,958.01	-3,181,005.81
加权平均基金份额本期利润	0.1994	0.1802	-0.0075
本期基金份额净值增长率	16.36%	21.23%	-1.10%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0766	0.0799	-0.0108
期末基金资产净值	144,787,522.03	198,901,310.61	352,707,102.67
期末基金份额净值	1.077	1.147	0.989

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

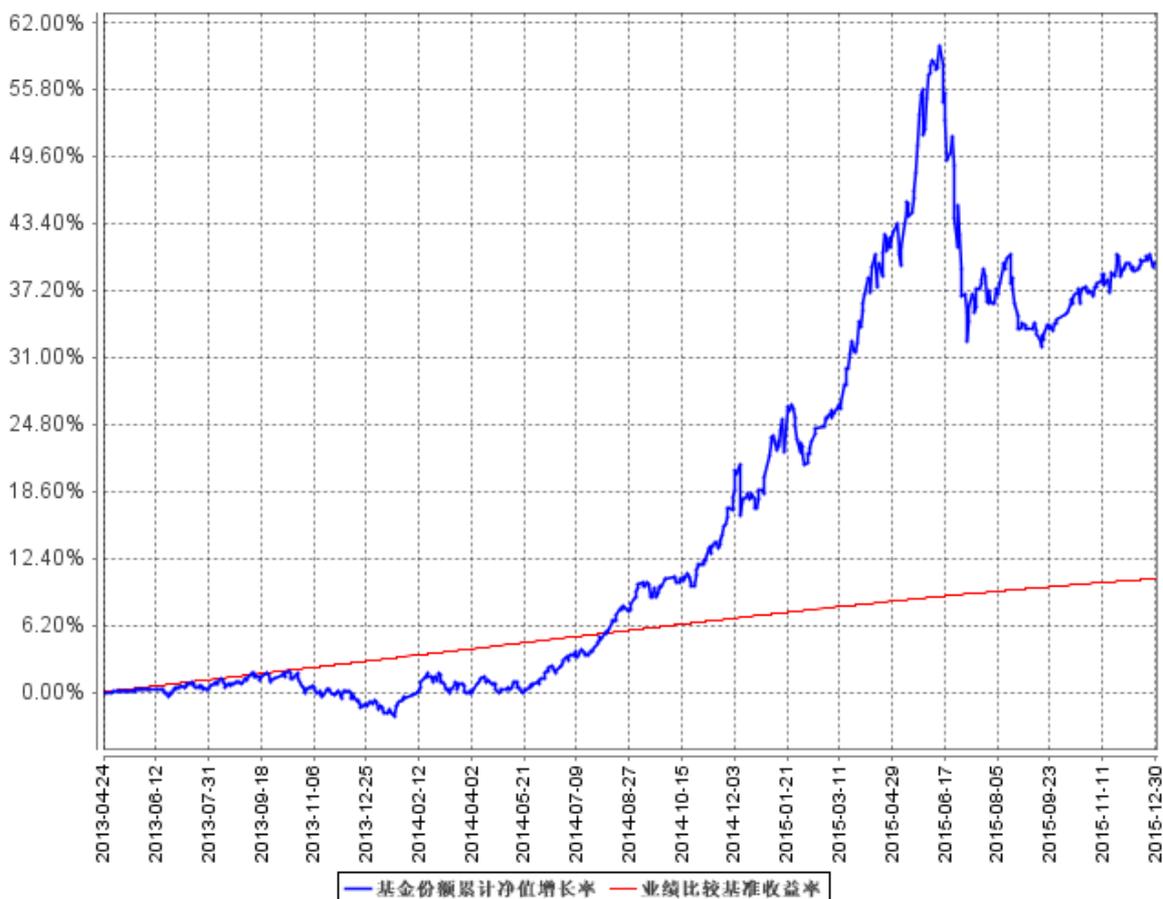
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.75%	0.40%	0.65%	0.01%	3.10%	0.39%
过去六个月	-3.81%	0.63%	1.38%	0.01%	-5.19%	0.62%
过去一年	16.36%	0.85%	3.14%	0.01%	13.22%	0.84%
自基金合同生效起至今	39.51%	0.59%	10.52%	0.01%	28.99%	0.58%

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

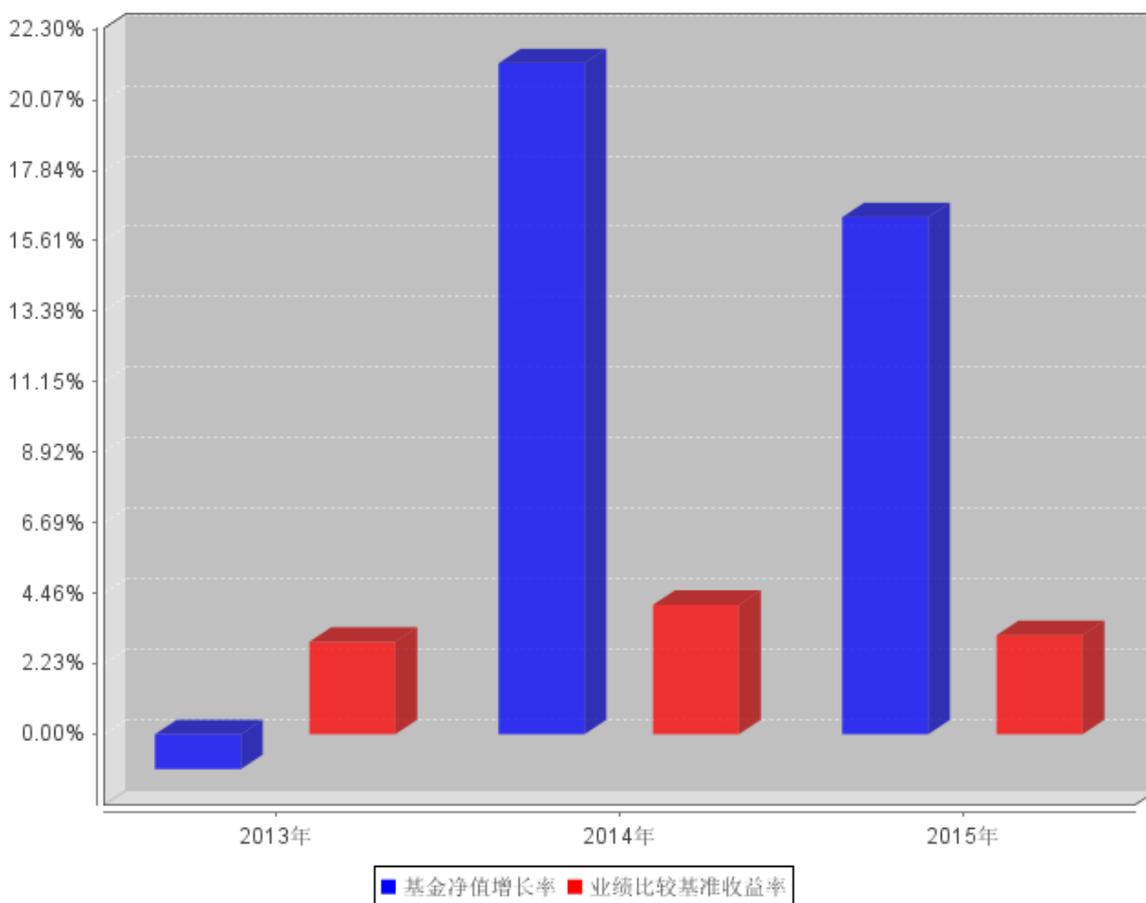


注：根据《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产

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。

### 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：合同生效当年按实际存续期计算，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
2015年度	2.5000	35,078,013.91	-	35,078,013.91	
2014年度	0.5000	9,728,390.56	-	9,728,390.56	
2013年度	-	-	-	-	
合计	3.0000	44,806,404.47	-	44,806,404.47	

## § 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金融控股（集团）有限公司。截止 2015 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、华富成长趋势混合型证券投资基金、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、华富量子生命力混合型证券投资基金、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、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富旺财保本混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金二十一基金。

#### 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、华富收益增强债券型基金经理、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、华富恒稳纯债债券型基金经理、华富旺财保本混	2013 年 4 月 24 日	-	十二年	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、2009 年 10 月 19 日至 2014 年 11 月 17 日任华富货币市场基金基金经理、2014 年 8 月 7 日至 2015 年 2 月 11 日任华富灵活配置混合型基金基

	合型基金经理、华富恒利债券型基金经理、公司公募投资决策委员会成员、公司总经理助理、固定收益部总监				金经理。
张惠	华富保本混合型基金经理、华富旺财保本混合型基金经理、华富恒利债券型基金基金经理	2014年11月19日	-	九年	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，先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员，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经理助理，2014年3月20日至2014年11月18日任华富保本混合型基金经理助理。

注：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

回顾刚刚过去的 2015 年，中国 GDP 同比增长 6.9%，较 2014 年回落 0.4 个百分点，从各产业增速来看，第一产业表现相对平稳；受到过剩行业产能去化的影响，第二产业整体疲弱；而由于上半年资本市场的快速上涨使得金融服务业对 GDP 的贡献大增，第三产业增速有所提升。从需求端看，投资持续下行，外贸低迷乏力，仅有消费维持相对平稳。固定资产投资受到房地产和制造业投资持续下行的拖累，仅基建投资在产业政策的作用下勉力支撑；外贸则受制于外围经济低迷、国内经济下行、实际有效汇率高企及大宗商品价格下跌等诸多因素的影响，年内一直呈现较为低迷的态势，进口与出口全年均录得负增长。消费则在居民收入大体稳定增长的基础上，受到房地产相关行业的带动，全年维持相对平稳。

即便如此，在全球范围中国经济仍然保持了较高的增速。美国 2015 年三季度名义 GDP 增速为 3%，实际 GDP 仅有 2.1%，去年 12 月美国 ISM 制造业指数为 48.2，连续三个月下滑。再看日韩，日本去年三季度不变价 GDP 增长 1.6%，名义增速 3.5%，2016 年 1 月日本 PMI 为 52.4，制造业温和扩张持续了大半年，韩国去年全年 GDP 增长 3%，名义增速约 5.2%，韩国去年 12 月 PMI 为 50.7，重回扩张区间。欧元区方面，德国去年三季度 GDP 增长 1.7%，名义增速大概在 3.7%，法国去年三季度实际 GDP 增长 1.2%，名义增长 2.5%。

从利率市场的表现来看，低增速导致外围长期利率走低，中国 10 年国债收益率从 2015 年初的 3.6% 下跌到年末的 2.8%。随着美联储 2015 年 12 月进入加息周期，中美利率存在倒挂的可能，到时将考验央行对汇率和政策利率的双调控能力。

2015 年，债券市场持续牛市行情。截至年末，各债券品种收益率基本都回到历史低位。从信用利差、各品种相对优劣来看，投资级信用债信用利差大幅收窄，所以信用债在 15 年仍呈“牛市越牛”特征。同时，细分品种中，国开债券较国债的利差继续缩窄，幅度低于 2014 年。另外，城投债表现好于产业债。

2015 年，股票市场走势波澜壮阔，上半年在利率下行，流动性推动下经历了 2000 点涨幅的大牛市，随后经济持续下行，清理杠杆的过程中出现了罕见的股灾，年末随着市场情绪的企稳又现小幅反弹。全年，上证综指上涨 9.41%，沪深 300 上涨 5.58%，创业板指数上涨 84.41%，由此看出代表中国经济转型方向的成长股涨幅巨大。

本基金在 2015 年精选债券，积极投资权益资产，净值持续增长，年末降低了权益仓位，适度降低了杠杆。

#### 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 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.077 元，累计份额净值为 1.377 元。自基金合同生效起至今，本基金份额净值增长率为 39.51%，同期业绩比较基准收益率为 10.52%。

#### 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 2016 年，我们认为宏观经济仍有下行压力，但是不存在系统性风险。伴随着政府对经济的“托底”，以及供给侧改革带来的产能出清，我们认为 16 年稳增长更加依赖于积极的财政政策刺激。2016 年，我们预测通缩压力仍然较大，存在继续降息的空间，但与 14 年年末 3% 的存款利率相比，目前 1.5% 的基准利率水平下毫无疑问降息空间受到约束，预测明年或有两到三次降息。而当前法定存款准备金率依然高达 17.5%，而历史上最低值仅 6%，意味着准备金率下调空间依然巨大，央行完全有能力对冲汇率不稳定性带来的流动性冲击，并维持宽松的货币政策。2016 年在“资产荒”的大格局下，我们看好未来优质金融资产的表现。我们将继续做好大类资产的配置，实现稳定的投资业绩。

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。

2016 年，本基金的第一个保本周期即将结束，我们将陆续变现持有的债券和股票，在为持有人保值增值的同时以维持基金到期时的流动性。

#### 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《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定；本报告期内共实施四次利润分配，分配金额为 35,078,013.91 元，符合基金合同所要求的收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50% 的约定；本报告期末，尚存可供分配的利润共 10,296,176.84 元，滚存至下一期进行分配。

#### 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，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。该基金本报告期内进行了四次利润分配，分配金额分别为 6,608,064.43 元、9,173,226.80 元、12,864,272.23 元、6,432,450.45 元。

### 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（2016）6-64 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 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 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）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。 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。

	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。	
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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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	2016 年 3 月 23 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		6,317,770.45	334,554.98
结算备付金		845,901.98	7,690,578.70
存出保证金		71,467.94	69,656.93
交易性金融资产		134,763,752.35	273,852,349.50
其中：股票投资		20,477,956.75	61,726,914.79
基金投资		-	-
债券投资		114,285,795.60	212,125,434.71
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		-	-
应收证券清算款		918,853.36	1,099,312.37
应收利息		2,638,852.10	5,003,302.36
应收股利		-	-
应收申购款		227,203.51	37,578.87
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		145,783,801.69	288,087,333.71

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<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		-	87,999,710.10
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		303,498.68	453,825.75
应付管理人报酬		146,426.88	210,417.25
应付托管费		24,404.49	35,069.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		127,723.80	54,976.59
应交税费		-	-
应付利息		-	38,248.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		394,225.81	393,775.42
负债合计		996,279.66	89,186,023.10
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		134,491,345.19	173,342,271.30
未分配利润		10,296,176.84	25,559,039.31
所有者权益合计		144,787,522.03	198,901,310.61
负债和所有者权益总计		145,783,801.69	288,087,333.71

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.077 元，基金份额总额 134,491,345.19 份。

## 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		33,011,901.82	58,748,491.00
1. 利息收入		8,111,518.60	16,685,485.51
其中：存款利息收入		128,468.77	264,352.52
债券利息收入		7,983,049.83	16,421,132.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		36,631,722.30	17,504,809.66

其中：股票投资收益		26,015,092.79	5,672,256.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益		10,036,424.05	11,411,099.26
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		580,205.46	421,453.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-12,301,447.15	23,686,643.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		570,108.07	871,551.98
<b>减：二、费用</b>		4,370,106.72	8,604,532.99
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	2,023,928.76	3,488,743.91
2. 托管费	7.4.8.2.2	337,321.43	581,457.36
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		589,071.96	332,234.12
5. 利息支出		987,300.08	3,763,669.03
其中：卖出回购金融资产支出		987,300.08	3,763,669.03
6. 其他费用		432,484.49	438,428.57
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		28,641,795.10	50,143,958.01
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		28,641,795.10	50,143,958.01

### 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	173,342,271.30	25,559,039.31	198,901,310.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	28,641,795.10	28,641,795.10
三、本期基金份额交易产	-38,850,926.11	-8,826,643.66	-47,677,569.77

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	88,475,797.01	20,300,413.75	108,776,210.76
2. 基金赎回款	-127,326,723.12	-29,127,057.41	-156,453,780.53
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)	-	-35,078,013.91	-35,078,013.91
五、期末所有者权益(基金净值)	134,491,345.19	10,296,176.84	144,787,522.03
项目	上年度可比期间 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)	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(本期净利润)	-	50,143,958.01	50,143,958.01
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)	-183,221,480.47	-10,999,879.04	-194,221,359.51
其中: 1. 基金申购款	17,597,826.89	1,558,868.96	19,156,695.85
2. 基金赎回款	-200,819,307.36	-12,558,748.00	-213,378,055.36
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)	-	-9,728,390.56	-9,728,390.56
五、期末所有者权益(基金净值)	173,342,271.30	25,559,039.31	198,901,310.61

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  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
姚怀然  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
陈大毅  
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(以下简称本基金或基金)经中国证券监督管理委员会(中国证监

会) (证监许可[2013]69号) 核准, 基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所(特殊普通合伙) 审验, 并出具《验资报告》(天健验(2013) 6-3 号)。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构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。

根据《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的规定, 本基金为保本混合型基金, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行上市的各类股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求, 同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作, 真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

#### **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)、《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》(财税〔2005〕102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)、《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》(财税〔2005〕107号)、《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》(财税〔2007〕84号)、《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《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, 主要税项列示如下:

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 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 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
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股（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

本基金本报告期内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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付	2,023,928.76	3,488,743.91

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	612,724.01	1,060,714.57

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）。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	337,321.43	581,457.36

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）。

#### 7.4.8.3 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

本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期和上年度可比期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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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	6,317,770.45	72,714.10	334,554.98	136,003.26

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（2015 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

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 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
123001	蓝标转债	2015 年 12 月 23 日	2016 年 1 月 8 日	新债未上市	100.00	100.00	810	81,000.00	81,000.00	-

##### 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
601058	赛轮金宇	2015 年 12 月 28 日	重大事项停牌	9.00	2016 年 1 月 12 日	8.10	300,000	2,418,618.46	2,700,000.00	-

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.10 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	2015 年 12 月 31 日公允价值	2014 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	17,777,956.75	180,043,799.50
第二层次	116,985,795.6	93,808,550.00
第三层次	-	-
合计	134,763,752.35	273,852,349.50

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号）的要求，本基金自 2015 年 3 月 30 日起，对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值（估值标准另有规定的除外），本报告期末本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

## § 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	20,477,956.75	14.05
	其中：股票	20,477,956.75	14.05
2	固定收益投资	114,285,795.60	78.39
	其中：债券	114,285,795.60	78.39
	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	7,163,672.43	4.91
7	其他各项资产	3,856,376.91	2.65
8	合计	145,783,801.69	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 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	-	-
C	制造业	10,653,081.75	7.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,685.00	0.01
F	批发和零售业	3,677,760.00	2.54
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	13,030.00	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,174,000.00	2.88
L	租赁和商务服务业	1,061,400.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	880,000.00	0.61
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	20,477,956.75	14.14

## 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	600203	福日电子	208,000	2,851,680.00	1.97

2	601058	赛轮金宇	300,000	2,700,000.00	1.86
3	600596	新安股份	220,000	2,244,000.00	1.55
4	600520	中发科技	70,000	1,951,600.00	1.35
5	002146	荣盛发展	200,000	1,906,000.00	1.32
6	000423	东阿阿胶	30,000	1,569,000.00	1.08
7	600240	华业资本	80,000	1,204,000.00	0.83
8	000703	恒逸石化	100,000	1,111,000.00	0.77
9	600048	保利地产	100,000	1,064,000.00	0.73
10	002408	齐翔腾达	79,925	1,063,801.75	0.73

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	600028	中国石化	9,341,502.90	4.70
2	601166	兴业银行	6,917,064.54	3.48
3	000089	深圳机场	6,772,983.28	3.41
4	600016	民生银行	5,190,680.80	2.61
5	000651	格力电器	4,138,099.30	2.08
6	000661	长春高新	4,040,730.00	2.03
7	000797	中国武夷	3,799,113.00	1.91
8	000061	农产品	3,482,776.96	1.75
9	002361	神剑股份	3,327,696.39	1.67
10	600048	保利地产	3,222,847.01	1.62
11	300133	华策影视	3,106,810.64	1.56
12	000703	恒逸石化	3,065,251.00	1.54
13	600520	中发科技	2,891,684.00	1.45
14	600203	福日电子	2,879,040.85	1.45
15	601233	桐昆股份	2,863,049.00	1.44
16	600356	恒丰纸业	2,729,277.70	1.37
17	002709	天赐材料	2,704,871.00	1.36
18	002693	双成药业	2,693,442.00	1.35
19	002625	龙生股份	2,559,000.00	1.29
20	300430	诚益通	2,551,178.20	1.28

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	601299	中国北车	10,429,485.12	5.24
2	600028	中国石化	10,322,181.60	5.19
3	002094	青岛金王	8,455,414.88	4.25
4	600016	民生银行	7,795,988.92	3.92
5	600089	特变电工	6,970,010.00	3.50
6	601166	兴业银行	6,954,100.09	3.50
7	000089	深圳机场	6,934,508.25	3.49
8	601318	中国平安	5,708,089.80	2.87
9	002146	荣盛发展	5,212,109.68	2.62
10	600280	中央商场	4,995,684.00	2.51
11	601818	光大银行	4,855,500.00	2.44
12	300072	三聚环保	4,790,963.20	2.41
13	000651	格力电器	4,608,000.00	2.32
14	600535	天士力	4,370,270.54	2.20
15	000661	长春高新	4,183,927.00	2.10
16	600196	复星医药	4,044,691.00	2.03
17	600108	亚盛集团	3,886,542.18	1.95
18	300133	华策影视	3,758,270.00	1.89
19	600976	健民集团	3,079,203.90	1.55
20	000060	中金岭南	2,978,040.00	1.50

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	162,720,104.20
卖出股票收入（成交）总额	221,759,130.05

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	10,033,000.00	6.93
	其中：政策性金融债	10,033,000.00	6.93
4	企业债券	84,115,795.60	58.10
5	企业短期融资券	20,056,000.00	13.85
6	中期票据	-	-
7	可转债	81,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	114,285,795.60	78.93

## 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	011599498	15 闽电子 SCP003	200,000	20,056,000.00	13.85
2	124367	13 锡城发	150,000	15,951,000.00	11.02
3	098082	09 华西债	135,000	13,626,900.00	9.41
4	1480303	14 蔡家湖债	100,000	11,065,000.00	7.64
5	1380264	13 石建投债	100,000	10,262,000.00	7.09

## 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

基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 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	71,467.94
2	应收证券清算款	918,853.36
3	应收股利	-
4	应收利息	2,638,852.10
5	应收申购款	227,203.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,856,376.91

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

### 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	601058	赛轮金宇	2,700,000.00	1.86	临时停牌

### 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
3,400	39,556.28	28,055,494.20	20.86%	106,435,850.99	79.14%

### 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	97,140.49	0.0722%

### 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、基金投资和研发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

## § 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
本报告期期初基金份额总额	173,342,271.30
本报告期基金总申购份额	88,475,797.01
减：本报告期基金总赎回份额	127,326,723.12
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	134,491,345.19

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、2015年2月3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，龚炜先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

2、2015年2月3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灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

3、2015年2月3日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任张亮先生为华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4、2015年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王夏儒先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、2015年4月14日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王夏儒先生为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、2015年4月14日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任高靖瑜女士为华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、2015年4月14日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任陈启明先生

为华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

8、2015 年 4 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作原因，王光力先生不再担任华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理。

9、2015 年 4 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王翔先生为华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理。

10、2015 年 4 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任陈启明先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理。

11、2015 年 5 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，刘文正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。

12、2015 年 9 月 22 日，经华富基金管理有限公司董事会会议审议通过，聘任龚炜为公司副总经理。

13、2015 年 9 月 22 日，经华富基金管理有限公司董事会会议审议通过，聘任曹华玮为公司副总经理。

14、2015 年 12 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，聘任翁海波先生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、经基金托管人决定，邓从国同志自 2015 年 4 月 1 日起担任资产托管与养老金业务部总经理职务。

16、自 2016 年 1 月起，基金托管人更新了组织架构并调整部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

### 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	359,816,634.17	100.00%	327,131.60	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	132,723,779.39	100.00%	6,373,460,000.00	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。本报告期本基金无新增交易单元。

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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。