

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告

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：平安银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 29 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。

基金托管人平安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。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 2015 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.....	11
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.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
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.....	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§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.....	16
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
8.7 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.....	46

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	46
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	46
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
8.12	投资组合报告附注	47
§9	基金份额持有人信息	48
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§10	开放式基金份额变动	48
§11	重大事件揭示	49
11.1	基金份额持有人大会决议	49
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	49
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4	基金投资策略的改变	50
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8	其他重大事件	51
§12	影响投资者决策的其他重要信息	59
§13	备查文件目录	59
13.1	备查文件目录	59
13.2	存放地点	59
13.3	查阅方式	59

§ 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	880,641,359.45 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
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号

邮政编码	200120	518001
法定代表人	章宏韬	孙建一

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	上海市陆家嘴环路 1000 号 31 层

§ 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
本期已实现收益	44,353,166.33	48,087,618.62	49,325,558.86
本期利润	40,135,305.27	40,269,139.68	49,777,248.84
加权平均基金份额本期利润	0.6733	0.2620	0.1994
本期加权平均净值利润率	41.86%	26.14%	22.59%
本期基金份额净值增长率	59.46%	28.60%	26.72%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	78,981,913.56	18,194,285.60	-30,381,901.88
期末可供分配基金份额利润	0.0897	0.1843	-0.1229
期末基金资产净值	959,623,273.01	116,905,870.66	227,723,564.41
期末基金份额净值	1.0897	1.1843	0.9209
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	88.85%	18.43%	-7.91%

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	37.76%	2.05%	11.02%	1.00%	26.74%	1.05%
过去六个月	3.45%	3.44%	-7.39%	1.60%	10.84%	1.84%
过去一年	59.46%	2.95%	8.82%	1.49%	50.64%	1.46%
过去三年	159.87%	2.01%	39.57%	1.07%	120.30%	0.94%
过去五年	105.92%	1.70%	28.53%	0.96%	77.39%	0.74%
自基金合同生效起至今	88.85%	1.65%	24.34%	0.99%	64.51%	0.66%

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

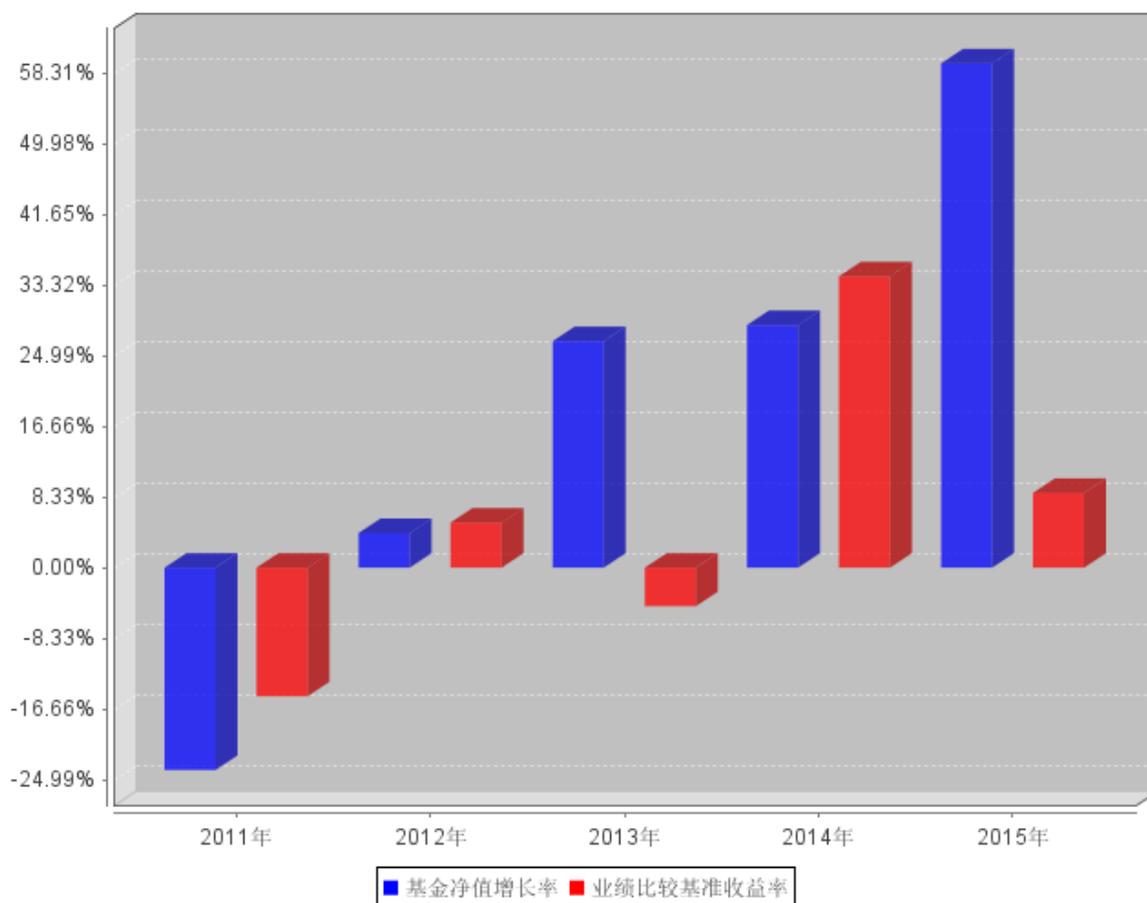
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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
2015年度	8.0000	815,317,255.25	5,981,468.93	821,298,724.18	
2014年度	-	-	-	-	
2013年度	-	-	-	-	
合计	8.0000	815,317,255.25	5,981,468.93	821,298,724.18	

§ 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		
陈启明	华富价值增长混合型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理，研究发展部副总监	2014 年 9 月 26 日	-	十年	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。

注：陈启明的任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

2015 年 A 股市场经历从大涨到大跌再反弹的曲折历程，一年经历多次牛熊转换，见证千股涨停、千股跌停、千股停牌，一系列奇观都在 2015 年上演。全年上证上涨 9.4%，沪深 300 指数上涨 5.58%，创业板指上涨 84%，但各大指数都收出较长上影线。

基本面方面，2015 年四季度中国经济名义 GDP 增速依然在下滑趋势，先导指标 PMI 低迷，PPI 继续收缩，新开工投资、铁路货运量、用电量、工业利润等数据均体现出单边下跌迹象，所以在终端 CPI 上，即使一二线楼市回暖，但是依然无力提振通货膨胀率，人民币汇率在加入 SDR 后出现剧烈贬值，释放出央行需要维持区域主导货币的双向波动的市场化属性，而我们研究各国长期国债-美债利差和本币兑美元汇率的相关性，体现出典型的利差收窄诱发汇率贬值的规律，所以随着国内多次降准降息和债务置换对长期利率的压制，中国 10 年国债呈现出期限利差和海外利差双倒挂的征兆。

这种情形与亚洲金融危机后的日本，以及近两年的韩国，十分之相似，而与印度、俄罗斯、巴西、越南等国截然相反。我们理解为，中国作为第二大工业化国家，其国际分工和文化特征，决定其会走上更像日韩台的儒家路径，就是大国的货币贬值、利差收窄、经济衰退，同步发生，而其资产价格、货币及金融自由化反而会在老龄化时代随着国际地位而显著提升，这与日元国际化的路径颇为一致，所以 2016 年资本市场的战略地位提升是毋庸置疑的。

在此背景下，随着 12 月美联储加息兑现，债市收益率继续下行，牛市行情延续，年末资金面扰动不大。其中，1 年国债收益率下行至 2.3%，10 年期国债收益率下跌至 2.82% 附近，10 年期国债收益率下跌至 3.14% 附近。信用债在山水违约冲击后情绪缓解，中高评级追随利率债回暖，1 年的 AAA 和 AA 短融收益率分别下跌至 2.87%、3.72%，5 年 AA 企业债收益率下跌至 4.39%，7 年期下跌至 4.8%。债券市场的利率曲线平坦化进入尾声，收益率已经相当低了。考虑美联储 2016 年将加息 3-4 次，中美利率倒挂，将考验央行对汇率和政策利率的双调控能力。

四季度的中国股市整体行情回暖，但是波段震荡加剧，题材和热点的轮动趋弱，创业板、大

金融和大蓝筹在 10-11 月冲高后再次进入调整周期，市场缺乏主线和合力，量能继续萎缩，赚钱效应不足。

本基金主要由于总体风格偏成长，配置中新兴行业占比较大，因此在全年中小创明显占优的行情中相对受益。本基金始终坚持认为改革受益、资金持续宽松、市场资金持续流入权益的方向不会发生根本性改变，未来慢牛、长牛格局有望持续，长期看好，但是短期来看增量资金进入趋缓，存量博弈环境更加显著的情况下，未来精选行业、个股将会成为投资的主战场，本基金将重新寻找被错杀个股，均衡配置相关行业。

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。

4.4.2 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 1.0897 元，累计份额净值为 1.8897 元；本报告期份额净值增长率为 59.46%，同期业绩比较基准收益率为 8.82%。

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，我们认为应该降低收益率预期，市场预计能够保持震荡格局。成长股经历了三年的大牛市历程(以创业板指数为代表，2012 年底的 585 点，2015 年高点 4037 点)，估值已经处于绝对高位，因此对于基金选股来说，难度大幅提高，只有基本面能够真实验证的行业及个股，才能获得持续较好的绝对以及相对收益。

从经济基本面来看，2015 年中国经济增长数据是 6.9%，我们剔除石油价格、PPI 持续通缩，以及耐用消费品的降价，大致推算广义经济增速在去年为 5.5-6%。我们再看 PMI、财政税收、房地产投资、铁路货运量、发电量和工业增加值的数据，去年 12 月份分别为 49.7、4.4%、1%、-12%、-0.2%和 6.1%，诸多经济指标都可以验证我们一贯的预判，中国经济正处于深度调整的趋势。

展望 2016 年，我们认为，中国实际 GDP 呈现前低后高，全年约在 6.5%，名义 GDP 可能下降到 5%附近，CPI 预计将回升到 2%，主要基于猪周期和粮食价格，随着人民币贬值，会有一些的通胀压力，而楼市火爆终会蔓延到社会消费，考虑楼市去库存异常缓慢，而财政赤字提升并不能对冲美国的财政收缩，海外需求难以支撑短期出口的改观，所以投资需求很难出现春季躁动。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015 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。2015 年，为配合反洗钱工作风险管理要求，制定了反洗钱风险自评估管理办法，进一步健全和完善了公司制度体系建设。

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《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，本报告期内进行一次利润分配，以 2015 年 12 月 17 日为基准日，2015 年 12 月 30 日为权益登记日，每 10 份基金份额分红 8 元。本期利润为 40,135,305.27 元，期末可供分配利润为 78,981,913.56 元，滚存至下一期进行分配。。

4.9 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。

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（2016）6-47 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 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	<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价值增长基金 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：华富价值增长灵活配置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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,077,748,584.34	17,640,306.63
结算备付金		211,797.55	414,340.13
存出保证金		112,444.34	559,520.30
交易性金融资产	7.4.7.2	289,265,495.47	109,837,076.61
其中：股票投资		289,265,495.47	92,199,666.61
基金投资		-	-
债券投资		-	17,637,410.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	135,763.23	76,268.34
应收股利		-	-
应收申购款		216,778.95	6,457.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,367,690,863.88	128,533,969.50
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
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		-	-
应付证券清算款		241,165,414.51	10,379,813.59
应付赎回款		165,199,416.41	258,391.32
应付管理人报酬		303,658.60	162,187.10
应付托管费		50,609.78	27,031.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	356,751.45	400,376.91
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	991,740.12	400,298.74
负债合计		408,067,590.87	11,628,098.84
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	880,641,359.45	98,711,585.06
未分配利润	7.4.7.10	78,981,913.56	18,194,285.60
所有者权益合计		959,623,273.01	116,905,870.66
负债和所有者权益总计		1,367,690,863.88	128,533,969.50

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0897 元，基金份额总额 880,641,359.45 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：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
一、收入		43,543,397.12	45,640,687.77
1. 利息收入		253,342.93	637,207.45
其中：存款利息收入	7.4.7.11	228,374.69	156,550.12
债券利息收入		24,968.24	51,102.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	429,554.93
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		47,217,356.80	52,757,425.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	43,471,805.49	51,232,541.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,543,280.71	864,629.81
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	202,270.60	660,254.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-4,217,861.06	-7,818,478.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	290,558.45	64,533.41
减：二、费用		3,408,091.85	5,371,548.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,361,418.88	2,322,166.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	226,903.13	387,027.71
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,431,769.84	2,243,954.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	388,000.00	418,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,135,305.27	40,269,139.68

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,135,305.27	40,269,139.68

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：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）	98,711,585.06	18,194,285.60	116,905,870.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,135,305.27	40,135,305.27
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）	781,929,774.39	841,951,046.87	1,623,880,821.26
其中：1. 基金申购款	1,025,260,012.68	906,583,591.96	1,931,843,604.64
2. 基金赎回款	-243,330,238.29	-64,632,545.09	-307,962,783.38
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）	-	-821,298,724.18	-821,298,724.18
五、期末所有者权益（基金净值）	880,641,359.45	78,981,913.56	959,623,273.01
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）	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	-148,569,661.84	-2,517,171.59	-151,086,833.43

(净值减少以“-”号填列)			
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

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（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2009]309号）核准，基金合同于2009年7月15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光华（北京）会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健华证验（2009）综字第070003号）。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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

(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

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。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

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

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计

量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和

债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于特殊事项停牌股票，本基金根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告〔2008〕38号），参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》进行估值。

2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》（基金部通知〔2006〕37号），若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；若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，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字〔2007〕21号）采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式及红利再投资形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

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

根据《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》的有关规定，自 2015 年 3 月 20 日起，本基金采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格对持有的交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）进行估值。

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《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 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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	1,077,748,584.34	17,640,306.63
定期存款	-	-
其中:存款期限1-3个月	-	-

其他存款	-	-
合计：	1,077,748,584.34	17,640,306.63

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	286,348,963.61	289,265,495.47	2,916,531.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	286,348,963.61	289,265,495.47	2,916,531.86
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	87,357,723.80	92,199,666.61	4,841,942.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	15,344,959.89	17,637,410.00
	银行间市场	-	-
	合计	15,344,959.89	17,637,410.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	102,702,683.69	109,837,076.61	7,134,392.92

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末和上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末和上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末和上年度末无期末买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	107,058.00	1,934.59
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	104.94	205.15
应收债券利息	-	73,851.62
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	28,544.63	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	55.66	276.98
合计	135,763.23	76,268.34

注：本表列示的“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末和上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	356,751.45	400,376.91
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	356,751.45	400,376.91

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	621,740.12	298.74
应付审计费	50,000.00	80,000.00
应付信息披露费	320,000.00	320,000.00
合计	991,740.12	400,298.74

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,711,585.06	98,711,585.06
本期申购	1,025,260,012.68	1,025,260,012.68
本期赎回（以“-”号填列）	-243,330,238.29	-243,330,238.29
本期末	880,641,359.45	880,641,359.45

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
上年度末	22,245,760.91	-4,051,475.31	18,194,285.60
本期利润	44,353,166.33	-4,217,861.06	40,135,305.27
本期基金份额交易产生的变动数	868,085,752.55	-26,134,705.68	841,951,046.87
其中：基金申购款	943,963,108.49	-37,379,516.53	906,583,591.96
基金赎回款	-75,877,355.94	11,244,810.85	-64,632,545.09
本期已分配利润	-821,298,724.18	-	-821,298,724.18
本期末	113,385,955.61	-34,404,042.05	78,981,913.56

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
	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
活期存款利息收入	189,816.35	123,175.12
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	5,723.63	22,388.87
其他	32,834.71	10,986.13
合计	228,374.69	156,550.12

注：其他所列本期金额包括结算保证金利息收入 4,290.08 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 28,544.63 元；所列上年度可比期间金额包括结算保证金利息收入 10,386.15 元、申购款停留管理公司清算账户产生的申购款利息收入 599.98 元

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 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
卖出股票成交总额	424,192,873.62	777,900,548.89
减：卖出股票成本总额	380,721,068.13	726,668,007.71
买卖股票差价收入	43,471,805.49	51,232,541.18

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,543,280.71	864,629.81
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,543,280.71	864,629.81

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	60,628,746.72	49,060,246.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	56,844,833.90	48,006,331.28
减：应收利息总额	240,632.11	189,285.11
买卖债券差价收入	3,543,280.71	864,629.81

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年
----	----------------------	----------------------------

	年12月31日	12月31日
赎回基金份额对价总额	798,571.83	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	797,074.74	-
减：赎回债券应收利息总额	1,497.09	-
赎回差价收入	-	-

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期和上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内和上年度期间无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期和上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	202,270.60	660,254.86
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	202,270.60	660,254.86

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-4,217,861.06	-7,818,478.94
——股票投资	-1,925,410.95	-11,574,293.20
——债券投资	-2,292,450.11	3,755,814.26
——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	-4,217,861.06	-7,818,478.94

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	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
基金赎回费收入	286,658.39	64,069.26
转换费收入	3,900.06	464.15
合计	290,558.45	64,533.41

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	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
交易所市场交易费用	1,431,769.84	2,243,954.03
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,431,769.84	2,243,954.03

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	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
审计费用	50,000.00	80,000.00
信息披露费	320,000.00	320,000.00
自营托管账户维护费	18,000.00	18,400.00
合计	388,000.00	418,400.00

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
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
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

7.4.10 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。

7.4.10.2 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
	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管理费	1,361,418.88	2,322,166.35
其中：支付销售机构的客户维护费	243,167.54	417,309.95

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）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	226,903.13	387,027.71

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）。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

份额单位：份#

项目	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	
	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	0.00	34,000,388.89		
期间申购/买入总份额	0.00		0.00	
期间因拆分变动份额	0.00		0.00	
减：期间赎回/卖出总份额	0.00		34,000,388.89	
期末持有的基金份额	0.00		0.00	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%		0.0000%	

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。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
华安证 券	21,150,063.45	2.4000%	0.00	0.0000%

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。

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 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	
	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	1,077,748,584.34	189,816.35	17,640,306.63	123,175.12

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和上年度可比期间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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 12 月 30 日		2015 年 12 月 30 日	8.0000	815,317,255.25	5,981,468.93	821,298,724.18	
合计	-	-		8.0000	815,317,255.25	5,981,468.93	821,298,724.18	

7.4.12 期末（2015 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。

7.4.12.2 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
002207	准油股份	2015 年 12 月 16 日	重大事项停牌	21.42	-	-	88,000	1,857,477.00	1,884,960.00	-
002383	合众思壮	2015 年 12 月 15 日	重大事项停牌	41.73	2016 年 3 月 17 日	36.32	43,000	1,720,430.00	1,794,390.00	-
002235	安妮股份	2015 年 7 月 2 日	重大事项停牌	24.60	2016 年 1 月 12 日	32.00	38,838	1,618,681.73	955,414.80	-

7.4.12.3 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。

7.4.13 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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	-	-

注：本报告期末本基金未投资包括短期融资券、一年期以内的资产支持证券等短期金融产品。

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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	0.00	7,275,880.00
AAA 以下	0.00	10,361,530.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	17,637,410.00

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。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。

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 2015 年 12 月	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

31 日							
资产							
银行存款	1,077,748,584.34	-	-	-	-	-	1,077,748,584.34
结算备付金	211,797.55	-	-	-	-	-	211,797.55
存出保证金	112,444.34	-	-	-	-	-	112,444.34
交易性金融资产	-	-	-	-	-	289,265,495.47	289,265,495.47
应收利息	-	-	-	-	-	135,763.23	135,763.23
应收申购款	-	-	-	-	-	216,778.95	216,778.95
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,078,072,826.23	-	-	-	-	289,618,037.65	1,367,690,863.88
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	241,165,414.51	241,165,414.51
应付赎回款	-	-	-	-	-	165,199,416.41	165,199,416.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	303,658.60	303,658.60
应付托管费	-	-	-	-	-	50,609.78	50,609.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	356,751.45	356,751.45
其他负债	-	-	-	-	-	991,740.12	991,740.12
负债总计	-	-	-	-	-	408,067,590.87	408,067,590.87
利率敏感度缺口	1,078,072,826.23	-	-	-	-	-118,449,553.22	959,623,273.01
上年度末 2014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	17,640,306.63	-	-	-	-	-	17,640,306.63
结算备付金	414,340.13	-	-	-	-	-	414,340.13
存出保证金	559,520.30	-	-	-	-	-	559,520.30
交易性金融资产	-	9,959,710.00	7,677,700.00	-	-	92,199,666.61	109,837,076.61
应收利息	-	-	-	-	-	76,268.34	76,268.34
应收申购款	-	-	-	-	-	6,457.49	6,457.49
资产总计	18,614,167.06	9,959,710.00	7,677,700.00	-	-	92,282,392.44	128,533,969.50
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,379,813.59	10,379,813.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	258,391.32	258,391.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	162,187.10	162,187.10
应付托管费	-	-	-	-	-	27,031.18	27,031.18

应付交易费用	-	-	-	-	400,376.91	400,376.91
其他负债	-	-	-	-	400,298.74	400,298.74
负债总计	-	-	-	-	11,628,098.84	11,628,098.84
利率敏感度缺口	18,614,167.06	9,959,710.00	7,677,700.00	-	80,654,293.60	116,905,870.66

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。

7.4.13.4.1.2 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（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	0.00	355,192.93
	市场利率上升 25 基点	0.00	-351,190.46

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 2015年12月31日		上年度末 2014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	289,265,495.47	30.14	92,199,666.61	78.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	17,637,410.00	15.09
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	289,265,495.47	30.14	109,837,076.61	93.95

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	15,131,782.33	1,906,287.71
	沪深 300 指数下降 5%	-15,131,782.33	-1,906,287.71

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（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	合计	65,720,737.37	1,873,102.01

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	2015 年 12 月 31 日公允价值	2014 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	284,630,730.67	100,486,688.25
第二层次	4,634,764.80	9,350,388.36

第三层次	-	-
合计	289,265,495.47	109,837,076.61

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	289,265,495.47	21.15
	其中：股票	289,265,495.47	21.15
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,077,960,381.89	78.82
7	其他各项资产	464,986.52	0.03
8	合计	1,367,690,863.88	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	1,738,140.00	0.18
B	采矿业	1,884,960.00	0.20
C	制造业	76,552,912.76	7.98
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	11,766,262.19	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,705,440.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,366,320.00	1.29
J	金融业	183,213,450.52	19.09
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	38,010.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	289,265,495.47	30.14

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	601398	工商银行	13,800,000	63,204,000.00	6.59
2	601988	中国银行	15,000,000	60,150,000.00	6.27
3	600016	民生银行	2,999,943	28,919,450.52	3.01
4	300016	北陆药业	588,000	20,879,880.00	2.18
5	601288	农业银行	6,000,000	19,380,000.00	2.02
6	002665	首航节能	618,000	18,849,000.00	1.96
7	300045	华力创通	580,006	14,186,946.76	1.48
8	601939	建设银行	2,000,000	11,560,000.00	1.20
9	300099	尤洛卡	388,830	10,747,261.20	1.12
10	300051	三五互联	380,000	10,070,000.00	1.05
11	002727	一心堂	158,893	9,188,782.19	0.96
12	000971	高升控股	128,000	3,377,920.00	0.35
13	300093	金刚玻璃	100,000	3,170,000.00	0.33
14	002520	日发精机	98,000	2,592,100.00	0.27

15	600203	福日电子	188,000	2,577,480.00	0.27
16	300352	北信源	36,800	2,296,320.00	0.24
17	002207	准油股份	88,000	1,884,960.00	0.20
18	002383	合众思壮	43,000	1,794,390.00	0.19
19	600598	北大荒	118,000	1,738,140.00	0.18
20	600834	申通地铁	88,000	1,705,440.00	0.18
21	002235	安妮股份	38,838	955,414.80	0.10
22	000681	视觉中国	1,000	38,010.00	0.00

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	601398	工商银行	63,392,000.00	54.22
2	601988	中国银行	60,200,000.00	51.49
3	600016	民生银行	28,064,267.99	24.01
4	300016	北陆药业	21,098,481.55	18.05
5	601288	农业银行	19,440,000.00	16.63
6	002665	首航节能	16,304,209.65	13.95
7	300045	华力创通	14,681,768.12	12.56
8	601939	建设银行	11,590,000.00	9.91
9	300099	尤洛卡	10,893,639.79	9.32
10	300051	三五互联	10,075,640.50	8.62
11	600750	江中药业	9,973,662.55	8.53
12	600571	信雅达	9,008,353.16	7.71
13	002727	一心堂	8,943,717.12	7.65
14	000997	新大陆	8,858,812.88	7.58
15	600570	恒生电子	7,830,875.43	6.70
16	601166	兴业银行	6,304,351.50	5.39
17	601000	唐山港	5,862,294.00	5.01
18	000078	海王生物	5,795,254.32	4.96
19	603939	益丰药房	5,420,162.86	4.64
20	002407	多氟多	5,130,156.40	4.39
21	600048	保利地产	4,786,462.50	4.09
22	000401	冀东水泥	4,683,790.08	4.01

23	600028	中国石化	4,670,745.74	4.00
24	600340	华夏幸福	4,644,086.49	3.97
25	002556	辉隆股份	4,541,123.00	3.88
26	600276	恒瑞医药	4,443,403.60	3.80
27	002235	安妮股份	4,218,347.07	3.61
28	600150	中国船舶	4,162,300.00	3.56
29	002279	久其软件	4,001,643.00	3.42
30	000090	天健集团	3,989,870.00	3.41
31	002714	牧原股份	3,793,369.00	3.24
32	300041	回天新材	3,771,034.74	3.23
33	002030	达安基因	3,578,073.00	3.06
34	300093	金刚玻璃	3,399,242.00	2.91
35	000559	万向钱潮	3,368,380.00	2.88
36	000400	许继电气	3,320,378.58	2.84
37	600090	啤酒花	3,210,956.26	2.75
38	601333	广深铁路	3,135,000.00	2.68
39	002201	九鼎新材	3,043,333.00	2.60
40	600203	福日电子	3,026,572.00	2.59
41	300325	德威新材	2,982,850.00	2.55
42	600598	北大荒	2,953,074.00	2.53
43	300231	银信科技	2,949,378.72	2.52
44	002520	日发精机	2,896,397.64	2.48
45	600172	黄河旋风	2,862,998.60	2.45
46	600382	广东明珠	2,856,462.50	2.44
47	000971	高升控股	2,851,236.00	2.44
48	300038	梅泰诺	2,832,874.82	2.42
49	601992	金隅股份	2,828,000.00	2.42
50	300439	美康生物	2,806,078.00	2.40
51	300299	富春通信	2,801,540.00	2.40
52	000503	海虹控股	2,757,391.00	2.36
53	600895	张江高科	2,709,200.00	2.32
54	300336	新文化	2,675,154.00	2.29
55	002332	仙琚制药	2,651,916.52	2.27
56	300205	天喻信息	2,573,788.00	2.20
57	300254	仟源医药	2,562,746.00	2.19
58	002007	华兰生物	2,445,066.23	2.09

59	002124	天邦股份	2,442,600.00	2.09
60	300133	华策影视	2,439,828.40	2.09
61	600651	飞乐音响	2,408,725.00	2.06
62	002292	奥飞动漫	2,398,400.00	2.05
63	600149	廊坊发展	2,373,518.00	2.03
64	002063	远光软件	2,368,186.60	2.03
65	300251	光线传媒	2,354,146.00	2.01
66	600827	百联股份	2,350,395.00	2.01
67	002313	日海通讯	2,346,990.48	2.01

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	300226	上海钢联	12,108,059.34	10.36
2	600750	江中药业	10,779,409.50	9.22
3	000997	新大陆	10,472,685.64	8.96
4	600153	建发股份	9,177,942.87	7.85
5	600570	恒生电子	8,359,105.26	7.15
6	600571	信雅达	7,907,495.72	6.76
7	000100	TCL 集团	7,328,275.00	6.27
8	601166	兴业银行	6,882,145.95	5.89
9	601000	唐山港	6,798,176.30	5.82
10	000078	海王生物	6,558,880.54	5.61
11	600827	百联股份	6,270,068.00	5.36
12	002556	辉隆股份	6,261,825.00	5.36
13	600895	张江高科	6,243,651.83	5.34
14	000401	冀东水泥	5,924,523.70	5.07
15	600276	恒瑞医药	5,564,128.48	4.76
16	600340	华夏幸福	5,266,699.65	4.51
17	002393	力生制药	5,260,387.69	4.50
18	002407	多氟多	5,224,576.08	4.47
19	603939	益丰药房	5,204,076.00	4.45
20	000651	格力电器	5,070,855.00	4.34
21	600150	中国船舶	4,972,685.00	4.25

22	600028	中国石化	4,642,115.95	3.97
23	300299	富春通信	4,623,007.75	3.95
24	002124	天邦股份	4,618,611.26	3.95
25	002084	海鸥卫浴	4,600,699.51	3.94
26	600158	中体产业	4,256,356.05	3.64
27	600048	保利地产	4,212,351.97	3.60
28	000559	万向钱潮	4,064,046.90	3.48
29	002714	牧原股份	4,058,146.74	3.47
30	600639	浦东金桥	4,001,863.06	3.42
31	300336	新文化	3,920,001.72	3.35
32	002332	仙琚制药	3,877,390.95	3.32
33	300367	东方网力	3,866,390.04	3.31
34	600172	黄河旋风	3,858,907.50	3.30
35	300224	正海磁材	3,816,084.50	3.26
36	300162	雷曼股份	3,686,671.00	3.15
37	002182	云海金属	3,508,059.95	3.00
38	000503	海虹控股	3,477,416.00	2.97
39	600382	广东明珠	3,411,832.50	2.92
40	300171	东富龙	3,355,682.00	2.87
41	600313	农发种业	3,339,252.80	2.86
42	300183	东软载波	3,308,916.90	2.83
43	000400	许继电气	3,255,600.00	2.78
44	601018	宁波港	3,167,059.49	2.71
45	600651	飞乐音响	3,133,183.00	2.68
46	601333	广深铁路	3,121,951.28	2.67
47	300041	回天新材	3,121,738.00	2.67
48	600784	鲁银投资	3,117,781.86	2.67
49	002030	达安基因	3,089,065.12	2.64
50	000090	天健集团	3,053,710.00	2.61
51	600661	新南洋	3,031,121.00	2.59
52	600867	通化东宝	2,935,838.66	2.51
53	002665	首航节能	2,902,990.32	2.48
54	600161	天坛生物	2,869,514.64	2.45
55	002292	奥飞动漫	2,792,231.56	2.39
56	002007	华兰生物	2,696,829.00	2.31
57	300133	华策影视	2,696,752.25	2.31
58	002312	三泰控股	2,693,600.00	2.30
59	300246	宝莱特	2,689,060.00	2.30

60	000663	永安林业	2,651,841.00	2.27
61	300050	世纪鼎利	2,650,647.90	2.27
62	002235	安妮股份	2,590,567.14	2.22
63	601992	金隅股份	2,585,979.94	2.21
64	300231	银信科技	2,551,980.00	2.18
65	002201	九鼎新材	2,511,040.00	2.15
66	300254	仟源医药	2,451,516.00	2.10
67	600149	廊坊发展	2,445,448.30	2.09
68	002063	远光软件	2,381,608.74	2.04
69	000916	华北高速	2,374,375.90	2.03
70	300065	海兰信	2,361,521.00	2.02
71	002279	久其软件	2,351,013.92	2.01

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。

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	579,712,307.94
卖出股票收入（成交）总额	424,192,873.62

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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	112,444.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	135,763.23
5	应收申购款	216,778.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	464,986.52

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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
2,539	346,845.75	849,921,472.78	96.51%	30,719,886.67	3.49%

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	8,247.30	0.0009%

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 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

§ 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	98,711,585.06
本报告期基金总申购份额	1,025,260,012.68
减:本报告期基金总赎回份额	243,330,238.29
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	880,641,359.45

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。

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 5 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	
光大证券	1	388,183,449.25	38.86%	358,060.52	39.52%	-
国信证券	2	314,502,613.93	31.49%	282,695.23	31.20%	-
川财证券	1	254,081,712.74	25.44%	227,095.40	25.06%	-
齐鲁证券	1	42,050,629.90	4.21%	38,275.85	4.22%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

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
光大证券	65,093,118.00	67.22%	-	-	-	-
国信证券	27,519,863.45	28.42%	-	-	-	-
川财证券	4,217,468.16	4.36%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
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。

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	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续参加中国工商银行个人电子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	2015年1月5日
2	《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2015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	2015年1月8日
3	《华富基金管理有限公司关于网上直销交易平台上海银联支付渠道暂停部分服务的通知》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年1月13日
4	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金2014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	2015年1月22日

5	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2015 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	2015 年 2 月 28 日
6	《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联泰资产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	2015 年 3 月 3 日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加上海联泰资产管理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	2015 年 3 月 3 日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（百联股份）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 17 日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加齐鲁证券有限公司网上交易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	2015 年 3 月 21 日
10	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（永安林业）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 21 日
11	《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工商银行个人电子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	2015 年 3 月 31 日
12	《华富基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 31 日

13	《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》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 31 日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（金一文化）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 4 月 2 日
15	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（神州高铁）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 4 月 2 日
16	《华富基金管理有限公司关于恢复网上直销交易平台上海银联通支付渠道服务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 4 月 8 日
17	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2015 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	2015 年 4 月 21 日
18	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（富春通信）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 4 月 24 日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（顺网科技）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 5 月 12 日
20	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（多氟多）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 5 月 21 日
21	《华富基金管理有限公司关于旗	在《中国证券报》、	2015 年 5 月 28 日

	下部分开放式基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告》	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
22	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（上海钢联）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年6月2日
23	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（益丰药房）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年6月11日
24	《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》、《证券时报》上公告	2015年6月12日
25	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（信雅达）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年6月19日
26	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中信建投证券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	2015年6月25日
27	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费优惠的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年6月30日
28	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（尤洛卡）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年6月30日
29	《华富基金管理有限公司关于旗	在《中国证券报》、	2015年7月1日

	下部分开放式基金参加杭州数米基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
30	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加上海汇付金融服务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	2015 年 7 月 3 日
31	《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汇付金融服务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	2015 年 7 月 3 日
32	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（新宁物流）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 7 月 3 日
33	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（安妮股份）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 7 月 6 日
34	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（九鼎新材）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 7 月 7 日
35	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（首航节能）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 7 月 7 日
36	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（北陆药	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 7 月 8 日

	业)》		
37	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告（德威新材)》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 7 月 8 日
38	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2015 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	2015 年 7 月 18 日
39	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浦发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	2015 年 8 月 3 日
40	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与泰诚财富基金销售（大连）有限公司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	2015 年 8 月 6 日
41	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泰诚财富基金销售（大连）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	2015 年 8 月 6 日
42	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 8 月 29 日
43	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2015 年第 2 号)》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 8 月 29 日
44	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》（黄河旋风)	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 8 月 29 日

45	《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市新兰德证券投资咨询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	2015 年 9 月 2 日
46	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳市新兰德证券投资咨询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	2015 年 9 月 2 日
47	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华宝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	2015 年 9 月 16 日
48	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》（东方网力）	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 9 月 16 日
49	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》（久其软件）	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 9 月 16 日
50	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》（蓝鼎控股）	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 9 月 22 日
51	《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	2015 年 9 月 23 日
52	《华富基金管理有限公司关于聘	在《中国证券报》、	2015 年 9 月 29 日

	任副总经理的公告》(曹华玮)	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
53	《华富基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告》(龚炜)	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 9 月 29 日
54	《价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2015 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	2015 年 10 月 27 日
55	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加中信期货为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 11 月 13 日
56	《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》、《证券时报》上公告	2015 年 11 月 20 日
57	《华富基金管理有限公司关于暂停网上直销系统银联通支付通道交易业务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 11 月 25 日
58	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》(北陆药业)	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 11 月 26 日
59	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》(首航节能)	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 11 月 28 日
60	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》(海兰信)	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 12 月 3 日
61	《华富基金管理有限公司关于旗	在《中国证券报》、	2015 年 12 月 18 日

	下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》(合众思壮)	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
62	《关于华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2015 年分红公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 12 月 28 日
63	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京乐融多源投资咨询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	2015 年 12 月 28 日
64	《关于指数熔断机制实施后华富基金管理有限公司旗下相关公募基金开放时间调整的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 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、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

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。