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

华富量子生命力股票型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12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	华富量子生命力股票型证券投资基金
基金简称	华富量子生命力股票
基金主代码	410009
交易代码	410009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月1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	78,151,610.46份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采用数量化投资方法,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	本基金在进行资产配置时,主要根据基金管理人开发的"估值驱动战略资产配置模型",通过对市场未来1-3个月整体估值水平进行预测,实现基金在股票、债券及现金之间的合理配置。模型从市场估值的驱动因素出发,通过寻找与市场走势相关性最大的因子组合,构建市场趋势预测模型。该因子主要包括的驱动因子包括但不限于:经济面因子、供求面因子、政策面因子、估值面因子、情绪面因子、盈利面因子。模型结果最终汇总为一个综合的配置指标,通过对市场未来走势的预测结果,调整基金在各类资产之间的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。一般情况下,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	ZHANGBO746@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	6,550,717.91	5,336,094.42	-25,014,700.89
本期利润	8,702,680.56	4,681,065.12	-4,520,748.52
加权平均基金份额本期利润	0.1262	0.0416	-0.0315
本期基金份额净值增长率	18.89%	0.30%	-2.90%
3.1.2 本期数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1696	-0.2747	-0.3235
期末基金资产净值	67,432,096.02	56,466,359.78	94,864,110.86
期末基金份额净值	0.8628	0.7257	0.7235

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。

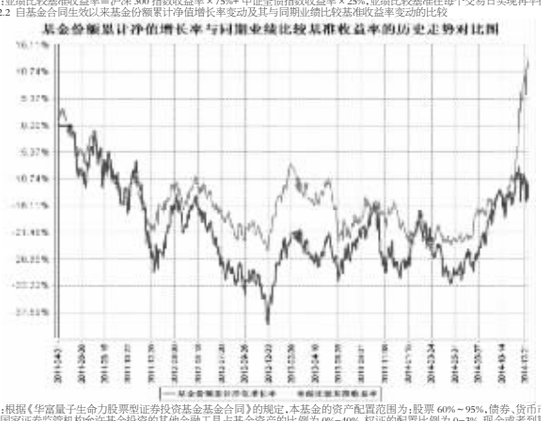
3.2 基金净值表现

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	0.52%	1.54%	32.85%	1.24%	-32.33%	0.30%
过去六个月	17.87%	1.33%	46.44%	0.99%	-28.57%	0.34%
过去一年	18.89%	1.31%	40.69%	0.91%	-21.80%	0.40%
过去三年	15.80%	1.36%	41.97%	0.97%	-26.17%	0.39%
自基金合同生效起至今	-13.72%	1.35%	13.69%	0.97%	-27.41%	0.38%

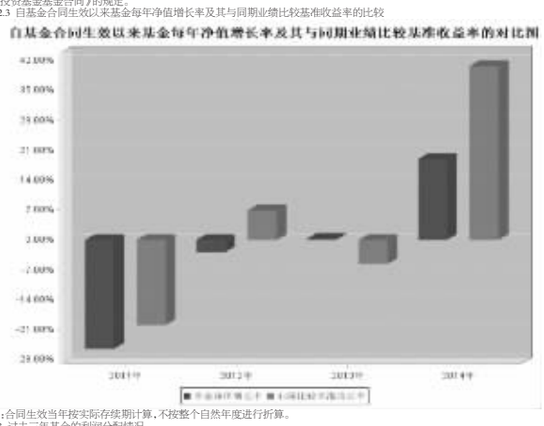
注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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



注:根据《华富量子生命力股票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60%~95%,债券、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比例为0%-40%,权证的配置比例为0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券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2011年4月1日到2011年10月1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《华富量子生命力股票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



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
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		
朱蓓	华富量子生命力股票型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理	2011年4月1日	-	八年	上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历,曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理。2009年11月进入华富基金管理有限公司,曾任金融工程研究员、产品设计经理。
孔庆卿	华富量子生命力股票型基金基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理	2013年8月30日	-	六年	英国曼彻斯特大学统计学博士,博士研究生学历。2009年8月进入华富基金管理有限公司,曾任金融工程研究员、华富中小板指数增强型基金基金经理助理、华富中证100指数基金基金经理助理。

注:朱蓓的任职日期指该基金成立之日,孔庆卿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 管理人对投资决策的说明

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,该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年中国经济步入了新政府主导的库存周期的下降阶段,全年实际GDP仅增长7.4%,名义GDP增长8.2%,房地产投资仅有10%,基建投资增长20%,二者一起拖累固定投资仅增长15%,外贸出口受汇率升值影响继续下滑,全年增长6%,进口仅增长0.4%,CPI全年不足2%,PPI受制于大宗商品价格暴跌全年下跌1.9%。按照我们的框架,2014年的经济形势的确是比较严峻的,这给予了货币政策更多的宽松空间,2014年也是央行首次将公开市场操作当作管理市场预期的关键工具,同时创设并推广了一系列新货币工具,如PSL、SLF、SLO、MLF等,中国版的量化宽松框架正在形成,11月份央行终于降息,春节前再次降准,标志着货币政策走向宽松。不过,我们保守地认为,特别是地方债务仍处于整顿清理的微妙窗口,因此2014年的财政政策不能没有积极作用,中央的底线思维没有得到有效贯彻,社会融资成本仍处高位,民生项目开工和地方基础建设持续低于我们的预期,财政约束、央地冲突以及债务瓶颈是经济下降周期政府迫问管理的最大挑战。

2014年是股债双牛的一年,大类资产里,股票、利率、信用及可转债均有不错的收益,全年上证指数上涨52.87%,创业板指上涨12.83%,中小板指上涨9.67%,中证国债净价指数上涨7%,中证信用净价指数上涨4.25%,上证企债30指数上涨7.24%,可转债指数上涨57%。

2014年,量子生命力在符合量化模型的基础上,对热点板块做了一定的主动投资。操作中,我们遵循量化投资理念,加强了对成长股的研究,不断优化我们的投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2011年4月1日正式成立,截止2014年12月31日,本基金份额净值为0.8628元,累计份额净值为0.8628元。报告期,本基金份额净值增长率为18.89%,同期业绩比较基准收益率为40.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于十三五规划即将启动,十九大将于2017年召开,我们认为,2015年中国各级政府迫于内外形势,会持续加大基建投资的力度,债务问题短期会通过PPP、国资改革、股权融资、资产证券化等多样化手段来托底,继续时间换空间。特别是去年四季度,随着全球一致预期美联储将于2015年6月启动加息,大宗商品价格暴跌,虽然降低了工业化国家经济复苏的输入性通胀,但是也带来了经济二次探底的压力,进入2015年以来,美国、日本和欧元区的经济数据急转直下,PMI大幅下滑,欧元区再次被迫启动量化宽松,持续购买1万亿的欧元债券直到2016年,这加剧了其负利率,此后印度、俄罗斯、澳大利亚等各国纷纷跟进降息,少人2015年全球委息交易再次卷土重来,人民币汇率也面临很大的贬值压力。零利率时代各国货币竞相贬值,外围的放水也会倒逼美联储重新考虑加息的问题,可以预见今年我国货币政策会有较大放松空间,春节后继续降准降息可期。而随着老龄化加快、收入放缓导致的需求不足,债务型通缩压力日益突显,中国政府大概率会启动新的财政刺激方案,例如日贸区、一路一带、经济带等投资规划,来对冲未来的周期性负债和经济悬崖,拉动地方经济的新增长点,总之7%的经济底线在今年是要托住的。

展望2015年,我们认为依然不会爆发系统性金融问题,但是经济形势依然是低迷的,需求复苏是个缓慢的筑底过程,而美联储对加息的犹豫以及央行继续宽松货币,对于股市和债市二季度的行情应该会有支撑。2015年权益资产仍将继续关注业绩确定性较高的估值相对较低的行业龙头和白马股,以及政府经济刺激方案利好的相关主题板块,如京津冀、一带一路、铁路投资等,同时国企和央企改革仍将贯穿全年,适合提前布局,此外还需关注长期行业空间巨大的互联网平台、可穿戴设备、国防安全、信息安全、智能机器人等相关行业及个股。

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,保证估值未被误曲以及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《华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本期利润为8,702,680.56,期末可供分配利润为-13,255,644.84。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")在对华富量子生命力基金(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]6-47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	华富量子生命力股票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量子生命力股票型证券投资基金(以下简称"华富量子生命力基金")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量子生命力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量子生命力基金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。
注册会计师的姓名	曹小勤 林品
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:华富量子生命力股票型证券投资基金

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
资产:		
银行存款	4,459,748.14	5,971,883.28
结算备付金	158,882.43	386,529.86
存出保证金	115,803.02	235,353.11
交易性金融资产	63,626,628.14	50,949,015.84
其中:股票投资	63,626,628.14	50,949,015.84
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	949,784.39	-
应收利息	2,009.13	2,408.39
应收股利	-	-
应收申购款	-	4,260.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	69,312,855.25	57,549,451.27
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
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	514,747.68	465,975.79
应付赎回款	764,249.93	10,198.92
应付管理人报酬	79,386.76	71,439.16
应付托管费	13,231.13	11,906.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	188,606.07	123,165.54
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	320,537.66	400,405.56
负债合计	1,880,759.23	1,083,091.49
所有者权益:		
实收基金	78,151,610.46	77,805,746.35
未分配利润	-10,719,514.44	-21,339,386.57
所有者权益合计	67,432,096.02	56,466,359.78
负债和所有者权益总计	69,312,855.25	57,549,451.27

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值0.8628元,基金份额总额78,151,610.46份。

7.2 利润表

会计主体:华富量子生命力股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	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
一.收入	10,841,144.24	7,755,920.40
1.利息收入	64,438.50	291,512.88
其中:存款利息收入	64,438.50	109,337.47
债券利息收入	-	21.18
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	182,154.23
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	8,612,353.01	7,947,549.92
其中:股票投资收益	8,270,018.56	7,000,968.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	20,076.82
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	342,334.45	926,504.14
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,151,962.65	-655,029.30
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	12,390.08	171,886.90
减:二.费用	2,138,463.68	3,074,855.28
1. 管理人报酬	806,750.22	1,282,502.82
2. 托管费	134,458.54	213,750.46
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	876,854.92	1,157,202.00
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	320,400.00	421,400.00
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	8,702,680.56	4,681,065.12
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	8,702,680.56	4,681,065.12

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富量子生命力股票型证券投资基金

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)	77,805,746.35	-21,339,386.57	56,466,359.78
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	8,702,680.56	8,702,680.56
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)	345,864.11	1,917,191.57	2,263,055.68
其中:1.基金申购款	25,813,203.04	-3,214,939.31	22,598,263.73
2.基金赎回款	-25,467,338.93	5,132,130.88	-20,335,208.05
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)	78,151,610.46	-10,719,514.44	67,432,096.02

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)	131,110,509.63	-36,246,398.77	94,864,110.86
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	4,681,065.12	4,681,065.12
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)	-53,304,763.28	10,225,947.08	-43,078,816.20
其中:1.基金申购款	4,558,577.83	-1,141,495.05	3,417,082.78
2.基金赎回款	-57,863,341.11	11,367,442.13	-46,495,898.98
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)	77,805,746.35	-21,339,386.57	56,466,359.78

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

华富量子生命力股票型证券投资基金(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《华富量子生命力股票型证券投资基金基金合同》发起,经中国证监监督管理委员会证监基金字[2010]1585号文核准募集设立。本基金自2011年2月28日起公开向社会发行,至2011年3月25日募集结束。经天健正信会计师事务所验资并出具(验资报告)(天健正信验(2011)综字第020032号)后,向中国证监会报送基金备案材料。本次募集资金总额为人民币293,506,500.23元;募集资金的银行存款利息共计人民币148,404.31元,折成基金份额,归投资人所有;设立募集期共募集293,654,904.54份基金单位。本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人华富基金管理有限公司,基金托管人为深圳发展银行股份有限公司;有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2011年4月1日生效,该日的基金份额为293,654,904.54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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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,继续免征收营业税。

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

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

7.4.6.5 基金买卖股票,经国务院批准,从2008年4月24日起正券(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

项目	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	806,750.22	1,282,502.82
其中:支付销售机构的客户维护费	290,249.06	362,112.01

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×年管理费率÷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 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
当期发生的基金应支付的托管费	134,458.54	213,750.46

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×年托管费率÷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 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
基金合同生效日(2011年4月1日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,007,750.00	10,007,750.00
期间申购/买入总份额	22,614,044.60	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	32,621,794.60	10,007,750.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	41.7400%	12.8600%

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

本报告期末和上年度末没有其他关联方投资本基金的情况。

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	4,459,748.14	58,218.08	5,971,883.28	95,227.43

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

本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---