华富保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）

（2015年第1号）

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

重要提示

华富保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”） 2013年1月29日证监许可[2013]69号文核准,本基金基金合同于2013年4月24日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。本基金为保本混合型基金,属证券投资基金中的低风险品种;本基金变更为“华富安鑫债券型证券投资基金”后属于证券市场中的较低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于一般混合型基金和股票型基金。本基金初始募集净值1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值。本基金未持有到期,投资者赎回时不能获得保本保证,将承担市场波动的风险。

本基金依照恒定比例保本策略将基金资产配置于保本资产与风险资产:保本资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据和企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）、债券回购、货币市场工具和银行存款等;风险资产为股票、权证等权益类资产。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为: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%。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存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。本基金基金份额持有人在当期保本周期内申购或转换转入,或在当期保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出的基金份额不适用保本条款,保本条款详见本基金基金合同及本招募说明书。

投资人购买本保本基金基金份额的行为视为同意保证合同的约定。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年4月24日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称:华富基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
邮政编码:200120
法定代表人:章宏韬
设立日期:2004年4月19日
核准设立机关:中国证监会
核准设立文号:中国证监会证监基金字【2004】47号
组织形式:有限责任公司
注册资本:1.2亿元人民币
存续期间:持续经营
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务
联系人:邵恒
电话:021-68886996
传真:021-68887997
股权结构:华安证券股份有限公司49%、安徽省信用担保集团有限公司27%、合肥兴泰控股集团有限公司24%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

章宏韬先生,董事长,本科学历,工商管理硕士,经济师。历任安徽省农村经济管理干部学院政治处职员,安徽省农村经济委员会调查研究处秘书、副科秘书,安徽证券交易中心综合部(办公室)经理助理、副经理（副主任）,安徽省证券公司合肥蒙城路营业部总经理,华安证券有限责任公司办公室副主任、总裁助理兼办公室主任、副总裁,现任华安证券股份有限公司总经理,兼任华安期货有限责任公司董事。

李工先生,董事,本科学历,工商管理硕士。历任合肥市财政局副科长、科长、副局长,合肥市信托投资公司经理;合肥市政府副秘书长、合肥市财政局党组书记,合肥市商业银行董事长、党组书记、行长;合肥市政府副秘书长,办公厅主任、党组副书记;肥西县委书记、县人大主任;安徽省农村信用联合社副理事长、副主任（主持工作）;华安证券有限责任公司董事长、党委书记。现任华安证券股份有限公司董事长、党委书记,兼任华安期货有限责任公司董事。

范强先生,董事,大专学历,历任安徽省财政厅工交处副主任科员、主任科员、副处长,安徽省财政厅工交处副处长,省地税局直属分局副局长、局长,省地税局计财处处长,省地税局财监处处长,安徽省信用担保集团副总经理兼任华安证券董事、皖煤投资有限公司董事长,现任安徽省信用担保集团副总经理、党委委员。

刘庆年先生,董事,大学本科学历。历任解放军某部排长、指导员,副营职干事,合肥市财政局党组秘书、合肥高新技术开发区财政局副局长（主持工作）、合肥市财政证券公司总经理（法人代表）,国元证券寿春路第二营业部总经理,华富基金管理有限公司督察长。

姚怀然先生,董事,学士学位,研究生学历。历任中国人民银行安徽省分行金融管理处主任科员,安徽省证券公司营业部经理、总办主任、总经理助理兼证券投资总部总经理,华安证券有限责任公司总裁助理兼证券投资总部总经理,华富基金管理有限公司董事长。现任华富基金管理有限公司总经理、上海华富利得资产管理有限公司董事长。

刘瑞中先生,独立董事,研究生学历。历任安徽铜陵财专教师,中国经济体制改革研究所助理研究员、信息部主任,中国国际期货经纪有限公司任信息部经理、深圳公司副总经理,北京商品交易所常务副总裁,深圳特区证券公司（现巨田证券）高级顾问。现任北京华创投资管理有限公司总裁,深圳神华期货经纪有限公司独立董事,冠通期货经纪有限公司独立董事。

陈庆平先生,独立董事,工商管理硕士。历任上海金融专科学校讲师、处长,申银证券公司哈尔滨营业部总经理,上海鑫兆投资管理咨询有限公司顾问,宁波国际银行上海分行行长,上海金融学院客座教授。

汪明华先生,独立董事,法律研究生学历。历任安徽省高级人民法院审判员、处长、主任,合肥市中级人民法院副院长、省高级法院经济庭、民二庭庭长等职。现任安徽承义应用法学研究所所长。

2、基金管理人监事会成员

王忠道先生,监事会主席,本科学历。历任上海财经大学金融理论教研室助教,安徽省财政厅副主任科员,安徽信托投资公司部门经理、安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省皖煤投资有限公司总经理。现任安徽省信用担保集团有限责任公司总经济师。

梅鹏军先生,监事,金融学博士,高级经济师。先后在安徽省国际经济技术合作公司,安徽省物资局（后更名为安徽省徽商集团）工作,历任合肥兴泰控股集团有限公司投资发展部业务经理,合肥兴泰控股集团有限公司金融研究所副所长。现任合肥兴泰控股集团有限公司金融研究所所长,安徽大学经济学院金融硕士研究生兼职导师。

李宏升先生,监事,本科学历。历任国元证券斜土路营业部交易部经理,交通银行托管部基金会计、基金清算。现任华富基金管理有限公司综合管理部总监。

岳红婷女士,监事,大专学历。历任中国银行安徽分行综合计划处、外汇信贷处任科员,中国银行东方信托投资公司上海总部副经理,安徽省证券公司投资总部副经理,华安证券研究所资产管理部经理,2002年12月参与华富基金管理有限公司筹建,曾任华富基金管理有限公司机构理财部总监,现任华富基金管理有限公司总经理助理。

3、基金高级管理人员及督察长

章宏韬先生,董事长,简历同上。

姚怀然先生,总经理,简历同上。

满志弘女士,督察长,管理学硕士,CPA。曾任道勤控股股份有限公司财务部总经理,华富基金管理有限公司监察稽核部副总监兼董事会秘书,上海华富利得资产管理有限公司监事,现任华富基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

陈大毅先生,副总经理,硕士学位。曾先后供职于安徽省证券公司上海自忠路营业部、徐家汇路营业部,华安证券上海总部,华安证券网络经纪公司（筹）。曾任华富基金管理有限公司总经理助理兼运作保障部总监。现任华富基金管理有限公司副总经理,上海华富利得资产管理有限公司董事、总经理。

4、本基金基金经理简介

胡伟先生,中南财经政法大学经济学学士、本科学历,十一年证券从业经历,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,历任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监、灵活配置混合型基金基金经理,现任华富基金管理有限公司固定收益部总监、公司公募投资决策委员会成员、华富收益增强债券型证券投资基金基金经理、华富保本混合型证券投资基金基金经理、华富恒富分级债券型证券投资基金基金经理、华富恒财分级债券型基金基金经理、华富恒稳纯债债券型基金基金经理、华富旺财保本混合型基金基金经理。

张惠女士,合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历,八年证券从业经历,2007年6月加入华富基金管理有限公司,历任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员、华富策略精选混合型基金基金经理助理、华富保本混合型基金基金经理助理,现任华富保本混合型基金基金经理、华富旺财保本混合型基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会是负责基金投资决策的最高权力机构,由公司分管投资业务的领导、涉及投资和研究的部门的业务负责人以及投资决策委员会认可的其他人员组成。投资决策委员会主席由公司分管投资业务的最高业务领导担任,负责投决会的召集和主持。

投资决策委员会成员姓名和职务如下:

龚炜先生	公司公募投资决策委员会主席、公司总经理助理、投研总监兼基金投资部总监
胡伟先生	公司公募投资决策委员会成员、固定收益部总监
王光力先生	公司公募投资决策委员会成员、研究发展部总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称: 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
成立时间: 1992年10月19日

经营范围:经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准,公司主营业务主要包括:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理结算;办理票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券;同业拆借;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保险箱业务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外币兑换;国际结算;同业外汇拆借;外汇票据的承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;结汇、售汇;买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券;自营外汇买卖;代客外汇买卖;资信调查、咨询、见证业务;离岸银行业务;证券投资基金托管业务;全国社会保障基金托管业务;经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式: 股份有限公司
注册资本: 186.53亿元人民币
存续期间: 持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人: 朱萍
联系电话:（021）61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务, 是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部,2005年更名为资产托管部,2013年再次更名为资产托管与养老金业务部,目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、运营管理处五个职能处室。

目前,上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构:
名称:华富基金管理有限公司直销中心和网上交易系统
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
法定代表人:章宏韬
办公地址:海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
联系人:方萍
咨询电话:021-50619688,400-700-8001
传真:021-68415680
网址:www.hffund.com

2、代销机构:

（1）上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:021-61618888
传真:021-63604199
联系人:高天、虞谷云
客户服务热线:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

（2）中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
客服电话:95533
网址:www.ccb.com
联系人:王琳

（3）交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:021-95559
传真:021-62701216
联系人:曹榕
客户电话:95559
公司网址:www.bankcomm.com

（4）中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:常振明
客服电话:95558
联系人:郭伟
传真:010-65550827
网址: bank.ecitic.com

（5）北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
联系人:谢小华
传真:010-66226045
客服电话:95526
公司网址:www.bankofbeijing.com.cn

（6）渤海银行股份有限公司
住所: 天津市河西区马场道201-205号
法定代表人:刘宝凤
电话:022-58316666
传真:022-58316569
联系人: 王宏
客服电话:400-888-8811
网址: www.cbhb.com.cn

（7）上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 楼、22-27 楼
办公地址:上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 楼、22-27 楼
法定代表人:胡平西
联系人:吴海平
电话:021-38576666
客服电话:021-962999,400-696-2999
网址:www.srcb.com

（8）平安银行股份有限公司
法定代表人:孙建一
注册地址:深圳市深南东路 5047 号
办公地址:深圳市深南东路5047号
联系人:张波
联系电话:0755-22168073
客户服务电话:95511-3
公司网址: www.bank.pingan.com

（9）中国农业银行股份有限公司
法定代表人:蒋超良
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
联系人:牛峰
电话:010-85108223
传真:010-85109219
客服电话:95599
网址:www.abchina.com

（10）深圳农村商业银行股份有限公司
住所:深圳市罗湖区深南东路3038号合作金融大厦
法定代表人:李伟
联系人:陈聪
电话:0755-25188263
传真:0755-25188785
网站: www.4001961200.net
客户服务电话:400-196-1200

（11）徽商银行股份有限公司
住所:合肥市安庆路79号天徽大厦A座
办公地址:合肥市安庆路79号天徽大厦A座
法定代表人:李宏鸣
联系人:叶卓伟
联系电话:0551-62667635
传真电话:0551-62667684
客户服务电话:40088-96588（安徽省内可直拨96588）
公司网址: www.hsbank.com.cn

（12）中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
联系电话:（010）66107900
传真:010-66107914
联系人:杨菲
客服电话:95588
公司网站:www.icbc.com.cn

（13）华安证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人:李工
联系人:甘霖
电话:0551-65161821
传真:0551-65161672
客服电话:0551-96518（安徽）、400-809-6518（全国）
公司网址:www. hazq.com

（14）民生证券股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人:余政
联系人:赵明
电话:010-85127622
传真:010-85127917
客服电话:4006198888
公司网址:www.mszq.com

（15）东北证券股份有限公司
住所:吉林省长春市自由大路 1138 号
法定代表人:杨树财
联系人:安岩岩
电话:0431-85096517
客服电话:400-600-0686、0431-85096733
公司网址:www.nesc.cn

（16）长城国瑞证券有限公司
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼
法定代表人:傅毅辉
联系人:赵钦
电话:0592-5161642
传真:0592-5161140
客户服务电话:0592-5163588
网址:www.xmzq.cn

（17）国都证券有限责任公司
注所:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
电话:010-84183333
客服电话:400-818-8118
公司网址:www.guodu.com

（18）安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018 号安联大厦35 层、28 层A02 单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018 号安联大厦35 层、28 层A02 单元
深圳市福田区深南大道凤凰大厦1 栋9 层
法定代表人:牛冠兴
联系人:陈剑虹
电话:0755-82825551
客服电话:400-800-1001
公司网址: www.essence.com.cn

（19）新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:刘汝军
联系人:宋旸
电话:010-83561070
客户服务电话:400-698-9898
网址:www.xsdzq.cn

（20）申万宏源证券有限公司
英文名称:Shenwan Hongyuan Securities Co., Ltd.
注册资本:人民币330亿元
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编:200031）
法定代表人:李梅
电话:021-33389888
传真:021-33388224
客服电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
国际互联网网址: www.swhysc.com
联系人:黄莹

（21）申万宏源西部证券有限公司
英文名称:Shenwan Hongyuan Securities (Western) Co., Ltd.
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区（新市区） 北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 （邮编:830002）
法定代表人:许建平
电话:010-88085858
传真:010-88085195
客户服务电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com
联系人:李巍

（22）中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:顾凌
电话:010-60838888
传真:010-60833739
网址:www.cs.ecitic.com

（23）齐鲁证券有限公司
注册地址:济南市经七路 86 号
办公地址:济南市经七路 86 号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889185
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

（24）中信证券（浙江）有限责任公司
住所:浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22、23 层
法定代表人:沈强
联系人:李珊
联系电话:0571-85776114
客服电话:95548
公司网址:www.bigsun.com.cn

（25）国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
联系人:芮敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670666
客户服务热线:4008-888-666
公司网站:www.gtja.com.cn

（26）国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦8楼
办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
法定代表人:姚志勇
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:沈刚
客服电话:95570
网址:www.glsc.com.cn

（27）东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区星阳街5号
办公地址:苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
联系人:方晓丹
联系电话:0512-65581136
客服电话:400-860-1555
公司网址:www.dwjq.com.cn

（28）国海证券股份有限公司
住所:广西桂林市辅星路13号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅锋
联系人:牛孟宇
电话:0755-83709350
客服电话:95563
公司网址:www.ghzq.com.cn

（29）中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
联系人:权唐
电话:010-85130577
传真:010-65182261
客服电话:400-8888-108
公司网址:www.csc108.com

（30）东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-888-8588
公司网站: www.longone.com.cn

（31）海通证券股份有限公司
住所:上海市广东路 689号
法定代表人:王开国
联系人:李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客户服务热线:95553
公司网站:www.htsec.com

（32）山西证券股份有限公司
住所:山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭熠
电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客服电话:400-666-1618 95573
公司网址:www.i618.com.cn

（33）中山证券有限责任公司
住所:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人:黄扬录
联系人:罗艺琳
电话:0755-82570586
客服电话:400-102-2011
网址: www.zszq.com.cn

（34）信达证券股份有限公司
注册（办公）地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服热线:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

（35）爱建证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人:宫龙云
联系人:戴莉丽
电话:021-32229888
传真:021-62878701
客服电话:400-196-2502、021-63340678
公司网址:www.ajzq.com

（36）国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人:何如
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
联系人:周杨
客服电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn

（37）中国中投证券有限责任公司
住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
客户服务电话:400-600-8008、95532
网址:www. china-invs.cn

（38）江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:刘爽
电话:0451-85863696
传真:0451-82287211
客户服务热线:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn

（39）中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:陈有安
联系人:宋明
电话:010-66568450
传真:010-66568990
客服电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn

（40）天风证券股份有限公司
住所:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:王芊芊
电话:027-87618882
传真:027-87618863
客服电话:027-87618882
公司网址:www.tfzq.com

（41）长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8 号长江证券大厦
法定代表人:杨泽柱
客户服务热线:95579 或4008-888-999
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
公司网址:www.95579.com

（42）恒泰证券股份有限公司
住所:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:庞介民
联系人:王旭华
电话: 0471-4972343
传真: 0471-4961259
客服电话:0471-4972343
公司网址: www.cnht.com.cn

（43）兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层
法定代表人:兰荣
联系人:谢高得
电话:021-38565785
客服电话:95562
公司网站:www.xyzq.com.cn

（44）平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:谢永林
联系人:郑舒丽
电话:0755-22626391
客户服务电话:95511-8
公司网址:www.pingan.com

（45）华龙证券股份有限公司
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-4890208
客服电话:400-689-8888、（0931）96668
网址:www.hlzqgs.com

（46）世纪证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40/42层
法定代表人:姜昧军
联系人:雷新东
电话:0755-83199599
传真:0755-83199545
客服电话:0755-83199599
网址:www.csco.com.cn

（47）大通证券股份有限公司
住所:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层
法定代表人:张智河
联系人:谢立军
电话:0411-39673202
客服电话:4008-169-169
网址:www.daton.com.cn

（48）华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系人:万鸣
联系电话:025-83290979
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

（49）华宝证券有限责任公司
住所:上海世纪大道100号环球金融中心57楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
联系人:汪明丽
电话:021-68778075
客服电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com

（50）招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
电话:0755-82943666
网站:www.newone.com.cn

（51）光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号
办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客户服务热线:95525、4008888788、10108998
公司网站:www.ebscn.com

（52）华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
联系人:张宗锐、徐松梅
联系电话:0591-83893286
业务传真:0591-87383610
客户服务电话:96326（福建省外请先拨0591）
公司网址:www.hfzq.com.cn

（53）西南证券股份有限公司
住所:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
电话:023-63786633
联系人:张煜
客服电话:400-809-6096
公司网址:www.swsc.com.cn

（54）国盛证券有限责任公司
注册地址:南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）
法定代表人:曾小普
联系人:陈明
联系电话:0791-86281305
传真:0791-86281305
客服电话:4008222111
公司网址:www.gsstock.com

（55）中信证券（山东）有限责任公司
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客服电话:0532-95548
网址:www.citicssd.com

（56）国金证券股份有限公司
注册地址:成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系电话:028-86690057
传真:028-86690126
联系人:刘婧漪
客户服务电话:400-660-0109
网址:www.gjzq.com.cn

（57）深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
客服电话:4006-788-887
公司网址:www.jjmmw.com,www.zlfund.cn

（58）上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-20613999
传真:021-68596916
客服电话:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com

（59）杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
电话:021-60897840
传真:0571-26697013
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

（60）和讯信息科技有限公司
办公地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:吴卫东
电话:021-20835789
传真:021-20835885
客服电话:400-920-0022
公司网址:licaike.hexun.com

（61）上海长量基金销售投资顾问有限公司
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:单丙烨
电话:400-820-2899
传真:021—20691861
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com

（62）上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话: 021-54509998
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn

（63）上海利得基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼
法定代表人:盛大
联系人:叶志杰
电话:021-50583533
传真:021-50583633

（64）万银财富（北京）基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
法定代表人:王斐
联系人:廉亮
电话:010-53300532
传真:010-59393074
客服电话:400-081-6655
公司网址:www.wy-fund.com

（65）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12层
法定代表人:汪静波
联系人:徐诚
电话:021-38509639
传真:021-38509777
客服电话:400-821-5399
公司网址:www.noah-fund.com

（66）中期资产管理有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人:路瑶
联系电话:（010）65807865
传真:（010）65807864
联系人:侯英建
客户服务电话:010-65807609
网址:www.cifcofund.com

（67）北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人:罗细安
联系电话:（010）67000988
传真:（010）67000988-6000
联系人:孙晋峰
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zcvc.com.cn

（68）北京钱景财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系电话:010-57418829
传真:010-57569671
联系人:魏争
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.niuji.net

（69）一路财富（北京）信息科技有限公司
住所:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
联系人:段京璐
电话:010-88312877
传真:010-88312885
客服电话:400-001-1566
公司网址:www.yilucaifu.com

（70）中国国际期货有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人:王兵
联系电话:010-59539864
传真:010-59539806
联系人:赵森
客户服务电话:95162、400-8888-160
网址:www.cifco.net

（71）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
法定代表人:沈伟桦
联系人:程刚
电话:010-52855713
传真:010-85894285
客服电话:400-6099-200
公司网址:www.yixinfund.com

（72）上海联泰资产管理有限公司
办公地址:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼
法定代表人:燕斌
联系电话:021-51507071
传真:021-62990063
联系人:凌秋艳
客户服务电话: 4000-466-788
网址: www.66zichan.com

（二）注册登记机构
名称:华富基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
办公地址:海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
法定代表人:章宏韬
联系人:潘伟
电话:021-68886996
传真:021-68887997

（三）出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:安冬
经办律师: 吕红、安冬

（四）审计基金财产的会计师事务所
名称:天健会计师事务所（特殊普通合伙）
主要经营场所:杭州市西溪路129号9楼
执行事务合伙人:胡少先
电话: 021-62281910
传真: 021-62286290
联系人:曹小勤
经办注册会计师:曹小勤、林晶

四、基金的名称

华富保本混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型、开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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）。

本基金依照恒定比例保本策略将基金资产配置于保本资产与风险资产:保本资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据和企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）、债券回购、货币市场工具和银行存款等固定收益资产;风险资产为股票、权证等权益类资产。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为: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%。

八、基金的投资策略

1. CPPI（Constant Proportion Portfolio Insurance）策略及配置策略

根据恒定比例组合保险原理,本基金将根据市场的波动、组合安全垫（即基金净资产超过基金价值底线的数额）的大小动态调整保本资产与风险资产投资的比例,通过对保本资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全,通过对风险资产的投资寻求保本周期间资产的稳定增值。本基金对保本资产和风险资产的资产配置具体可分为以下三步:

第一步,确定保本资产的最低配置比例。根据保本周期末投资组合最低目标价值（本基金的最低保本值为投资本金的100%）和合理的贴现率（初期以三年期金融债的到期收益率为贴现率）,设定当期应持有的保本资产的最低配置比例,即设定基金价值底线;

第二步,确定风险资产的最高配置比例。根据组合安全垫和风险资产风险特性,决定安全垫的放大倍数——风险乘数,然后根据安全垫和风险乘数计算当期可持有的风险资产的最高配置比例;

第三步,动态调整保本资产和风险资产的配置比例,并结合市场实际运行态势制定风险资产投资策略,进行投资组合管理,实现基金资产在保本基础上的保值增值。

计算缓冲额度Ct :$C_t=A_t-F_t$

计算投资风险敞口Et:$E_t=M\times C_t=M\times(A_t-F_t)$

计算投资于安全资产的额度:$B_t=A_t-E_t$

其中,Et表示t 时刻投资于风险资产的额度

M 表示风险乘数（Multiplier）

At 表示t 时刻投资组合的净资产

Ft 表示t 时刻的保险底线或最低保险额度（Floor）,保险底线表示保本到期时基金资产必须保证的资产总值按无风险利率贴现得到的在该时刻的现值。越接近保本到期日,保险底线越接近要保的本金。

（At − Ft）为最大止损额,又称为安全垫（Cushion）。

[illegible]

假定本基金又经过两年的运作,期间保本资产取得了8%的收益,股票市场呈现震荡向上态势,风险资产取得了40% 的收益,那么期末保本资产为17.9亿元（16.6×1.08=17.9）,风险资产为4.94亿元（3.8×1.4=5.3）,基金净资产为23.2亿元（17.9+5.3=23.2）,保本周期内基金累计收益率为16%。

2. 股票投资策略

本基金的股票投资将贯彻长期投资、策略为先、精选个股的管理方式。首先,利用公司的行业研究和金融工程平台,形成适合本基金契约规定和风格特征的品种跟踪范围,即建立本基金的风格股票池,主要参考因素包括流动性、成长性、估值等量化指标;其次,根据经过尽职调研和深度评估而形成的公司股票池对风格股票池进行调整,从而得到本基金可最终投资的基金股票池;最后,根据风险预算目标和对市场驱动因素的评估,合理制定当期的股票投资策略,在控制风险的基础上精选个股,构建并调整股票资产组合。

3. 债券投资策略

本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心,在动态避险的基础上,追求适度收益。

（1）纯固定收益投资策略

本基金纯固定收益类资产投资策略主要基于华富宏观利率检测体系的观测指标和结果,通过久期控制、期限结构管理、类属资产选择实施组合战略管理,同时利用个券选择、跨市场套利、骑乘策略、息差策略等战术性策略提升组合的收益率水平。

① 华富宏观利率监测体系

华富宏观利率监测体系主要是通过对影响债券市场收益率变化的诸多因素进行跟踪,逐一评价各相应指标的影响程度并据此判断未来市场利率的趋势及收益率曲线形态变化。具体执行中将结合定性的预测和定量的因子分析、时间序列回归等诸多统计手段来增强预测的科学性和准确性。

② 组合战略管理

组合战略管理是在华富宏观利率检测体系对基础利率、债券收益率变化趋势及收益率曲线变化对固定收益组合实施久期控制、期限结构管理、类属资产选择,以实现组合主要收益的稳定。

久期控制:根据华富宏观利率监测体系对利率水平的预期对组合的久期进行积极的管理,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期（包括买入浮动利率债券）,以规避债券价格下降的风险。

期限结构管理:通过对债券收益率曲线形状变化（即不同期限的债券品种受到利率变化影响不一样大）的预期,选择相应的投资策略如子弹型、哑铃型或梯形的不同期限债券的组合形式,获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。

类属资产选择:通过提高相对收益率较高类属、降低相对收益率较低的类属以取得较高的总回报。由于信用差异、流动性差异、税收差异等诸多因素导致固定收益品种中同一期限的国债、金融债、企业债、资产支持证券等收益率之间价差在不同的时点价差出现波动。通过把握经济周期变化、不同投资主体投资需求变化等,分析不同固定收益类资产之间相对收益率价差的变化趋势,选择相对低估、收益率相对较高的类属资产进行配置,择机减持相对高估、收益率相对较低的类属资产。

③ 组合战术性策略

本基金纯固定收益组合在战略管理基础上,利用个券选择、跨市场套利、骑乘策略、息差策略等战术性策略提升组合的收益率水平。

个券选择:由于各发债主体信用等级,发行规模、担保人等因素导致同一类属资产的收益率水平存在差异,本基金在符合组合战略管理的条件下,综合考虑流动性、信用风险、收益率水平等因素后优先选择综合价值低估的品种。

跨市场套利:由于国内债券市场被分割为交易所市场和银行间市场,不同市场投资主体差异化、市场资金面的供求关系导致现券、回购等相同条款相近的交易中存在显著的套利,本基金将充分利用市场的套利机会,积极进行跨市场回购套利、跨市场债券套利等。

骑乘策略:主要是利用收益率曲线陡峭特征,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券持有一段时间后获得因期限缩短而导致的收益率下滑进而带来的资本利得。中国债券市场收益率曲线在不同时期不同期限表现出来的陡峭程度不一,为本基金实施骑乘策略提供了有利的市场环境。

息差策略:息差策略是通过正回购融资放大交易策略,其主要目标是获得票息大于回购成本而产生的收益。一般而言市场回购利率普遍低于中长期债券的收益率,为息差交易提供了机会,不过由于可能导致的资本利差损,因此本基金将根据对市场回购利率走势的判断,适当地选择杠杆比率,谨慎地实施息差策略,提高投资组合的收益水平。

④ 可转债投资策略

可转换债券（含可分离转债）同时具有债券与权益类证券的双重特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将利用可转换债券定价模型进行估值分析,重点结合公司投资价值、可转换债券条款、可转债的转换价值溢价水平、债券价值溢价水平选择债性股性相对均衡的转债品种,获得一定超额回报。

一级市场申购:结合转债公司基本面、转债上市定价、中签率、市场环境、资金成本等因素综合制定申购策略。

二级市场投资:重点结合公司基本面,选择相对价值低估的成长型公司的转债品种,分享成长性带来的股价上涨,最后进而进行转股获利或二级市场抛售。同时结合转股价值溢价率、债券价值溢价率对具体时点进行选择,结合转债的赎回、回售、修正转股价等条款对转债进行选择,以降低转债的投资风险。

套利交易:在可转债进入转股期后,由于市场的非完全有效性,转债转股次日方能卖出、市场流动性等因素,导致转债出现折价交易的机会,本基金将充分利用套利机会选择合适的交易策略实施无风险套利。

4. 权证投资策略

（在法律允许的范围内）本基金权证投资的原则主要为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础,结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价,主要运用的投资策略为:杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta对冲策略等。

九、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。

本基金选择三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准的原因如下:

本基金的保本周期为三年,但不保证收益率。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使本基金的保本受益人能够理性判断本基金的风险收益特征,合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准指数时,本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则变更本基金的业绩比较基准;并依据市场代表性、流动性、与原标的的相关性等诸多因素选择确定新的业绩比较基准。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准,基金管理人在与基金托管人协商一致并履行适当程序后报中国证监会备案,并在中国证监会指定的媒体上公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、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存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。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据本基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日,报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	74,229,413.90	29.75
	其中:股票	74,229,413.90	29.75
2	固定收益投资	161,639,203.38	64.79
	其中:债券	161,639,203.38	64.79
	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	4,870,841.07	1.95
7	其他资产	8,743,120.17	3.50
8	合计	249,482,578.52	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,088,000.00	2.10
B	采矿业	1,282,000.00	0.66
C	制造业	34,001,167.00	17.43
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	12,012,796.90	6.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	16,171,110.00	8.29
K	房地产业	5,525,000.00	2.83
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	9,640.00	0.00
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	1,139,700.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	74,229,413.90	38.05

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002094	青岛金王	300,000	5,913,000.00	3.03
2	002146	荣盛发展	260,000	5,525,000.00	2.83
3	601166	兴业银行	300,000	5,508,000.00	2.82
4	600280	中央商场	300,000	4,944,000.00	2.53
5	600976	健民集团	139,909	4,770,896.90	2.45
6	601818	光大银行	900,000	4,257,000.00	2.18
7	600196	复星医药	170,000	4,214,300.00	2.16
8	600108	亚盛集团	400,000	4,088,000.00	2.10
9	601318	中国平安	50,000	3,912,000.00	2.01
10	300072	三聚环保	100,000	3,780,000.00	1.94

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,204,000.00	9.84
	其中:政策性金融债	19,204,000.00	9.84
4	企业债券	130,040,140.90	66.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	12,395,062.48	6.35
8	其他	-	-
9	合计	161,639,203.38	82.86

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140338	14进出38	200,000	19,204,000.00	9.84
2	124367	13锡城发	150,000	15,457,500.00	7.92
3	098082	09华西债	135,000	13,567,500.00	6.95
4	112051	11报喜02	130,100	13,530,400.00	6.94
5	112193	13美邦01	101,080	10,598,238.00	5.43

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7、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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货投资。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（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。

（3）其他资产构成:

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	58,592.06
2	应收证券清算款	2,933,484.06
3	应收股利	-
4	应收利息	4,820,041.62
5	应收申购款	931,002.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,743,120.17

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	125089	深机转债	5,130,243.88	2.63
2	110019	恒丰转债	4,055,188.80	2.08
3	110023	民生转债	2,745,400.00	1.41
4	128007	通鼎转债	275,495.60	0.14
5	113006	深燃转债	188,734.20	0.10

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600196	复星医药	4,214,300.00	2.16	临时停牌

（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。

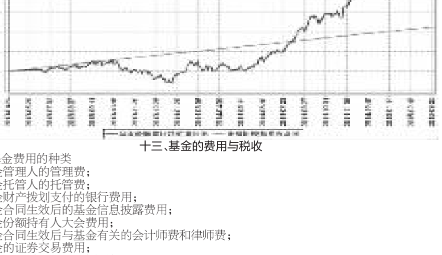
十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）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	净值增长率①	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
2013.04.24 -2013.12.31	-1.10%	0.19%	2.93%	0.01%	-4.03%	0.18%
2014.01.01 -2014.12.31	21.23%	0.43%	4.10%	0.01%	17.13%	0.42%
2015.01.01 -2015.03.31	11.60%	0.75%	0.90%	0.01%	10.70%	0.74%
2013.04.24 -2015.03.31	33.81%	0.42%	8.12%	0.01%	25.69%	0.41%

（二）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



十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.基金财产拨划支付的银行费用;
4.基金合同生效后的基金信息披露费用;
5.基金份额持有人大会费用;
6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
7.基金的证券交易费用;
8.基金的开户费用、账户维护费用
9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times$年管理费率$\div$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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times$年托管费率$\div$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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3.若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“华富安鑫债券型证券投资基金”的基金份额,管理费按前一日基金资产净值的0.7 %的年费率计提,托管费按前一日基金资产净值的0.2 %的年费率计提。计算方法同上,此项调整无需召开基金份额持有人大会。

4.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对原《华富保本混合型证券投资基金招募说明书更新（2014年第2号）》进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“重要提示”部分,更新招募说明书更新截止日期。

2、在“二、释义”部分,更新《基金法》、《运作办法》的释义等内容。

3、在“三、基金管理人”部分,更新了基金管理人董事会成员、监事会成员、基金经理、投资决策会成员的相关信息。

4、在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人概况、主要人员情况、基金托管业务经营情况、基金托管人的内部控制制度、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序等内容,删去基金托管人的禁止行为的部分。

5、在“五、相关服务机构”中更新了相关服务机构的内容。

6、在“十一、基金投资”中,更新了财务数据的截止日期,增加了基金最近一期投资组合报告的内容。

7、在“十二、基金的业绩”中,增加了基金最近一期的业绩说明。

8、在“二十四、其他应披露事项”披露了本期基金的相关公告。

华富基金管理有限公司
二零一五年六月

华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加北京钱景财富投资管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告

为答谢广大投资者对华富基金管理有限公司（以下简称“本公司”）长期以来的信任与支持,经本公司与北京钱景财富投资管理有限公司（以下简称“钱景财富”）协商一致,决定本公司旗下部分开放式基金参加钱景财富基金申购费率优惠活动。现将有关事项公告如下:

一、适用基金范围

本公司参加钱景财富基金申购费率优惠活动的基金包括:华富恒财分级债券型证券投资基金B类基金（基金代码:000624 B类）、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金（基金代码:000757）、华富恒稳纯债债券型证券投资基金A类基金（基金代码:000898 A类）、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金（基金代码:000767）。

二、优惠活动期间

自2015年6月5日起,结束时间将以钱景财富公告为准。

三、优惠活动内容

1. 投资者可通过钱景财富办理上述基金的定投业务定投每月最低申购额为100元人民币,详细规则以钱景财富的相关公告为准。

2. 费率优惠规定

投资者通过钱景财富申购（含定期定额申购）上述基金的（只限前端收费模式）,原申购费率高于0.6%的,其申购费率享有4折优惠,优惠后费率低于0.6%的按0.6%执行;原申购费率等于、低于0.6%或为固定费用的,其申购费率按原费率执行,不再享有费率折扣。原费率指本公司发布的各基金最新的招募说明书及相关公告上注明的费率。

上述费率优惠活动解释权归钱景财富所有,有关上述费率优惠活动的具体规定及活动结束时间如有变化,敬请投资人留意钱景财富的有关公告。。

四、限制条款

本次优惠活动仅针对正常申购期的开放式基金的前端收费模式,不包括基金的后端收费模式和基金募集期的认购费率。

五、重要提示

1、本次优惠活动期间,业务办理以钱景财富业务规则为准。投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读所购买基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

2、本次优惠活动解释权归钱景财富所有。

3、本公司后续新发行或转换的开放式基金若由钱景财富代销,且届时优惠活动仍然持续,则该基金自动参加此项申购费率优惠活动,本公司不再另行公告。如有某只或某些特定基金产品不适用费率优惠,则由本公司另行公告确定。

六、咨询办法

投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况:

1、北京钱景财富投资管理有限公司
网站:www.niuji.net
客户服务电话:400-678-5095

2、华富基金管理有限公司
网站:www.hffund.com
客户服务电话400-700-8001

特此公告。

华富基金管理有限公司
二零一五年六月五日

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钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告

根据华富基金管理有限公司与北京钱景财富投资管理有限公司的代销业务安排,自2015年6月5日起,北京钱景财富投资管理有限公司将代理华富基金管理有限公司旗下华富恒财分级债券型证券投资基金B类基金（基金代码:000624 B类）、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金（基金代码:000757）、华富恒稳纯债债券型证券投资基金（基金代码:000898 A类;基金代码:000899 C类）、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金（基金代码:000767）的销售业务。投资者欲了解详细信息,请仔细阅读上述基金的相关基金合同、招募说明书及上述基金披露的公告。

投资者可在北京钱景财富投资管理有限公司的网上基金交易平台办理上述基金的开户、申购、赎回、定投、转换及其他业务,具体办理程序应遵循北京钱景财富投资管理有限公司的相关规定。

投资者可通过以下途径咨询有关详情:

1、华富基金管理有限公司
网站:www.hffund.com
客户服务电话:400-700-8001

2、北京钱景财富投资管理有限公司
网站:www.niuji.net
客户服务电话:400-678-5095

特此公告。

华富基金管理有限公司
二零一五年六月五日