华富保本混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
送出日期:2016年3月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年01月01日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富保本混合型证券投资基金
基金简称	华富保本混合
基金主代码	000028
交易代码	000028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	134,491,345.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取恒定比例组合保险策略CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance),通过动态调整资产组合,在确保本金安全的前提下,力争实现保本周期内基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金遵循长期投资的基本原则,融合国际化的风险管理工具与本土化的价值投资实践,利用趋险技术进行风险跨期管理,在此基础上,坚持以价值发现为核心的投资研究理念,寻找中国经济成长和资本市场发展过程中的中长期投资机遇,最大限度地追求本金安全与财富增值的动态平衡。
业绩比较基准	本基金在保本周期内的业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	廖原
	联系电话	021-68886996	021-61618888
	电子邮箱	manzh@hffund.com	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95528
传真		021-68887997	021-6360 2540

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

注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2)以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3)期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数,表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日。

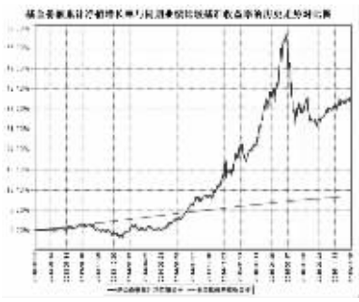
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.75%	0.40%	0.65%	0.01%	3.10%	0.39%
过去六个月	-3.81%	0.63%	1.38%	0.01%	-5.19%	0.62%
过去一年	16.36%	0.85%	3.14%	0.01%	13.22%	0.84%
自基金合同生效起至今	39.51%	0.59%	10.52%	0.01%	28.99%	0.58%

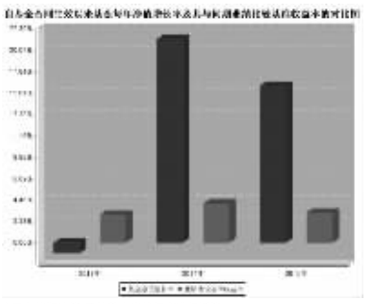
注:本基金在保本周期内的业绩比较基准=三年期银行定期存款税后收益率,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:根据《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为2013年4月24日到2013年10月24日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年度	2.5000	35,078,013.91	-	35,078,013.91	
2014年度	0.5000	9,728,390.56	-	9,728,390.56	
2013年度	-	-	-	-	
合计	3.0000	44,806,404.47	-	44,806,404.47	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业,4月19日在上海正式注册成立,注册资本1.2亿元,公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股(集团)有限公司。截止2015年12月31日,本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富分级债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富旺财保本混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金二十一只基金。

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		
胡伟	华富保本混合型基金经理、华富收益增强债券型基金经理、华富恒富分级债券型基金经理、华富恒财分级债券型基金经理、华富恒稳纯债债券型基金经理、华富旺财保本混合型基金经理、华富恒利债券型基金经理、公司公募投资决策委员会成员、公司总经理助理、固定收益部总监	2013年4月24日	-	十二年	中南财经政法大学经济学学士、本科学历,曾任珠海市商业银行资金营运部交易员,从事债券研究及债券交易工作,2006年11月加入华富基金管理有限公司,曾任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监,2009年10月19日至2014年11月17日任华富货币市场基金基金经理,2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。
张惠	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、华富恒利债券型基金基金经理	2014年11月19日	-	九年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历,2007年6月加入华富基金管理有限公司,先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员,2012年5月21日至2014年3月19日任华富策略精选混合型基金基金经理助理,2014年3月20日至2014年11月18日任华富保本混合型基金基金经理助理。

注:任职日期指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下:

在研究分析和投资决策环节,公司通过建立规范、完善的研究管理平台,为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合,在保证其决策相对独立的同时,在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略,制定客观、完整的交易决策规则,并按照这些规则进行投资决策,保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节,公司设立独立的集中交易部门,通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则:"价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施",保证交易在各投资组合间的公正实施,保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度,确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节,公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容,加强对投资交易行为的监察稽核力度,公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后,集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记,逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果,由具体执行的交易员签字确认留档,并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如1日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差进行分析。本报告期内,根据纳入样本内的数据分析结果,未发现明显异常情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2013年4月24日正式成立。截止2015年12月31日,本基金份额净值为1.077元,累计份额净值为1.377元。自基金合同生效起至今,本基金份额净值增长率为39.51%,同期业绩比较基准收益率为10.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位,在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,发挥管理人的综合优势,积极稳健地做好配置策略,均衡投资,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定,成立了估值委员会,并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所(特殊普通合伙)进行审核并出具报告,由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司总经理,成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对华富保本混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对华富保本混合型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了四次利润分配,分配金额分别为6,608,064.43元、9,173,226.80元、12,864,272.23元、6,432,450.45元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审[2016]6-64号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富保本混合型证券投资基金全体持有人
引言段	我们审计了后附的华富保本混合型证券投资基金(以下简称"华富保本混合基金")财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表,2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华富保本混合基金的基金管理人华富基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评估管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,在所有重大方面公允反映了华富保本混合基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	曹小勤 林晶
会计师事务所的名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	杭州市西溪路128号新湖商务大厦9楼
审计报告日期	2016年3月23日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:华富保本混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款		6,317,770.45	334,554.98
结算备付金		845,901.98	7,690,578.70
存出保证金		71,467.94	69,656.93
交易性金融资产		134,763,752.35	273,852,349.50
其中:股票投资		20,477,956.75	61,726,914.79
基金投资		-	-
债券投资		114,285,795.60	212,125,434.71
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		918,853.36	1,099,312.37
应收利息		2,638,852.10	5,003,302.36
应收股利		-	-
应收申购款		227,203.51	37,578.87
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		145,783,801.69	288,087,333.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
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		-	87,999,710.10
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		303,498.68	453,825.75
应付管理人报酬		146,426.88	210,417.25
应付托管费		24,404.49	35,069.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		127,723.80	54,976.59
应交税费		-	-
应付利息		-	38,248.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		394,225.81	393,775.42
负债合计		996,279.66	89,186,023.10
所有者权益:			
实收基金		134,491,345.19	173,342,271.30
未分配利润		10,296,176.84	25,559,039.31
所有者权益合计		144,787,522.03	198,901,310.61
负债和所有者权益总计		145,783,801.69	288,087,333.71

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

7.2 利润表

会计主体:华富保本混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		33,011,901.82	58,748,491.00
1.利息收入		8,111,518.60	16,685,485.51
其中:存款利息收入		128,468.77	264,352.52
债券利息收入		7,983,049.83	16,421,132.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		36,631,722.30	17,504,809.66
其中:股票投资收益		26,015,092.79	5,672,256.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益		10,036,424.05	11,411,099.26
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		580,205.46	421,453.68
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-12,301,447.15	23,686,643.85
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		570,108.07	871,551.98
减:二、费用		4,370,106.72	8,604,532.99
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	2,023,928.76	3,488,743.91
2. 托管费	7.4.8.2.2	337,321.43	581,457.36
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		589,071.96	332,234.12
5. 利息支出		987,300.08	3,763,669.03
其中:卖出回购金融资产支出		987,300.08	3,763,669.03
6. 其他费用		432,484.49	438,428.57
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		28,641,795.10	50,143,958.01
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		28,641,795.10	50,143,958.01

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富保本混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	173,342,271.30	25,559,039.31	198,901,310.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	28,641,795.10	28,641,795.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-38,850,926.11	-8,826,643.66	-47,677,569.77
其中:1.基金申购款	88,475,797.01	20,300,413.75	108,776,210.76
2.基金赎回款	-127,326,723.12	-29,127,057.41	-156,453,780.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-35,078,013.91	-35,078,013.91
五、期末所有者权益(基金净值)	134,491,345.19	10,296,176.84	144,787,522.03
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	356,563,751.77	-3,856,649.10	352,707,102.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	50,143,958.01	50,143,958.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-183,221,480.47	-10,999,879.04	-194,221,359.51
其中:1.基金申购款	17,597,826.89	1,558,868.96	19,156,695.85
2.基金赎回款	-200,819,307.36	-12,558,748.00	-213,378,055.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-9,728,390.56	-9,728,390.56
五、期末所有者权益(基金净值)	173,342,271.30	25,559,039.31	198,901,310.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____章宏韬_____ _____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

华富保本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(中国证监会)(证监许可[2013]69号)核准,基金合同于2013年4月24日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并出具《验资报告》(天健验(2013)6-3号)。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128号)、《关于证券投资基金税收政策问题的通知》(财税[2004]78号)、《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》(财税[2005]102号)、《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》(财税[2005]103号)、《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》(财税[2005]107号)、《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》(财税[2007]84号)、《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税[2008]1号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税[2012]85号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

7.4.6.1以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

7.4.6.2基金买卖股票、债券的差价收入,从2004年1月1日起,继续免征收营业税。

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日起证券(股票)交易印花税税率由3‰调整为1‰。经国务院批准,从2008年9月19日起,对证券交易印花税政策进行调整,由双边征收改为向卖方单边征收,税率保持1‰。

7.4.6.6基金作为流通股股东,在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司("华安证券")	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	2,023,928.76	3,488,743.91
其中:支付销售机构的客户维护费	612,724.01	1,060,714.57

注:基金管理费按前一日基金资产净值1.20%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×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 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
当期发生的基金应支付的托管费	337,321.43	581,457.36

注:基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期和上年度可比期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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
上海浦东发展银行股份有限公司	6,317,770.45	72,714.10	334,554.98	136,003.26

注:本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7