华富收益增强债券型证券投资基金

2013 年度报告摘要

基金管理人：华富基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2014年3月26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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月25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2013年01月01日起至2013年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富收益增强债券型证券投资基金	
基金简称	华富收益增强债券	
基金主代码	410004	
交易代码	410004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年5月28日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	746,734,136.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
下属分级基金的交易代码：	410004	410005
报告期末下属分级基金的份额总额	522,362,663.68份	224,371,472.46份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类产品，在维持资产较高流动性、严格控制投资风险、获得债券稳定收益的基础上，积极利用各种稳健的金融工具和投资渠道，力争基金资产的持续增值。
投资策略	本基金以系统化研究为基础通过对固定收益类资产的主动配置获得稳定的债券总收益，并通过新股申购、转债投资等品种的主动投资提升基金资产的增值效率。投资策略主要包括纯固定收益、新股申购、转债投资等。
业绩比较基准	中信标普全债指数
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，预期其长期平均风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金、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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	田青
	联系电话	021-68886996	010-67595096
	电子邮箱	manzh@hffund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853

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	2013年		2012年		2011年	
	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
本期已实现收益	78,167,133.97	46,277,068.91	-7,422,121.77	-7,869,683.19	-23,026,194.16	-22,823,550.30
本期利润	56,924,488.44	39,178,261.03	68,438,559.89	42,672,713.05	-186,445,396.11	-109,121,058.46
加权平均基金份额本期利润	0.1150	0.1392	0.0794	0.0766	-0.1166	-0.1140
本期基金份额净值增长率	9.35%	8.92%	7.45%	7.01%	-9.51%	-9.87%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0060	0.0089	-0.0160	-0.0272	-0.0082	-0.0150
期末基金资产净值	586,611,484.28	252,466,734.90	712,036,157.77	465,634,845.67	1,113,363,707.25	724,217,774.17
期末基金份额净值	1.1230	1.1252	1.1552	1.1432	1.0751	1.0683

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

华富收益增强债券A

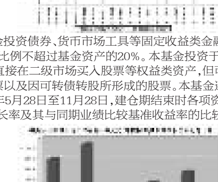
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.16%	0.29%	-1.20%	0.06%	-0.96%	0.23%
过去六个月	1.12%	0.32%	-0.82%	0.05%	1.94%	0.27%
过去一年	9.35%	0.48%	1.78%	0.05%	7.57%	0.43%
过去三年	6.32%	0.41%	9.89%	0.05%	-3.57%	0.36%
过去五年	36.51%	0.38%	12.39%	0.06%	24.12%	0.32%
自基金合同生效起至今	47.50%	0.36%	20.48%	0.07%	27.02%	0.29%

华富收益增强债券B

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	-2.26%	0.29%	-1.20%	0.06%	-1.06%	0.23%
过去六个月	0.91%	0.32%	-0.82%	0.05%	1.73%	0.27%
过去一年	8.92%	0.48%	1.78%	0.05%	7.14%	0.43%
过去三年	5.05%	0.41%	9.89%	0.05%	-4.84%	0.36%
过去五年	33.74%	0.38%	12.39%	0.06%	21.35%	0.32%
自基金合同生效起至今	44.15%	0.36%	20.48%	0.07%	23.67%	0.29%

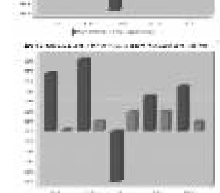
注：业绩比较标准收益率=中信标普全债指数，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

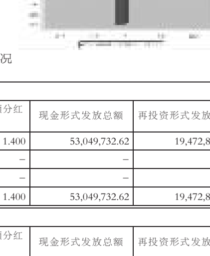
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：根据基金合同的规定，本基金投资债券、货币市场工具等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%，投资股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%。本基金投资于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%。本基金不直接在二级市场买入股票等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购和新股增发，并持有因在一级市场申购所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票。本基金还可以持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。本基金建仓期为2008年5月28日至11月28日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华富收益增强债券A

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
2013年度	1.400	53,049,732.62	19,472,809.20	72,522,541.82	
2012年度	-	-	-	-	
2011年度	-	-	-	-	
合计	1.400	53,049,732.62	19,472,809.20	72,522,541.82	

华富收益增强债券B

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
2013年度	1.200	16,225,160.87	12,690,706.77	28,915,867.64	
2012年度	-	-	-	-	
2011年度	-	-	-	-	
合计	1.200	16,225,160.87	12,690,706.77	28,915,867.64	

§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2013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、华富恒鑫债券型证券投资基金十二只基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
胡伟	华富收益增强债券型基金基金经理、华富货币市场基金基金经理、华富保本混合型基金基金经理、华富恒鑫债券型基金基金经理、公司投资决策委员会成员、固定收益部总监	2011年10月10日	-	九年	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。

注：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

2013年中国经济经历了流动性拐点，伴随美联储缩减QE和逆回购的启动，外部资金趋势收紧导致海外局势日益动荡，从而制约国内货币政策，冲击国内流动性。另一方面，经济基本面因素日趋恶化，2013年经济增长继续中枢下行，名义GDP增速不足10%，为近五年来新低，而CPI则受制于经济降温和猪价低迷未现大幅上涨。然而，受楼市火热和土地市场升温带动，2013年地方土地财政收入创新高，一方面缓解了地方债务压力，另一方面也给予了影子银行顺应107号文加快转变的契机。我们认为，流动性、基本面和债务，三大因素仍将影响2014年。

2013年债券市场先扬后抑。债市在6月"钱荒"、信用评级下调、地方债务审计等不利影响下，债券收益率出现大幅上行，调整幅度超市场预期。而权益市场则以创业板为代表的新兴产业成长类个股大幅上涨，转债品种以中小盘品种表现较优。

2013年本基金在大类资产配置上，维持了较高的权益以及转债仓位；在纯债方面采取短久期、较低仓位的策略，较好的规避了收益率大幅上升对组合净值的影响。受益于持仓个股及部分转债品种的良好表现，基金资产获得了较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止到2013年12月31日，华富收益增强A类基金份额净值为 1.1230 元，累计份额净值为1.4350元，本报告期的份额累计净值增长率为9.35%，同期业绩比较基准收益率为1.78%；华富收益增强B基金份额净值为1.1252元，累计份额净值为1.4072元，本报告期的份额累计净值增长率为8.92%，同期业绩比较基准收益率为1.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从2014年一季度的形势来看，我们预计今年GDP将前低后高。全年增长7-7.5%；CPI上半年不高下半年不低，全年增长3%左右，经济基本面对债市偏正面。房地产市场2014年预计将步入下行周期，信托风险加快暴露，银行将被动收紧银根对冲风险，从而倒逼影子银行加快转表。美联储维持基准利率上升，日元贬值，欧元区负利率，一并决定了2014年外围局势更加混乱，新兴市场遭遇流动性负反馈，中国央行被迫出手干预或是常态。由于2014年的政策基调仍是改革，所以下半年除非经济超预期下滑，或者债务危机爆发，否则中央不会出台刺激政策，而地方债务自主化或成为财政分权的契机。

上述因素决定今年债市的趋势。新年开局，对经济的悲观预期，对流动性改善的预期，以及对银行缩减非标的预期，导致债券收益率出现快速下行，短端利率大幅下降带动前期过度扁平化的曲线自我修复，利率品和中长端信用债反弹，机构配置盘涌现令债市出现罕见的火热行情。我们认为2014年债市的结构机会将始终存在，利率债、短融、3-5年高评级信用债以及超跌的产业债的配置价值较高。转债品种而言，我们将重点挖掘中小转债，中线持有存在促转股预期的品种，而大盘转债仍以波段操作为主。2014年，权益市场将延续结构性机会，自下而上精选个股依旧是重点研究的方向。我们将继续做好大类资产的配置，力争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。

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《证券投资基金运作管理办法》和《华富收益增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，在本报告期内共实现可分配利润127,522,716.12元；本报告期内共实施两次利润分配，累计分配金额为101,438,409.46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5,162,107.88元，滚存至下一期进行分配。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金A类实施利润分配的金额为72,522,541.82元，本基金B类实施利润分配的金额为28,915,867.64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

本托管人复核审查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。

§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〔2014〕6-43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	华富收益增强债券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收益增强债券型证券投资基金(以下简称"华富收益增强基金")财务报表，包括2013年12月31日的资产负债表，2013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	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是华富收益增强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)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；(2)选择和运用恰当的会计政策；(3)作出合理的会计估计。	
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作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收益增强基金2013年12月31日的财务状况以及2013 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	2014年3月25日	

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：华富收益增强债券型证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	1,527,692.68	11,412,636.91
结算备付金	25,232,278.90	78,260,127.55
存出保证金	43,937.16	250,000.00
交易性金融资产	1,051,212,307.32	1,883,700,223.58
其中：股票投资	98,481,461.71	199,962,206.28
基金投资	-	-
债券投资	952,730,845.61	1,675,785,017.30
资产支持证券投资	-	7,953,000.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,559,979.78	7,794,494.37
应收利息	18,836,795.16	34,828,073.15
应收股利	-	-
应收申购款	366,546.56	120,926.72
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,098,779,537.56	2,016,366,482.28
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	250,000,000.00	813,799,987.80
应付证券清算款	364,703.06	10,848,137.99
应付赎回款	3,319,984.91	7,764,999.04
应付管理人报酬	438,882.58	624,021.84
应付托管费	146,294.20	208,007.27
应付销售服务费	90,198.58	167,070.42
应付交易费用	24,043.60	47,908.28
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	5,317,211.45	5,235,346.20
负债合计	259,701,318.38	838,695,478.84
所有者权益：		
实收基金	746,734,136.14	1,023,671,624.07
未分配利润	92,344,083.04	153,999,379.37
所有者权益合计	839,078,219.18	1,177,671,003.44
负债和所有者权益总计	1,098,779,537.56	2,016,366,482.28

注：报告截止日2013年12月31日，A类基金份额净值1.1230元、B类基金份额净值1.1252元，基金份额总额746,734,136.14份，A类基金份额总额522,362,663.68份、B类基金份额总额224,371,472.46份。

7.2 利润表

会计主体：华富收益增强债券型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	116,509,804.01	147,374,343.87
1.利息收入	37,482,556.16	69,883,616.84
其中：存款利息收入	1,333,170.17	1,235,463.15
债券利息收入	35,505,945.99	68,215,953.27
资产支持证券利息收入	135,853.40	33,880.92
买入返售金融资产收入	507,586.60	398,319.50
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	107,293,275.83	-48,920,488.23
其中：股票投资收益	55,749,749.00	-44,093,705.19
基金投资收益	-	-
债券投资收益	50,287,727.98	-8,566,922.81
资产支持证券投资收益	10,000.00	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,245,798.85	3,740,139.77
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-28,341,453.41	126,403,077.90
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	75,425.43	8,137.36
减：二、费用	20,407,054.54	36,263,070.93
1.管理人报酬	5,678,422.58	9,488,643.99
2.托管费	1,892,807.45	3,162,881.31
3.销售服务费	1,377,629.92	2,470,845.52
4.交易费用	512,912.72	504,884.60
5.利息支出	10,501,039.37	20,180,427.22
其中：卖出回购金融资产支出	10,501,039.37	20,180,427.22
6.其他费用	444,242.50	455,388.29
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	96,102,749.47	111,111,272.94
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	96,102,749.47	111,111,272.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富收益增强债券型证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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)	1,023,671,624.07	153,999,379.37	1,177,671,003.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	96,102,749.47	96,102,749.47
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)	-276,937,487.93	-56,319,636.34	-333,257,124.27
其中：1.基金申购款	772,165,799.26	180,077,330.04	952,243,129.30
2.基金赎回款	-1,049,103,287.19	-236,396,966.38	-1,285,500,253.57
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)	-	-101,438,409.46	-101,438,409.46
五、期末所有者权益(基金净值)	746,734,136.14	92,344,083.04	839,078,219.18
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	1,713,544,781.68	124,036,699.74	1,837,581,481.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	111,111,272.94	111,111,272.94
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)	-689,873,157.61	-81,148,593.31	-771,021,750.92
其中：1.基金申购款	329,027,862.37	39,376,149.79	368,404,012.16
2.基金赎回款	-1,018,901,019.98	-120,524,743.10	-1,139,425,763.08
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)	1,023,671,624.07	153,999,379.37	1,177,671,003.44

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

华富收益增强债券型证券投资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》、《证券投资基金运作管理办法》及相关规定和《华富收益增强债券型证券投资基金基金合同》发起，经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]320号文批准募集设立。本基金自2008年4月16日起公开向社会发行，至2008年5月23日募集结束。经天健华证中洲（北京）会计师事务所（现已合并为天健正信会计师事务所）验资并出具天健华证中洲验（2008）JR字第070001号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本次募集的净认购金额为756,843,512.69元人民币，其中A类（基金代码：410004）625,880,740.81元，B类（基金代码：410005）130,962,771.88元；有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计249,555.96 元人民币，其中A类 196,448.50元，B类 53,107.46元，折成基金份额，归投资人所有。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司；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2008年5月28日生效，该日的基金份额为757,093,068.65份基金单位。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以财政部于2006年2月15日颁布的《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》、《华富收益增强债券型证券投资基金基金合同》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2013年度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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策问题的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1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[2012]85号文《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》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
中国建设银行股份有限公司	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

本报告期内及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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,678,422.58	9,488,643.99
其中：支付销售机构的客户维护费	951,807.45	1,600,110.27

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率费每日计提，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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,892,807.45	3,162,881.31

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率每日计提，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）。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 华富收益增强债券A	华富收益增强债券B	合计
中国建设银行股份有限公司	-	506,985.72	506,985.72
华安证券股份有限公司	-	609.65	609.65
华富基金管理有限公司	-	20,144.43	20,144.43
合计	-	527,739.80	527,739.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 华富收益增强债券A	华富收益增强债券B	合计
中国建设银行股份有限公司	-	847,609.92	847,609.92
华安证券股份有限公司	-	801.93	801.93
华富基金管理有限公司	-	110,893.72	110,893.72
合计	-	959,305.57	959,305.57

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费；B类基金份额的销售服务费按前一日B 类基金资产净值的0.40%年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式H ＝ E ×年销售服务费率÷ 当年天数（H 为B 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为B 类基金份额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

本基金本报告期和上年度可比期间内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

份额单位：份

关联方名称	华富收益增强债券A 本期末 2013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	上年度末 2012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
华安证券股份有限公司	8,352,159.81	1.12%	7,421,422.49	0.72%

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。

本表列示"持有的基金份额占基金总份额的比例"为占期末基金份额总额的比例。

份额单位：份

关联方名称	华富收益增强债券B 本期末 2013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	上年度末 2012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
-	-	-	-	-

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 2013年1月1日至2013年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,527,692.68	105,303.96	11,412,636.91	229,403.04

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（2013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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币250,000,000.00元，于2014年1月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据"财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好2010年年报工作的通知（财会（2010）25号）"（以下简称"通知"）要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

类别	2013年12月31日公允价值	2012年12月31日公允价值
第一层次	873,935,507.32	1,491,050,023.58
第二层次	177,276,800.00	392,650,200.00
第三层次	-	-
合计	1051212307.32	1,883,700,223.58

§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	98,481,461.71	8.96
	其中：股票	98,481,461.71	8.96
2	固定收益投资	952,730,845.61	86.71
	其中：债券	952,730,845.61	86.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	26,759,971.58	2.44
6	其他各项资产	20,807,258.66	1.89
7	合计	1,098,779,537.56	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见8.10.3 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	-	-
B	采矿业	21,896,000.00	2.61
C	制造业	75,384,051.50	8.98
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,201,410.21	0.14
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	98,481,461.71	11.74

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002683	宏大爆破	700,000	21,896,000.00	2.61
2	300146	汤臣倍健	240,000	17,493,600.00	2.08
3	000731	四川美丰	1,500,000	14,835,000.00	1.77
4	002250	联化科技	560,000	11,754,400.00	1.40
5	300145	南方泵业	280,000	10,542,000.00	1.26
6	000729	燕京啤酒	1,090,315	8,831,551.50	1.05
7	601965	中国汽研	450,000	6,030,000.00	0.72
8	600422	昆明制药	250,000	5,897,500.00	0.70
9	000099	中信海直	141,843	1,201,410.21	0.14

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000731	四川美丰	31,232,281.50	2.65
2	601989	中国重工	19,404,516.60	1.65
3	600422	昆明制药	10,257,370.90	0.87
4	000729	燕京啤酒	8,809,745.20	0.75
5	000099	中信海直	1,215,594.51	0.10
6	600521	华海药业	183,750.00	0.02

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	300146	汤臣倍健	46,844,669.14	3.98
2	300212	易华录	30,985,719.29	2.63
3	601989	中国重工	17,423,803.52	1.48
4	600028	中国石化	14,882,758.95	1.26
5	002683	宏大爆破	12,867,554.66	1.09
6	000731	四川美丰	12,632,632.71	1.07
7	002475	立讯精密	12,608,649.77	1.07
8	002687	乔治白	12,532,305.96	1.06
9	600143	金发科技	9,209,884.51	0.78
10	601098	中南传媒	9,038,862.84	0.77
11	000630	铜陵有色	7,731,529.99	0.66
12	300333	兆日科技	5,577,896.60	0.47
13	002250	联化科技	5,361,011.08	0.46
14	300070	碧水源	4,684,394.40	0.40
15	300329	海伦钢琴	4,178,635.96	0.35
16	601965	中国汽研	3,934,589.96	0.33
17	600422	昆明制药	3,852,730.00	0.33
18	002482	广田股份	3,632,416.20	0.31
19	300145	南方泵业	3,543,054.33	0.30
20	002154	报 喜 鸟	3,475,000.00	0.30

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	71,103,258.71
卖出股票收入(成交)总额	232,012,760.78

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,997,000.00	3.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,730,000.00	2.35
	其中：政策性金融债	19,730,000.00	2.35
4	企业债券	559,860,159.90	66.72
5	企业短期融资券	9,991,000.00	1.19
6	中期票据	29,061,000.00	3.46
7	可转债	304,091,685.71	36.24
8	其他	-	-
9	合计	952,730,845.61	113.54

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	680,000	64,844,800.00	7.73
2	122844	11筑城投	487,000	48,213,000.00	5.75
3	122847	11甬交投	400,000	40,000,000.00	4.77
4	113003	重工转债	342,620	39,925,508.60	4.76
5	110018	国电转债	384,000	39,609,600.00	4.72

8.7 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。

8.8 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。

8.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1 石化转债的发行主体中国石油化工股份有限公司（以下简称 "中国石化"）于2014年1月12日发布《中国石油化工股份有限公司公告》，公告称2013年11月22日凌晨，中国石化位于青岛经济技术开发区的东黄复线原油管道发生破裂，导致原油泄漏，部分原油漏入市政排水暗渠；当日上午市政排水暗渠发生爆炸，导致周边行人、居民、抢险人员伤亡的重大事故。国务院于近日将该起 "山东省青岛市11?22中石化东黄输油管道泄漏爆炸" 事故认定为一起特别重大责任事故，并对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分，对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

本基金投资于"石化转债（110015）"的决策程序说明：基于石化转债基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于"石化转债"债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

报告期内本基金投资的前十名证券中其他九名证券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。

8.10.2 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。

8.10.3 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	43,937.16
2	应收证券清算款	1,559,979.78
3	应收股利	-
4	应收利息	18,836,795.16
5	应收申购款	366,546.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,807,258.66

8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	64,844,800.00	7.73
2	113003	重工转债	39,925,508.60	4.76
3	110018	国电转债	39,609,600.00	4.72
4	110020	南山转债	29,161,600.00	3.48
5	113001	中行转债	19,266,000.00	2.30
6	110023	民生转债	14,479,500.00	1.73
7	128001	泰尔转债	11,553,903.87	1.38
8	110022	同仁转债	9,995,200.00	1.19
9	110012	海运转债	9,394,727.00	1.12
10	110016	川投转债	8,647,317.20	1.03
11	126729	燕京转债	1,350,292.94	0.16
12	127001	海直转债	566,123.16	0.07
13	125089	深机转债	13,191.78	0.00

8.10.5 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不存在流通受限情况。

8.10.6 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

份额级别	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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
华富收益增强债券A	7,458	70,040.58	211,497,201.11	40.49%	310,865,462.57	59.51%
华富收益增强债券B	5,145	43,609.62	167,841.56	0.07%	224,203,630.90	99.93%
合计	12,603	59,250.51	211,665,042.67	28.35%	535,069,093.47	71.65%

注：本表列示"占总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华富收益增强债券A	-	-
	华富收益增强债券B	10,641.20	0.0047%
	合计	10,641.20	0.0014%

注：1)本表列示"占基金总份额比例"中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

2)本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理未持有本基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富收益增强债券A	华富收益增强债券B
基金合同生效日(2008年5月28日)基金份额总额	626,077,189.31	131,015,879.34
本报告期期初基金份额总额	616,380,747.67	407,290,876.40
本报告期基金总申购份额	500,625,879.08	271,539,920.18
减：本报告期基金总赎回份额	594,643,963.07	454,459,324.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	522,362,663.68	224,371,472.46

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、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，陈德义先生不再担任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理的职务。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因个人原因，陈德义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的职务。

3、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，郭晨先生不再担任华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理的职务。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任胡伟先生为华富保本混合型证券投资基金基金经理。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘刘文正先生为华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘孔庆卿先生为华富量子生命力股票型证券投资基金基金经理。

7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，增聘王光力先生为华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。

8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任胡伟先生为华富恒鑫债券型证券投资基金基金经理。

9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任龚炜先生为华富恒鑫债券型证券投资基金基金经理。

10、经华富基金管理有限公司股东会2013年度会议审议通过，增聘总经理姚怀然先生为公司董事会成员。

11、经华富基金管理有限公司第三届董事会第十九次会议审议通过，聘任陈大毅先生为华富基金管理有限公司副总经理。

12、经华富基金管理有限公司股东会2013年第三次临时会议审议通过，杨新潮先生不再担任公司董事职务，选举董建平先生为第四届董事会非独立董事。

13、本基金托管人2013年12月5日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所(特殊普通合伙)审计报酬为8万元人民币。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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
中投证券	2	232,012,760.78	100.00%	240,980.40	100.00%	-

注：此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
中投证券	2,321,475,386.34	100.00%	65,763,600,000.00	100.00%	-	-

注：1）根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。

2）本报告期本基金交易单元没有发生变化。

3）债券交易成交金额按照全价统计。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。