

华富保本混合型证券投资基金

[2015]第四季度报告

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
报告送出日期：2016年1月21日

§ 1 重要提示

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、完整性承担个别及连带责任。

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1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期间为2015年10月1日至2015年12月31日。

§ 2 基金产品概况

| 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 | | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 134,401,346.19份 | | | | |
| 投资目标 | 本基金采用恒定比例组合策略(CPPI)（Constant Proportion Portfolio Insurance），通过动态资产配置，在确保本金安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 | | | | |
| 投资策略 | 本基金在年内定期的对股票投资比例进行调整，最高不超过股票投资比例为三年期银行定期存款税后收益的150%，最低不低于股票投资比例的50%。同时根据市场情况，适时地调整股票投资比例，以达到本基金在不同阶段内追求资本增值与风险控制的平衡。 | | | | |
| 业绩比较基准 | 本基金在年内定期的对股票投资比例进行调整，最高不超过股票投资比例为三年期银行定期存款税后收益的150%，最低不低于股票投资比例的50%。 | | | | |
| 风险收益特征 | 本基金属于保本型理财产品，属中低风险品种，但并不保证本金一定盈利。 | | | | |
| 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 | | | | |
| 基金保证人 | 中海信托有限公司 | | | | |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | | | | | |
| 3.1 主要财务指标 | | | | | |
| 单位：人民币元 | | | | | |
| 主要财务指标 | 报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日) | | | | |
| 1.本期已实现收益 | 4,616,412.98 | | | | |
| 2.期初利润 | 5,137,791.69 | | | | |
| 3.本期利润当年累计份额本期利润 | 0.0392 | | | | |
| 4.期末基金份额净值 | 144,787,522.03 | | | | |
| 5.期末基金份额净值 | 10.07 | | | | |
| 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；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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 | | | | | |
| 3.2.1 基金净值表现 | | | | | |
| 3.2.1 本基金报告期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 | |
| 过去三个月 | 3.95% | 0.40% | 0.61% | 0.01% | |
| 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 | | | | | |
| 序号 | 名称 | 成立至今净值增长率 | 年化收益率 | 夏普指数 | 最近一年 |
| 1 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 2 | 华富基金管理有限公司 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 3 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 4 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 5 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 6 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 7 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 8 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 9 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 10 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 11 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 12 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 13 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 14 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 15 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 16 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 17 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 18 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 19 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 20 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 21 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 22 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 23 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 24 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 25 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 26 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 27 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 28 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 29 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 30 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 31 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 32 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 33 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 34 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 35 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 36 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 37 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 38 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 39 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 40 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 41 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 42 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 43 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 44 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 45 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 46 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 47 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 48 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 49 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 50 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 51 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 52 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 53 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 54 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 55 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 56 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 57 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 58 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 59 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 60 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 61 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 62 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 63 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 64 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 65 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 66 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 67 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 68 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 69 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 70 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 71 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 72 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 73 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 74 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 75 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 76 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 77 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 78 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 79 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 80 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 81 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 82 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 83 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 84 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 85 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 86 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 87 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 88 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 89 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 90 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 91 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787% | 10.07% | 3.40% | 0.38% |
| 92 | 华富保本混合型证券投资基金 | 144.787 | | | |