

华富恒稳纯债债券型证券投资基金 2015 年 半年度报告

2015 年 6 月 30 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

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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 2015 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.11 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息	40

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	40
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
§12 备查文件目录.....	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富恒稳纯债债券型证券投资基金	
基金简称	华富恒稳纯债债券	
基金主代码	000898	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 12 月 17 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	110,001,489.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富恒稳纯债债券 A	华富恒稳纯债债券 C
下属分级基金的交易代码:	000898	000899
报告期末下属分级基金的份额总额	72,607,462.95 份	37,394,026.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
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。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		章宏韬	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华富恒稳纯债债券 A	华富恒稳纯债债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,484,325.67	1,837,497.18
本期利润	6,156,333.48	2,065,378.71
加权平均基金份额本期利润	0.0277	0.0253
本期加权平均净值利润率	2.74%	2.50%
本期基金份额净值增长率	3.09%	2.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	2,217,507.27	1,044,387.69
期末可供分配基金份额利润	0.0305	0.0279
期末基金资产净值	74,971,734.10	38,514,026.86
期末基金份额净值	1.033	1.030
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	3.30%	3.00%

注：1) 本基金合同生效未满一年。

2) 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。

3) 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。

4) 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 6 月 30 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

华富恒稳纯债债券 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
过去一个月	0.39%	0.06%	0.43%	0.04%	-0.04%	0.02%
过去三个月	1.97%	0.06%	2.21%	0.09%	-0.24%	-0.03%
过去六个月	3.09%	0.06%	3.17%	0.09%	-0.08%	-0.03%
自基金合同生效起至今	3.30%	0.06%	4.12%	0.09%	-0.82%	-0.03%

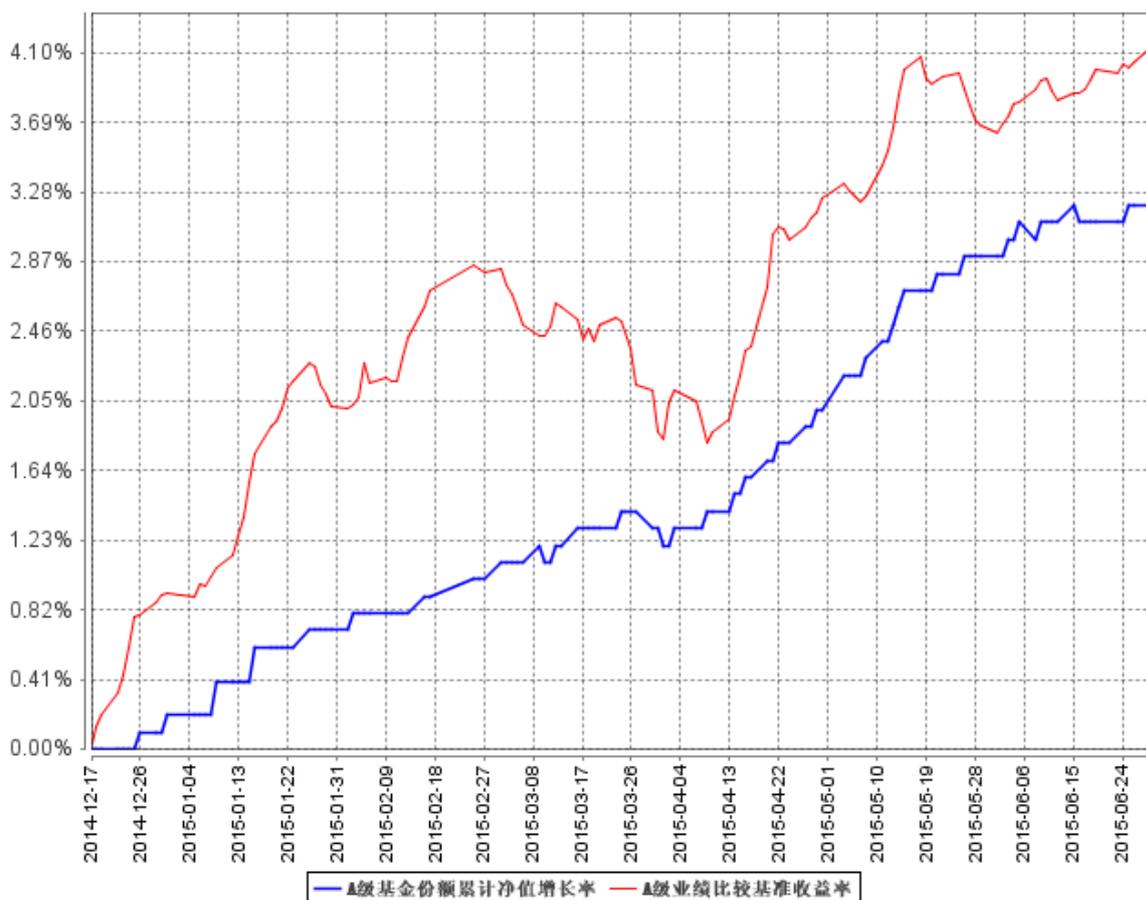
华富恒稳纯债债券 C

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
过去一个月	0.29%	0.03%	0.43%	0.04%	-0.14%	-0.01%
过去三个月	1.88%	0.05%	2.21%	0.09%	-0.33%	-0.04%
过去六个月	2.79%	0.05%	3.17%	0.09%	-0.38%	-0.04%
自基金合同生效起至今	3.00%	0.05%	4.12%	0.09%	-1.12%	-0.04%

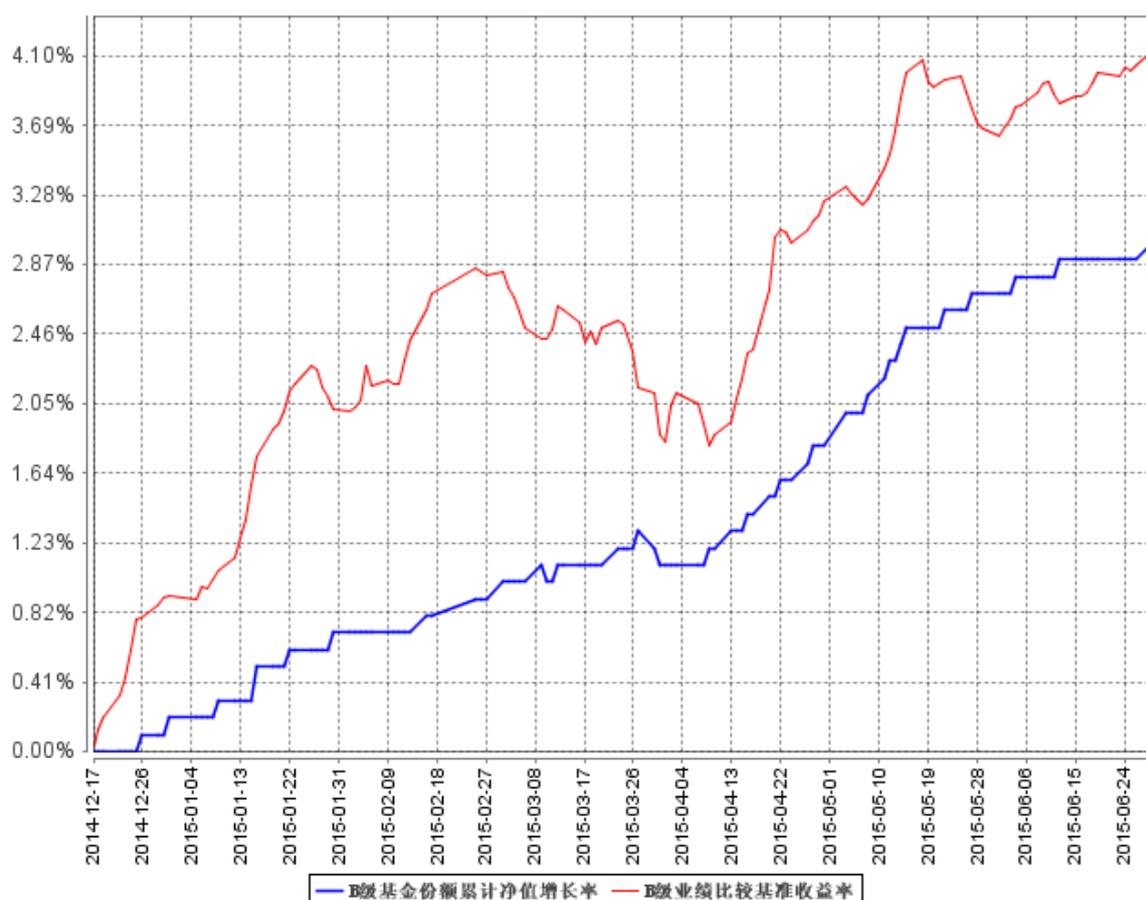
注: 本基金业绩比较基准=中证全债指数, 业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2014 年 12 月 17 日到 2015 年 6 月 17 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《华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 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 6 月

30 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、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和华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金十九只基金。

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	华富恒稳纯债债券型基金基金经理、华富收益增强债券型基金基金经理、华富保本混合型基金经理、华富恒富分级债券型基金基金经理、华富恒财分级债券型基金基金经理、华富旺财保本混合型基金经理、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	2014 年 12 月 17 日	-	十一年	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经理。

注：任职日期是指该基金成立之日。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，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行

为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

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。

4.3.2 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

2015 年上半年，中国经济整体处于软着陆的阶段，GDP 增长继续回落至 7%，7 月 PMI 再次跌回 50，总理指数跌至 0 附近，进出口今年以来持续负增长，固定资产投资回落至 11.4%，CPI 回落至 1.3%，PPI 跌幅扩大至 4.6%。二季度随着 330 楼市新政的发酵，新房销量在 5-6 月大幅回暖，6 月末商品房销售的同比增速回升至 4%，一线城市房价环比持续上涨，但是楼市回暖尚未传导至房地产开发投资，上半年新开工投资仍下滑 16%。全球范围，日本 6 月 PMI 下滑显著，欧元区 PMI 继续回暖，美国 6 月 PMI 和就业数据持续向好、消费信心好转，欧美经济好转的迹象越来越明显，或将制约欧美央行未来货币宽松的力度。二季度海外债券利率反弹显著，美国和德国十年国债均上行超过 20BP，一度在 5 月给国内带来巨大的压力，6 月份由于半年末，还有新股压力，资金面略显紧张，7 天回购一度反弹至 4.8%，央行降准降息齐发，为了稳定资金利率重启逆回购，并且持续下调利率，资金面再次宽松，7 天利率下行至 2.7% 附近。

大类资产配置的角度，6 月虽然是半年末，但是回购利率和国债利率的波动不大，央行维稳的力度超预期，债市长牛格局不变，三季度随着利差扩大后仍有较好的机会，但是一旦地方债务置换加速，经济筑底企稳，信贷投放加大，利率曲线重回平坦将很漫长，预计随着降息传导至理财收益走低，中长端信用债配置价值优于利率债。三季度最大的变数，来自加大基建投资和财政

赤字，或导致短期经济企稳预期升温，而 9 月进入消费旺季，CPI 或随着猪价持续反弹，导致债市套利空间被收窄。

上半年，由于市场风险偏好的上升，纯债类产品赎回压力较大，本基金减持了部分债券品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2014 年 12 月 17 日正式成立。截止到 2015 年 6 月 30 日，华富恒稳纯债债券 A 类基金份额净值为 1.033 元，累计份额净值为 1.033 元，本报告期的份额累计净值增长率为 3.09%，同期业绩比较基准收益率为 3.17%；华富恒稳纯债债券 C 基金份额净值为 1.030 元，累计份额净值为 1.030 元，本报告期的份额累计净值增长率为 2.79%，同期业绩比较基准收益率为 3.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，2015 年下半年依然是基建加码和地产回暖的一年，因此经济企稳、流动性充裕或是常态。7 月底召开的政治局会议已为下半年的政策奠定基调，仍是调结构和稳增长并进，国务院会在财政政策上加大刺激的力度，央行货币政策仍有放松空间。从社会融资来看，6 月显然已经加大信贷投放，而美联储 9 月加息预期导致的外汇占款流出在二季度显然尚未构成实质冲击，所以内生的流动性会持续充裕，而银行间利率不出意外继续低位，进而传导至理财产品和信贷利率，下半年的社会融资利率有望下行。展望下半年，经济虽然低迷但有望见底，货币政策继续维持宽松格局。上半年猪价反弹较快对下半年的通胀预期会有所修复，而三季度美联储加息也是大概率事件，总体而言我们认为债券牛市行情仍未走完，但面临的不确定因素在增多，阶段性波动将会比较频繁。

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。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《华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 8,221,712.19 元，期末可供分配利润为 3,261,894.96 元。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，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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富恒稳纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	634,625.89	505,191,961.18
结算备付金		731,546.74	-
存出保证金		14,206.55	-
交易性金融资产	6.4.7.2	130,923,480.18	87,889,996.00
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		130,923,480.18	87,889,996.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	80,000,000.00
应收证券清算款		2,199,531.57	-
应收利息	6.4.7.5	3,177,189.23	2,301,505.05
应收股利		-	-
应收申购款		1,353,745.98	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		139,034,326.14	675,383,462.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		22,199,989.10	-
应付证券清算款		2,700,587.38	44,089.45
应付赎回款		371,579.21	-
应付管理人报酬		58,672.34	155,148.85
应付托管费		19,557.44	51,716.28
应付销售服务费		12,872.63	20,871.94
应付交易费用	6.4.7.7	1,519.70	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	183,787.38	-
负债合计		25,548,565.18	271,826.52
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	110,001,489.92	673,603,487.32
未分配利润	6.4.7.10	3,484,271.04	1,508,148.39
所有者权益合计		113,485,760.96	675,111,635.71

负债和所有者权益总计		139,034,326.14	675,383,462.23
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.033 元、C 类基金份额净值 1.030 元，基金份额总额 110,001,489.92 份，A 类基金份额总额 72,607,462.95 份、C 类基金份额总额 37,394,026.97 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富恒稳纯债债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		10,283,979.89
1.利息收入		7,729,490.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,423,322.84
债券利息收入		4,548,354.06
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		757,813.44
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,536,208.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,536,208.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	899,889.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	118,391.63
减：二、费用		2,062,267.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	932,346.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	310,782.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	167,253.75
4. 交易费用	6.4.7.19	6,091.79
5. 利息支出		453,199.07
其中：卖出回购金融资产支出		453,199.07
6. 其他费用	6.4.7.20	192,594.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,221,712.19
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,221,712.19

注：本基金合同于 2014 年 12 月 17 日生效，无上年度可比期间。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富恒稳纯债债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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)	673,603,487.32	1,508,148.39	675,111,635.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,221,712.19	8,221,712.19
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)	-563,601,997.40	-6,245,589.54	-569,847,586.94
其中：1.基金申购款	8,758,658.91	178,619.10	8,937,278.01
2.基金赎回款	-572,360,656.31	-6,424,208.64	-578,784,864.95
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)	110,001,489.92	3,484,271.04	113,485,760.96

注：本基金合同于 2014 年 12 月 17 日生效，无上年度可比期间。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

章宏韬

基金管理人负责人

姚怀然

主管会计工作负责人

陈大毅

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富恒稳纯债债券型证券投资基金（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《华富恒稳纯债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[2014]1120 号文核准募集设立。本基金自 2014 年 11 月 24 日至 2014 年 12 月 12 日募集结束。经天健会计师事务所

所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（天健验（2014）6-101号）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人民币 673,396,408.06 元，有效认购款项在基金募集期间产生的利息共计人民币 207,079.26 元，折成基金份额，归投资人所有。本基金为契约型开放式，存续期限不定期，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 2014 年 12 月 17 日生效，该日的基金份额为 673,603,487.32 份基金单位。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 半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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期对持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，自 2015 年 3 月 30 日起主要依据第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工

具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

6.4.4.4.1 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

6.4.4.4.1.1 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.4.1.2 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于获得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减权证确定的成本确认债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

6.4.4.4.1.3 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证按附注 6.4.4.4.1.2 所示的方法确权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.4.2 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，

终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

6.4.4.3 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

6.4.4.5.1 股票投资

上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

首次公开发行但未上市股票采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

本基金投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

6.4.4.5.2 债券投资

上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，自 2015 年 3 月 30

日起主要依据第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值。

证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

银行间同业市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

6.4.4.5.3 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

6.4.4.5.4 如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于确认当日全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的，可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

6.4.4.10.1 基金管理人报酬

根据《华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6%的年费率逐日计提，按月支付。

6.4.4.10.2 基金托管费

根据《华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率逐日计提，按月支付。

6.4.4.10.3 销售服务费

根据《华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金资产净值 0.40% 的年费率逐日计提，按月支付。

6.4.4.10.4 其他费用

除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用，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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 50%。

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

同一类别每一基金份额享有同等分配权。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期对持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，自 2015 年 3 月 30 日起主要依据第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值。其他交易品种的会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 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:

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。

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。

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。

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。

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%。

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	634,625.89
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	634,625.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	89,800,796.48	90,660,480.18
	银行间市场	40,056,570.13	40,263,000.00
	合计	129,857,366.61	130,923,480.18
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	129,857,366.61	130,923,480.18	1,066,113.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	63.28
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	329.20
应收债券利息	3,176,790.35
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.40
合计	3,177,189.23

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,519.70
合计	1,519.70

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	307.68
应付审计费	34,712.18
应付信息披露费	148,767.52
合计	183,787.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富恒稳纯债债券 A		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	537,667,431.08	537,667,431.08
本期申购	3,554,926.08	3,554,926.08
本期赎回 (以 "-" 号填列)	-468,614,894.21	-468,614,894.21
本期末	72,607,462.95	72,607,462.95

金额单位：人民币元

华富恒稳纯债债券 C		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	135,936,056.24	135,936,056.24
本期申购	5,203,732.83	5,203,732.83
本期赎回 (以 "-" 号填列)	-103,745,762.10	-103,745,762.10
本期末	37,394,026.97	37,394,026.97

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华富恒稳纯债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,087,793.96	132,684.72	1,220,478.68
本期利润	5,484,325.67	672,007.81	6,156,333.48
本期基金份额交易产生的变动数	-4,354,612.36	-657,928.65	-5,012,541.01
其中：基金申购款	59,684.59	5,634.51	65,319.10
基金赎回款	-4,414,296.95	-663,563.16	-5,077,860.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,217,507.27	146,763.88	2,364,271.15

单位：人民币元

华富恒稳纯债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	254,130.20	33,539.51	287,669.71
本期利润	1,837,497.18	227,881.53	2,065,378.71
本期基金份额交易产生的变动数	-1,047,239.69	-185,808.84	-1,233,048.53
其中：基金申购款	101,326.14	11,973.86	113,300.00
基金赎回款	-1,148,565.83	-197,782.70	-1,346,348.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,044,387.69	75,612.20	1,119,999.89

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	68,077.32
定期存款利息收入	2,316,358.31
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	38,806.08
其他	81.13
合计	2,423,322.84

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,536,208.58
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,536,208.58

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	322,414,498.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	314,347,331.25
减：应收利息总额	6,530,959.00
买卖债券差价收入	1,536,208.58

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	899,889.34
——股票投资	-

——债券投资	899,889.34
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	899,889.34

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	78,303.60
转换费收入 000898	40,088.03
合计	118,391.63

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	991.79
银行间市场交易费用	5,100.00
合计	6,091.79

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	5,714.73
自营托管账户维护费	3,000.00
其他	400.00
合计	192,594.43

注：其他所列金额为证券账户开户费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元发生的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
华安证券	174,777,765.51	100.00%	-	-

注：本基金合同于 2014 年 12 月 17 日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华安证券	5,293,900,000.00	100.00%	-	-

注：本基金合同于 2014 年 12 月 17 日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
华安证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	932,346.52	-
其中：支付销售机构的客户维护费	572,297.19	-

注：本基金合同于2014年12月17日生效，无上年度可比期间。基金管理费按前一日基金资产净值0.6%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金管理费，E为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	310,782.14	-

注：本基金合同于2014年12月17日生效，无上年度可比期间。基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.3 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富恒稳纯债债券 A	华富恒稳纯债债券 C	合计
	华富基金管理有限公司	-	49,040.61
中国建设银行股份有限公司	-	116,035.67	116,035.67
华安证券股份有限公司	-	7.70	7.70
合计	-	165,083.98	165,083.98

注：本基金合同于 2014 年 12 月 17 日生效，无上年度可比期间。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 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 $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值）。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	634,625.89	68,077.32	-	-

注：本基金合同于 2014 年 12 月 17 日生效，无上年度可比期间。本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.10.6 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未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本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 22,199,989.10 元，于 2015 年 7 月 1 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	10,094,000.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	20,121,000.00	0.00
合计	30,215,000.00	0.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券、一年期以内的资产支持证券等债券基金可投资的短期信用产品。信用等级按期末评级结果列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	10,177,548.00	12,337,650.00
AAA 以下	110,697,932.18	75,552,346.00
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	120,875,480.18	87,889,996.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般

不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	634,625.89	-	-	-	-	-	634,625.89
结算备付金	731,546.74	-	-	-	-	-	731,546.74
存出保证金	14,206.55	-	-	-	-	-	14,206.55
交易性金融资产	1,000.10	17,189,080.00	79,258,601.90	34,474,798.18	-	-	130,923,480.18
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,199,531.57	2,199,531.57
应收利息	-	-	-	-	-	3,177,189.23	3,177,189.23
应收申购款	-	-	-	-	-	1,353,745.98	1,353,745.98
资产总计	1,381,379.28	17,189,080.00	79,258,601.90	34,474,798.18	-	6,730,466.78	139,034,326.14
负债							
卖出回购金融资产款	22,199,989.10	-	-	-	-	-	22,199,989.10
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,700,587.38	2,700,587.38

应付赎回款	-	-	-	-	-	371,579.21	371,579.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	58,672.34	58,672.34
应付托管费	-	-	-	-	-	19,557.44	19,557.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,872.63	12,872.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,519.70	1,519.70
其他负债	-	-	-	-	-	183,787.38	183,787.38
负债总计	22,199,989.10	-	-	-	-	3,348,576.08	25,548,565.18
利率敏感度缺口	-20,818,609.82	17,189,080.00	79,258,601.90	34,474,798.18	-	-3,381,890.70	113,485,760.96
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	505,191,961.18	-	-	-	-	-	505,191,961.18
交易性金融资产	-	-	-	87,046,996.00	843,000.00	-	87,889,996.00
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	-	-	80,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,301,505.05	2,301,505.05
资产总计	585,191,961.18	-	-	87,046,996.00	843,000.00	2,301,505.05	675,383,462.23
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	44,089.45	44,089.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	155,148.85	155,148.85
应付托管费	-	-	-	-	-	51,716.28	51,716.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,871.94	20,871.94
其他负债	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	271,826.52	271,826.52
利率敏感度缺口	585,191,961.18	-	-	87,046,996.00	843,000.00	2,029,678.53	675,111,635.71

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
市场利率下降 25 基点		-391, 228. 00	-
市场利率上升 25 基点		394, 312. 88	-

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	130, 923, 480. 18	115. 37	87, 889, 996. 00	13. 02
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	130, 923, 480. 18	115. 37	87, 889, 996. 00	13. 02

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，股票类权益资产占基金资产净值的比例为 0%，因此若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 95%
----	-------------

	2. 观察期 1 年		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2015 年 6 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)
	合计	76,746.00	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期对持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，自 2015 年 3 月 30 日起主要依据第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值。其他交易品种的会计估计无变更。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	130,923,480.18	94.17
	其中：债券	130,923,480.18	94.17
	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	1,366,172.63	0.98
7	其他各项资产	6,744,673.33	4.85
8	合计	139,034,326.14	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.11.3 期末其他各项资产构成。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,048,000.00	8.85
	其中：政策性金融债	10,048,000.00	8.85
4	企业债券	90,660,480.18	79.89
5	企业短期融资券	30,215,000.00	26.62
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	130,923,480.18	115.37

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	112107	12 云内债	100,000	10,359,000.00	9.13
2	122204	12 双良节	100,000	10,253,000.00	9.03
3	122866	10 杭交投	100,400	10,177,548.00	8.97
4	112092	12 海药债	100,000	10,110,000.00	8.91
5	041562011	15 鲁宏桥 CP001	100,000	10,094,000.00	8.89

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 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。

7.11.3 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	14,206.55
2	应收证券清算款	2,199,531.57
3	应收股利	-
4	应收利息	3,177,189.23
5	应收申购款	1,353,745.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,744,673.33

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华富恒稳纯债债券A	453	160,281.38	20,009,800.00	27.56%	52,597,662.95	72.44%
华富恒稳纯债债券C	203	184,207.03	20,000,000.00	53.48%	17,394,026.97	46.52%
合计	656	167,685.20	40,009,800.00	36.37%	69,991,689.92	63.63%

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。

8.2 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	华富恒稳纯债债券 A	0.00	0.0000%
	华富恒稳纯债债券 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

注：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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华富恒稳纯债债券 A	0
	华富恒稳纯债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	华富恒稳纯债债券 A	0

开放式基金	华富恒稳纯债债券 C	0
	合计	0

注：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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富恒稳纯债债券A	华富恒稳纯债债券C
基金合同生效日（2014 年 12 月 17 日）基金份额总额	537,667,431.08	135,936,056.24
本报告期期初基金份额总额	537,667,431.08	135,936,056.24
本报告期基金总申购份额	3,554,926.08	5,203,732.83
减：本报告期基金总赎回份额	468,614,894.21	103,745,762.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	72,607,462.95	37,394,026.97

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 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，因工作需要，王光力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，因工作需要，增聘陈启明先生为华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理。

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，增聘王翔先生为华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。

4、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，刘文正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。

5、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，龚炜先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

6、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，胡伟先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

7、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，增聘王夏儒先生为华富灵活配置混合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，因工作需要，聘任龚炜先生为华富国泰民安灵活配置混合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，因工作需要，聘任刘文正先生为华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

10、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，增聘张亮先生为华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

11、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，聘任胡伟先生为华富旺财保本混合型证券投资基金基金经理。

12、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，聘任张惠女士为华富旺财保本混合型证券投资基金基金经理。

13、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	2	-	-	-	-	-

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），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在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券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金无交易单元变化。

3) 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。

10.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华安证券	174,777,765.51	100.00%	5,293,900,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《华富基金管理有限公司关于网上直销交易平台上海银联支付渠道暂停部分服务的通知》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年1月13日
2	《华富恒稳纯债债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定投业务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年1月21日
3	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加恒丰银行股份有限公司开放式基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015年3月3日
4	《华富基金管理有限公司关于旗下基金增加上海联泰资	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证	2015年3月3日

	产管理有限公司为代销机构的公告》	券时报》上公告	
5	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海联泰资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 3 日
6	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加恒丰银行股份有限公司开放式基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 6 日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海天天基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 17 日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加齐鲁证券有限公司网上交易申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 21 日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 3 月 31 日
10	《华富基金管理有限公司关于恢复网上直销交易平台上海银联通支付渠道服务的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 4 月 8 日
11	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳众禄基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 4 月 8 日
12	《华富恒稳纯债债券型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 4 月 21 日
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与华龙证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 4 月 21 日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加一路财富（北京）信息科技有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 5 月 28 日

15	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 5 月 28 日
16	《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》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 6 月 5 日
17	《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》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 6 月 5 日
18	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 6 月 12 日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与华安证券股份有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 6 月 17 日
20	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中信建投证券基金申购费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2015 年 6 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富恒稳纯债债券型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富恒稳纯债债券型证券投资基金招募说明书》

4、报告期内华富恒稳纯债债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。