

华福长乐半年定期开放
债券型证券投资基金
2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：华福基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 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。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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日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。

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。

本报告期自 2015 年 6 月 9 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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..... | 6 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 其他指标..... | 9 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §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..... | 11 |
| 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明..... | 14 |
| 4.10 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 | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| §6 审计报告 | 14 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 14 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 15 |
| §7 年度财务报表 | 15 |
| 7.1 资产负债表..... | 15 |
| 7.2 利润表..... | 17 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 7.4 报表附注..... | 18 |
| §8 投资组合报告 | 37 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 37 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 38 |
| 8.3 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..... | 38 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 38 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 38 |

| | |
|---|-----------|
| 8.6 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 |
| 8.7 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 |
| 8.8 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 |
| 8.9 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 |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 39 |
| 8.11 投资组合报告附注 | 39 |
| §9 基金份额持有人信息..... | 40 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 40 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 40 |
| 9.3 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 | 41 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 41 |
| §11 重大事件揭示..... | 41 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 41 |
| 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 | 41 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 42 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 42 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 42 |
| 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 | 42 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 42 |
| 11.8 其他重大事件 | 42 |
| §12 备查文件目录..... | 43 |
| 12.1 备查文件目录 | 43 |
| 12.2 存放地点 | 43 |
| 12.3 查阅方式 | 43 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华福长乐定开债 |
| 基金主代码 | 001246 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 9 日 |
| 基金管理人 | 华福基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,000,469,095.13 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>2、债券投资组合策略</p> <p>在债券组合的构建和调整上，本基金综合运用久期配置、期限结构配置、类属资产配置、收益率曲线策略、杠杆放大策略等组合管理手段进行日常管理。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>（1）信用债投资策略</p> <p>本基金将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源，本基金将在内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。</p> <p>（2）可转换债券投资策略</p> <p>基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等，本基金在一、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。</p> <p>（3）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，长期预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

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 | | 华福基金管理有限责任公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 林佳 | 张志永 |
| | 联系电话 | 021-20296236 | 021-62677777-212004 |
| | 电子邮箱 | lj@hffunds.cn | zhangzhy@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 40000-96326 | 95561 |
| 传真 | | 021-68630069 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 福建省福州市平潭县潭城镇西航路西航住宅新区 11 号楼 4 楼 | 福州市湖东路 154 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号上海招商银行大厦 16 楼 | 上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200041 |
| 法定代表人 | | 陈文奇 | 高建平 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券日报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.hffunds.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及托管人办公处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------|--------------------------------|
| 会计师事务所 | 天健会计师事务所(特殊普通合伙) | 杭州市西溪路 128 号新湖商务大厦 9 层 |
| 注册登记机构 | 华福基金管理有限责任公司 | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 16 楼 |

§ 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 6 月 9 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
| 本期已实现收益 | 128,216,139.08 |
| 本期利润 | 291,603,056.60 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0583 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.73% |

| | |
|----------------------|------------------|
| 本期基金份额净值增长率 | 5.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末 |
| 期末可供分配利润 | 128,211,075.21 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0256 |
| 期末基金资产净值 | 5,292,063,557.28 |
| 期末基金份额净值 | 1.058 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2015 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 5.80% |

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

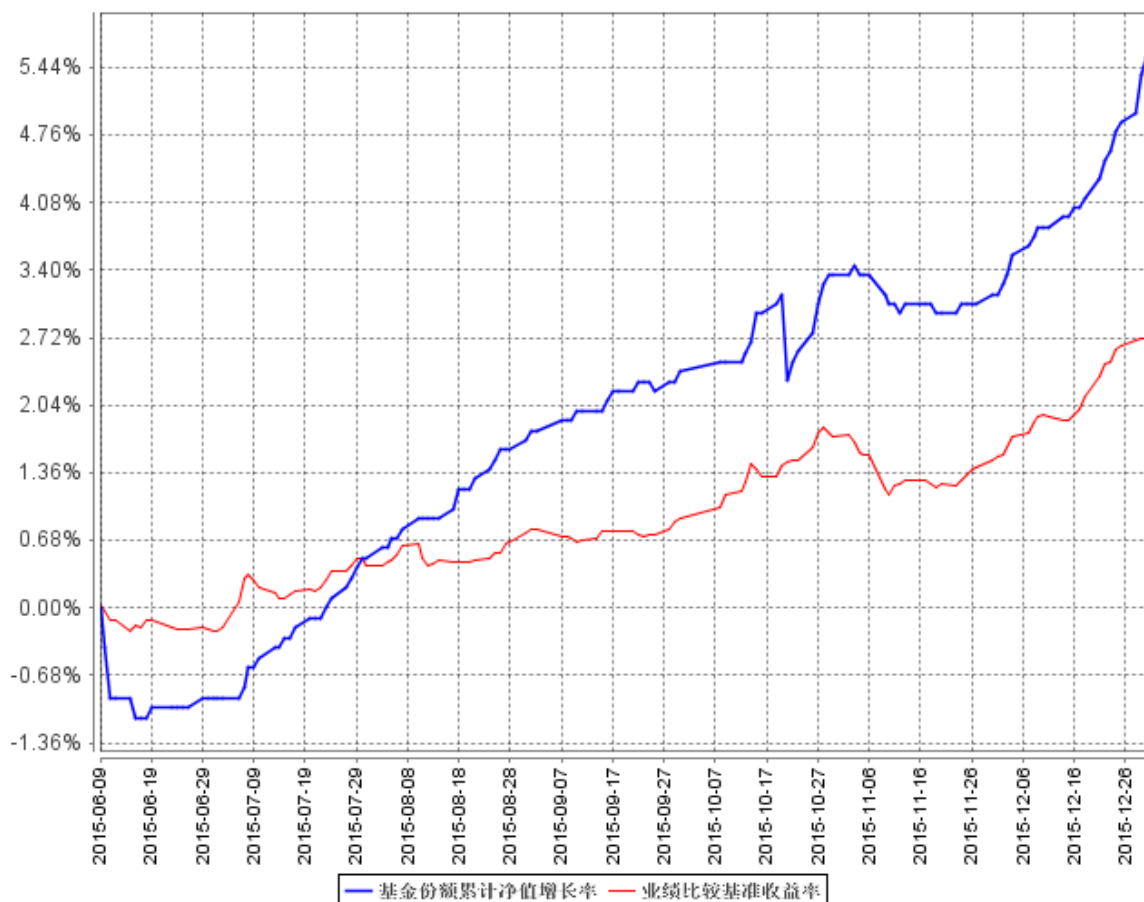
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 2.52% | 0.09% | 1.22% | 0.06% | 1.30% | 0.03% |
| 过去三个月 | 3.32% | 0.16% | 1.81% | 0.08% | 1.51% | 0.08% |
| 过去六个月 | 6.76% | 0.12% | 2.95% | 0.07% | 3.81% | 0.05% |
| 过去一年 | 5.80% | 0.13% | 2.74% | 0.07% | 3.06% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.80% | 0.13% | 2.74% | 0.07% | 3.06% | 0.06% |

注：本基金成立于 2015 年 6 月 9 日；

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数（0571.CS）

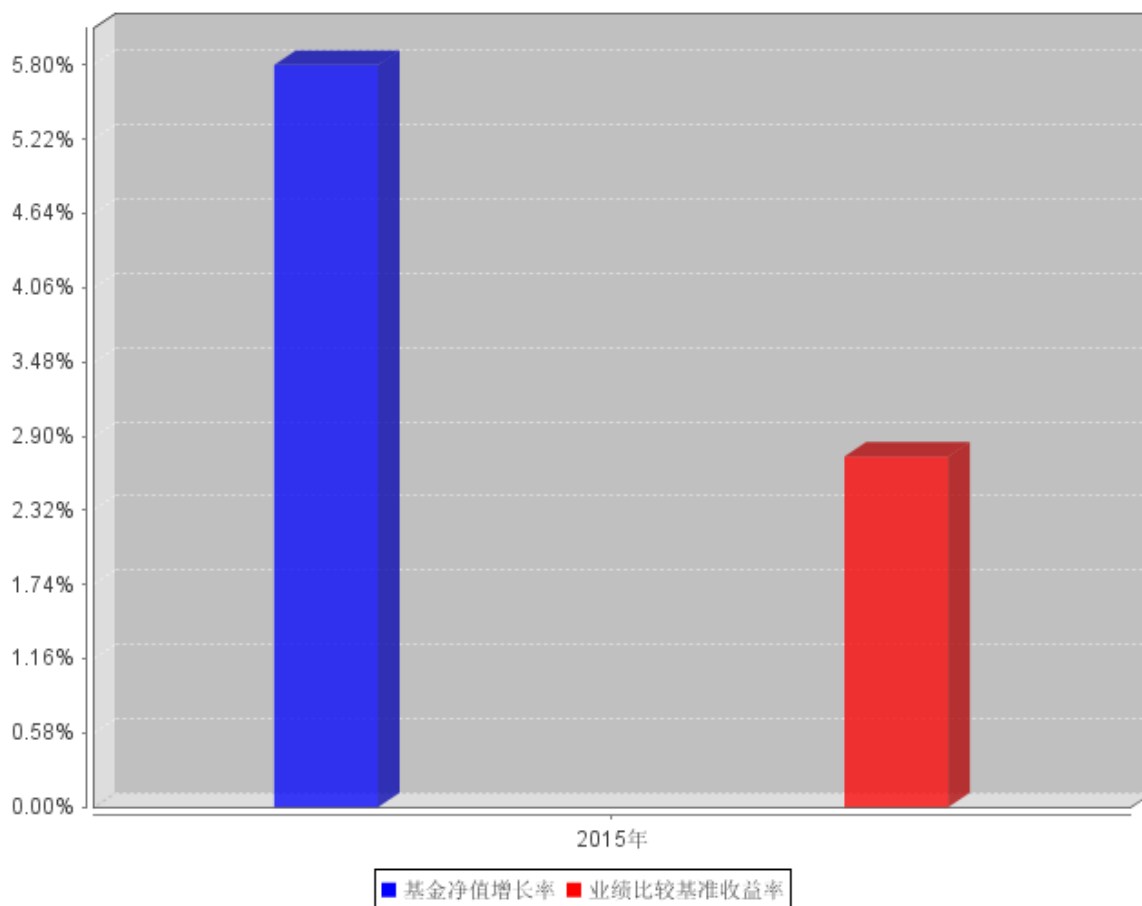
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

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对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金还未进行过利润分配。

§ 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

华福基金管理有限责任公司注册资本为 1 亿元人民币，注册地为福建省平潭综合实验区，公司办公场所位于上海市浦东新区。公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、

资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。

截至 2015 年 12 月 31 日，华福基金管理了华福货币市场基金、华福现金增利货币市场基金、华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金、华福瑞益纯债债券型证券投资基金、华福朝阳债券型证券投资基金、华福大健康灵活配置混合型证券投资基金、华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金、华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金及华福稳健债券型证券投资基金九支开放式基金。管理资产规模人民币 723 亿元。

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 | | |
| 陈博亮 | 本基金的基金经理、固定收益总监 | 2015 年 11 月 19 日 | - | 8 年 | 硕士研究生，拥有 8 年银行、基金行业工作经验。曾任职于中国农业银行金融市场部，历任交易员、投资经理、高级投资经理。现任华福基金管理有限责任公司固定收益总监，自 2015 年 11 月起担任华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2015 年 11 月起担任华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金基金经理、自 2015 年 11 月起担任华福现金增利货币市场基金基金经理、自 2015 年 12 月起担任华福朝阳债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 洪木妹 | 本基金的基金经理、公司总经理助理 | 2015 年 6 月 9 日 | - | 9 年 | 硕士研究生，特许金融分析师（CFA），拥有 9 年证券、基金行业工作经验。曾任职于华福证券有限责任公司投资自营部和资产管理总部，从事宏观经济研究和投资工作，现任华福基金管理有限责任公司总经理助理，自 2014 年 8 月起担任华福货币市场基金基金经理、自 2015 年 5 月起担任华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2015 年 6 月起担任华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金基金经理、自 2015 年 6 月起担任华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2015 年 11 月起担任华福现金增利货币市场基金基金经理、自 2015 年 11 月起担任华福瑞益纯债债券型证券投资基金基金经理、自 2015 年 12 月起担任华福稳健债券型证券投资基金基金经理。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规的规定及基金合同、招募说明书及其更新等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

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

本基金管理人制定了《华福基金管理有限责任公司公平交易管理流程》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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 年我国制造业产能过剩、地产高库存、私人部门去杠杆、政府投资基数过高等因素促使经济增速呈现疲弱走势。面对经济增速下台阶预期转浓、人民币贬值压力增大等情况，央行货币政策延续宽松，体现了降成本促改革、防止系统性风险以及对冲资本外流等意图，期间多次降准降息，并多次采用多种工具释放流动性。

在基本面和政策面等因素的支撑下，2015 年债市确立牛市基础。加之权益市场剧烈波动后，居民财富向固收类资管产品转移，相关配置需求主导了下半年债券收益率中枢的整体快速下移，利率债与中高评级信用债的价格涨幅明显。但值得关注的是，受宏观环境持续低迷影响，多数行业盈利能力走弱，信用违约事件由点状爆发转向片状扩散，钢铁、煤炭、有色和水泥等传统过剩行业以及部分商贸行业风险频发，低评级信用债利差分化加剧。

报告期内，我们预判债市收益率总体下行且信用环境有所恶化，我们精选并配置长久期高资质城投债，并适度增加杠杆，增配了部分长久期中票和企业债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期份额净值收益率为 5.80%，同期业绩比较基准收益率为 2.74%。

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，国际经济疲弱或超此前市场普遍预期，人民币仍有一定贬值压力，但相比 2015 年汇改前后有明显缓和。国内方面，在“供给侧改革”推动新兴产业发展与传统产业升级的过程中，经济或缓慢筑底，年内增速呈 L 型。期间财政政策与产业政策尚有发力空间，而央行进一步宽松空间较小，主要以各种对冲、平复过大波动的“稳”操作为主，倾向于使用更有针对性的货币市场工具，降准降息的次数或较少。同时，改革过程中信用违约风险总体上升，需重视中长期品种、低评级信用品种的收益率波动。

根据以上研判，我们预计资金面仍较为宽松，资产配置压力仍较大，资质较好品种仍受青睐，但债券市场收益率波动较大，需审慎对待。我们拟基本保持现有持仓，加强资产定价，逢高适度减持部分资产；利用货币市场利率较低的有利环境，增配部分流动性较好、收益较好的短期品种，增厚组合收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，不断健全完善内控机制，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。本基金管理人主要监察稽核工作如下：

(1) 加强公司和基金日常运作的合规审核。做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，确保基金运作的诚信和合法合规性符合监管要求。

(2) 深入重点专项稽核工作。本基金管理人进一步梳理业务模式、主要监管规则、潜在风险点等，全面、深入地对关键业务领域进行专项稽核，内容涵盖相关业务领域的各个重要环节的内部控制与风险防范，促进制度规章及时更新，优化操作流程，提升业务线合规管理及风控意识。

(3) 进一步规范对投资研究交易特定岗位的通讯管理。对投资研究交易特定岗位工具在交易时间的集中管理，并定期或不定期的对其网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

(4) 强化法规学习，开展内控培训，促进合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强内部

合规培训力度，深化基金从业人员风合规险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围，促进公司稳定健康地发展。

(5) 完成各种定期报告及临时公告的信息披露工作。按照法规的要求，做好旗下各支基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

估值委员会由公司督察长、监察稽核部、基金运营部、研究部、风险管理部组成。均具有丰富的证券研究、会计核算、风控、合规等证券投资基金行业从业经验及专业能力。估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；不定期对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或投资新品种的适用性，对新投资策略或投资新品种采用的估值方法作出决定。

(2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，基金收益分配原则为：1、本基金收益分配方式为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；2、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； 3、本基金每一基金份额享有同等分配权。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

无。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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（2016）7-64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 | 华福长乐半年定期开放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福长乐半年定期开放债券型证券投资基金（以下简称华福长乐定开债基金）财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年度的利润表和持有人权益（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福长乐定开债基金的基金管理人华福基金管理有限责任公司管理层的责任，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关于基金行业实务操作的有关规定的规定编制财务报表，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 | <p>我们的责任是在执行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中国注册会计师职业道德守则，计划和执行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。</p> <p>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，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。</p> <p>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。</p> | |
| 审计意见段 | 我们认为，华福长乐定开债基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和持有人权益（基金净值）变动。 | |
| 注册会计师的姓名 | 谭炼 | 吴志辉 |
| 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 | 中国杭州 | |
| 审计报告日期 | 2016 年 3 月 25 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金

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 |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 489,473,313.53 |
| 结算备付金 | | - |
| 存出保证金 | | 560,752.37 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 5,512,309,120.00 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 5,469,247,140.00 |
| 资产支持证券投资 | | 43,061,980.00 |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 999,552,539.33 |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 176,849,651.75 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 7,178,745,376.98 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 1,880,066,759.89 |
| 应付证券清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,770,148.96 |
| 应付托管费 | | 442,537.27 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 14,561.94 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | 4,247,811.64 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 140,000.00 |
| 负债合计 | | 1,886,681,819.70 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 5,000,469,095.13 |

| | | |
|------------|----------|------------------|
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 291,594,462.15 |
| 所有者权益合计 | | 5,292,063,557.28 |
| 负债和所有者权益总计 | | 7,178,745,376.98 |

7.2 利润表

会计主体：华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015年6月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2015年6月9日(基金合同 生效日)至2015年12月31 日 |
|----------------------------|------------|--|
| 一、收入 | | 310,538,628.77 |
| 1. 利息收入 | | 171,636,696.02 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 4,125,643.21 |
| 债券利息收入 | | 167,141,138.23 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 369,914.58 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -24,484,984.77 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -24,484,984.77 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.5 | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 163,386,917.52 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | - |
| 减：二、费用 | | 18,935,572.17 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 11,439,685.99 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 2,859,921.57 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 110,163.45 |
| 5. 利息支出 | | 4,252,741.16 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,252,741.16 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.20 | 273,060.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 291,603,056.60 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 291,603,056.60 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)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） | - | - | - |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 291,603,056.60 | 291,603,056.60 |
| 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） | 5,000,469,095.13 | -8,594.45 | 5,000,460,500.68 |
| 其中：1. 基金申购款 | 5,000,689,469.38 | - | 5,000,689,469.38 |
| 2. 基金赎回款 | -220,374.25 | -8,594.45 | -228,968.70 |
| 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） | 5,000,469,095.13 | 291,594,462.15 | 5,292,063,557.28 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 财务报表由下列负责人签署：

_____ 陈文奇 _____

基金管理人负责人

_____ 张力 _____

主管会计工作负责人

_____ 刘建新 _____

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金(以下简称本基金)经中国证监会证监许可(2015)609号文准予注册,由华福基金管理有限责任公司作为发起人,于2015年6月1日向社会公开发行募集并于2015年6月9日正式成立。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集规模不低于2亿份基金份额,基金募集金额不少于人民币2亿元且基金份额持有人的人数不少于200人。

本基金的基金管理人为华福基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2015 年 6 月 1 日至 2015 年 6 月 2 日，募集资金总额为人民币 5,000,689,469.38 元，其中募集资金的银行存款利息为人民币 50,000.14 元，上述资金业经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资，并由其出具《验证报告》（天健验〔2015〕6-79 号）。

根据《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》以及《华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）等有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、银行存款等以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可将其纳入投资范围。本基金不从二级市场买入股票或权证，也不参与一级市场新股申购或股票增发。可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

本基金的财务报表于 2016 年 3 月 28 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

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、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 9 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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和贷款及应收款项，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在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他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。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时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和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的不同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。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。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

4) 对于交易所市场和银行间市场交易的主要固定收益品种，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定除外。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净

值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

- 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入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。

- 公允价值变动收益

公允价值变动收益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，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times 0.40\%$ 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.10\%$ 的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 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；

2) 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;

3) 每一基金份额享有同等分配权;

4) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度,本基金整体为一个报告分部,且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内未发生会计估计的变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

本基金的各项税费参照证券投资基金公司缴纳。

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)、《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》(财税〔2005〕107号)、《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (一) 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。
- (二) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (三) 基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
- (四) 基金买卖股票自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,

买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 189,473,313.53 | - |
| 定期存款 | 300,000,000.00 | - |
| 其中：存款期限1-3个月 | 300,000,000.00 | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计： | 489,473,313.53 | - |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31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 | 163,301,408.81 | 164,560,940.00 |
| | 银行间市场 | 5,143,072,553.02 | 5,304,686,200.00 |
| | 合计 | 5,306,373,961.83 | 5,469,247,140.00 |
| 资产支持证券 | 42,548,240.65 | 43,061,980.00 | 513,739.35 |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 5,348,922,202.48 | 5,512,309,120.00 | 163,386,917.52 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31日 | |
|----|--------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |

| | | |
|------------|----------------|---|
| 买入返售证券_银行间 | 999,552,539.33 | - |
| 合计 | 999,552,539.33 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 317,934.37 |
| 应收定期存款利息 | 50,000.00 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | - |
| 应收债券利息 | 175,781,220.13 |
| 应收买入返售证券利息 | 369,914.58 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 330,582.67 |
| 合计 | 176,849,651.75 |

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 13,161.94 |
| 银行汇划费 | 1,400.00 |
| 合计 | 14,561.94 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |

| | |
|-------|------------|
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 140,000.00 |
| 合计 | 140,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年6月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | |
|---------------|--------------------------------------|------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 5,000,689,469.38 | 5,000,689,469.38 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -220,374.25 | -220,374.25 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 5,000,469,095.13 | 5,000,469,095.13 |

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 128,216,139.08 | 163,386,917.52 | 291,603,056.60 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,063.87 | -3,530.58 | -8,594.45 |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | -5,063.87 | -3,530.58 | -8,594.45 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 128,211,075.21 | 163,383,386.94 | 291,594,462.15 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年6月9日(基金合同生效日)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 |
|-----------|--------------------------------------|----------------------------------|
| | 活期存款利息收入 | 4,035,969.52 |
| 定期存款利息收入 | 50,000.00 | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 34,849.11 | - |

| | | |
|----|--------------|---|
| 其他 | 4,824.58 | - |
| 合计 | 4,125,643.21 | - |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年6月9日(基金合 同生效日)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 |
|-----------------------------------|--|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债 转股及债券到期兑付）差价收入 | -24,484,984.77 | - |
| 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 | -24,484,984.77 | - |

7.4.7.13.2 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6月9日(基金合 同生效日)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 |
|-----------------------------|--|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额 | 541,172,240.99 | - |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额 | 548,956,072.97 | - |
| 减：应收利息总额 | 16,701,152.79 | - |
| 买卖债券差价收入 | -24,484,984.77 | - |

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2015年6月9日(基金合 同生效日)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 |
|------------|--|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 163,386,917.52 | - |
| ——股票投资 | - | - |
| ——债券投资 | 162,873,178.17 | - |
| ——资产支持证券投资 | 513,739.35 | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2. 衍生工具 | - | - |

| | | |
|--------|----------------|---|
| ——权证投资 | - | - |
| 3. 其他 | - | - |
| 合计 | 163,386,917.52 | - |

7.4.7.18 其他收入

无。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年6月9日(基金合同生效 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 |
|-----------|--|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 92,106.70 | - |
| 银行间市场交易费用 | 18,056.75 | - |
| 合计 | 110,163.45 | - |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年6月9日(基金合同生 效日)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 |
|-------|--|--------------------------------------|
| 审计费用 | 50,000.00 | - |
| 信息披露费 | 90,000.00 | - |
| 银行汇划费 | 1,810.00 | - |
| 其他费用 | 128,250.00 | - |
| 帐户维护费 | 3,000.00 | - |
| 合计 | 273,060.00 | - |

7.4.7.21 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

| | |
|--------------|-----------------------|
| 华福基金管理有限责任公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 华福证券有限责任公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 国脉科技股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海兴瀚资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 兴银投资有限公司 | 基金管理人的股东华福证券全资子公司 |
| 华福资本投资有限公司 | 基金管理人的股东华福证券全资子公司 |

注：本报告期基金关联方增加基金管理人的全资子公司上海兴瀚资产管理有限公司，基金管理人的股东华福证券全资子公司兴银投资有限公司及华福资本投资有限公司。本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同生效日为 2015 年 6 月 9 日，以下仅为本基金报告期数据，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | |
|-------|---|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 华福证券 | 4,939,254,355.32 | 100.00% |

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|----|---|
| | |

| | |
|-----------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 11,439,685.99 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：本基金的管理费年费率为 0.4%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

本年度该基金无支付给销售机构的客户维护费。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 6 月 9 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,859,921.57 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2015 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 |
|-----|------------------|----------------------|
| 托管行 | 5,000,050,000.00 | 99.9916% |

除托管行投资本基金外，截止报告期末无其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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6月9日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | |
|-------|--------------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 托管行 | 189,473,313.53 | 4,035,969.52 |

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期内未持有流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期内未持有流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,880,066,759.89 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---------|----------|-----------------|--------|-----------|----------------|
| 1480075 | 14 廊坊经开债 | 2016 年 1 月 18 日 | 112.09 | 1,000,000 | 112,090,000.00 |
| 1480092 | 14 余经开债 | 2016 年 1 月 18 日 | 110.86 | 1,000,000 | 110,860,000.00 |
| 1480116 | 14 龙岩城发债 | 2016 年 1 月 18 日 | 111.17 | 500,000 | 55,585,000.00 |
| 1480127 | 14 江宁经开债 | 2016 年 2 月 1 日 | 115.29 | 1,000,000 | 115,290,000.00 |

| | | | | | |
|---------|-------------|-----------------|--------|------------|------------------|
| 1480149 | 14 贵阳水交债 01 | 2016 年 2 月 1 日 | 116.25 | 1,000,000 | 116,250,000.00 |
| 1480160 | 14 梧州东泰债 | 2016 年 2 月 1 日 | 112.33 | 1,000,000 | 112,330,000.00 |
| 1480184 | 14 防城港债 | 2016 年 2 月 1 日 | 110.03 | 300,000 | 33,009,000.00 |
| 1480063 | 14 酒经投债 | 2016 年 1 月 25 日 | 110.69 | 1,600,000 | 177,104,000.00 |
| 1480044 | 14 怀化债 02 | 2016 年 1 月 25 日 | 115.00 | 623,000 | 71,645,000.00 |
| 1480066 | 14 淮安新城债 01 | 2016 年 1 月 25 日 | 111.17 | 1,000,000 | 111,170,000.00 |
| 1580075 | 15 广安债 | 2016 年 1 月 8 日 | 106.92 | 1,000,000 | 106,920,000.00 |
| 1480539 | 14 海宁城投债 | 2016 年 1 月 8 日 | 105.07 | 700,000 | 73,549,000.00 |
| 1480046 | 14 锦开发债 02 | 2016 年 1 月 8 日 | 110.58 | 300,000 | 33,174,000.00 |
| 1480537 | 14 自贡高投债 | 2016 年 1 月 8 日 | 104.97 | 1,000,000 | 104,970,000.00 |
| 1480536 | 14 乐山国资债 | 2016 年 1 月 8 日 | 105.77 | 1,200,000 | 126,924,000.00 |
| 1480497 | 14 滨投债 | 2016 年 1 月 8 日 | 107.37 | 800,000 | 85,896,000.00 |
| 1480529 | 14 鹰投债 | 2016 年 1 月 8 日 | 105.76 | 1,500,000 | 158,640,000.00 |
| 1380213 | 13 西宁经开债 | 2016 年 1 月 8 日 | 104.92 | 500,000 | 52,460,000.00 |
| 1480272 | 14 柳州龙投债 | 2016 年 1 月 8 日 | 116.00 | 1,100,000 | 127,600,000.00 |
| 1380352 | 13 平度国资债 | 2016 年 1 月 8 日 | 108.54 | 900,000 | 97,686,000.00 |
| 1480042 | 14 泉州高新债 | 2016 年 1 月 8 日 | 111.45 | 1,000,000 | 111,450,000.00 |
| 合计 | | | | 19,023,000 | 2,094,602,000.00 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 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 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA | 230,096,000.00 |
| AAA 以下 | 5,138,049,640.00 |
| 未评级 | 101,101,500.00 |
| 合计 | 5,469,247,140.00 |

注：本基金期末持有资产支持证券 43,061,980.00 元，债项评级为 AAA 以下，上述统计未包含该类资产。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金投资于一家公司发行的股票市值

不超过基金资产净值的 10%，且本基金与本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

-

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持有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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变化而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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、存在保证金、债券投资及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2015 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 | 489,473,313.53 | - | - | - | - | - | 489,473,313.53 |
| 存出保证金 | 560,752.37 | - | - | - | - | - | 560,752.37 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 1,636,857,220.00 | 3,875,451,900.00 | - | 5,512,309,120.00 |
| 买入返售金融资产 | 999,552,539.33 | - | - | - | - | - | 999,552,539.33 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 176,849,651.75 | 176,849,651.75 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,489,586,605.23 | - | - | 1,636,857,220.00 | 3,875,451,900.00 | 176,849,651.75 | 7,178,745,376.98 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产 | 1,550,067,454.89 | 329,999,305.00 | - | - | - | - | 1,880,066,759.89 |

| | | | | | | | |
|---------|------------------|-----------------|---|------------------|------------------|----------------|------------------|
| 产款 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,770,148.96 | 1,770,148.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 442,537.27 | 442,537.27 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 4,247,811.64 | 4,247,811.64 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 14,561.94 | 14,561.94 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 140,000.00 | 140,000.00 |
| 负债总计 | 1,550,067,454.89 | 329,999,305.00 | - | - | - | 6,615,059.81 | 1,886,681,819.70 |
| 利率敏感度缺口 | -60,480,849.66 | -329,999,305.00 | - | 1,636,857,220.00 | 3,875,451,900.00 | 170,234,591.94 | 5,292,063,557.28 |

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|--------------|---------------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 除市场利率以外，其他市场变量保持不变； | |
| | 测算市场利率变动 25bp 对期末基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| 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 12 月 31 日） |
| | 利率增加 25 个 bp | -40,497,817.50 |
| 利率下降 25 个 bp | 40,497,817.50 | |

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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市场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债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金是债券型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对债券资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在不同久期、评级以及债券类型之间分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成有利于风险收益匹配的资产配置方案。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31日 | |
|---------------|--------------------|---------------|
| | 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 | 5,469,247,140.00 | 103.35 |
| 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 | 5,469,247,140.00 | 103.35 |

注：本基金期末持有资产支持证券 43,061,980.00 元，占基金资产净值比例为 0.81%。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 5,512,309,120.00 | 76.79 |
| | 其中：债券 | 5,469,247,140.00 | 76.19 |
| | 资产支持证券 | 43,061,980.00 | 0.60 |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 5 | 买入返售金融资产 | 999,552,539.33 | 13.92 |
| | 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 | 489,473,313.53 | 6.82 |
| 7 | 其他各项资产 | 177,410,404.12 | 2.47 |
| 8 | 合计 | 7,178,745,376.98 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 5,181,201,640.00 | 97.91 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 186,944,000.00 | 3.53 |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 101,101,500.00 | 1.91 |
| 10 | 合计 | 5,469,247,140.00 | 103.35 |

8.6 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 | 1380191 | 13 渝南发债 | 1,800,000 | 190,980,000.00 | 3.61 |
| 2 | 1480063 | 14 酒经投债 | 1,600,000 | 177,104,000.00 | 3.35 |
| 3 | 1480200 | 14 衢州国资债 | 1,500,000 | 165,975,000.00 | 3.14 |
| 4 | 1480244 | 14 渝保税港债 | 1,500,000 | 165,855,000.00 | 3.13 |
| 5 | 1480529 | 14 鹰投债 | 1,500,000 | 158,640,000.00 | 3.00 |

8.7 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 1589068 | 15 兴银 2B | 437,000 | 43,061,980.00 | 0.81 |

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.11.2

本基金投资范围不包含股票，不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.11.3 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 | 560,752.37 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 176,849,651.75 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 177,410,404.12 |

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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

| 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 |
| 306 | 16,341,402.27 | 5,000,050,000.00 | 99.99% | 419,095.13 | 0.01% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 7,897.79 | 0.0002% |
|------------------|----------|---------|

9.3 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 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015年6月9日）基金份额总额 | 5,000,689,469.38 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 220,374.25 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 5,000,469,095.13 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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) 报告期内本基金基金管理人人事变动如下：

2015年3月12日，基金管理人发布了高级管理人员变更公告，本基金管理人的总理由张力同志正式任职，原总经理林煜同志正式离任；

2015年6月4日，基金管理人发布了高级管理人员任职公告，卢银英同志正式担任本基金管理人的副总经理。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内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

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为天健会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自 2015 年起为本基金提供审计服务至今，本报告期应支付审计费 50,000 元。

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

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到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 | | 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 | |
| 华福证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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 | | 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 |
| 华福证券 | 4,939,254,355.32 | 100% | - | - | - | - |

11.8 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 | 华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金份额发售公告 | 证券日报、公司网站 | 2015 年 5 月 7 日 |
| 2 | 华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告 | 证券日报、公司网站 | 2015 年 6 月 10 日 |
| 3 | 华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告 | 证券日报、公司网站 | 2015 年 10 月 28 日 |
| 4 | 华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告 | 证券日报、公司网站 | 2015 年 11 月 21 日 |
| 5 | 华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金开放申购（赎回）业务公告 | 证券日报、公司网站 | 2015 年 12 月 4 日 |
| 6 | 华福现金增利货币市场基金等基金新增海通证券为代销机构的公告 | 证券日报、公司网站 | 2015 年 12 月 8 日 |
| 7 | 关于旗下基金新增好买基金为代销机构的公告 | 证券日报、公司网站 | 2015 年 12 月 14 日 |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

公司网站：www.hffunds.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人华福基金管理有限责任公司。

客户服务中心电话：40000-96326

华福基金管理有限责任公司
2016 年 3 月 29 日