

华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 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 8 月 26 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华福鼎新灵活配置
基金主代码	001339
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 25 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	196,429,864.05 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>本基金是混合型基金，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，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。</p> <p>本基金由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。本基金采用积极灵活的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，对基金资产进行灵活资产配置。在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。</p>
业绩比较基准	<p>五年期银行定期存款利率（税后）+1%</p> <p>其中，五年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构五年期人民币存款基准利率。</p>
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

§ 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-22,773,136.23
本期利润	-31,204,923.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1583
本期基金份额净值增长率	-14.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0781
期末基金资产净值	182,725,153.70
期末基金份额净值	0.930

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	1.97%	0.76%	0.45%	0.02%	1.52%	0.74%
过去三个月	1.09%	0.71%	1.37%	0.01%	-0.28%	0.70%
过去六个月	-14.52%	1.60%	2.77%	0.02%	-17.29%	1.58%
自基金合同生效起至今	-1.98%	1.36%	6.35%	0.02%	-8.33%	1.34%

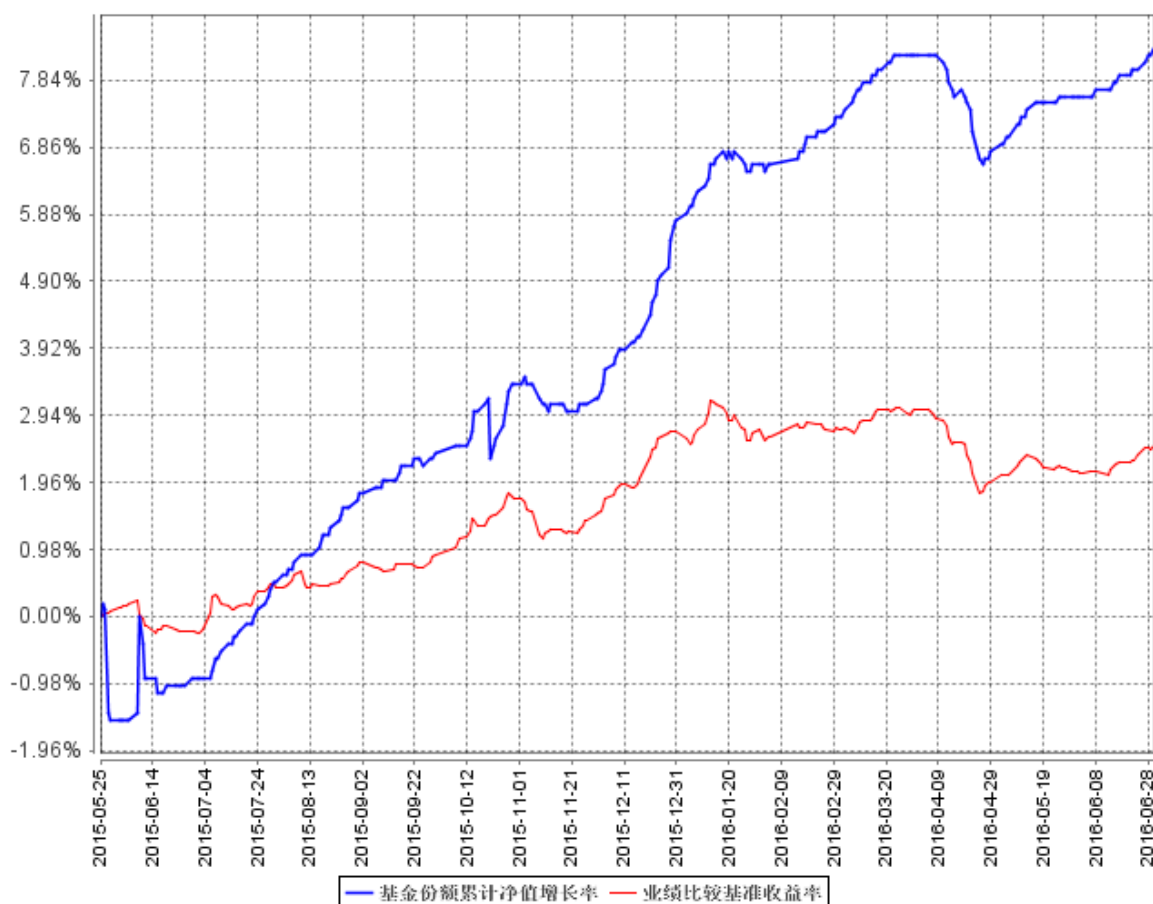
注：1、本基金成立于 2015 年 5 月 25 日；

2、比较基准为：五年银行定期存款利率（税后）+1%；

3、本基金 2016 年 2 季度业绩表现以本报告“过去三个月”业绩表现数据为准。

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



注：1、本基金成立于 2015 年 5 月 25 日；
2、比较基准为：五年银行定期存款利率（税后）+1%

§ 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，公司主要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 2016 年 6 月 30 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、华福稳健债券型证券投资基金及华福长禧半年定期开放债券型证券投资基金十只开放式基金，管理公募基金资产规模人民币 589.32 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、自2016年5月起担任华福长禧半年定期开放债券型证券投资基金基金经理。
洪木妹	本基金的基金经理、公司总经理助理	2015年5月25日	2016年6月29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、于2015年5月至2016年6月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。本报告期内本基金基金经理发生变动，洪木妹女士不再担任本基金基金经理，仅由陈博亮先生担任本基金基金经理。

1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

洪木妹女士为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。本报告期内本基金基金经理发生变动，洪木妹女士不再担任本基金基金经理，仅由陈博亮先生担任本基金基金经理。

2、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间向交易价差的分析，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2016 年上半年，国内宏观经济补库存活动早于此前市场预期结束；货币政策总体仍较宽松。就固收市场而言，收益率先上后下，总体下行，信用利差的行业分化进一步加剧。就权益市场而言，板块轮动与主题切换频繁，指数总体振幅不大。本基金控制权益产品仓位在中等水平，加强固收产品投资以及新股认购，增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金期末份额净值为 0.987 元；

报告期内，基金份额净值增长率为-14.52%，业绩比较基准收益率为 2.77%。

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 年下半年，英国脱欧及后续事件的持续冲击将拖累全球经济复苏步伐，预计国内宏观经济总体疲弱，通胀压力较小，供给侧改革与适度的政策托底并行不悖。

就权益市场而言，延续前期震荡市的判断，经过上半年的波动，去年以来大起大落的影响趋于消散，或存在结构化行情。就固收市场而言，收益率震荡中有所下行，可能挑战前低；信用违约事件仍将较多，信用利差行业分化格局延续。继续看好业绩确定、增长前景较好的企业以及细

分龙头。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 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

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管运营保障部的公司领导担任，成员由基金事务部、风险管理部、监察稽核部、研究发展部、投资管理部门(视会议议题内容选择相关投资方向部门)部门负责人或其指定人员组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

2. 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

3. 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4. 已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

本报告期本基金没有应分配但尚未分配的利润。

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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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

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

本托管人认真复核了本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		45,592,599.05	6,099,124.63
结算备付金		181,210.96	1,591,901.12
存出保证金		273,155.38	722,712.94
交易性金融资产		106,628,859.99	207,981,769.94
其中: 股票投资		96,640,859.99	167,835,769.94
基金投资		-	-
债券投资		9,988,000.00	40,146,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		50,000,000.00	-
应收证券清算款		108,995.18	-
应收利息		119,493.56	1,151,477.33
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		202,904,314.12	217,546,985.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		19,886,443.67	-
应付赎回款		-	54,377.30
应付管理人报酬		147,674.23	351,113.02
应付托管费		14,767.43	35,111.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		36,439.73	1,518,666.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		93,835.36	130,000.00
负债合计		20,179,160.42	2,089,268.24
所有者权益:			
实收基金		196,429,864.05	198,095,267.11
未分配利润		-13,704,710.35	17,362,450.61
所有者权益合计		182,725,153.70	215,457,717.72

负债和所有者权益总计		202,904,314.12	217,546,985.96
------------	--	----------------	----------------

6.2 利润表

会计主体：华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 25 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-29,835,503.25	-27,306,839.01
1.利息收入		657,436.04	6,167,092.34
其中：存款利息收入		385,501.82	4,549,125.04
债券利息收入		158,688.00	47,520.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		113,246.22	1,570,446.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-22,061,814.27	-28,439,335.56
其中：股票投资收益		-23,411,030.20	-28,532,198.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-84,608.09	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,433,824.02	92,862.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-8,431,787.75	-5,074,892.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		662.73	40,296.83
减：二、费用		1,369,420.73	4,435,419.80
1. 管理人报酬		901,819.73	2,869,118.09
2. 托管费		90,181.94	286,911.83
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		264,278.08	1,255,010.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		113,140.98	24,379.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-31,204,923.98	-31,742,258.81
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-31,204,923.98	-31,742,258.81
-------------------	--	----------------	----------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	198,095,267.11	17,362,450.61	215,457,717.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-31,204,923.98	-31,204,923.98
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）	-1,665,403.06	137,763.02	-1,527,640.04
其中：1.基金申购款	103,751.76	-9,379.65	94,372.11
2.基金赎回款	-1,769,154.82	147,142.67	-1,622,012.15
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）	196,429,864.05	-13,704,710.35	182,725,153.70
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 25 日（基金合同生效日）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）	996,360,866.50	-	996,360,866.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-31,742,258.81	-31,742,258.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,429,533,190.36	-36,421,744.10	2,393,111,446.26

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	2,436,839,670.15	-36,553,470.61	2,400,286,199.54
2.基金赎回款	-7,306,479.79	131,726.51	-7,174,753.28
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）	3,425,894,056.86	-68,164,002.91	3,357,730,053.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.3 财务报表由下列负责人签署：

<u>陈文奇</u>	<u>张力</u>	<u>刘建新</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2015 年 5 月 11 日证监许可（2015）878 号注册募集，本基金首次募集资金总额为人民币 996,360,866.50 元。本基金基金合同于 2015 年 5 月 25 日起正式生效。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。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）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，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4)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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

注：本报告期末不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。

6.4.7.2 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
兴业银行股份有限公司	基金托管人
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
华福证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华福证券有限责任公司	-	-	1,008,448,501.24	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2015 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
华福证券有限责任	-	-	1,098,200,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内未进行权证投资。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
华福证券有限责任公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 5 月 25 日 (基金合同生效日) 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
华福证券有限责任公司	716,402.64	100.00%	716,402.64	100.00%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 25 日 (基金合同 生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	901,819.73	2,869,118.09
其中：支付销售机构的客户维护费	6.72	0.00

本基金的管理费率年费率为 1.0%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	90,181.94	286,911.83

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 25 日(基金合同生效日)至 2015 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
兴业银行股份有限公司	45,592,599.05	385,501.82	380,767,371.78	2,391,138.93

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	1,435	18,626.30	18,626.30	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,436	12,191.64	12,191.64	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	425	2,465.00	2,465.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：本报告期内本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	96,640,859.99	47.63

	其中：股票	96,640,859.99	47.63
2	固定收益投资	9,988,000.00	4.92
	其中：债券	9,988,000.00	4.92
	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	50,000,000.00	24.64
	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	45,773,810.01	22.56
7	其他各项资产	501,644.12	0.25
8	合计	202,904,314.12	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	73,465,023.54	40.21
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	23,113,000.00	12.65
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,710.35	0.02
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	20,126.10	0.01
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	96,640,859.99	52.89

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 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	600572	康恩贝	1,365,985	8,851,582.80	4.84
2	600276	恒瑞医药	212,305	8,515,553.55	4.66
3	002262	恩华药业	416,801	8,398,540.15	4.60
4	002055	得润电子	260,000	7,961,200.00	4.36
5	600826	兰生股份	300,000	7,854,000.00	4.30
6	000501	鄂武商 A	500,000	7,845,000.00	4.29
7	600600	青岛啤酒	260,000	7,558,200.00	4.14
8	000963	华东医药	110,000	7,414,000.00	4.06
9	600066	宇通客车	330,000	6,534,000.00	3.58
10	000530	大冷股份	600,000	6,396,000.00	3.50

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

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	002055	得润电子	13,317,088.53	6.18
2	600572	康恩贝	13,240,709.30	6.15
3	600826	兰生股份	10,062,405.61	4.67
4	600900	长江电力	9,783,860.00	4.54
5	600005	武钢股份	9,750,944.00	4.53
6	600600	青岛啤酒	9,032,359.24	4.19
7	600737	中粮屯河	8,544,430.21	3.97
8	600660	福耀玻璃	8,272,313.50	3.84

9	002001	新和成	6,062,142.78	2.81
10	600066	宇通客车	5,947,324.00	2.76
11	600649	城投控股	4,751,618.62	2.21
12	002179	中航光电	4,224,505.25	1.96
13	000530	大冷股份	2,039,765.50	0.95
14	300511	雪榕生物	22,320.14	0.01
15	601966	玲珑轮胎	18,626.30	0.01
16	603868	飞科电器	18,102.12	0.01
17	603528	多伦科技	17,000.55	0.01
18	002795	永和智控	16,943.85	0.01
19	300510	金冠电气	16,789.50	0.01
20	603726	朗迪集团	15,964.53	0.01

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

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	600005	武钢股份	26,977,720.23	12.52
2	600896	中海海盛	13,667,670.00	6.34
3	601336	新华保险	13,226,000.00	6.14
4	000060	中金岭南	10,522,422.40	4.88
5	600900	长江电力	9,551,944.50	4.43
6	601021	春秋航空	7,696,003.70	3.57
7	600584	长电科技	6,940,566.50	3.22
8	000530	大冷股份	6,226,193.51	2.89
9	002055	得润电子	6,040,260.14	2.80
10	000501	鄂武商 A	5,957,794.56	2.77
11	600737	中粮屯河	5,440,297.00	2.52
12	000963	华东医药	4,601,039.20	2.14
13	601992	金隅股份	3,957,552.57	1.84
14	600649	城投控股	3,780,000.00	1.75
15	600066	宇通客车	3,421,297.31	1.59
16	600572	康恩贝	3,069,022.00	1.42
17	002262	恩华药业	2,991,607.70	1.39
18	600276	恒瑞医药	2,418,254.00	1.12
19	600660	福耀玻璃	2,384,266.00	1.11
20	600826	兰生股份	2,242,415.00	1.04

7.4.3 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	105,319,972.28
卖出股票收入（成交）总额	144,619,619.53

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	9,988,000.00	5.47
	其中：政策性金融债	9,988,000.00	5.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,988,000.00	5.47

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	160204	16 国开 04	100,000	9,988,000.00	5.47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本报告期内本基金未进行资产支持证券投资。

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

注：本报告期内本基金未进行贵金属投资。

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

注：本报告期内本基金未进行权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本报告期内本基金未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金报告期内未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

本报告期内，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	273,155.38
2	应收证券清算款	108,995.18
3	应收股利	-
4	应收利息	119,493.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	501,644.12

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期内本基金未进行可转债的投资。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期内本基金未存在流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

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
315	623, 586. 87	180, 667, 570. 01	91. 98%	15, 762, 294. 04	8. 02%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金未上市交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金管理人所有从业人员期末未持有本基金。

8.4 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

期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 5 月 25 日 ）基金份额总额	996, 360, 866. 50
本报告期期初基金份额总额	198, 095, 267. 11
本报告期基金总申购份额	103, 751. 76
减：本报告期基金总赎回份额	1, 769, 154. 82
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	196, 429, 864. 05

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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) 报告期内本基金基金管理人人事变动如下：

2016 年 3 月 29 日，基金管理人发布了高级管理人员变更公告，由林佳同志正式担任本基金

管理人的督察长，原督察长郑燕洪同志正式离任。

(2) 报告期内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

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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

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改聘为基金审计的会计师事务所。

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

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。

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	
平安证券有限责任公司	2	249,649,086.07	100.00%	97,137.88	100.00%	-
华福证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动资源，协助基金投资；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

选择程序：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选证券公司的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的证券公司。

2、报告期内租用证券公司交易单元未发生变更。

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
平安证券有限责任公司	-	-	835,000,000.00	100.00%	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

华福基金管理有限责任公司
2016 年 8 月 26 日