

**华安宏利混合型证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

## 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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	14
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	14
<b>5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
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	39
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	41
<b>8 基金份额持有人信息</b>	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	42
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4 基金投资策略的改变 .....	43
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
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 .....	46
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安宏利混合型证券投资基金	
基金简称	华安宏利混合	
基金主代码	040005	
交易代码	040005(前端)	041005(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年9月6日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
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	696,749,373.25 份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益，以及分红所带来的红利收益，实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合，并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持，使其更为科学和客观。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×90%+同业存款利率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

### 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		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32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		朱学华	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、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-518,243,164.62
本期利润	-642,677,634.73
加权平均基金份额本期利润	-0.9163
本期加权平均净值利润率	-25.43%
本期基金份额净值增长率	-20.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,807,136,499.35
期末可供分配基金份额利润	2.5937
期末基金资产净值	2,503,885,872.60
期末基金份额净值	3.5937
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	358.60%

注：1、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：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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、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（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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	3.20%	1.15%	-0.44%	0.88%	3.64%	0.27%
过去三个月	-1.18%	1.24%	-1.78%	0.91%	0.60%	0.33%
过去六个月	-20.35%	1.82%	-13.88%	1.66%	-6.47%	0.16%
过去一年	-18.35%	2.52%	-26.16%	2.05%	7.81%	0.47%
过去三年	70.06%	1.92%	39.86%	1.63%	30.20%	0.29%
自基金合同生效起至今	358.60%	1.71%	130.10%	1.72%	228.50%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×90% + 金融同业存款利率×10%。

根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的 60-95%，债券的投资比例为基金资产净值的 5-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5% 以上。

#### 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

华安宏利混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006 年 9 月 6 日至 2016 年 6 月 30 日)



## 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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分



地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板 50ETF 等 77 只开放式基金。管理资产规模达到 1403.87 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
王春	基金经理	2015-10-28	-	14 年	硕士研究生，14 年证券、基金行业从业经验。曾任德恒证券研究所研究员、兴业证券研究所市场研究部主管、平安资产管理有限责任公司投资经理兼研究总监、汇丰晋信基金基金经理兼策略与金融工程总监。2015 年 5 月加入华安基金，2015 年 10 月起担任本基金的基金经理；2015 年 11 月起担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理。
翁启森	基金经理，基金投资部兼全球投资部高级总监，公司总经理助理	2014-03-18	-	20 年	工业工程学硕士，20 年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，任全球投资部总监。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部总监。2014 年 3

				月起同时担任本基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015 年 2 月起同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任公司总经理助理。2015 年 3 月起同时担任华安物联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。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》等有关法律法规及基金合同、招募说明书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，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经

理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风控部门的监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现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% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

#### 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，沪深 A 股市场大幅下跌。其中，传媒、计算机、餐饮旅游等高估值行业跌幅领先；而食品饮料、家电、银行等低估值行业跌幅相对较小。在经历了年初的快速熔断之后，A 股市场呈现底部抬高的震荡反弹走势。本基金上半年总体保持中性偏低的仓位，重点配置了有色金属、钢铁、煤炭、通讯、家电等板块，但由于反弹中仓位偏低和部分板块配置时机失当导致净值表现欠佳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 3.5937 元, 本报告期份额净值增长率为-20.35%, 同期业绩比较基准增长率为-13.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年, 中国经济继续保持低位运行态势, 供给侧改革成为上半年各项经济政策的主基调。政府在保持经济平稳增长的同时, 进一步加大经济结构调整力度, 通过各种方式和手段调整经济结构, 推进经济转型。从实际效果来看, 过剩产能开始有序进入化解阶段; 以移动互联网、新能源、工业 4.0 等为代表的新经济也逐步取代传统的旧经济, 成为中国经济的主要亮点。

从 A 股市场走势来看, 整体市场仍然处于估值泡沫的修复阶段。由于宏观经济低位运行, 企业盈利增速放缓, 市场较难出现系统性的投资机会。但另一方面, 由于流动性宽裕, 市场博弈气氛浓厚, 板块和个股波动剧烈, 主题机会也此起彼伏。从投资方向来看, 未来我们将重点关注下阶段不断推出的各项促进经济转型的政策, 重点在政策鼓励的投资方向和投资领域之中寻找投资机会。

#### 4.6 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

公司建立基金估值委员会, 组成人员包括: 基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括: 证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时, 负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值; 同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历:

翁启森, 基金投资部兼全球投资部高级总监, 总经理助理, 工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券

任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利混合、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网主题股票、华安宝利配置混合、华安生态优先混合的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安策略优选混合、华安国企改革灵活配置、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数 (LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理,指数投资部高级总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

## (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、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理翁启森作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

5、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。

6、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**

本报告期不进行收益分配。

**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**

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 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**

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：华安宏利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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	482,627,271.56	462,539,513.03
结算备付金		8,761,600.63	14,049,507.76
存出保证金		1,567,181.61	2,395,758.18
交易性金融资产	6.4.7.2	2,151,872,288.50	2,708,602,584.63
其中：股票投资		1,981,236,288.50	2,542,660,084.63
基金投资		-	-
债券投资		170,636,000.00	165,942,500.00
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		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.3	3,037,288.58	3,208,266.17
应收股利		-	-
应收申购款		314,876.23	1,872,137.37
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,648,180,507.11</b>	<b>3,192,667,767.14</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
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		128,017,253.35	15,996,967.40
应付赎回款		3,351,702.45	4,607,685.27
应付管理人报酬		3,041,388.49	4,015,024.96
应付托管费		506,898.09	669,170.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	8,676,183.54	6,566,525.40
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	701,208.59	905,642.42
<b>负债合计</b>		<b>144,294,634.51</b>	<b>32,761,016.27</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.6	696,749,373.25	700,364,110.18
未分配利润	6.4.7.7	1,807,136,499.35	2,459,542,640.69
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,503,885,872.60</b>	<b>3,159,906,750.87</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,648,180,507.11</b>	<b>3,192,667,767.14</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.5937 元，基金份额总额 696,749,373.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安宏利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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-597,200,685.19</b>	<b>2,121,153,560.71</b>
1.利息收入		4,484,937.16	4,717,275.38
其中：存款利息收入	6.4.7.8	2,005,016.54	278,185.64
债券利息收入		2,479,920.62	4,439,089.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-477,310,230.41	1,766,027,394.23
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-486,156,471.18	1,749,424,763.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	-592,410.00	-164,870.00
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	6.4.7.11	9,438,650.77	16,767,500.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	-124,434,470.11	349,887,376.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	59,078.17	521,515.01
<b>减：二、费用</b>		<b>45,476,949.54</b>	<b>47,671,694.01</b>
1. 管理人报酬		18,894,334.93	32,519,173.72
2. 托管费		3,149,055.86	5,419,862.23



3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.14	23,210,836.09	9,515,890.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.15	222,722.66	216,767.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-642,677,634.73</b>	<b>2,073,481,866.70</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-642,677,634.73</b>	<b>2,073,481,866.70</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安宏利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）	700,364,110.18	2,459,542,640.69	3,159,906,750.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-642,677,634.73	-642,677,634.73
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）	-3,614,736.93	-9,728,506.61	-13,343,243.54
其中：1.基金申购款	31,066,882.66	82,186,379.17	113,253,261.83
2.基金赎回款	-34,681,619.59	-91,914,885.78	-126,596,505.37
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）	696,749,373.25	1,807,136,499.35	2,503,885,872.60
项目	上年度可比期间 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）	1,419,530,389.60	2,541,077,082.53	3,960,607,472.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,073,481,866.70	2,073,481,866.70
三、本期基金份额交易产	-607,523,089.14	-1,852,414,753.20	-2,459,937,842.34

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	115,515,770.85	330,116,332.44	445,632,103.29
2.基金赎回款	-723,038,859.99	-2,182,531,085.64	-2,905,569,945.63
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）	812,007,300.46	2,762,144,196.03	3,574,151,496.49

报表附注为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：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安宏利混合型证券投资基金(原名为华安宏利股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 143 号《关于同意华安宏利股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,683,963,683.51 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 112 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 9 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,684,224,358.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 260,674.66 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华安宏利股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安宏利混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的 60%-95%,债券的投资比例为基金资产净值的 5%-40%,现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5%以上。根据《华安

基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准的公告》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起本基金的业绩比较基准由“中信标普 300 指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%”变更为“沪深 300 指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%”。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2016 年 8 月 23 日批准报出。

#### **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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》各项具体及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宏利股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年上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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **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**

本会计期间不存在会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本会计期间不存在会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本会计期间不存在差错更正。

#### **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。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。

(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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	482,627,271.56
定期存款	-

其他存款	-
合计	482,627,271.56

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,860,235,769.47	1,981,236,288.50	121,000,519.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	170,933,300.00	170,636,000.00
	合计	170,933,300.00	170,636,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,031,169,069.47	2,151,872,288.50	120,703,219.03

#### 6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	34,594.84
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	3,548.52
应收债券利息	2,998,510.54
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	634.68
合计	3,037,288.58

#### 6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,675,508.54
银行间市场应付交易费用	675.00

合计	8,676,183.54
----	--------------

#### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	2,175.96
应付后端申购费	128.47
预提审计费	49,726.04
预提信息披露费	149,178.12
合计	701,208.59

#### 6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	700,364,110.18	700,364,110.18
本期申购	31,066,882.66	31,066,882.66
本期赎回（以“-”号填列）	-34,681,619.59	-34,681,619.59
本期末	696,749,373.25	696,749,373.25

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.7 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
上年度末	2,531,555,630.11	-72,012,989.42	2,459,542,640.69
本期利润	-518,243,164.62	-124,434,470.11	-642,677,634.73
本期基金份额交易产生的变动数	-9,227,071.75	-501,434.86	-9,728,506.61
其中：基金申购款	101,080,714.25	-18,894,335.08	82,186,379.17
基金赎回款	-110,307,786.00	18,392,900.22	-91,914,885.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,004,085,393.74	-196,948,894.39	1,807,136,499.35

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	1,906,669.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	84,132.45
其他	14,214.68
合计	2,005,016.54

#### 6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	7,674,905,357.74
减：卖出股票成本总额	8,161,061,828.92
买卖股票差价收入	-486,156,471.18

#### 6.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	118,690,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	116,071,690.00
减：应收利息总额	3,210,720.00
买卖债券差价收入	-592,410.00

#### 6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,438,650.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,438,650.77

#### 6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-124,434,470.11
——股票投资	-124,429,630.11
——债券投资	-4,840.00

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-124,434,470.11

#### 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	59,078.17
合计	59,078.17

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	23,209,936.09
银行间市场交易费用	900.00
合计	23,210,836.09

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
银行汇划费用	14,818.50
帐户维护费	9,000.00
合计	222,722.66

### 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**

无。

**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
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）均无应支付关联方的佣金。

**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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,894,334.93	32,519,173.72

其中：支付销售机构的客户维护费	2,348,929.68	4,138,501.60
-----------------	--------------	--------------

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

#### 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
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,149,055.86	5,419,862.23

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 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

单位：人民币元

本期						
2016年1月1日至2016年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	10,074,441.58	-	-	-	-	-

#### 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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间均未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**

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2016 年 6 月 30 日）和上年度末（2015 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

**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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1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
中国建设银行	482,627,271.56	1,906,669.41	146,804,986.39	254,720.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**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**

本报告期不进行收益分配。

**6.4.12 期末（2016 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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
60196	玲珑	2016-0	2016-0	网下	12.98	12.98	15,341	199,12	199,12	-

6	轮胎	6-24	7-06	中签			.00	6.18	6.18	
---	----	------	------	----	--	--	-----	------	------	--

#### 6.4.12.2 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000975	银泰资源	2016-04-19	重大事项停牌	14.39	-	-	2,560,607.00	38,468,683.99	36,847,134.73	-
002072	凯瑞德	2016-02-24	重大事项停牌	23.44	-	-	754,900.00	17,451,554.64	17,694,856.00	-
002101	广东鸿图	2016-05-03	重大事项停牌	21.62	-	-	900,206.00	19,944,457.78	19,462,453.72	-
002278	神开股份	2016-04-01	重大事项停牌	13.25	2016-07-05	12.71	460,800.00	6,709,148.40	6,105,600.00	-
002347	泰尔重工	2016-04-05	重大事项停牌	19.45	2016-07-18	21.40	159,053.00	2,873,169.37	3,093,580.85	-
002587	奥拓电子	2016-04-20	重大事项停牌	14.45	2016-07-28	14.00	86,237.00	1,287,766.74	1,246,124.65	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大事项停牌	27.47	-	-	407,700.00	11,084,195.74	11,199,519.00	-
300353	东土科技	2016-06-23	重大事项停牌	22.09	-	-	1,874,726.00	38,414,589.28	41,412,697.34	-
600556	慧球科技	2016-01-20	重大事项停牌	16.19	2016-07-07	14.22	864,666.00	22,382,984.36	13,998,942.54	-

#### 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

截至报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投

资及权证投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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以上风险控制在限定的范围之内，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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

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。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，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，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。

#### 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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于 2016 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2015 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 6.4.13.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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%，且本基金与由本基金的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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注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，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2016 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部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。

#### 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金持有的利率敏感性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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	482,627,271.56	-	-	-	482,627,271.56
结算备付金	8,761,600.63	-	-	-	8,761,600.63
存出保证金	1,567,181.61	-	-	-	1,567,181.61
交易性金融资产	170,636,000.00	-	-	1,981,236,288.50	2,151,872,288.50
应收利息	-	-	-	3,037,288.58	3,037,288.58
应收申购款	-	-	-	314,876.23	314,876.23
资产总计	663,592,053.80	-	-	1,984,588,453.31	2,648,180,507.11
负债					
应付证券清算款	-	-	-	128,017,253.35	128,017,253.35
应付赎回款	-	-	-	3,351,702.45	3,351,702.45
应付管理人报酬	-	-	-	3,041,388.49	3,041,388.49
应付托管费	-	-	-	506,898.09	506,898.09
应付交易费用	-	-	-	8,676,183.54	8,676,183.54
其他负债	-	-	-	701,208.59	701,208.59

负债总计	-	-	-	144,294,634.51	144,294,634.51
利率敏感度缺口	663,592,053.80	-	-	1,840,293,818.80	2,503,885,872.60
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	462,539,513.03	-	-	-	462,539,513.03
结算备付金	14,049,507.76	-	-	-	14,049,507.76
存出保证金	2,395,758.18	-	-	-	2,395,758.18
交易性金融资产	165,942,500.00	-	-	2,542,660,084.63	2,708,602,584.63
应收利息	-	-	-	3,208,266.17	3,208,266.17
应收申购款	-	-	-	1,872,137.37	1,872,137.37
资产总计	644,927,278.97	-	-	2,547,740,488.17	3,192,667,767.14
负债					
应付证券清算款	-	-	-	15,996,967.40	15,996,967.40
应付赎回款	-	-	-	4,607,685.27	4,607,685.27
应付管理人报酬	-	-	-	4,015,024.96	4,015,024.96
应付托管费	-	-	-	669,170.82	669,170.82
应付交易费用	-	-	-	6,566,525.40	6,566,525.40
其他负债	-	-	-	905,642.42	905,642.42
负债总计	-	-	-	32,761,016.27	32,761,016.27
利率敏感度缺口	644,927,278.97	-	-	2,514,979,471.90	3,159,906,750.87

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.81%(2015 年 12 月 31 日：5.25%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。



#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 60-95%，债券的投资比例为基金资产净值的 5-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5% 以上。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 VaR(Value at Risk) 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	1,981,236,288. 50	79.13	2,542,660,084. .63	80.47

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,981,236,288.50	79.13	2,542,660,084.63	80.47

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的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：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 13,119	增加约 16,400
	业绩比较基准下降 5%	减少约 13,119	减少约 16,400

#### 6.4.14 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	1,981,236,288.50	74.82
	其中：股票	1,981,236,288.50	74.82
2	固定收益投资	170,636,000.00	6.44
	其中：债券	170,636,000.00	6.44
	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	491,388,872.19	18.56
7	其他各项资产	4,919,346.42	0.19
8	合计	2,648,180,507.11	100.00

## 7.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	94,982,537.20	3.79
C	制造业	1,322,161,619.54	52.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	775,274.28	0.03
F	批发和零售业	3,756,800.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	126,714,715.98	5.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	323,793,545.16	12.93
J	金融业	95,122,997.37	3.80
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	0.00
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	13,908,672.87	0.56
S	综合	-	-
	合计	1,981,236,288.50	79.13

### 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

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	300017	网宿科技	1,263,396	84,900,211.20	3.39
2	002597	金禾实业	4,507,499	60,716,011.53	2.42
3	002508	老板电器	1,565,510	57,563,802.70	2.30
4	000418	小天鹅 A	1,528,735	49,867,335.70	1.99
5	600547	山东黄金	1,233,917	48,011,710.47	1.92
6	002179	中航光电	1,057,587	45,814,668.84	1.83
7	002035	华帝股份	1,870,533	45,790,647.84	1.83
8	600338	西藏珠峰	1,545,835	45,432,090.65	1.81
9	000858	五粮液	1,394,814	45,373,299.42	1.81
10	002335	科华恒盛	932,840	45,261,396.80	1.81
11	000733	振华科技	1,973,900	44,412,750.00	1.77
12	300075	数字政通	1,685,265	43,227,047.25	1.73
13	600522	中天科技	4,399,778	43,117,824.40	1.72
14	600050	中国联通	11,284,100	42,992,421.00	1.72
15	603128	华贸物流	4,369,458	42,864,382.98	1.71
16	600115	东方航空	6,414,500	42,399,845.00	1.69
17	000748	长城信息	2,136,182	41,911,890.84	1.67
18	600487	亨通光电	3,323,823	41,813,693.34	1.67
19	603377	东方时尚	911,200	41,450,488.00	1.66
20	300353	东土科技	1,874,726	41,412,697.34	1.65
21	601012	隆基股份	3,100,735	40,464,591.75	1.62
22	300078	思创医惠	1,206,689	40,351,680.16	1.61
23	000783	长江证券	3,368,900	39,079,240.00	1.56
24	002383	合众思壮	1,086,812	38,940,473.96	1.56
25	000063	中兴通讯	2,665,424	38,222,180.16	1.53
26	002716	金贵银业	2,046,032	38,056,195.20	1.52
27	600521	华海药业	1,563,266	38,018,629.12	1.52
28	600172	黄河旋风	2,041,900	37,632,217.00	1.50
29	002609	捷顺科技	2,109,822	37,111,768.98	1.48
30	000975	银泰资源	2,560,607	36,847,134.73	1.47
31	002090	金智科技	1,214,335	35,665,018.95	1.42
32	600988	赤峰黄金	1,880,204	35,065,804.60	1.40
33	300098	高新兴	2,135,900	33,918,092.00	1.35
34	300360	炬华科技	1,487,176	33,654,792.88	1.34
35	002537	海立美达	1,087,300	33,053,920.00	1.32
36	000404	华意压缩	3,221,529	30,991,108.98	1.24
37	000066	长城电脑	2,376,802	30,304,225.50	1.21
38	300310	宜通世纪	681,861	26,040,271.59	1.04
39	601009	南京银行	2,411,865	22,647,412.35	0.90
40	002142	宁波银行	1,417,429	20,949,600.62	0.84
41	300389	艾比森	813,579	19,989,636.03	0.80

42	002101	广东鸿图	900,206	19,462,453.72	0.78
43	300363	博腾股份	779,603	19,349,746.46	0.77
44	300458	全志科技	174,875	18,708,127.50	0.75
45	002072	凯瑞德	754,900	17,694,856.00	0.71
46	300377	赢时胜	357,300	17,682,777.00	0.71
47	600689	上海三毛	1,155,556	17,599,117.88	0.70
48	300275	梅安森	686,900	15,585,761.00	0.62
49	600562	国睿科技	436,000	14,950,440.00	0.60
50	603899	晨光文具	838,517	14,841,750.90	0.59
51	002169	智光电气	640,900	14,580,475.00	0.58
52	600556	慧球科技	864,666	13,998,942.54	0.56
53	300144	宋城演艺	558,357	13,908,672.87	0.56
54	600436	片仔癀	294,200	13,241,942.00	0.53
55	002191	劲嘉股份	1,093,600	12,674,824.00	0.51
56	002500	山西证券	751,615	12,446,744.40	0.50
57	300166	东方国信	407,700	11,199,519.00	0.45
58	002281	光迅科技	172,400	11,068,080.00	0.44
59	300324	旋极信息	515,619	11,065,183.74	0.44
60	300053	欧比特	472,500	8,575,875.00	0.34
61	000426	兴业矿业	1,018,800	7,661,376.00	0.31
62	002157	正邦科技	313,431	7,353,091.26	0.29
63	002278	神开股份	460,800	6,105,600.00	0.24
64	600382	广东明珠	234,800	3,756,800.00	0.15
65	601965	中国汽研	386,900	3,718,109.00	0.15
66	002347	泰尔重工	159,053	3,093,580.85	0.12
67	000603	盛达矿业	134,700	2,462,316.00	0.10
68	300114	中航电测	81,600	2,431,680.00	0.10
69	002587	奥拓电子	86,237	1,246,124.65	0.05
70	000801	四川九洲	99,000	1,219,680.00	0.05
71	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
72	002308	威创股份	20,000	328,600.00	0.01
73	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
74	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
75	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
76	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
77	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
78	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
79	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
80	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
81	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
82	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
83	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
84	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
85	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 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	002335	科华恒盛	128,868,105.01	4.08
2	000807	云铝股份	100,393,960.23	3.18
3	600028	中国石化	89,340,205.00	2.83
4	002357	富临运业	88,024,418.94	2.79
5	600050	中国联通	80,572,983.96	2.55
6	002074	国轩高科	75,212,347.53	2.38
7	600019	宝钢股份	74,317,166.78	2.35
8	300198	纳川股份	72,580,488.23	2.30
9	300017	网宿科技	70,261,132.54	2.22
10	000858	五粮液	68,907,690.54	2.18
11	600172	黄河旋风	67,452,049.77	2.13
12	600489	中金黄金	66,227,321.13	2.10
13	002597	金禾实业	65,279,013.46	2.07
14	002508	老板电器	64,050,430.36	2.03
15	600782	新钢股份	63,849,632.20	2.02
16	002609	捷顺科技	63,186,959.38	2.00
17	600406	国电南瑞	59,264,731.10	1.88
18	600689	上海三毛	58,472,051.42	1.85
19	002281	光迅科技	58,311,902.63	1.85
20	600219	南山铝业	57,101,916.78	1.81

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 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	002357	富临运业	106,574,591.45	3.37
2	002335	科华恒盛	93,730,518.64	2.97
3	601021	春秋航空	92,010,063.99	2.91
4	601169	北京银行	87,569,607.25	2.77
5	000807	云铝股份	86,295,958.76	2.73
6	600028	中国石化	85,813,826.70	2.72
7	002074	国轩高科	80,116,838.52	2.54
8	300198	纳川股份	77,521,025.04	2.45

9	002444	巨星科技	72,118,566.97	2.28
10	600136	当代明诚	69,781,024.68	2.21
11	600019	宝钢股份	67,766,832.15	2.14
12	600489	中金黄金	65,485,328.74	2.07
13	002142	宁波银行	64,684,802.20	2.05
14	600519	贵州茅台	62,955,105.81	1.99
15	600172	黄河旋风	61,847,659.66	1.96
16	600562	国睿科技	60,053,727.02	1.90
17	600219	南山铝业	58,253,629.36	1.84
18	601166	兴业银行	58,105,907.40	1.84
19	300017	网宿科技	56,724,468.08	1.80
20	600900	长江电力	56,225,903.57	1.78

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	7,724,067,662.90
卖出股票的收入（成交）总额	7,674,905,357.74

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	170,636,000.00	6.81
	其中：政策性金融债	170,636,000.00	6.81
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	170,636,000.00	6.81

#### 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	150408	15 农发 08	700,000	70,665,000.00	2.82
2	150215	15 国开 15	300,000	30,000,000.00	1.20
3	150222	15 国开 22	300,000	29,997,000.00	1.20
4	110240	11 国开 40	200,000	20,008,000.00	0.80
5	160209	16 国开 09	200,000	19,966,000.00	0.80

#### 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。

#### 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

本基金本报告期没有投资股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 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

无。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。



**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，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。

7.12.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**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	1,567,181.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,037,288.58
5	应收申购款	314,876.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,919,346.42

**7.12.4 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。

**7.12.5 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。

**7.12.6 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
70,177	9,928.46	20,806,395.31	2.99%	675,942,977.94	97.01%

### 8.2 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	67,513.83	0.01%

### 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 9 月 6 日）基金份额总额	1,684,224,358.17
本报告期期初基金份额总额	700,364,110.18
本报告期基金总申购份额	31,066,882.66
减：本报告期基金总赎回份额	34,681,619.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	696,749,373.25

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

无。

### 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财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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	
海通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	3,505,540,164.16	22.77%	3,264,694.95	23.04%	-
国泰君安	1	2,685,502,202.89	17.44%	2,447,302.90	17.27%	-
上海证券	2	1,492,616,888.84	9.70%	1,360,223.15	9.60%	-
光大证券	1	1,398,512,379.93	9.08%	1,274,466.26	8.99%	-
瑞银证券	1	1,382,476,073.68	8.98%	1,259,852.34	8.89%	-
方正证券	1	1,058,507,850.70	6.88%	964,620.47	6.81%	-
广发证券	1	732,357,710.87	4.76%	682,041.82	4.81%	-
华泰证券	1	615,340,630.69	4.00%	573,063.17	4.04%	-
兴业证券	1	555,467,961.68	3.61%	517,308.40	3.65%	-
银河证券	1	539,846,584.69	3.51%	502,760.07	3.55%	-
中信证券	1	487,515,632.73	3.17%	454,021.16	3.20%	-
东北证券	1	436,664,919.80	2.84%	406,664.30	2.87%	-
中泰证券	1	217,995,345.68	1.42%	198,660.23	1.40%	-
广州证券	2	161,235,617.44	1.05%	146,935.20	1.04%	-
中信建投	1	125,301,703.15	0.81%	116,691.16	0.82%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (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，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动物体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果

进行审核，并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3.报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2016 年 2 月完成退租托管在建行基金的德邦证券 33187 交易单元。

2016 年 3 月完成退租托管在建行基金的长城证券 27450 交易单元。

**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		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
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

## 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	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-04
2	华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
3	华安基金关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-07
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“众信旅游”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-08
5	关于旗下部分基金增加金牛网为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-14
6	华安基金管理有限公司关于参加渤海银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-19
7	华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-19
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“凯撒旅游”、“安徽水利”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-20
9	关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-25
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长信科技”、“慧球科技”、“升华拜克”股票估	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2016-01-29

	值调整的公告	司网站	
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“苏宁环球”、“和晶科技”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-30
12	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-03
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“卓翼科技”、“浦发银行”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-19
14	关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-23
15	关于旗下部分基金增加中正为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-25
16	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“凯瑞德”、“慈文传媒”、“ST 兴业”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-01
17	关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-23
18	华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-24
19	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-28
20	关于华安旗下基金参加工商银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
21	关于旗下部分基金参加东亚银行（中国）有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
22	华安基金管理有限公司关于以固有资金购买基金所涉风险资产的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
23	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“四维图新”、“国瓷材料”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-05
24	华安基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-11
25	关于基金电子交易平台暂停部分基金赎回转	《上海证券报》、《证券时	2016-04-12

	申购业务的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
26	关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-19
27	关于旗下部分基金增加格上理财为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-26
28	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南山铝业”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-27
29	关于旗下部分基金增加中经北证为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-29
30	华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
31	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
32	华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-06
33	关于旗下部分基金增加金观诚为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-10
34	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-10
35	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“银泰资源”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-12
36	关于华安旗下部分基金参加民生银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-14
37	华安基金管理有限公司关于参加中正费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-18
38	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-25
39	关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-02



40	关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-08
41	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-08
42	关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-14
43	关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-21
44	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-23
45	关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-28
46	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-28

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 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、《华安宏利混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安宏利混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安宏利混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安宏利混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照

## 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日