

华富物联世界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：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 26 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 21 日起至 2016 年 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	华富物联世界灵活配置混合
基金主代码	001709
交易代码	001709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 21 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	578,890,094.88 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究并积极投资于与物联世界主题相关的优质上市公司，精选个股，分享其发展和成长的机会，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及物联世界相关行业的发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

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		华富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	洪渊
	联系电话	021-68886996	(010) 66105799
	电子邮箱	manzh@hffund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95588
传真		021-68887997	(010) 66105798

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	http://www.hffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§ 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 21 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,790,908.03
本期利润	17,241,239.45
加权平均基金份额本期利润	0.0514
本期基金份额净值增长率	5.00%
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	0.0435
期末基金资产净值	608,022,123.05
期末基金份额净值	1.050

注：1) 本基金合同生效未满一年。

2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3) 以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

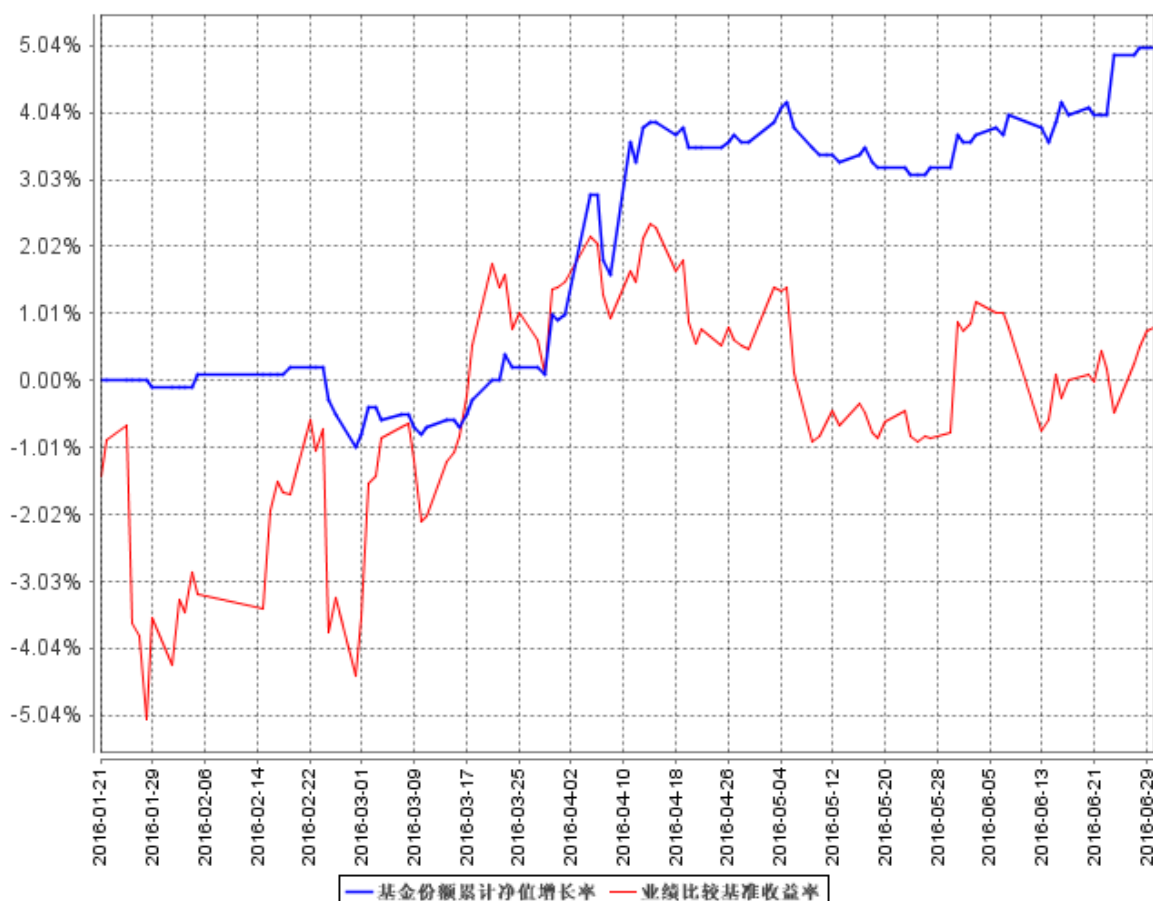
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.25%	0.24%	-0.07%	0.49%	1.32%	-0.25%

过去三个月	4.06%	0.41%	-0.60%	0.50%	4.66%	-0.09%
自基金合同生效起至今	5.00%	0.34%	0.80%	0.76%	4.20%	-0.42%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票投资比例为基金资产的 0%–95%，投资于本基金合同界定的物联世界主题相关证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2016 年 1 月 21 日到 2016 年 7 月 21 日。本报告期内，本基金仍在建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富分级债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富旺财保本混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享保本混合型证券投资基金、华富安福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金二十五只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王翔	华富物联世界灵活配置混合型基金基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理，华富成长趋势混合型基金基金经理	2016 年 1 月 21 日	-	七年	墨尔本大学工程管理学硕士、研究生学历。2010 年 3 月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、2014 年 5 月 12 日至 2014 年 11 月 18 日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理助理。

注：这里的任职日期是指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 上半年沪深 300 指数累计上涨-15.47%，创业板指累计上涨-17.92%，市场在经历了一季度的大幅下跌之后，呈现区间窄幅震荡的局面。从二季度的行业表现来看，涨幅较大的是食品饮料、电子、家电等行业，而餐饮旅游、交通运输、商贸零售等行业则相对较弱。

上半年整体来看，指数经历一月份的大幅下跌后，波动空间逐步变窄，但行业分化巨大，属于典型的结构性行情。本基金组合在上半年中以绝对收益为主，总体仓位较轻，同时通过择时来控制净值的回撤，通过对个股买卖来为产品创造正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 1 月 21 日正式成立。截止 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.050 元，累计份额净值为 1.050 元。报告期，本基金份额净值增长率为 5.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从最新公布的数据看，目前经济数据虽有压力，但处于稳定区间。国家统计局公布的数据显示：7 月份制造业 PMI 为 49.9%，比上月下降 0.1 个百分点，微低于临界点，近期走势波动较小，总体平稳。本月回落主要原因：一是受超强厄尔尼诺现象影响，强降雨席卷我国大部分省市，特别是长江中下游部分地区洪涝灾害严重，对相关地区的生产、运输等造成较大影响。本月生产指数为 52.1%，比上月回落 0.4 个百分点，其中江苏、安徽、湖北、河北等地的生产指数回落幅度较大。二是市场需求增速放缓，扩张动力仍显不足。1-6 月份固定资产投资（不含农户）同比增长 9.0%，比 1-5 月份回落 0.6 个百分点，其中民间投资增速继续回落，由 1-5 月份的 3.9% 回落到 1-6 月份的 2.8%。本月新订单指数为 50.4%，低于上月 0.1 个百分点，连续 4 个月回落。三是一些传统行业继续化解产能，压缩生产。高耗能行业 PMI 为 47.7%，比上月下降 0.5 个百分点，连续 4 个月下行。其中非金属矿物制品业和黑色金属冶炼及压延加工业持续处于收缩区间。

分企业规模看，大型企业 PMI 为 51.2%，比上月上升 0.2 个百分点，持续高于临界点；中、小型企业 PMI 分别为 48.9% 和 46.9%，比上月下降 0.2 和 0.5 个百分点，连续两个月回落，这也是本月 PMI 回落的主要因素。

尽管 PMI 小幅回落，但一些积极因素仍在不断积累。一是高技术制造业 PMI 为 53.2%，比上月上升 1.9 个百分点，为今年以来的新高，高技术制造业在结构转型中的引领作用进一步增强。二是反映资金紧张和劳动力成本上涨的企业比重为 42.1% 和 38.1%，分别比上月下降 0.7 和 1.2 个百分点，企业融资难和劳动力成本上涨的矛盾有所缓解。三是生产经营活动预期指数为 55.3%，比上月提高 1.9 个百分点，表明企业对未来发展的信心有所增强。

自年初开始大跌以来，市场经历了一季度的大幅震荡，二季度进入窄幅震荡，大量的个股均经历了大幅回调之后，部分景气度较高的行业标的经历了大幅上涨。

自年初开始大跌以来，市场经历了一季度的大幅震荡，二季度进入窄幅震荡，大量的个股均经历了大幅回调之后，部分景气度较高的行业标的经历了大幅上涨。对 2016 年下半年的行情，我们认为仍然是结构性行情为主，指数向上和向下的空间都不大，随着流动性泛滥和监管趋严，市场仍将处在夯实底部的过程中。

从结构性的角度考虑，我们下一阶段的布局将围绕以下几个方面来进行：一、调整较为充分的新兴行业；二、供给侧改革相关的周期行业；三、行业基本面发生预期变化的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 17,241,239.45 元，期末可供分配利润为 25,180,488.99 元。本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华富基金管理有限公

司在华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华富基金管理有限公司编制和披露的华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富物联世界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	6.4.7.1	443,764,197.22	-
结算备付金		4,851,899.04	-
存出保证金		153,271.44	-
交易性金融资产	6.4.7.2	80,659,271.20	-
其中：股票投资		80,659,271.20	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	91,100,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	88,843.19	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		620,617,482.09	-
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,671,915.25	-
应付赎回款		3,229,201.43	-
应付管理人报酬		679,615.74	-
应付托管费		113,269.32	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	705,960.34	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	195,396.96	-
负债合计		12,595,359.04	-
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	578,890,094.88	-
未分配利润	6.4.7.10	29,132,028.17	-
所有者权益合计		608,022,123.05	-
负债和所有者权益总计		620,617,482.09	-

注：本基金合同于 2016 年 1 月 21 日生效，无上年度可比期间。报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.050 元，基金份额总额 578,890,094.88 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 21 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月21日(基金 合同生效日)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
一、收入		21,598,191.13	-
1.利息收入		1,268,684.69	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	863,438.95	-
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		405,245.74	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,358,114.05	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,335,074.05	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	23,040.00	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,450,331.42	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	521,060.97	-
减：二、费用		4,356,951.68	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,267,122.26	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	377,853.72	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,520,767.07	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	191,208.63	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,241,239.45	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,241,239.45	-

注：本基金合同于 2016 年 1 月 21 日生效，无上年度可比期间。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 21 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 21 日(基金合同生效日)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）	309,060,074.68	-	309,060,074.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	17,241,239.45	17,241,239.45
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）	269,830,020.20	11,890,788.72	281,720,808.92
其中：1.基金申购款	428,862,465.70	15,677,726.19	444,540,191.89
2.基金赎回款	-159,032,445.50	-3,786,937.47	-162,819,382.97
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）	578,890,094.88	29,132,028.17	608,022,123.05

注：本基金合同于 2016 年 1 月 21 日生效，无上年度可比期间。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：

 章宏韬 余海春 陈大毅
 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

华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2015]1621 号）核准，基金合同于 2016 年 1 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2016）6-33 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债券）、权证、资产支持证券、货币市场工具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规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金根据《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照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》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 21 日至 2016 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的

交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

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；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以

外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于特殊事项停牌股票，本基金根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告〔2008〕38号），参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》进行估值。

2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》（基金部通知〔2006〕37号），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字〔2007〕21号）采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在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确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税〔2002〕128号)、《关于证券投资基金税收政策问题的通知》(财税〔2004〕78号)、《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》(财税〔2005〕102号)、《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》(财税〔2005〕103号)、《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》(财税〔2005〕107号)、《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》(财税〔2007〕84号)、《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1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〔2012〕85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〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36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〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

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。

对基金买卖股票、债券的差价收入,从 2004 年 1 月 1 日起,继续免征收企业所得税;对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20.00%的个人所得税。

根据财政部、国税总局、证监会发布之《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》,从 2013 年 1 月 1 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

基金买卖股票,经国务院批准,从 2008 年 4 月 24 日起证券(股票)交易印花税税率由现行的 3‰调整为 1‰。经国务院批准,从 2008 年 9 月 19 日起,对证券交易印花税政策进行调整,由现行双边征收改为向卖方单边征收,税率保持 1‰。

基金作为流通股股东,在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 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
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司（华安证券）	基金管理人的股东、代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于 2016 年 1 月 21 日生效，无上年度可比期间。

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 21 日(基金合同生效日)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	
	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
华安证券股份有限公司	801,283,858.57	9.55%	-	-

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

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 21 日(基金合同生效日)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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
华安证券股份有限	3,139,900,000.00	61.46%	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 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21日(基金合同生效日)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
华安证券股份有限公司	734, 536. 85	77. 73%	495, 455. 51	70. 18%

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

6.4.8.2 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21日(基金合同生效日)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	2, 267, 122. 26
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月21日(基金合同生效日)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托管费	377, 853. 72

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.8.3 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

注：本基金本报告期内本基金管理人没有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

注：本基金本报告期内基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

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21日(基金合同生效日) 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	443,764,197.22	834,566.70	-	-

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告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	4,711	61,148.78	61,148.78	-
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	1,602	13,600.98	13,600.98	-
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	971	5,631.80	5,631.80	-
--------	------	-----------------	----------------	--------	------	------	-----	----------	----------	---

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
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	-	-	1,000	3,470.00	20,920.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

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	80,659,271.20	13.00
	其中：股票	80,659,271.20	13.00
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	91,100,000.00	14.68
	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	448,616,096.26	72.29
7	其他各项资产	242,114.63	0.04

8	合计	620,617,482.09	100.00
---	----	----------------	--------

注：本表列示的其他各项资产详见 7.12.3 期末其他各项资产构成。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	42,897,698.92	7.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,920.00	0.00
F	批发和零售业	18,801,102.33	3.09
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	18,919,423.85	3.11
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	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	80,659,271.20	13.27

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	600612	老凤祥	1,040,000	42,484,000.00	6.99
2	600637	东方明珠	776,635	18,848,931.45	3.10
3	000078	海王生物	2,530,431	18,801,102.33	3.09
4	601127	小康股份	3,647	87,053.89	0.01
5	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
6	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
7	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
8	601966	玲珑轮胎	4,711	61,148.78	0.01
9	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
10	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站的半年度报告正文。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002383	合众思壮	59,241,603.11	9.74
2	600612	老凤祥	57,400,539.58	9.44
3	000670	*ST 盈方	31,069,526.84	5.11
4	000917	电广传媒	23,501,099.30	3.87
5	000603	盛达矿业	21,019,937.06	3.46
6	002275	桂林三金	20,392,675.48	3.35
7	000078	海王生物	18,539,586.83	3.05
8	600637	东方明珠	18,260,063.22	3.00
9	600489	中金黄金	18,133,974.77	2.98
10	600965	福成股份	15,449,784.45	2.54
11	600525	长园集团	14,948,365.60	2.46

12	002727	一心堂	14,421,404.00	2.37
13	002464	金利科技	14,279,673.80	2.35
14	002010	传化股份	13,566,708.21	2.23
15	600306	*ST 商城	13,293,010.49	2.19
16	002353	杰瑞股份	10,220,232.00	1.68
17	600259	广晟有色	9,600,704.00	1.58
18	002155	湖南黄金	9,146,109.50	1.50
19	000793	华闻传媒	8,936,854.01	1.47
20	002426	胜利精密	8,653,781.35	1.42

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.2 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

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002383	合众思壮	62,179,457.49	10.23
2	000670	*ST 盈方	31,316,153.96	5.15
3	000917	电广传媒	24,471,161.67	4.02
4	002275	桂林三金	21,998,727.72	3.62
5	000603	盛达矿业	21,522,105.46	3.54
6	600489	中金黄金	19,359,834.49	3.18
7	600612	老凤祥	16,991,672.26	2.79
8	600525	长园集团	15,679,378.35	2.58
9	002727	一心堂	14,845,294.87	2.44
10	002464	金利科技	14,753,671.72	2.43
11	600965	福成股份	14,725,313.74	2.42
12	002010	传化股份	14,495,706.70	2.38
13	600306	*ST 商城	13,519,478.58	2.22
14	002353	杰瑞股份	10,520,618.24	1.73
15	600259	广晟有色	10,247,713.47	1.69
16	002155	湖南黄金	10,027,082.44	1.65
17	002426	胜利精密	9,249,936.00	1.52
18	000793	华闻传媒	9,078,444.00	1.49
19	600073	上海梅林	8,668,566.34	1.43
20	300170	汉得信息	8,100,778.74	1.33

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

用。

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	545,285,731.87
卖出股票收入（成交）总额	484,411,866.14

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	153,271.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	88,843.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	242,114.63

7.12.4 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601966	玲珑轮胎	61,148.78	0.01	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,319	438,885.59	429,260,127.06	74.15%	149,629,967.82	25.85%

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	127,369.19	0.0220%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月21日）基金份额总额	309,060,074.68
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	428,862,465.70
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	159,032,445.50

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）	-
本报告期末基金份额总额	578,890,094.88

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，高靖瑜女士不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，孔庆卿先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘胡伟先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘张惠女士为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘翁海波先生为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘王翔先生为华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尹培俊先生为华富安享保本混合型证券投资基金基金经理。

9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘张惠女士为华富安享保本混合型证券投资基金基金经理。

10、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘胡伟先生为华富安福保本混合型证券投资基金基金经理。

11、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘王夏儒先生为华富安福保本混合型证券投资基金基金经理。

12、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘尹培俊先生为华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

13、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用天健会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计机构。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	98,292,519.77	9.55%	89,574.22	9.48%	-
华安证券	2	801,283,858.57	77.84%	734,536.85	77.73%	-
中银国际证券有限责任公司	1	129,851,022.49	12.61%	120,930.61	12.80%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。本报告期本基金新增了招商证券、华安证券、中银国际证券等 11 个交易单元。

2) 债券交易中的企业债及可分离债的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	3,139,900,000.00	61.46%	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	1,968,700,000.00	38.54%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无
