

# 华富国泰民安灵活配置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：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展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 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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> .....	<b>6</b>
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> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	35

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>36</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
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.....	36
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>37</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>37</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	38
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.....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	39
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>42</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>43</b>
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	华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华富国泰民安灵活配置混合
基金主代码	000767
交易代码	000767
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月4日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	208,711,655.68份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将从与国泰民安主题相关的证券中精选优质标的进行投资，分享我国国泰民安领域未来发展的红利，力求取得超额收益。
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、证券市场以及国泰民安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%+中证全债指数收益率*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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	廖原
	联系电话	021-68886996	021-61618888
	电子邮箱	manzh@hffund.com	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95528
传真		021-68887997	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	上海市中山东一路12号

	区陆家嘴环路1000号31层	
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层	上海市中山东一路12号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	章宏韬	吉晓辉

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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	3,344,111.24
本期利润	5,941,097.00
加权平均基金份额本期利润	0.0270
本期加权平均净值利润率	2.78%
本期基金份额净值增长率	2.81%
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	-2,787,781.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0134
期末基金资产净值	205,923,874.68
期末基金份额净值	0.987
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	-1.30%

注：1) 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。

2) 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。

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。  
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

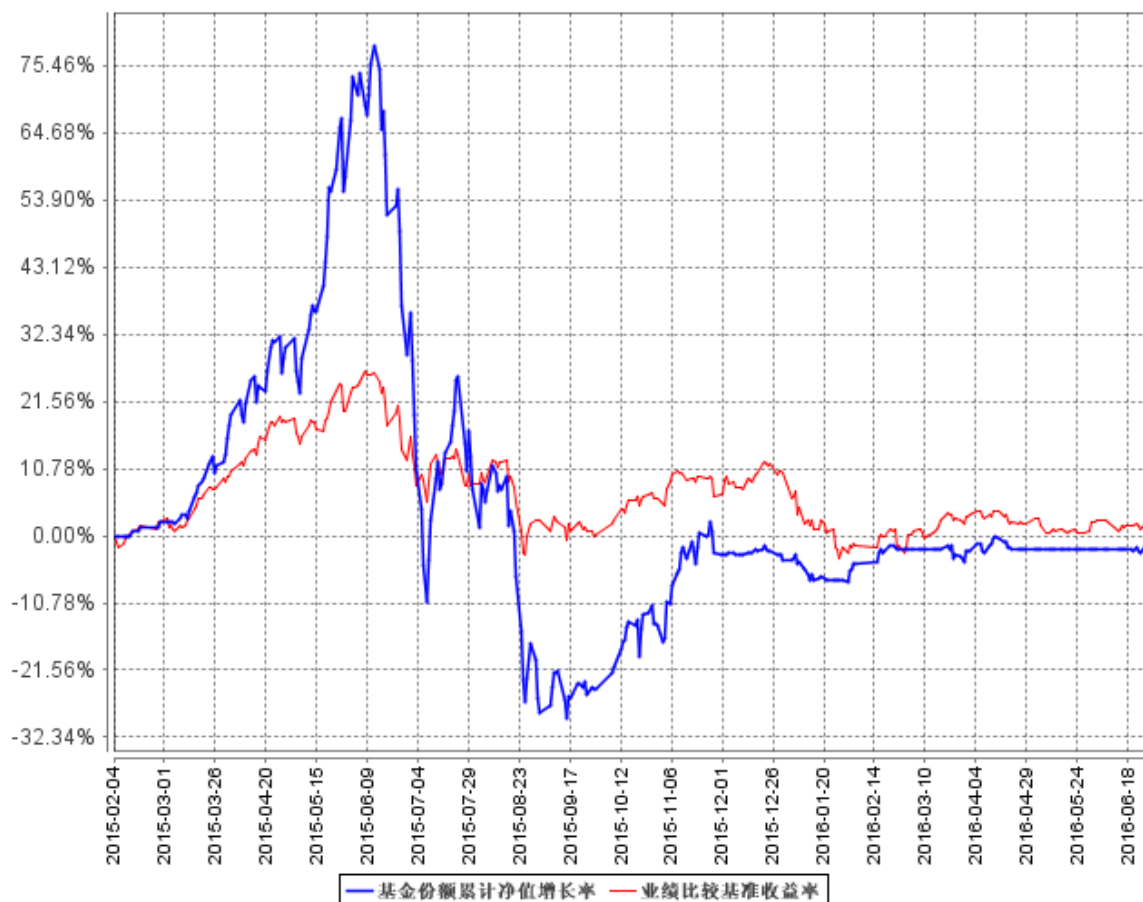
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.82%	0.33%	0.13%	0.49%	0.69%	-0.16%
过去三个月	1.23%	0.40%	-0.75%	0.51%	1.98%	-0.11%
过去六个月	2.81%	0.55%	-6.83%	0.92%	9.64%	-0.37%
过去一年	-27.32%	2.61%	-11.64%	1.15%	-15.68%	1.46%
自基金合同生效起至今	-1.30%	2.59%	2.45%	1.14%	-3.75%	1.45%

注：业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*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《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%，投资于本合同界定的国泰民安相关证券不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；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。本基金建仓期为 2015 年 2 月 4 日到 2015 年 8 月 4 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业，4月19日在上海正式注册成立。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		
龚炜	华富国泰民安灵活配置混合型基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金经理、华富竞争力优选混合型基金经理、华富成长趋势混合型基金经理、公司公募投资决策委员会主席、公司副总经理	2015年2月4日	-	十三年	安徽财经大学金融学硕士，研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监，2012年9月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展

					部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理，2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。
刘文正	华富国泰民安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、基金投资部副总监	2015年2月4日	-	十三年	工商管理硕士，研究生学历。历任天治基金管理有限公司系统管理员、行业研究员，2010年9月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部行业研究员、华富竞争力优选混合型基金基金经理助理，研究发展部总监助理。2013年6月7日至2015年5月27日任华富策略精选混合型基金基金经理。
张亮	华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理	2015年2月27日	-	七年	上海交通大学材料加工工程学硕士，研究生学历。曾任天治基金管理有限公司行业研究员，2013年7月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究发展部行业研究员、华富竞争力优选混合型基金基金经理助理。

注：龚炜、刘文正的任职日期指该基金成立之日，张亮的任职日期指公司作出决定之日。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合规守信情况的说明

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**

上半年经济呈现“L”状态，整体偏弱，但波动幅度很小。PMI、工业增加值、固定资产投资、进出口数据偏弱，呈现逐月下滑态势，尤其是 PMI，6 月的 PMI 回到 50.0，创 4 个月新低，历年同期新低，在一定程度上反映制造业景气较差。地产销售继续回落，固定资产投资逐月小幅回落。偏弱的经济和较高的房价对消费的拖累明显，社会消费品零售增速在二季度也呈现逐月回落的态势。一季度信贷大量投放，二季度央行加紧调控，信贷增速也小幅回落。二季度经济没有明显改善迹象，唯一改善的地方是二季度蔬菜和猪肉稳中有降，CPI 增长势头得到阶段性缓解，通胀压力暂时减小。

外围环境剧烈波动。美联储加息预期和英国公投脱欧对市场造成巨大扰动。脱欧的黑天鹅造成欧美股市大跌，商品随美联储加息预期减弱而逐步走强，尤其是黄金，在避险情绪推动下表现抢眼，大宗商品上半年的表现大幅优于股市。

上半年上证综指下跌 15.85%，创业板指下跌 17.92%，年初出人意料快速下跌，随后小幅震荡攀升，但行业分化加剧，结构性行情继续演绎。

基金上半年大部分时间都处于空仓状态，期间小幅参与市场反弹，有效规避了市场下跌风险，基金年初至今仍然保持正收益，大幅跑赢各个指数。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

本基金于 2015 年 2 月 4 日正式成立。截止 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.987 元，累计份额净值为 0.987 元。报告期，本基金份额净值增长率为 2.81%，同期业绩比较基准收益率为 -6.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济仍延续 L 型走势，可能在三季度阶段性反弹，但整体依然比较弱。国际方面，要密切关注美联储的加息进程和英国的脱欧进程，虽然风险资产有一定反弹，但英国脱欧的负面影响不能忽视，甚至会影响到整个欧洲的经济以及世界格局的重构。

三季度可能还是以震荡为主，结构性行情继续演绎，热点轮动可能更快，超额收益的获取更加困难，不排除三季度的某个时间，抱团的股票有一次剧烈冲击，毕竟这些股票在二季度涨幅巨大。市场系统性上涨的机会可能要等到四季度。

#### 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《华富国泰民安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 5,941,097.00 元，期末可供分配利润为 -2,787,781.00 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

## 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

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：华富国泰民安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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	128,277,077.86	208,908,486.69
结算备付金		-	1,167,739.24
存出保证金		322,379.75	707,946.48
交易性金融资产	6.4.7.2	78,287,978.63	6,033,492.92
其中：股票投资		78,287,978.63	6,033,492.92
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	-	-
应收证券清算款		-	6,975,200.03
应收利息	6.4.7.5	67,858.23	91,369.10
应收股利		-	-
应收申购款		199.70	32,905.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		206,955,494.17	223,917,139.78
<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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		210,939.13	618,778.93
应付管理人报酬		253,565.06	293,130.87
应付托管费		42,260.85	48,855.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	230,366.31	805,260.46
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	294,488.14	401,421.93
负债合计		1,031,619.49	2,167,447.32
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	208,711,655.68	231,104,549.04
未分配利润	6.4.7.10	-2,787,781.00	-9,354,856.58
所有者权益合计		205,923,874.68	221,749,692.46
负债和所有者权益总计		206,955,494.17	223,917,139.78

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.987 元，基金份额总额 208,711,655.68 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：华富国泰民安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2月4日(基 金合同生效日)至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		8,986,724.95	282,642,208.09
1.利息收入		1,508,980.29	2,348,889.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,508,980.29	2,011,824.28
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		-	337,064.75

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,806,574.61	264,736,567.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,778,278.26	263,481,531.67
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	28,296.35	1,255,035.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,596,985.76	10,545,647.26
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	74,184.29	5,011,104.69
<b>减：二、费用</b>		3,045,627.95	10,313,706.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,594,184.99	4,767,132.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	265,697.54	794,522.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	981,197.62	4,563,072.45
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	204,547.80	188,979.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,941,097.00	272,328,501.51
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,941,097.00	272,328,501.51

注：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：华富国泰民安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）	231,104,549.04	-9,354,856.58	221,749,692.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,941,097.00	5,941,097.00
三、本期基金份额交易	-22,392,893.36	625,978.58	-21,766,914.78

产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	13,853,505.57	-585,844.53	13,267,661.04
2.基金赎回款	-36,246,398.93	1,211,823.11	-35,034,575.82
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)	208,711,655.68	-2,787,781.00	205,923,874.68
项目	上年度可比期间 2015年2月4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)	1,073,507,334.60	-	1,073,507,334.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	272,328,501.51	272,328,501.51
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)	-780,830,394.36	-167,589,490.36	-948,419,884.72
其中: 1.基金申购款	229,720,771.48	94,315,270.88	324,036,042.36
2.基金赎回款	-1,010,551,165.84	-261,904,761.24	-1,272,455,927.08
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)	292,676,940.24	104,739,011.15	397,415,951.39

注: 后附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:

<u>章宏韬</u>	<u>余海春</u>	<u>陈大毅</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

华富国泰民安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[2014]793号)核准,基金合同于2015年2月4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（2015）6-14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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富国泰民安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、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**

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### **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 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**

#### **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 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	128,277,077.86

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	128,277,077.86

#### 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	76,516,734.60	78,287,978.63	1,771,244.03
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	76,516,734.60	78,287,978.63	1,771,244.03

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	67,707.29
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	-

应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	5.84
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	145.10
合计	67,858.23

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	230,366.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	230,366.31

#### 6.4.7.8 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	-
应付赎回费	552.58
审计费	34,809.32
信息披露费	259,126.24
合计	294,488.14

#### 6.4.7.9 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	231,104,549.04	231,104,549.04
本期申购	13,853,505.57	13,853,505.57
本期赎回(以“-”号填列)	-36,246,398.93	-36,246,398.93
本期末	208,711,655.68	208,711,655.68

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,153,078.48	-41,507,935.06	-9,354,856.58
本期利润	3,344,111.24	2,596,985.76	5,941,097.00
本期基金份额交易产生的变动数	-3,334,236.78	3,960,215.36	625,978.58
其中：基金申购款	1,844,587.72	-2,430,432.25	-585,844.53
基金赎回款	-5,178,824.50	6,390,647.61	1,211,823.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,162,952.94	-34,950,733.94	-2,787,781.00

### 6.4.7.11 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	1,500,104.57
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	4,940.82
其他	3,934.90
合计	1,508,980.29

注：其他为结算保证金利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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	303,768,949.19
减：卖出股票成本总额	298,990,670.93
买卖股票差价收入	4,778,278.26

### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	-

#### 6.4.7.16 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	28,296.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	28,296.35

#### 6.4.7.17 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	2,596,985.76
——股票投资	2,596,985.76
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,596,985.76

#### 6.4.7.18 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	73,736.65
转换费收入	447.64
合计	74,184.29

#### 6.4.7.19 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	981,197.62
银行间市场交易费用	-
合计	981,197.62

#### 6.4.7.20 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	34,809.32
信息披露费	159,126.24
银行汇划费用	1,612.24
债券帐户维护费	9,000.00
合计	204,547.80

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、代销机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内和上年度可比期间内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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2月4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	1,594,184.99	4,767,132.65
其中：支付销售机构的客户维护费	606,749.84	1,485,226.71

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年2月4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	265,697.54	794,522.06

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）。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

##### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期和上年度可比期间内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。



#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期和上年度可比期间内基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年2月4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
上海浦东发展银行股份有限公司	128,277,077.86	1,500,104.57	53,888,570.19	1,986,869.29

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
300353	东土科技	2016年6月23日	重大事项停牌	22.09	-	-	154,900	3,067,614.66	3,421,741.00	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券、一年期以内的资产支持证券

等基金可投资的短期信用产品。信用等级按期末评级结果列示。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.0	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	128,277,077.86	-	-	-	-	-	128,277,077.86
存出保证金	322,379.75	-	-	-	-	-	322,379.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	78,287,978.63	78,287,978.63
应收利息	-	-	-	-	-	67,858.23	67,858.23
应收申购款	-	-	-	-	-	199.70	199.70
资产总计	128,599,457.61	-	-	-	-	78,356,036.56	206,955,494.17
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	210,939.13	210,939.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	253,565.06	253,565.06
应付托管费	-	-	-	-	-	42,260.85	42,260.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	230,366.31	230,366.31
其他负债	-	-	-	-	-	294,488.14	294,488.14
负债总计	-	-	-	-	-	1,031,619.49	1,031,619.49
利率敏感度缺口	128,599,457.61	-	-	-	-	-77,324,417.07	205,923,874.68
上年度末 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	208,908,486.69	-	-	-	-	-	208,908,486.69
结算备付金	1,167,739.24	-	-	-	-	-	1,167,739.24
存出保证金	707,946.48	-	-	-	-	-	707,946.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	6,033,492.92	6,033,492.92
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,975,200.03	6,975,200.03
应收利息	-	-	-	-	-	91,369.10	91,369.10
应收申购款	-	-	-	-	-	32,905.32	32,905.32
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	210,784,172.41	-	-	-	-	-13,132,967.37	223,917,139.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	618,778.93	618,778.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	293,130.87	293,130.87
应付托管费	-	-	-	-	-	48,855.13	48,855.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	805,260.46	805,260.46
其他负债	-	-	-	-	-	401,421.93	401,421.93
负债总计	-	-	-	-	-	2,167,447.32	2,167,447.32
利率敏感度缺口	210,784,172.41	-	-	-	-	-10,965,520.05	221,749,692.46

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	0.00	0.00
市场利率上升 25 基点	0.00	0.00	

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	78,287,978.63	38.02	6,033,492.92	2.72
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	78,287,978.63	38.02	6,033,492.92	2.72

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）

		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	沪深300指数上升5%	599,471.18	328,528.95
	沪深300指数下降5%	-599,471.18	-328,528.95

#### 6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）		
	2. 观察期（1年）		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	合计	22,201,135.93	6,190,113.65

#### 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	78,287,978.63	37.83
	其中：股票	78,287,978.63	37.83
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	-	-
	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	128,277,077.86	61.98
7	其他各项资产	390,437.68	0.19
8	合计	206,955,494.17	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,403,960.00	3.11
C	制造业	52,754,360.52	25.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,009,996.00	2.92
F	批发和零售业	-	-
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	6,787,292.11	3.30
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	6,332,370.00	3.08
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	78,287,978.63	38.02

### 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	000555	神州信息	209,549	6,787,292.11	3.30

2	300016	北陆药业	286,100	6,537,385.00	3.17
3	600711	盛屯矿业	865,400	6,403,960.00	3.11
4	300012	华测检测	511,500	6,332,370.00	3.08
5	300228	富瑞特装	370,900	6,305,300.00	3.06
6	601208	东材科技	734,800	6,267,844.00	3.04
7	300400	劲拓股份	168,800	6,105,496.00	2.96
8	002741	光华科技	237,800	6,056,766.00	2.94
9	002081	金螳螂	599,800	6,009,996.00	2.92
10	600460	士兰微	756,123	5,996,055.39	2.91
11	300137	先河环保	399,247	5,904,863.13	2.87
12	000666	经纬纺机	266,900	5,204,550.00	2.53
13	300353	东土科技	154,900	3,421,741.00	1.66
14	002353	杰瑞股份	49,500	954,360.00	0.46

## 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	000555	神州信息	12,820,992.76	5.78
2	002348	高乐股份	12,794,711.72	5.77
3	300016	北陆药业	12,643,179.00	5.70
4	002741	光华科技	12,396,857.18	5.59
5	002313	日海通讯	11,807,191.79	5.32
6	600685	中船防务	10,986,202.00	4.95
7	600395	盘江股份	9,896,141.00	4.46
8	300358	楚天科技	9,534,681.57	4.30
9	002081	金螳螂	9,399,746.37	4.24
10	000561	烽火电子	7,759,469.55	3.50
11	600764	中电广通	7,538,890.01	3.40
12	000733	振华科技	6,660,169.50	3.00
13	002673	西部证券	6,614,567.00	2.98
14	600158	中体产业	6,513,298.16	2.94
15	600325	华发股份	6,510,344.38	2.94
16	600409	三友化工	6,505,224.35	2.93
17	601233	桐昆股份	6,504,820.48	2.93



18	600872	中炬高新	6,502,817.28	2.93
19	600776	东方通信	6,502,492.97	2.93
20	002229	鸿博股份	6,501,688.04	2.93
21	600549	厦门钨业	6,501,366.00	2.93
22	000877	天山股份	6,498,976.71	2.93
23	600888	新疆众和	6,494,665.13	2.93
24	600005	武钢股份	6,479,443.00	2.92
25	000655	金岭矿业	6,464,805.58	2.92
26	300352	北信源	6,303,267.00	2.84
27	002224	三力士	6,283,708.74	2.83
28	002243	通产丽星	6,281,979.01	2.83
29	002405	四维图新	6,281,138.00	2.83
30	000971	高升控股	6,241,513.32	2.81
31	601208	东材科技	6,146,482.33	2.77
32	300012	华测检测	6,145,217.15	2.77
33	600711	盛屯矿业	6,131,703.50	2.77
34	300228	富瑞特装	6,127,498.05	2.76
35	600460	士兰微	5,939,534.75	2.68
36	300137	先河环保	5,932,182.24	2.68
37	300400	劲拓股份	5,928,349.50	2.67
38	603799	华友钴业	5,370,577.65	2.42
39	000666	经纬纺机	5,104,156.35	2.30
40	000503	海虹控股	4,981,252.13	2.25
41	002362	汉王科技	4,930,036.00	2.22
42	300390	天华超净	4,493,043.24	2.03

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	002348	高乐股份	15,062,132.20	6.79
2	000971	高升控股	14,391,635.34	6.49
3	002313	日海通讯	11,999,745.20	5.41
4	300358	楚天科技	11,312,717.26	5.10

5	600395	盘江股份	10,127,017.00	4.57
6	600764	中电广通	8,889,269.04	4.01
7	600685	中船防务	8,852,129.70	3.99
8	600549	厦门钨业	7,422,772.54	3.35
9	002405	四维图新	7,262,775.04	3.28
10	000555	神州信息	7,216,704.92	3.25
11	002224	三力士	7,178,381.00	3.24
12	600158	中体产业	7,042,867.67	3.18
13	300016	北陆药业	6,900,140.73	3.11
14	600888	新疆众和	6,834,069.28	3.08
15	002243	通产丽星	6,776,250.50	3.06
16	300352	北信源	6,670,400.93	3.01
17	002741	光华科技	6,624,967.00	2.99
18	002673	西部证券	6,612,043.09	2.98
19	000877	天山股份	6,506,913.00	2.93
20	600776	东方通信	6,433,968.49	2.90
21	000655	金岭矿业	6,358,015.50	2.87
22	600872	中炬高新	6,214,042.95	2.80
23	002229	鸿博股份	6,201,666.25	2.80
24	600005	武钢股份	6,076,249.26	2.74
25	600409	三友化工	6,030,023.10	2.72
26	600325	华发股份	5,958,830.50	2.69
27	601233	桐昆股份	5,932,916.50	2.68
28	000561	烽火电子	5,920,731.00	2.67
29	000503	海虹控股	5,270,760.62	2.38
30	002362	汉王科技	5,199,197.00	2.34
31	603799	华友钴业	5,172,053.30	2.33
32	000733	振华科技	5,158,733.00	2.33
33	300093	金刚玻璃	4,952,946.89	2.23
34	300259	新天科技	4,520,879.26	2.04

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。

### 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	368,648,170.88
卖出股票收入（成交）总额	303,768,949.19

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所有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	322,379.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	67,858.23

5	应收申购款	199.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	390,437.68

#### 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

注：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

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
4,982	41,893.15	0.00	0.00%	208,711,655.68	100.00%

### 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	6,839.59	0.0033%

### 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	0~10
-----------------	------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月4日）基金份额总额	1,073,507,334.60
本报告期期初基金份额总额	231,104,549.04
本报告期基金总申购份额	13,853,505.57
减：本报告期基金总赎回份额	36,246,398.93
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	208,711,655.68

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、自 2016 年 1 月起，上海浦东发展银行进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	1,850,181.75	0.28%	1,723.04	0.28%	-
民生证券	2	159,428,257.58	23.71%	148,475.56	24.03%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	145,743,547.90	21.67%	132,815.96	21.50%	-
方正证券	1	276,395,809.45	41.10%	251,879.29	40.77%	-
光大证券	1	88,999,323.39	13.24%	82,885.23	13.42%	-

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。本报告期本基金无新增交易单元的情况

2，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。

### 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
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《华富基金管理有限公司关于旗	在《中国证券报》、	2016年1月4日

	下部分开放式基金在指数发生不可恢复熔断后相关业务进行调整的公告》	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
2	《华富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》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年1月6日
3	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在指数发生不可恢复熔断后相关业务进行调整的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年1月7日
4	《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年1月21日
5	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加渤海银行基金费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年1月22日
6	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年1月29日
7	《华富基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年2月26日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国银河证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年2月26日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加恒丰银行	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证	2016年2月29日



	股份有限公司开放式基金申购费率优惠活动的公告》	券时报》上公告	
10	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京增财基金销售有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年3月11日
11	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华安证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年3月14日
12	《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2016年第1号)》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年3月17日
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海陆金所资产管理有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年3月21日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年3月22日
15	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加开源证券股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年3月25日
16	《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告》及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年3月29日
17	《华富基金管理有限公司关于旗	在《中国证券报》、	2016年3月30日

	下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
18	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加徽商银行股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年4月19日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加徽商银行基金费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年4月19日
20	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年4月20日
21	《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年4月20日
22	《华富基金管理有限公司关于变更高级管理人员的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年6月13日
23	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2016年6月16日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

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