

华富成长趋势混合型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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	华富成长趋势混合
基金主代码	410003
前端交易代码	410003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 3 月 19 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	608,842,339.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选符合中国经济增长新趋势、能持续为股东创造价值的公司，采取适度主动资产配置和积极主动精选证券的投资策略，在风险限度内，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票品种为主要投资标的。在行业及股票选择方面，本基金“自下而上”地以可持续增值企业为目标进行三次股票筛选来寻找价值被低估的优势企业，结合“自上而下”精选最优行业，动态寻找优势企业与景气行业的最佳结合，构建投资组合，以追求基金资产的中长期稳定增值。
业绩比较基准	80%×标普中国 A 股 300 指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金是混合型基金，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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	张燕
	联系电话	021-68886996	0755-83199084
	电子邮箱	manzh@hffund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-8001	95555
传真		021-68887997	0755-83195201

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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-77,730,211.49
本期利润	-55,167,376.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0812
本期基金份额净值增长率	-8.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1250
期末基金资产净值	532,711,288.24
期末基金份额净值	0.8750

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

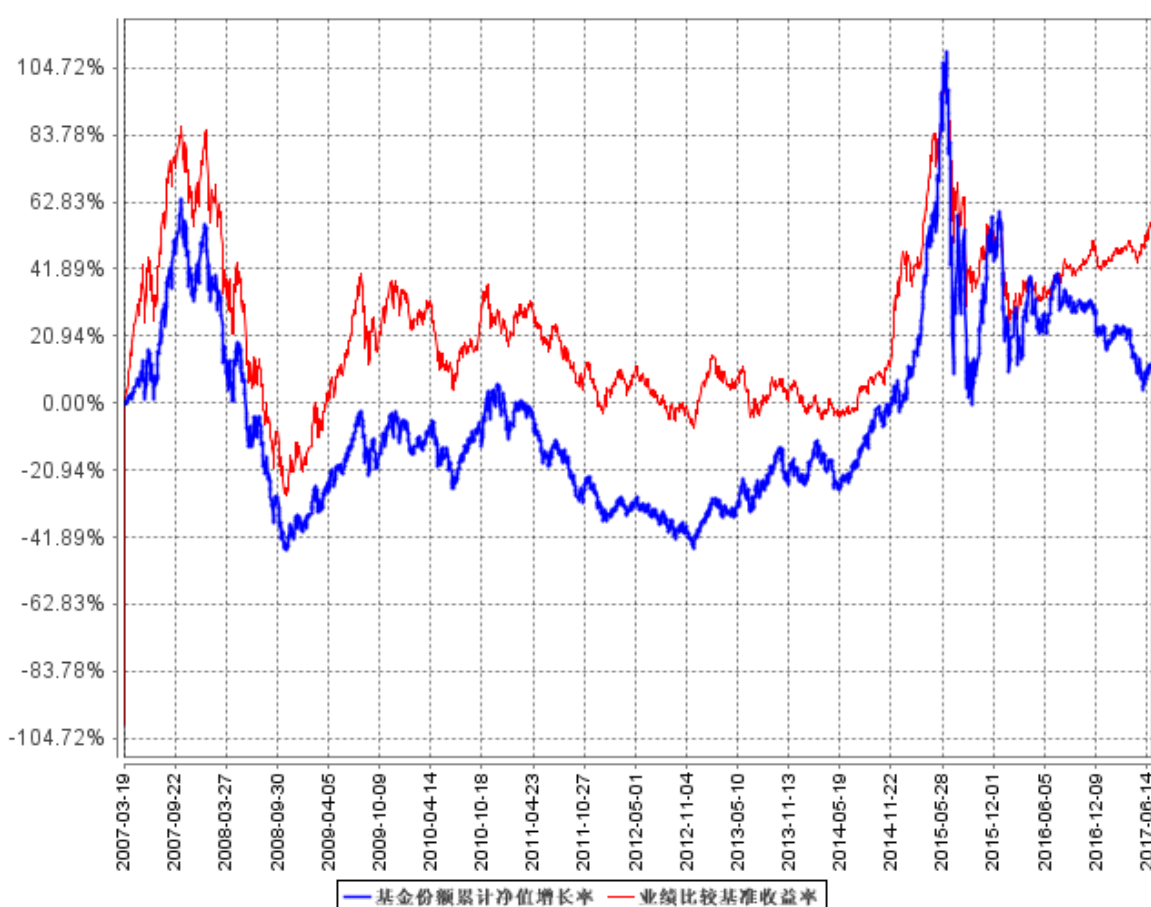
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.83%	1.25%	4.57%	0.55%	-0.74%	0.70%

过去三个月	-6.95%	1.24%	5.24%	0.52%	-12.19%	0.72%
过去六个月	-8.51%	1.02%	9.71%	0.46%	-18.22%	0.56%
过去一年	-15.65%	0.96%	15.04%	0.52%	-30.69%	0.44%
过去三年	42.09%	2.19%	59.31%	1.37%	-17.22%	0.82%
自基金合同生效起至今	11.83%	1.82%	56.16%	1.46%	-44.33%	0.36%

注：业绩比较基准收益率=80%×标普中国 A 股 300 指数+20%×中证全债指数，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：1、根据《华富成长趋势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 60%~95%，债券资产的配置比例为 0-35%，权证的配置比例为 0-3%，现金或者到期日在 1 年以内的政府债券的配置比例不低于基金资产净值的 5%，本基金建仓期为 2007 年 3 月 19 日至 9 月 19 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《华富成长趋势混合型证券投资基金基金合同》的规定。

2、本基金自 2015 年 9 月 30 日起，将基金业绩比较基准由“80%×中信标普 300 指数+20%×中信标普全债指数”变更为“80%×中信标普 300 指数+20%×中证全债指数”。本基金自 2015 年 11 月 24 日起，将基金业绩比较基准由“80%×中信标普 300 指数+20%×中证全债指数”变更为“80%×标普中国 A 股 300 指数+20%×中证全债指数”。

§ 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 2.5 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 2017 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、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金三十三只基金。

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	华富成长趋势混合型基金经理、华富竞争力优选混合	2012 年 12 月 21 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

	<p>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、华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富物联网世界灵活配置混合型基金基金经理、公司公募投资决策委员会主席、公司副总经理</p>				<p>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。</p>
<p>陈启明</p>	<p>华富成长趋势混合型基金基金经理、华富价</p>	<p>2017 年 3 月 14 日</p>	<p>-</p>	<p>十一年</p>	<p>复旦大学会计学硕士，本科学历，历任日盛嘉富证券上海代表处研究员、群益证券上海代表处研究员、中银国际证券产品经理，2010 年 2 月加入华富</p>

	<p>值增长 灵活配 置混合 型基金 基金经 理、华富 竞争力 优选混 合型基 金基金 经理、华 富健康 文娱灵 活配置 混合型 基金基 金经理、 华富产 业升级 灵活配 置混合 型基金 基金经 理、公司 公募投 资决策 委员会 委员、基 金投资 部总监</p>				<p>基金管理有限公司，曾任 行业研究员、研究发展部 副总监，2013年3月1日 至2014年9月25日任成 长趋势股票型基金基金经 理助理。</p>
王翔	<p>华富成 长趋势 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 物联世 界灵活 配置混</p>	<p>2015年5月11 日</p>	<p>2017年3月14 日</p>	<p>七年</p>	<p>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， 2015年5月11日至2017 年3月14日任华富成长趋 势混合型基金经理。</p>

	合 型 基 金 基 金 经 理、华 富 灵 活 配 置 混 合 型 基 金 基 金 经 理、华 富 天 鑫 灵 活 配 置 混 合 型 基 金 基 金 经 理、公 司 公 募 投 资 决 策 委 员 会 成 员				
--	--	--	--	--	--

注：龚炜、陈启明的任职日期指公司作出决定之日，王翔的离任日期指中国基金业协会作出注销决定之日。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、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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

上半年沪深 300 指数累计上涨 10.78%，创业板指累计下跌 7.34%。上半年，市场分化非常明显，二八分化甚至一九分化现象向极致化演绎。上半年，监管趋严、金融去杠杆进一步深化，资金面紧张，风险偏好下降明显，资金持续向蓝筹龙头白马集中，上半年上涨较好的行业主要是家电、食品饮料、电子元器件、银行、煤炭等行业。

本基金组合结构总体均衡，配置中传统周期性行业 and 新兴产业整体均衡，重点关注处于行业周期性拐点的行业，以及行业仍处于上升期，且估值相对合理的标的。整体来看，大盘指数震荡上升，而小盘成长股出现明显回调，投资机会主要来自于蓝筹，本基金着重医药、新能源、计算机板块表现落后，整体基金表现落后。维持前期观点：从价值角度观察，成长股跟随创业板以及壳资源股估值出现泥沙俱下的大幅杀跌，恰恰有利于从中挑选未来数年真正能够跟随甚至超越行业成长的龙头公司进行左侧配置。下一阶段本基金将继续踏实寻找基本面真正良好、成长性突出的行业、个股加以重点配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2007 年 3 月 19 日正式成立。截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8750 元，累计基金份额净值为 1.1650 元。在本报告期内，本基金本报告期份额净值增长率为-8.51%，同期业绩比较基准收益率为 9.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场整体预期二季度经济数据回落，但从分月数据来看，经济回落幅度低于预期。6 月 PMI51.7，环比提高 0.7 个百分点，其中：生产指数为 54.4%，环比回升 1 个百分点，新订单指数为 53.1%，环比提升 0.8 个百分点，新出口订单和进口指数分别为 52.0%、51.2%，分别环比提升 1.3、1.2 个百分点；从 PMI 数据看，整体内外需月度环比都有所改善。

自 2016 年年初开始，市场经历了大幅震荡之后开始走向分化，大量的个股在经历熔断回调之后，开始走向分化，传统行业蓝筹随着市场风格切换开始稳步上涨，而创业板则继续下调。对 2017 年第三季度的行情，我们持相对中性的态度。一方面宏观经济可能短阶段见顶，货币政策的大幅

紧缩仍然相对遥远，而从相对来看，股票资产在未来大类资产中仍然属于较优资产。另一方面部分质地优良的成长股，未来的市场空间较大，潜在成长性突出，经过充分调整之后，性价比凸显，我们会积极布局。

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《华富成长趋势混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-55,167,376.45 元，期末可供分配利润为-76,131,051.51 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富成长趋势混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		35,301,988.74	70,178,568.30
结算备付金		989,419.61	2,703,345.18
存出保证金		365,906.25	825,885.96
交易性金融资产		492,384,598.58	617,540,308.16
其中：股票投资		472,108,289.28	617,540,308.16
基金投资		-	-
债券投资		20,276,309.30	-
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		13,696,390.21	10,140,262.70

应收利息		66,614.67	16,604.30
应收股利		-	-
应收申购款		1,879.11	300,397.10
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		542,806,797.17	701,705,371.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,029,855.30	2,998,553.35
应付赎回款		333,924.23	625,395.77
应付管理人报酬		658,588.89	941,274.08
应付托管费		109,764.81	156,879.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		764,935.33	1,532,299.73
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		198,440.37	560,323.33
负债合计		10,095,508.93	6,814,725.27
所有者权益:			
实收基金		608,842,339.75	726,557,726.63
未分配利润		-76,131,051.51	-31,667,080.20
所有者权益合计		532,711,288.24	694,890,646.43
负债和所有者权益总计		542,806,797.17	701,705,371.70

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 532,711,288.24 元，基金份额总额 608,842,339.75 份。后附表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富成长趋势混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
一、收入		-45,914,222.99	-230,401,433.06

1.利息收入		270,214.16	723,602.68
其中：存款利息收入		257,180.25	636,633.52
债券利息收入		9,360.08	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,673.83	86,969.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-68,754,162.39	-104,219,273.03
其中：股票投资收益		-70,617,803.31	-107,002,951.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益		42,128.60	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,821,512.32	2,783,678.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		22,562,835.04	-127,259,248.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		6,890.20	353,486.25
减：二、费用		9,253,153.46	15,839,535.85
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	4,653,812.28	8,502,829.32
2. 托管费	6.4.8.2.2	775,635.40	1,417,138.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		3,621,627.93	5,688,470.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		202,077.85	231,097.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-55,167,376.45	-246,240,968.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-55,167,376.45	-246,240,968.91

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：华富成长趋势混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017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）	726,557,726.63	-31,667,080.20	694,890,646.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-55,167,376.45	-55,167,376.45
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）	-117,715,386.88	10,703,405.14	-107,011,981.74
其中：1.基金申购款	5,117,676.37	-459,852.22	4,657,824.15
2.基金赎回款	-122,833,063.25	11,163,257.36	-111,669,805.89
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）	608,842,339.75	-76,131,051.51	532,711,288.24
	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
项目	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）	1,330,914,164.88	276,371,803.63	1,607,285,968.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-246,240,968.91	-246,240,968.91
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）	-358,479,235.46	6,097,670.49	-352,381,564.97
其中：1.基金申购款	111,339,911.70	35,182.93	111,375,094.63
2.基金赎回款	-469,819,147.16	6,062,487.56	-463,756,659.60
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）	972,434,929.42	36,228,505.21	1,008,663,434.63

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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

华富成长趋势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）（证监基金字【2007】50号）核准，基金合同于2007年3月19日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位境况业经天健华证中洲（北京）会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健华证中洲验（2007）JR字第070001号）。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。本基金管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华富成长趋势混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若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

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

本报告期本基金无会计估计的变更。

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:

(一) 2016年5月1日前,发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收营业税。

(二) 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。

(三) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(四) 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。

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%的个人所得税。

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
招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
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东

合肥兴泰金融控股（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	268,911,440.99	11.37%	-	-

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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 2017年1月1日至2017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	249,038.42	11.43%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华安证券	-	-	-	-

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,653,812.28	8,502,829.32
其中：支付销售机构的客户维护费	912,863.09	1,125,803.09

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	775,635.40	1,417,138.18

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）。

6.4.8.2.3 销售服务费

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2017 年 1 月 1 日至 2017 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						
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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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。

6.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

注：本基金本报告期末和上年度末除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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
招商银行股份有限公司	35,301,988.74	236,172.69	92,059,057.81	599,887.66

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及上年度可比期间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（2017 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
002859	洁美科技	2017 年 3 月 24 日	2018 年 4 月 7 日	公开发行有锁定期	29.82	39.92	6,666	198,780.12	266,106.72	-
002860	星帅尔	2017 年 3 月 31 日	2018 年 4 月 12 日	公开发行有锁定期	19.81	26.26	7,980	158,083.80	209,554.80	-

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
300075	数字政通	2017年6月29日	重大事项停牌	20.94	2017年7月17日	18.86	509,925	10,832,536.00	10,677,829.50	-
603501	韦尔股份	2017年6月5日	重大事项停牌	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-
002856	美芝股份	2017年6月19日	重大事项停牌	31.86	-	-	30	348.30	955.80	-

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	472,108,289.28	86.98
	其中：股票	472,108,289.28	86.98
2	固定收益投资	20,276,309.30	3.74
	其中：债券	20,276,309.30	3.74
	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	36,291,408.35	6.69
7	其他各项资产	14,130,790.24	2.60
8	合计	542,806,797.17	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,086,512.79	6.77
C	制造业	271,344,437.57	50.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,199,338.55	2.29
E	建筑业	20,612,328.46	3.87
F	批发和零售业	53,041,519.12	9.96
G	交通运输、仓储和邮政业	741.32	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,266,324.90	7.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,231,950.00	3.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,322,169.97	3.81
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	2,966.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	472,108,289.28	88.62

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
合计	-	-

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	603939	益丰药房	1,573,892	53,040,160.40	9.96
2	600750	江中药业	1,188,959	41,316,325.25	7.76
3	000597	东北制药	3,318,169	37,097,129.42	6.96
4	000823	超声电子	2,000,000	28,840,000.00	5.41
5	002665	首航节能	3,873,964	27,892,540.80	5.24
6	002325	洪涛股份	2,799,940	20,439,562.00	3.84
7	603588	高能环境	1,300,000	20,280,000.00	3.81
8	600340	华夏幸福	602,500	20,231,950.00	3.80
9	300567	精测电子	233,063	18,628,725.59	3.50
10	002460	赣锋锂业	350,000	16,187,500.00	3.04

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	603939	益丰药房	46,270,350.89	6.66
2	000597	东北制药	42,753,066.36	6.15
3	600750	江中药业	42,085,646.81	6.06
4	000423	东阿阿胶	38,069,626.06	5.48
5	000823	超声电子	34,021,098.15	4.90
6	002665	首航节能	32,820,533.47	4.72
7	600418	江淮汽车	30,464,471.79	4.38
8	603588	高能环境	25,986,515.28	3.74
9	600110	诺德股份	24,305,652.00	3.50
10	601688	华泰证券	23,857,654.57	3.43
11	000975	银泰资源	23,641,597.96	3.40
12	002554	惠博普	22,713,919.01	3.27
13	600569	安阳钢铁	22,359,492.90	3.22
14	600884	杉杉股份	21,322,973.54	3.07
15	300567	精测电子	21,080,396.74	3.03
16	600340	华夏幸福	20,784,018.00	2.99
17	600500	中化国际	20,282,666.72	2.92
18	002325	洪涛股份	20,251,984.40	2.91
19	600820	隧道股份	20,130,761.20	2.90
20	300324	旋极信息	19,975,620.41	2.87
21	300346	南大光电	19,660,498.65	2.83
22	601600	中国铝业	19,603,010.32	2.82
23	601908	京运通	19,480,845.01	2.80
24	600547	山东黄金	19,444,799.00	2.80
25	002205	国统股份	19,224,998.58	2.77
26	600651	飞乐音响	18,668,701.27	2.69
27	601186	中国铁建	17,264,743.26	2.48
28	002431	棕榈股份	17,128,741.16	2.46
29	000910	大亚圣象	16,948,730.74	2.44
30	300446	乐凯新材	16,703,610.50	2.40
31	300113	顺网科技	16,261,366.66	2.34
32	000426	兴业矿业	16,198,873.80	2.33
33	002439	启明星辰	15,541,297.40	2.24

34	002236	大华股份	15,366,094.38	2.21
35	600967	内蒙一机	15,117,283.11	2.18
36	002460	赣锋锂业	14,924,325.56	2.15
37	002341	新纶科技	14,031,278.53	2.02

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	603366	日出东方	52,049,897.91	7.49
2	000887	中鼎股份	44,277,607.72	6.37
3	000423	东阿阿胶	43,602,712.74	6.27
4	600984	建设机械	37,375,536.79	5.38
5	000426	兴业矿业	36,274,164.30	5.22
6	600498	烽火通信	33,748,929.51	4.86
7	002281	光迅科技	33,347,052.48	4.80
8	601566	九牧王	33,337,622.54	4.80
9	600816	安信信托	32,846,262.50	4.73
10	600418	江淮汽车	28,762,891.76	4.14
11	300369	绿盟科技	25,837,148.25	3.72
12	002554	惠博普	25,494,450.62	3.67
13	600110	诺德股份	24,239,763.00	3.49
14	601688	华泰证券	23,900,290.00	3.44
15	601258	庞大集团	23,656,000.00	3.40
16	600569	安阳钢铁	22,426,182.35	3.23
17	300166	东方国信	21,867,389.11	3.15
18	000752	西藏发展	21,089,710.44	3.03
19	300324	旋极信息	20,980,857.75	3.02
20	300336	新文化	20,924,558.35	3.01
21	300183	东软载波	20,883,614.75	3.01
22	601908	京运通	20,706,627.56	2.98
23	002630	华西能源	19,975,081.33	2.87
24	600884	杉杉股份	19,618,369.50	2.82
25	600820	隧道股份	19,412,936.30	2.79
26	601600	中国铝业	19,376,857.12	2.79
27	600500	中化国际	19,228,363.49	2.77

28	002205	国统股份	19,048,125.74	2.74
29	601186	中国铁建	18,766,477.30	2.70
30	600547	山东黄金	18,274,639.91	2.63
31	002636	金安国纪	18,183,009.70	2.62
32	600499	科达洁能	18,001,530.28	2.59
33	300334	津膜科技	17,620,528.40	2.54
34	002236	大华股份	16,212,454.00	2.33
35	600651	飞乐音响	15,449,420.28	2.22
36	002431	棕榈股份	15,148,302.40	2.18
37	600687	刚泰控股	14,793,178.00	2.13

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	1,135,470,043.05
卖出股票收入（成交）总额	1,232,539,050.97

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	20,276,309.30	3.81
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,276,309.30	3.81

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	128013	洪涛转债	200,161	20,276,309.30	3.81

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

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。

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	365,906.25
2	应收证券清算款	13,696,390.21
3	应收股利	-
4	应收利息	66,614.67
5	应收申购款	1,879.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,130,790.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128013	洪涛转债	20,276,309.30	3.81

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
28,803	21,138.16	68,659,115.50	11.28%	540,183,224.25	88.72%

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	107,392.79	0.0176%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2007 年 3 月 19 日) 基金份额总额	6,777,723,584.78
本报告期期初基金份额总额	726,557,726.63
本报告期基金总申购份额	5,117,676.37
减:本报告期基金总赎回份额	122,833,063.25
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	608,842,339.75

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，增聘姚姣姣女士为华富货币市场基金基金经理。

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，增聘姚姣姣女士为华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金经理。

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，增聘姚姣姣女士为华富天益货币市场基金基金经理。

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，王翔先生不再担任华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理的职务。

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，增聘陈启明先生为华富成长趋势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，增聘姚姣姣女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

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，刘文正先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

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，刘文正先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

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，增聘高靖瑜女士为华富策略精选灵活配置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，翁海波先生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。

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，增聘高靖瑜女士为华富智慧城市灵活配置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，翁海波先生不再担任

华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

13、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，增聘龚炜先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

14、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，增聘龚炜先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

15、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天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

16、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，增聘龚炜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。

17、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物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

18、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	
中投证券	1	355,103,395.31	15.02%	323,606.29	14.85%	-
海通证券	1	307,281,435.10	13.00%	286,171.90	13.14%	-
华安证券	2	268,911,440.99	11.37%	249,038.42	11.43%	-
西南证券	1	256,261,078.37	10.84%	238,656.44	10.95%	-
国泰君安	1	253,233,131.72	10.71%	230,772.06	10.59%	-
华信证券	1	183,560,783.10	7.76%	167,278.82	7.68%	-
中信建投证券	2	179,633,493.07	7.60%	164,845.82	7.57%	-
东方证券	1	119,561,265.88	5.06%	111,346.37	5.11%	-
东吴证券	1	112,743,382.79	4.77%	104,998.87	4.82%	-
中泰证券	2	110,855,101.66	4.69%	101,022.38	4.64%	-
天风证券	3	90,970,495.86	3.85%	84,721.06	3.89%	-
民生证券	1	83,911,755.51	3.55%	76,468.77	3.51%	-
方正证券	1	42,271,162.54	1.79%	39,617.84	1.82%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中国国际金融公司	2	-	-	-	-	-

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。

- 2) 本报告期本基金撤销国盛证券交易单元 1 个。
- 3) 此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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
中投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	26,800,000.00	100.00%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华信证券	20,018,417.11	88.73%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	2,542,501.20	11.27%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 公司	-	-	-	-	-	-

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

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无