

# 华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

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：平安银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。

基金托管人平安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。

## 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>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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>	<b>15</b>
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>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华富价值增长混合
基金主代码	410007
交易代码	410007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 15 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	147,114,775.61 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于价值相对低估且能为股东创造持续稳定回报的公司，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用较为灵活的投资策略。在资产配置中，本基金采用自上而下的方式，通过分析证券市场投资环境，预测股票市场和债券市场未来收益和风险，确定资产配置方案；在股票选择中，本基金采用定量分析、定性分析和实地调研等方法，自下而上，精选个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于灵活配置混合型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	方琦
	联系电话	021-68886996	0755-22160168
	电子邮箱	manzh@hffund.com	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95511-3
传真		021-68887997	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	深圳市罗湖区深南东路 5047 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	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码	200120	518001
法定代表人	章宏韬	谢永林

## 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	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-7,126,458.72
本期利润	-3,113,506.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0164
本期加权平均净值利润率	-1.59%
本期基金份额净值增长率	-1.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	2,735,500.06
期末可供分配基金份额利润	0.0186
期末基金资产净值	149,850,275.67
期末基金份额净值	1.0186
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	76.52%

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	2.86%	1.22%	3.46%	0.40%	-0.60%	0.82%
过去三个月	-3.55%	1.20%	3.70%	0.38%	-7.25%	0.82%
过去六个月	-1.94%	1.04%	6.30%	0.35%	-8.24%	0.69%
过去一年	-4.11%	0.97%	9.67%	0.41%	-13.78%	0.56%
过去三年	87.33%	2.06%	49.66%	1.05%	37.67%	1.01%

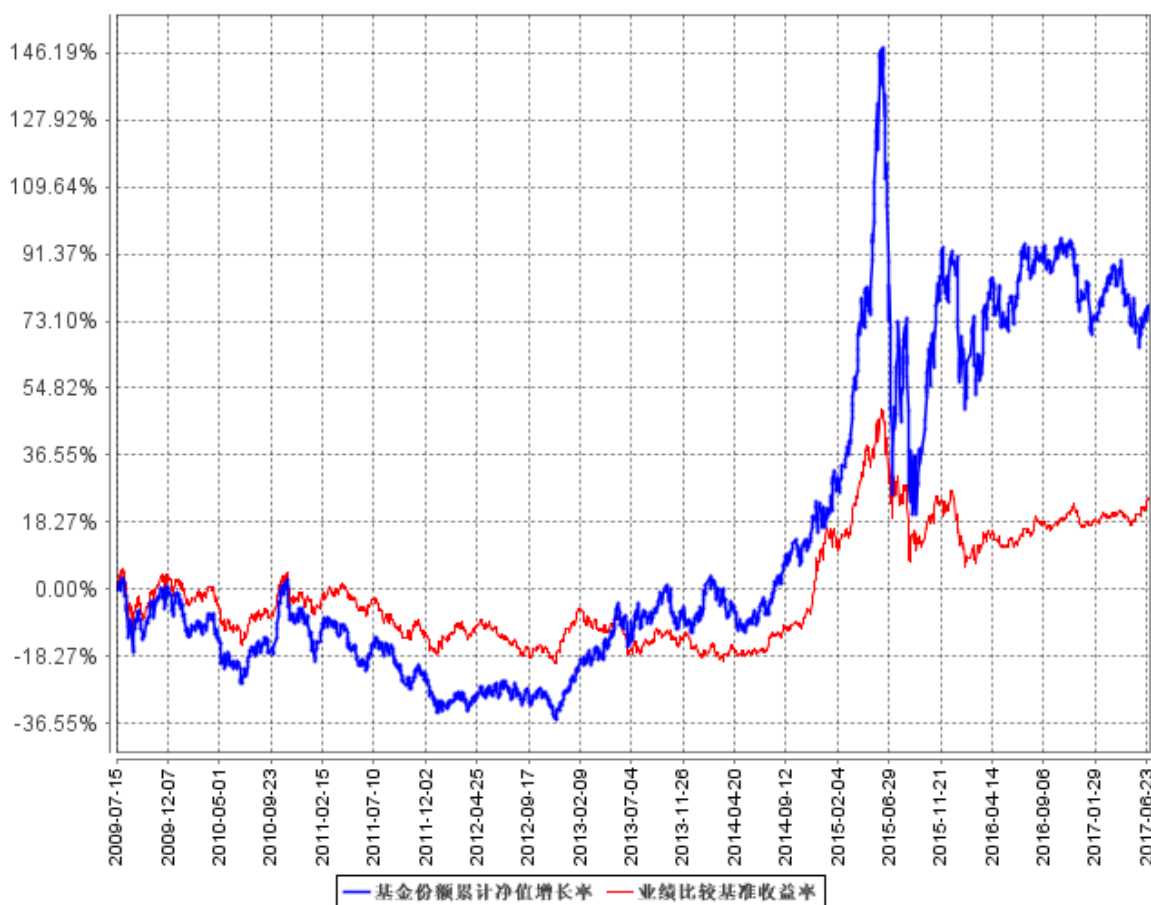


自基金合同生效起至今	76.52%	1.62%	24.71%	0.95%	51.81%	0.67%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%，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《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票投资占基金资产的比例为 30%-80%；债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-70%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 7 月 15 日到 2010 年 1 月 15 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《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

## § 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 2.5 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		
陈启明	华富价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	2014 年 9 月 26 日	-	十一年	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

	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、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				券产品经理，2010 年 2 月加入华富基金管理有限公司，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。
--	--	--	--	--	--

注：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、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

2017 年上半年沪深 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 2009 年 7 月 15 日生效，截止 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0186 元，累计份额净值为 1.8186 元。报告期，本基金份额净值增长率为-1.94%，同期业绩比较基准收益率为 6.30%。

#### 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%，环比提上 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《华富价值增长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-3,113,506.35 元，期末可供分配利润为 2,735,500.06 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，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）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、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本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、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：华富价值增长灵活配置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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,571,093.40	13,942,268.28
结算备付金		219,799.18	655,080.41
存出保证金		268,967.28	467,345.26
交易性金融资产	6.4.7.2	128,170,618.13	282,630,270.15
其中：股票投资		118,040,618.13	238,238,217.99
基金投资		-	-
债券投资		10,130,000.00	44,392,052.16
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		9,511,168.11	9,863,970.81
应收利息	6.4.7.5	32,490.33	63,644.04
应收股利		-	-
应收申购款		18,732.90	133,386.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		150,792,869.33	307,755,965.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		421,923.98	108,565.24
应付管理人报酬		182,498.07	402,675.46
应付托管费		30,416.36	67,112.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	182,774.84	409,312.76

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	124,980.41	275,400.62
负债合计		942,593.66	1,263,066.69
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	147,114,775.61	295,086,231.43
未分配利润	6.4.7.10	2,735,500.06	11,406,667.60
所有者权益合计		149,850,275.67	306,492,899.03
负债和所有者权益总计		150,792,869.33	307,755,965.72

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0186 元，基金份额总额 147,114,775.61 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：华富价值增长灵活配置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
<b>一、收入</b>		-427,280.81	15,144,995.29
1.利息收入		108,805.53	425,354.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	73,900.30	425,354.87
债券利息收入		34,905.23	-
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）		-4,752,217.61	-5,478,595.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,460,904.83	-6,158,758.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-762,094.68	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	470,781.90	680,162.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,012,952.37	18,941,616.73
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	203,178.90	1,256,619.24



<b>减：二、费用</b>		2,686,225.54	5,572,263.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,470,856.77	2,649,912.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	245,142.77	441,652.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	846,253.67	2,387,677.56
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	123,972.33	93,021.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,113,506.35	9,572,732.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,113,506.35	9,572,732.10

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：华富价值增长灵活配置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）	295,086,231.43	11,406,667.60	306,492,899.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,113,506.35	-3,113,506.35
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）	-147,971,455.82	-5,557,661.19	-153,529,117.01
其中：1.基金申购款	12,960,159.87	362,676.34	13,322,836.21
2.基金赎回款	-160,931,615.69	-5,920,337.53	-166,851,953.22
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	147,114,775.61	2,735,500.06	149,850,275.67



根据《华富价值增长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，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本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 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	12,571,093.40
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	12,571,093.40

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	120,403,611.58	118,040,618.13	-2,362,993.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	11,894,248.57	10,130,000.00	-1,764,248.57
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,894,248.57	10,130,000.00	-1,764,248.57
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		132,297,860.15	128,170,618.13	-4,127,242.02

### 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 2017年6月30日
应收活期存款利息	2,725.22
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	98.90
应收债券利息	29,545.21
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	121.00
合计	32,490.33

注：其他所列款项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 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	182,774.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	182,774.84

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,008.08
预提费用	-
应付审计费	34,712.18
应付信息披露费	89,260.15
合计	124,980.41

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	295,086,231.43	295,086,231.43
本期申购	12,960,159.87	12,960,159.87
本期赎回(以“-”号填列)	-160,931,615.69	-160,931,615.69
本期末	147,114,775.61	147,114,775.61

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	47,688,072.28	-36,281,404.68	11,406,667.60
本期利润	-7,126,458.72	4,012,952.37	-3,113,506.35
本期基金份额交易产生的变动数	-21,557,879.27	16,000,218.08	-5,557,661.19
其中：基金申购款	1,636,885.13	-1,274,208.79	362,676.34
基金赎回款	-23,194,764.40	17,274,426.87	-5,920,337.53
本期已分配利润	-	-	-

本期末	19,003,734.29	-16,268,234.23	2,735,500.06
-----	---------------	----------------	--------------

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	67,393.91
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	3,640.07
其他	2,866.32
合计	73,900.30

注：其他所列本期金额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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	322,619,776.32
减：卖出股票成本总额	327,080,681.15
买卖股票差价收入	-4,460,904.83

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-762,094.68
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-762,094.68

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	50,244,208.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	50,951,456.15
减：应收利息总额	54,846.96
买卖债券差价收入	-762,094.68

#### 6.4.7.13.3 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

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	470,781.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	470,781.90

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	4,012,952.37
——股票投资	4,443,779.56
——债券投资	-430,827.19
——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	4,012,952.37

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	172,535.11
转换费收入	30,643.79
-	-
合计	203,178.90

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	846,253.67
银行间市场交易费用	-
合计	846,253.67

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	89,260.15
自营托管账户维护费	-
-	-
合计	123,972.33

### 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
平安银行股份有限公司	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

### 6.4.10 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

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	68,472,554.45	13.13%	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华安证券	19,249,914.30	28.89%	-	-

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 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	62,939.42	13.20%	-	-
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
-	-	-	-	-

#### 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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,470,856.77	2,649,912.12
其中：支付销售机构的客户维护费	219,031.22	145,589.63

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）。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	245,142.77	441,652.03

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。

### 6.4.10.4 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：本基金本报告期内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：本基金本报告期末和上年度末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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	12,571,093.40	67,393.91	87,099,408.06	408,085.42

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（2017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
002859	洁美	2017年	2018	公开发	29.82	39.72	6,666	198,780.12	264,773.52	-

	科技	3月24日	年4月7日	行有锁定期						
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	26.13	7,980	158,083.80	208,517.40	-
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

#### 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
300075	数字政通	2017年6月29日	临时停牌	20.94	2017年7月17日	18.86	160,000	3,352,960.55	3,350,400.00	-
603238	诺邦股份	2017年5月15日	重大事项停牌	29.38	2017年8月23日	31.99	1,750	23,292.50	51,415.00	-
002856	美芝	2017年6月	重大	31.86	-	-	1,230	14,280.30	39,187.80	-

	股份	月 19 日	事项停牌							
300582	英飞特	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	18.92	2017 年 8 月 2 日	17.50	2,038	20,181.15	38,558.96	-
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	-

### 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

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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	-	-

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债券基金可投资的短期信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	10,130,000.00	44,392,052.16
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	10,130,000.00	44,392,052.16

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

银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。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 2017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	12,571,093.40	-	-	-	-	-	12,571,093.40
结算备付金	219,799.18	-	-	-	-	-	219,799.18
存出保证金	268,967.28	-	-	-	-	-	268,967.28



交易性金融资产	10,130,000.00	-	-	-	-	-	-	118,040,618.13	128,170,618.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	9,511,168.11	9,511,168.11
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	32,490.33	32,490.33
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	18,732.90	18,732.90
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,189,859.86	-	-	-	-	-	-	127,603,009.47	150,792,869.33
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	421,923.98	421,923.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	182,498.07	182,498.07
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	30,416.36	30,416.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	182,774.84	182,774.84
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	124,980.41	124,980.41
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	942,593.66	942,593.66
利率敏感度缺口	23,189,859.86	-	-	-	-	-	-	-126,660,415.81	149,850,275.67
上年度末 2016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	13,942,268.28	-	-	-	-	-	-	-	13,942,268.28
结算备付金	655,080.41	-	-	-	-	-	-	-	655,080.41
存出保证金	467,345.26	-	-	-	-	-	-	-	467,345.26
交易性金融资产	18,292,500.00	-	26,099,552.16	-	-	-	-	238,238,217.99	282,630,270.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	9,863,970.81	9,863,970.81
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	63,644.04	63,644.04
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	133,386.77	133,386.77
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,357,193.95	-	26,099,552.16	-	-	-	-	248,299,219.61	307,755,965.72
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	108,565.24	108,565.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	402,675.46	402,675.46
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	67,112.61	67,112.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	409,312.76	409,312.76
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	275,400.62	275,400.62
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	1,263,066.69	1,263,066.69
利率敏感度缺口	33,357,193.95	-	26,099,552.16	-	-	-	-	-247,036,152.92	306,492,899.03

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	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( 2017 年 6 月 30 日 )	上年度末( 2016 年 12 月 31 日 )
	市场利率下降 25 基点	123, 079. 50	593, 993. 40
	市场利率上升 25 基点	-123, 079. 50	-584, 615. 58

#### 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	118, 040, 618. 13	78. 77	238, 238, 217. 99	77. 73
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	10, 130, 000. 00	6. 76	44, 392, 052. 16	14. 48
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	128, 170, 618. 13	85. 53	282, 630, 270. 15	92. 21

##### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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( 2017 年 6 月 30 日 )	上年度末( 2016 年 12 月 31 日 )	
		沪深 300 指数上升 5%	4, 123, 045. 64	11, 333, 212. 59
		沪深 300 指数下降 5%	-4, 123, 045. 64	-11, 333, 212. 59

#### 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 (2017 年 6 月 30 日)	上年度末 (2016 年 12 月 31 日)
	合计	30,214,080.62	42,416,884.61

#### 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	118,040,618.13	78.28
	其中：股票	118,040,618.13	78.28
2	固定收益投资	10,130,000.00	6.72
	其中：债券	10,130,000.00	6.72
	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	12,790,892.58	8.48
7	其他各项资产	9,831,358.62	6.52
8	合计	150,792,869.33	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	2,338,529.00	1.56
C	制造业	67,739,494.48	45.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,138,800.00	2.09
E	建筑业	5,227,056.16	3.49
F	批发和零售业	15,438,269.60	10.30
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	10,843,248.72	7.24
J	金融业	86,614.92	0.06
K	房地产业	4,029,600.00	2.69

L	租赁和商务服务业	41,847.12	0.03
M	科学研究和技术服务业	1,558.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	5,930,210.22	3.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,220,500.00	2.15
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,889.71	0.00
S	综合	-	-
	合计	118,040,618.13	78.77

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股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	603939	益丰药房	458,000	15,434,600.00	10.30
2	002665	首航节能	1,600,000	11,520,000.00	7.69
3	600750	江中药业	287,500	9,990,625.00	6.67
4	000597	东北制药	729,920	8,160,505.60	5.45
5	000823	超声电子	500,000	7,210,000.00	4.81
6	603588	高能环境	380,000	5,928,000.00	3.96
7	300567	精测电子	64,100	5,123,513.00	3.42
8	002325	洪涛股份	700,000	5,110,000.00	3.41
9	002466	天齐锂业	79,936	4,344,521.60	2.90
10	002439	启明星辰	224,489	4,175,495.40	2.79
11	300346	南大光电	183,200	4,171,464.00	2.78
12	600967	内蒙一机	300,000	4,089,000.00	2.73
13	600340	华夏幸福	120,000	4,029,600.00	2.69
14	300446	乐凯新材	100,000	3,407,000.00	2.27
15	300075	数字政通	160,000	3,350,400.00	2.24
16	002460	赣锋锂业	70,000	3,237,500.00	2.16
17	300113	顺网科技	120,000	3,228,000.00	2.15
18	600661	新南洋	150,000	3,220,500.00	2.15
19	600116	三峡水利	280,000	3,138,800.00	2.09

20	002229	鸿博股份	240,000	2,688,000.00	1.79
21	601168	西部矿业	304,100	2,338,529.00	1.56
22	603986	兆易创新	28,836	2,243,729.16	1.50
23	002859	洁美科技	6,666	264,773.52	0.18
24	002860	星帅尔	7,980	208,517.40	0.14
25	601878	浙商证券	5,092	86,614.92	0.06
26	603186	华正新材	1,874	80,150.98	0.05
27	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.05
28	603179	新泉股份	1,495	65,645.45	0.04
29	300600	瑞特股份	1,124	62,606.80	0.04
30	603628	清源股份	2,581	57,556.30	0.04
31	603239	浙江仙通	2,160	56,224.80	0.04
32	603197	保隆科技	999	52,996.95	0.04
33	002846	英联股份	1,492	51,921.60	0.03
34	002850	科达利	570	51,750.30	0.03
35	603238	诺邦股份	1,750	51,415.00	0.03
36	300588	熙菱信息	1,380	48,010.20	0.03
37	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
38	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.03
39	603228	景旺电子	842	40,626.50	0.03
40	002856	美芝股份	1,230	39,187.80	0.03
41	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.03
42	300582	英飞特	2,038	38,558.96	0.03
43	300606	金太阳	1,228	38,080.28	0.03
44	603388	元成股份	892	33,512.44	0.02
45	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.02
46	603488	展鹏科技	1,837	32,074.02	0.02
47	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.02
48	603326	我乐家居	1,089	30,459.33	0.02
49	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
50	002881	美格智能	989	22,608.54	0.02
51	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
52	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
53	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
54	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
55	300616	尚品宅配	57	7,726.92	0.01
56	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01
57	002841	视源股份	90	6,679.80	0.00
58	300623	捷捷微电	85	5,712.00	0.00

59	603165	荣晟环保	67	4,445.45	0.00
60	603665	康隆达	85	3,412.75	0.00
61	300610	晨化股份	144	3,379.68	0.00
62	300630	普利制药	88	3,176.80	0.00
63	603303	得邦照明	94	3,138.66	0.00
64	300620	光库科技	86	2,973.88	0.00
65	603096	新经典	70	2,966.60	0.00
66	603225	新凤鸣	79	2,858.22	0.00
67	603926	铁流股份	82	2,782.26	0.00
68	300625	三雄极光	82	2,689.60	0.00
69	002849	威星智能	60	2,562.00	0.00
70	603819	神力股份	98	2,479.40	0.00
71	603042	华脉科技	86	2,444.12	0.00
72	300622	博士眼镜	80	2,434.40	0.00
73	002869	金溢科技	55	2,392.50	0.00
74	002866	传艺科技	88	2,369.84	0.00
75	002843	泰嘉股份	77	2,291.52	0.00
76	603113	金能科技	96	2,238.72	0.00
77	603955	大千生态	50	2,234.00	0.00
78	300589	江龙船艇	89	2,185.84	0.00
79	603050	科林电气	56	2,181.76	0.00
80	603266	天龙股份	62	2,098.70	0.00
81	603929	亚翔集成	93	2,094.36	0.00
82	002875	安奈儿	58	2,079.30	0.00
83	603320	迪贝电气	58	2,062.48	0.00
84	603811	诚意药业	53	1,997.57	0.00
85	603035	常熟汽饰	96	1,938.24	0.00
86	300592	华凯创意	83	1,923.11	0.00
87	603578	三星新材	42	1,918.14	0.00
88	603630	拉芳家化	51	1,898.22	0.00
89	603826	坤彩科技	99	1,787.94	0.00
90	300591	万里马	126	1,726.20	0.00
91	002826	易明医药	81	1,696.14	0.00
92	300635	达安股份	49	1,558.20	0.00
93	603081	大丰实业	82	1,556.36	0.00
94	300641	正丹股份	80	1,544.00	0.00
95	002870	香山股份	46	1,543.30	0.00
96	603177	德创环保	79	1,505.74	0.00
97	002827	高争民爆	59	1,421.90	0.00

98	603196	日播时尚	83	1,302.27	0.00
99	300609	汇纳科技	37	1,267.99	0.00
100	300621	维业股份	58	1,249.32	0.00
101	002867	周大生	40	1,235.20	0.00
102	300603	立昂技术	34	1,114.52	0.00
103	300647	超频三	44	1,082.40	0.00
104	603041	美思德	34	1,030.54	0.00
105	603313	梦百合	32	1,026.56	0.00
106	300587	天铁股份	38	1,019.16	0.00
107	300657	弘信电子	21	989.10	0.00
108	002868	绿康生化	34	988.38	0.00
109	603787	新日股份	49	958.93	0.00
110	300658	延江股份	22	854.26	0.00
111	601882	海天精工	48	834.24	0.00
112	603229	奥翔药业	40	792.80	0.00
113	002863	今飞凯达	49	791.84	0.00
114	300537	广信材料	38	783.56	0.00
115	603797	联泰环保	37	704.48	0.00
116	300514	友讯达	24	645.36	0.00
117	002774	快意电梯	41	574.00	0.00
118	300605	恒锋信息	16	508.80	0.00
119	300593	新雷能	19	501.41	0.00
120	300633	开立医疗	24	446.88	0.00
121	603728	鸣志电器	19	443.27	0.00
122	603855	华荣股份	28	428.96	0.00
123	603920	世运电路	19	425.98	0.00
124	300643	万通智控	26	425.62	0.00
125	300596	利安隆	19	409.64	0.00
126	603906	龙蟠科技	16	361.12	0.00
127	002840	华统股份	14	356.58	0.00
128	002851	麦格米特	8	318.96	0.00
129	603668	天马科技	21	309.54	0.00
130	300637	扬帆新材	12	279.84	0.00
131	300626	华瑞股份	8	232.72	0.00
132	603639	海利尔	3	159.36	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	600570	恒生电子	11,016,898.19	3.59
2	600750	江中药业	10,108,873.57	3.30
3	600498	烽火通信	9,088,334.00	2.97
4	600820	隧道股份	8,902,931.88	2.90
5	000423	东阿阿胶	8,222,164.92	2.68
6	002466	天齐锂业	7,973,416.92	2.60
7	000597	东北制药	7,761,078.90	2.53
8	603588	高能环境	7,637,510.72	2.49
9	000915	山大华特	7,131,219.10	2.33
10	002325	洪涛股份	6,900,248.14	2.25
11	600392	盛和资源	6,817,310.93	2.22
12	600889	南京化纤	6,793,846.00	2.22
13	000997	新大陆	6,159,798.00	2.01
14	300567	精测电子	5,477,654.00	1.79
15	300346	南大光电	5,350,888.00	1.75
16	600651	飞乐音响	5,336,982.05	1.74
17	002140	东华科技	5,272,504.00	1.72
18	300446	乐凯新材	4,673,457.11	1.52
19	600884	杉杉股份	4,313,905.00	1.41
20	600340	华夏幸福	4,166,230.96	1.36

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	600110	诺德股份	26,815,283.76	8.75
2	002519	银河电子	16,296,699.12	5.32

3	600498	烽火通信	16,167,277.63	5.27
4	000823	超声电子	15,542,803.59	5.07
5	002281	光迅科技	14,315,787.88	4.67
6	600661	新南洋	14,246,735.70	4.65
7	603883	老百姓	12,557,588.89	4.10
8	000426	兴业矿业	12,453,814.88	4.06
9	002466	天齐锂业	11,241,791.86	3.67
10	600570	恒生电子	10,916,046.16	3.56
11	600068	葛洲坝	10,871,878.56	3.55
12	300446	乐凯新材	10,087,208.00	3.29
13	600820	隧道股份	9,002,323.44	2.94
14	000752	西藏发展	8,507,043.01	2.78
15	000423	东阿阿胶	8,403,446.15	2.74
16	001979	招商蛇口	8,340,106.00	2.72
17	603939	益丰药房	8,260,989.75	2.70
18	300183	东软载波	7,775,248.32	2.54
19	000915	山大华特	7,725,968.90	2.52
20	300369	绿盟科技	7,226,228.85	2.36
21	300354	东华测试	7,216,819.65	2.35
22	600392	盛和资源	6,909,549.71	2.25

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	202,439,301.73
卖出股票收入（成交）总额	322,619,776.32

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）	10,130,000.00	6.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,130,000.00	6.76

### 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	100,000	10,130,000.00	6.76

### 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	268,967.28
2	应收证券清算款	9,511,168.11
3	应收股利	-
4	应收利息	32,490.33
5	应收申购款	18,732.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,831,358.62

### 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	10,130,000.00	6.76

### 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
5,431	27,087.97	74,591,798.59	50.70%	72,522,977.02	49.30%

### 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	58,247.50	0.0396%

### 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	0~10
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（2009年7月15日）基金份额总额	679,121,902.68
本报告期期初基金份额总额	295,086,231.43
本报告期基金总申购份额	12,960,159.87
减：本报告期基金总赎回份额	160,931,615.69
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	147,114,775.61

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	
中泰证券	1	170,264,939.29	32.65%	155,196.86	32.56%	-
中投证券	1	122,471,263.61	23.49%	111,607.41	23.41%	-
天风证券	2	73,746,826.47	14.14%	67,205.36	14.10%	-
华安证券	2	68,472,554.45	13.13%	62,939.42	13.20%	-
光大证券	1	22,845,120.38	4.38%	21,275.50	4.46%	-
海通证券	1	21,625,068.32	4.15%	19,707.12	4.13%	-
国泰君安证券	1	18,745,242.06	3.59%	17,457.35	3.66%	-
民生证券	1	13,840,158.38	2.65%	12,612.35	2.65%	-
川财证券	1	5,458,562.29	1.05%	4,974.36	1.04%	-



民族证券	1	3,959,665.86	0.76%	3,687.60	0.77%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	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），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在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券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金退租中国中投证券 1 个席位。。

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
中泰证券	22,487,244.20	33.75%	-	-	-	-
中投证券	8,665,946.18	13.01%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	19,249,914.30	28.89%	-	-	-	-
光大证券	6,823,636.40	10.24%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	9,396,511.80	14.10%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

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。

## 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	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2016 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	2017 年 1 月 19 日
2	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费费率优惠的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2017 年 2 月 23 日
3	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新及摘要（2017 年第 1 号）》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2017 年 2 月 28 日
4	《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万得投资顾问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	2017 年 3 月 8 日
5	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2016 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	2017 年 3 月 29 日
6	《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工商银行个人电子银行基金申购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	2017 年 3 月 30 日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费费率优惠的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2017 年 4 月 22 日
8	《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2017 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	2017 年 4 月 24 日

## § 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
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富价值增长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。