

# 华福丰盈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：华福基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2016 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及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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<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
3.3 其他指标.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37

7.12 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
8.4 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.....	39
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>39</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	41
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>42</b>
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	42
11.3 查阅方式.....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华福丰盈灵活配置
基金主代码	001474
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日
基金管理人	华福基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	42,686,403.37 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。</p> <p>本基金由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。本基金采用积极灵活的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，对基金资产进行灵活资产配置。在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。</p>
业绩比较基准	<p>五年期银行定期存款利率（税后）+1%</p> <p>其中，五年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构五年期人民币存款基准利率。</p>
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平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	华福基金管理有限责任公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	林佳
	联系电话	021-20296236
	电子邮箱	lj@hffunds.cn
		张志永
		021-62677777-212004
		zhangzhy@cib.com.cn

客户服务电话	40000-96326	95561
传真	021-68630069	021-62159217
注册地址	福建省福州市平潭县潭城镇西航路西航住宅新区 11 号楼 4 楼	福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号上海招商银行大厦 16 楼	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	陈文奇	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华福基金管理有限责任公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 16 楼
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	杭州市西溪路 128 号新湖商务大厦 9 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	5,817,706.72
本期利润	4,312,439.45
加权平均基金份额本期利润	0.0631
本期加权平均净值利润率	5.57%
本期基金份额净值增长率	3.96%
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	6,589,864.73
期末可供分配基金份额利润	0.1544
期末基金资产净值	49,276,268.10
期末基金份额净值	1.154
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	15.40%

### 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

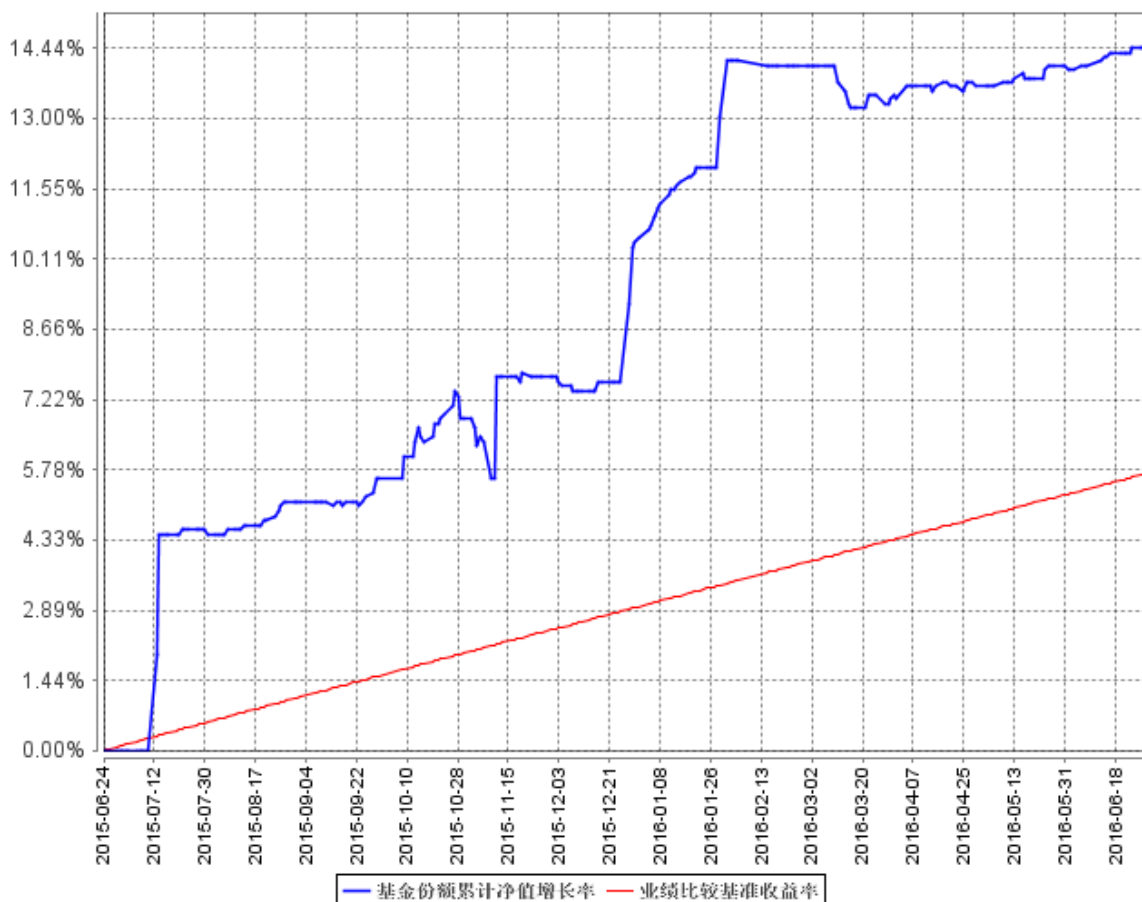
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.35%	0.05%	0.45%	0.02%	-0.10%	0.03%
过去三个月	0.96%	0.06%	1.37%	0.01%	-0.41%	0.05%
过去六个月	3.96%	0.16%	2.78%	0.02%	1.18%	0.14%
自基金合同生效起至今	15.40%	0.30%	5.88%	0.02%	9.52%	0.28%

注：1、本基金成立于 2015 年 6 月 24 日；

2、比较基准=五年银行定期存款利率（税后）+1%

#### 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、本基金成立于 2015 年 6 月 24 日；

2、比较基准=五年银行定期存款利率（税后）+1%

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华福基金管理有限责任公司注册资本为 1 亿元人民币，注册地为福建省平潭综合实验区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，华福基金管理了华福货币市场基金、华福现金增利货币市场基金、华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金、华福瑞益纯债债券型证券投资基金、华福朝阳债券型证券投资基金、华福大健康灵活配置混合型证券投资基金、华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金、华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金、华福稳健债券型证券投资基金及华福长禧半年定期开放债券型证券投资基金十只开放式基金，管理公募基金资产规模人民币 589.32 亿元。

#### 4.1.1 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		
洪木妹	本基金的 基金经 理、公 司总经 理助理	2015 年 6 月 24 日	-	9 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），拥有 9 年证券、基金行业工作经验。曾任职于华福证券有限责任公司投资自营部和资产管理总部，从事宏观经济研究和投资工作，现任华福基金管理有限责任公司总经理助理，自 2014 年 8 月起担任华福货币市场基金基金经理、于 2015 年 5 月至 2016 年 6 月担任华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2015 年 6 月起担任华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金基金经理、自 2015 年 6 月起担任华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2015 年 11 月起担任华福现金增利货币市场基金基金经理、自 2015 年 11 月起担任华福瑞益纯债债券型证券投资基金基金经理、自 2015 年 12 月起担



					任华福稳健债券型证券投资基金基金经理。
张晓南	基金经理	2015 年 11 月 19 日	-	6 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM），拥有 6 年证券、基金行业工作经验。曾任职于鹏华基金管理有限公司，现任职于华福基金管理有限公司投资管理部，自 2015 年 8 月起担任华福大健康灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 11 月起担任华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

洪木妹女士为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规的规定及基金合同、招募说明书及其更新等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内方面，国内经济形势仍然处于反复探底过程中，企稳迹象尚不能支持经济根本性回暖，经济仍然面临继续下行压力。一季度 GDP 同比增长 6.7%，呈现持续下行态势。工业增长方面，上半年规模以上工业增速触底反弹，一二月工业增加值同比增长 5.4%，创下 2008 年 11 月以来最低水平，随后工业增速回升，1-5 月规模以上工业增加值累计同比增长 5.9%。固定资产投资方面，1-5 月同比名义增长 9.6%，其中第三产业投资、基础设施投资分别增长 11.9%、20%。投资增速放缓但投资结构优化。在全球经济走低的大背景下，内外需疲弱以及受供给侧改革调结构、去产能的影响，经济下行压力不减。通胀方面，2 月 CPI 加速回升至 2.3%；高点过后，物价

水平走势基本保持小幅波动，且已有所回落。总体来说，尽管出现短期企稳的迹象，但从数据上也可以看出，经济回暖的态势并不稳定，仍然处于反复筑底的过程中。

国际方面，1-4 月中美经济数据呈复苏态势，整体全球情绪乐观，利率市场的投机力量在一季度显得薄弱，利率曲线趋于增陡。不过，一季度为国债配置传统时点，国债收益率整体走低。至五一假期，“营改增”补充规定发布，明确政策性金融债利息收入免增值税，政策性金融债长端利率自年初启动的趋势性调整暂告段落，率先企稳下行。6 月上半月，由于市场为应对缴税、MPA 时点考核做了较充分准备，市场资金面紧张程度不及预期。长端利率在经过五月底的震荡调整后，于端午节后释放部分紧张情绪，持续下行趋势。同时受英国“脱欧”公投，外围避险情绪影响，十年期国债收益率由节前 3.01%下行 21bp 至 2.80%。高资质中票、企业债收益率均有不同程度下行。

报告期内，本基金主要采用固定收益灵活久期策略，将主要仓位投资于债券市场以保证稳健收益。根据对宏观经济周期所处阶段及其他相关因素的灵活研判而调整组合久期。如果预期利率下降，本基金增加组合的久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金缩短组合的久期，以减小债券价格下降带来的风险。在二季度重点参与债券市场行情，进行了加久期操作，获得较佳收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金期末份额净值为 1.154 元；

报告期内，本基金份额净值增长率为 3.96%，业绩比较基准增长率为 2.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，宏观经济仍将低位运行，但由一致性贬值预期和通胀预期而产生的对于央行货币政策的压力仍然存在，央行货币政策料将继续维持稳健。由于近期数据表现不及预期，下半年财政政策还有望继续发力，基建投资短期内仍然有望继续保持相对高速增长，财政和准财政政策将继续托底经济。国际市场不确定性较大，我们将时刻关注市场变化，积极应对。在积极适度参与债市行情的同时，我们将注意控制仓位，并注意配置流动性较好的资产，以应对随时可能出现的市场转向。另外，信用事件有待进一步发酵，投资中将尽量规避高收益高风险品种。三季度股指受“脱欧”情绪修复料将小幅反弹，我们将谨慎参与、灵活配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参

与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管运营保障部的公司领导担任，成员由基金事务部、风险管理部、监察稽核部、研究发展部、投资管理部门(视会议议题内容选择相关投资方向部门)部门负责人或其指定人员组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

#### 2. 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

#### 3. 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### 4. 已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

本报告期本基金没有应分配但尚未分配的利润。

### 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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人的情形，但存在连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《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规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：华福丰盈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	36,742,366.63	235,937,447.28
结算备付金		-	-
存出保证金		272,988.54	13,508.73
交易性金融资产	6.4.7.2	12,228,100.00	2,845,750.23
其中：股票投资		-	2,682,750.23
基金投资		-	-
债券投资		12,228,100.00	163,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	156,912.56	432,147.74
应收股利		-	-
应收申购款		12,444.51	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		49,412,812.24	239,228,853.98
<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		1,001.07	529,500.33
应付管理人报酬		32,288.43	1,045,004.23
应付托管费		4,036.04	130,625.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,382.50	221,693.44
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	93,836.10	120,000.00
负债合计		136,544.14	2,046,823.54
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	42,686,403.37	213,609,800.87
未分配利润	6.4.7.10	6,589,864.73	23,572,229.57
所有者权益合计		49,276,268.10	237,182,030.44
负债和所有者权益总计		49,412,812.24	239,228,853.98

## 6.2 利润表

会计主体：华福丰盈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6月24日(基 金合同生效日)至

			2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		4,779,256.02	648,678.93
1.利息收入		943,799.14	915,077.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	335,871.74	915,077.65
债券利息收入		415,306.94	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		192,620.46	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,485,493.38	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,499,336.71	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-13,843.33	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,505,267.27	-266,998.00
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	855,230.77	599.28
<b>减：二、费用</b>		466,816.57	288,519.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	299,752.16	248,468.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,469.01	24,846.87
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	13,978.07	9,405.98
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	115,617.33	5,797.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,312,439.45	360,159.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,312,439.45	360,159.63

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华福丰盈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)	213,609,800.87	23,572,229.57	237,182,030.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,312,439.45	4,312,439.45
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)	-170,923,397.50	-21,294,804.29	-192,218,201.79
其中：1.基金申购款	36,732,966.80	5,486,458.99	42,219,425.79
2.基金赎回款	-207,656,364.30	-26,781,263.28	-234,437,627.58
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)	42,686,403.37	6,589,864.73	49,276,268.10
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年6月30日</b>		
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)	1,511,769,922.85	-	1,511,769,922.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	360,159.63	360,159.63
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)	1,533,959,048.15	-	1,533,959,048.15
其中：1.基金申购款	1,533,999,000.00	-	1,533,999,000.00
2.基金赎回款	-39,951.85	-	-39,951.85
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)	3,045,728,971.00	360,159.63	3,046,089,130.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.3 财务报表由下列负责人签署：

_____ 陈文奇 _____	_____ 张力 _____	_____ 刘建新 _____
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

华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称本基金)经中国证监会证监许可(2015)1030号文准予注册,本次募集资金总额为人民币 1,511,769,922.85 元。本基金于 2015 年 6 月 24 日正式成立。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为华福基金管理有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关约定,本基金投资于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(包含中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)以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相关规定)。除被动持有权证外不主动投资权证。如法律法规或监管机构允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可将其纳入投资范围。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。



#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。申购、赎回、转换及分红再投资引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。在计算实际利率时，扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税因素。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每一份基金份额享有同等分配权；
- (2) 收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) 根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每日支付。
- (4) 根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益；
- (5) 每日进行收益计算并分配时，每日累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每日累计收益支付时，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额。若投资者赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资者赎回基金款中扣除；
- (6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益；
- (7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向

管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号—公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号—合营安排》、《企业会计准则第 41 号—在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号—长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号—职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号—财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

#### 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	36,742,366.63
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	36,742,366.63

#### 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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,343,546.24	-116,446.24
	银行间市场	5,008,375.00	-7,375.00
	合计	12,351,921.24	-123,821.24
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,351,921.24	12,228,100.00	-123,821.24

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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**

无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有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	13,817.24
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	142,972.52
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	122.80
合计	156,912.56

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**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	-
银行间市场应付交易费用	5,382.50
合计	5,382.50

**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	0.74
预提费用	93,835.36
合计	93,836.10

### 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	213,609,800.87	213,609,800.87
本期申购	36,732,966.80	36,732,966.80
本期赎回(以“-”号填列)	-207,656,364.30	-207,656,364.30
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	42,686,403.37	42,686,403.37

### 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	23,092,249.81	479,979.76	23,572,229.57
本期利润	5,817,706.72	-1,505,267.27	4,312,439.45
本期基金份额交易产生的变动数	-22,050,502.67	755,698.38	-21,294,804.29
其中：基金申购款	5,636,544.28	-150,085.29	5,486,458.99
基金赎回款	-27,687,046.95	905,783.67	-26,781,263.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,859,453.86	-269,589.13	6,589,864.73

### 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
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	26,863.92
其他	2,209.98
合计	335,871.74

### 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	5,800,640.91
减：卖出股票成本总额	1,301,304.20
买卖股票差价收入	4,499,336.71

### 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 2016年1月1日至2016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	-13,843.33
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	-13,843.33

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	201,555,782.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	199,668,402.92
减：应收利息总额	1,901,222.84
买卖债券差价收入	-13,843.33

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未持有资产支持证券。



### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未进行贵金属投资。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期间未进行贵金属投资。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期间未进行贵金属投资。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期间未进行贵金属投资。

### 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

本基金本报告期间未进行权证投资。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期间未进行衍生工具投资。

### 6.4.7.16 股利收益

无。

### 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	-1,505,267.27
——股票投资	-1,381,446.03
——债券投资	-123,821.24
——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	-1,505,267.27

### 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	855,230.77
合计	855,230.77

#### 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	7,710.57
银行间市场交易费用	6,267.50
合计	13,978.07

#### 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	49,726.04
银行汇划费	2,781.97
上清所查询费	1,100.00
银行间证书费	200.00
帐户维护费	27,000.00
合计	115,617.33

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 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

本报告期末不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。

##### 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
-------	---------

华福基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华福证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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6月24日(基金合同生效日)至 2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华福证券有限责任公司	-	-	11,416,398.00	100.00%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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6月24日(基金合同生效日)至 2015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
华福证券有限责任公司	45,274,433.83	99.61%	-	-

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 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 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
华福证券有限责任公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月24日(基金合同生效日)至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		量的比例		总额的比例
华福证券有限责任公司	8,110.24	100.00%	8,110.24	100.00%

### 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6月24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	299,752.16	248,468.56
其中：支付销售机构的客户维护费	17,753.70	3,364.71

本基金的管理费率年费率为 0.8%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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6月24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	37,469.01	24,846.87

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。

### 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

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自有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 6 月 24 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
兴业银行股份有限公司	36,742,366.63	335,871.74	307,964,703.00	257,522.12

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期末未持有流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有停牌受限股票。

##### 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

本基金本报告期末未持有交易所市场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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设合规及风险管理委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极组织对公司各项制度及内部控制的执行情况、业务的合法合规性进行监督检查，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度及内部控制执行情况的监察稽核工作，风险管理部负责公司业务合法合规性管理，履行合规管理职责。公司管理层重视和支持风险管理和监察稽核工作，并保证合规管理和监察稽核工作的独立性和权威性，配备了充足合格的人员，明确了部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。报告期内，本基金未持有其他短期债券。

#### 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	7,227,100.00	-
AAA 以下	-	163,000.00
未评级	-	-
合计	7,227,100.00	163,000.00

长期信用评级由中国人民银行许可的信用机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式接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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持有金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变

动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变化而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存在保证金、债券投资及部分应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1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	36,742,366.63	-	-	-	-	-	36,742,366.63
存出保证金	272,988.54	-	-	-	-	-	272,988.54
交易性金融资产	-	5,001,000.00	-	7,227,100.00	-	-	12,228,100.00
应收利息	-	-	-	-	-	156,912.56	156,912.56
应收申购款	-	-	-	-	-	12,444.51	12,444.51
资产总计	37,015,355.17	5,001,000.00	-	7,227,100.00	-	169,357.07	49,412,812.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,001.07	1,001.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,288.43	32,288.43
应付托管费	-	-	-	-	-	4,036.04	4,036.04
其他负债	-	-	-	-	-	99,218.60	99,218.60
负债总计	-	-	-	-	-	136,544.14	136,544.14
利率敏感度缺口	37,015,355.17	5,001,000.00	-	7,227,100.00	-	32,812.93	49,276,268.10
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	235,937,447.28	-	-	-	-	-	235,937,447.28
存出保证金	13,508.73	-	-	-	-	-	13,508.73
交易性金融资产	-	-	-	163,000.00	-	2,682,750.23	2,845,750.23
应收利息	-	-	-	-	-	432,147.74	432,147.74



资产总计	235,950,956.01	-	-	163,000.00	-	3,114,897.97	239,228,853.98
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	529,500.33	529,500.33
应付管理人报酬		-	-	-	-	1,045,004.23	1,045,004.23
应付托管费		-	-	-	-	130,625.54	130,625.54
应付交易费用		-	-	-	-	218,293.44	218,293.44
其他负债		-	-	-	-	123,400.00	123,400.00
负债总计		-	-	-	-	2,046,823.54	2,046,823.54
利率敏感度缺口	235,950,956.01	-	-	163,000.00	-	1,068,074.43	237,182,030.44

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外，其他市场变量保持不变；		
	测算市场利率变动 25bp 对期末基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）。		
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）
	市场利率上升 25 个 bp	-279.71	-
	市场利率下降 25 个 bp	279.71	-

上年度末，本基金持有的交易性权益类资产占基金资产净值比例仅为 1.13%，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	2,682,750.23	1.13
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	12,228,100.00	24.82	163,000.00	0.07
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	12,228,100.00	24.82	2,845,750.23	1.20

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

2015年12月31日，本基金持有的交易性权益类资产占基金资产净值比例仅为1.13%；2016年6月30日，本基金未持有交易性权益类资产。因此，除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

- (1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- (2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入

值等；

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

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	12,228,100.00	24.75
	其中：债券	12,228,100.00	24.75
	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	36,742,366.63	74.36
7	其他各项资产	442,345.61	0.90
8	合计	49,412,812.24	100.00

### 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

本基金本报告期内未进行境内股票投资。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期内未买入股票。

### 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	603508	思维列控	1,814,144.00	0.76
2	300494	盛天网络	585,106.60	0.25
3	002782	可立克	507,852.80	0.21
4	002786	银宝山新	493,056.00	0.21
5	603778	乾景园林	492,741.00	0.21
6	300497	富祥股份	416,820.81	0.18
7	603299	井神股份	406,532.70	0.17
8	002777	久远银海	341,120.00	0.14
9	300491	通合科技	311,577.00	0.13
10	002785	万里石	240,002.00	0.10
11	002778	高科石化	191,688.00	0.08

### 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	-
卖出股票收入（成交）总额	5,800,640.91

## 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	5,001,000.00	10.15
	其中：政策性金融债	5,001,000.00	10.15
4	企业债券	7,227,100.00	14.67
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,228,100.00	24.82

## 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	150419	15 农发 19	50,000	5,001,000.00	10.15
2	122261	13 华泰 01	40,000	4,133,600.00	8.39
3	122808	PR 滕州债	50,000	3,093,500.00	6.28

## 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：本报告期内本基金未进行资产支持证券投资。

## 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：本报告期内本基金未进行贵金属投资。

## 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：本报告期内本基金未进行权证投资。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本报告期内未进行股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	272,988.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	156,912.56
5	应收申购款	12,444.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	442,345.61

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期内未持有可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期内未存在流通受限的股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
316	135,083.55	34,781,739.13	81.48%	7,904,664.24	18.52%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金未上市交易。

## 8.3 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	1,023.88	0.0024%

## 8.4 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	0~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月24日）基金份额总额	1,511,769,922.85
本报告期期初基金份额总额	213,609,800.87
本报告期基金总申购份额	36,732,966.80
减：本报告期基金总赎回份额	207,656,364.30
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	42,686,403.37

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 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) 报告期内本基金基金管理人人事变动如下：

2016 年 3 月 29 日，基金管理人发布了高级管理人员变更公告，由林佳同志正式担任本基金管理人的督察长，原督察长郑燕洪同志正式离任。

(2) 报告期内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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内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改聘为基金审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到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	
平安证券有限责任公司	2	5,800,640.91	100.00%	1,341.71	100.00%	-
华福证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动资源，协助基金投资；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。



选择程序：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选证券公司的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的证券公司。

2、报告期内租用证券公司交易单元未发生变更。

### 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
平安证券有限责任公司	179,300.00	0.39%	1,007,200,000.00	100.00%	-	-
华福证券有限责任公司	45,274,433.83	99.61%	-	-	-	-

### 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	华福基金管理有限责任公司关于 2016 年 1 月 4 日因指数熔断机制实施旗下基金相关业务办理时间调整的公告	公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	华福基金管理有限责任公司关于 2016 年 1 月 7 日因指数熔断机制实施旗下基金相关业务办理时间调整的公告	公司网站	2016 年 1 月 7 日
3	华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
4	关于旗下基金新增陆金所资管为代销机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 28 日
5	华福丰盈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）	上海证券报、公司网站	2016 年 2 月 1 日
6	关于旗下基金新增天天基金为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 2 月 22 日
7	关于旗下基金参加天天基金费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 2 月 26 日
8	关于旗下华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金延长基金赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2016 年 2 月 26 日
9	华福基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
10	华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
11	关于旗下基金新增同花顺基金为代销机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 11 日
12	华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 20 日

13	关于旗下部分基金开通定期定额投资业务并参加兴业银行基金定投优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 22 日
14	关于旗下基金新增代销机构的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 27 日
15	关于旗下基金参加平安证券费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 5 月 3 日
16	关于旗下基金参加好买基金费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 5 月 6 日
17	关于旗下部分基金在陆金所资管开通定期定额投资业务并参加定投费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 29 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告。

### 11.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（www.hffunds.cn）查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客户服务中心电话（40000-96326）咨询本基金管理人。

华福基金管理有限责任公司  
2016 年 8 月 26 日