

丰和价值证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
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	10
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	11
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	12
§5 托管人报告	12
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
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
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
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	37
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	38
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	38
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	38
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	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38

§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	39
§9 重大事件揭示	40
9.1 基金份额持有人大会决议.....	40
9.2 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
9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
9.4 基金投资策略的改变.....	40
9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
9.8 其他重大事件.....	42
§10 备查文件目录	42
10.1 备查文件目录.....	42
10.2 存放地点.....	42
10.3 查阅方式.....	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	丰和价值证券投资基金
基金简称	嘉实丰和价值封闭
场内简称	基金丰和
基金主代码	184721
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002 年 3 月 22 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期	15 年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2002 年 4 月 4 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为价值型证券投资基金，主要投资于依照有关区分股票价值、成长特征的指标所界定的价值型股票，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资方法，在综合宏观经济发展情况、政策取向、证券市场走势等多种因素的基础上，确定基金在股票、国债上的投资比例。坚持价值型投资理念，确立以相对价值判断为核心，兼顾对公司内在价值评估的选股思路；同时，以基本分析为基础，重视数量分析，系统考察上市公司的投资价值，最终确定所投资的股票，并以技术分析辅助个股投资的时机选择。

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		嘉实基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	林葛
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010) 65182266	(010) 68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	北京东城区建国门内大街 69 号

	区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	
办公地址	北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码	100005	100031
法定代表人	邓红国	周慕冰

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》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

§ 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	-60,143,967.36
本期利润	-61,989,269.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0207
本期加权平均净值利润率	-1.82%
本期基金份额净值增长率	0.15%
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	37,576,950.79
期末可供分配基金份额利润	0.0125
期末基金资产净值	3,296,440,120.01
期末基金份额净值	1.0988
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	623.39%

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) 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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

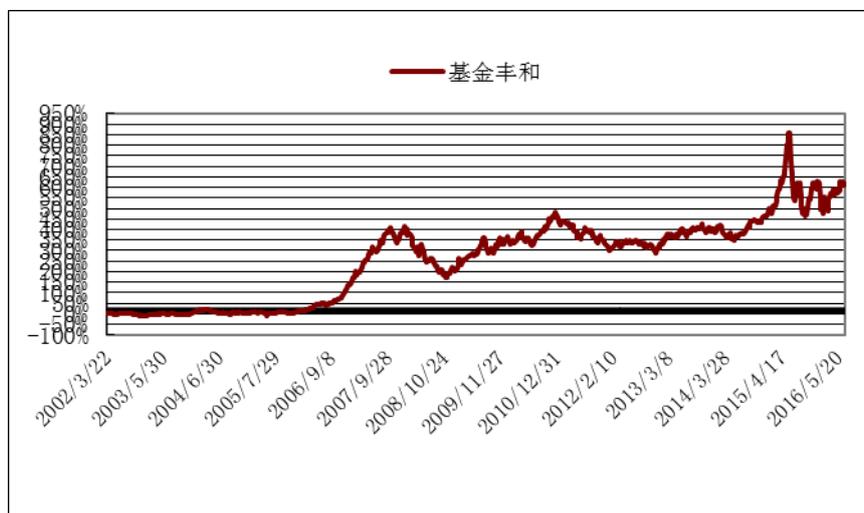
(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	5.92%	3.13%				
过去三个月	7.77%	2.64%				
过去六个月	0.15%	4.71%				
过去一年	-2.49%	5.04%				
过去三年	54.10%	3.68%				
自基金合同生效起至今	623.39%	2.89%				

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



图：嘉实丰和价值封闭累计份额净值增长率的历史走势对比图

(2002年3月22日至2016年6月30日)

注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（七、（四）投资组合）的有关约定：（1）本基金投资于股票、债券的比重不低于基金资产总值的80%，投资于国债的比重不低于基金资产净值的20%；（2）本基金投资于一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%；（3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；（4）本基金股票投资组合的平均B/P值高于沪深A股市场的平均B/P值；（5）遵守中国证监会规定的其他比例限制。

§ 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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、93 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯

债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

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		
吴云峰	本基金基金经理	2014 年 11 月 26 日	-	7 年	曾任中国国际金融有限公司资产管理部研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究员，2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司任研究部研究员、基金经理助理。博士，具有基金从业资格，中国国籍。

注：（1）任职日期、离任日期指公司作出决定后公告之日；（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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《丰和价值证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年股市先跌后涨，开年伊始在人民币贬值等不利因素影响下市场出现了 4 次向下熔断，后续在美国加息放缓、国内宏观经济数据逐步转好等利好因素的影响下，市场开始逐步企稳反弹。整体上半年，上证综指下跌 17.22%，创业板指数下跌 17.92%，沪深 300 指数下跌 15.47%。具体分板块来看，计算机、交运、旅游等板块跌幅靠前，食品饮料、有色金属、银行等板块跌幅较小。由于担心人民币贬值会带来资本外流，2016 年上半年市场整体估值压缩的较为厉害，去年年底估值较高的 TMT、互联网等主题板块跌幅较大，以白酒为代表的低估值、同时景气逐步回升的板块在上半年表现了较好的防御性。受到国家政策支持同时行业景气处于高位的新能源汽车产业链是上半年表现最为抢眼的板块，其中的三元材料、上游锂资源、钴资源等子板块表现最为靓丽。

本组合上半年净值上涨 0.15%，较大幅度跑赢了业绩基准。在一季度市场的快速下跌过程当中，组合及时降低了仓位，集中仓位增加了对新能源汽车上游的锂资源、稀土板块的配置，这两个板块在二季度的反弹当中给组合贡献了较多的正收益，同时去年年底配置的养殖板块在 2016 年上半年也贡献一定的收益。在二季度末，组合针对部分上涨幅度较大、同时未来空间业绩较为有限的品种进行了减持，增加了部分新发掘的优质品种，力争下半年为组合获得更好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0988 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在宏观层面，国内 PMI 等经济数据显示宏观经济反弹的势头逐步放缓，同时中央已经表明态度后续不会搞强刺激经济政策，因此宏观经济下半年上行空间有限，考虑到去年年底以及 2016 年 1 季度的政策性金融支持，估计 3 季度宏观经济仍然还会保持稳定，4 季度可能经济会有一些下行压力。在汇率方面，在 G20 之前，估计人民币汇率会保持稳定，同时随着英国脱欧带来的市场动荡，美联储加息的步伐会因此放缓，因此人民币短期贬值压力会减轻。但是中长期来看，美国经济由于前期去杠杆比较顺利，目前在全球范围内表现的较为健康，美元相对国际主要货币仍然有升值空间。加上国内经济的长期结构性因素仍然没有消除，人民币中期仍然有较大压力。同时国内债券市场的信用违约事件如果处理不当，可能也会产生较大冲击。综合上述两个方面的因素，我们判断站在中期的角度，市场上行仍然空间有限，短期 3 季度随着人民币汇率的压力减轻，同时产业资本减持的压力放缓，市场可能会有一定的反弹空间。中期市场仍然需要防范的风险因

素包括：1、美元升值带来人民币汇率压力；2、国内信用市场可能的冲击。

基于上述的判断，组合在 3 季度仍然会保持一个中性偏乐观的仓位，主要围绕几个方向进行配置：1、传媒、大数据、半导体新材料、新能源汽车等中长期景气度处于上行阶段的新兴产业；2、政策对供给侧层面进行调控的稀土、电解铝、煤炭板块中的优质标的，它们随着供给侧改革推进，企业价值面临一个重估的机会；3、部分行业竞争结构较好，估值较低同时稳定成长的白马蓝筹会受益于低利率环境带来的价值重估。组合会根据产业评估、自下而上的个股调研，力争挖掘更多的优质标的进行中长线投资，为组合带来更好的投资收益。同时也会密切跟踪评估流动性以及经济增长的变化，及时对组合进行积极的风险防范。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规部等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 本基金的基金管理人于 2016 年 3 月 28 日发布《丰和价值证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 2.936 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

(2) 报告期内本基金未实施利润分配。

(3) 根据本报告 3.1.1 “本期利润”为 -61,989,269.30 元以及本基金基金合同（十八（二）基金收益分配原则）“4、基金投资当年亏损，则不进行收益分配”，因此报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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

无。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：丰和价值证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	62,402,227.51	94,730,027.23
结算备付金		5,352,347.91	14,155,777.99
存出保证金		2,132,464.07	7,930,231.39
交易性金融资产	6.4.7.2	3,214,888,700.41	4,087,598,687.55

其中：股票投资		2,480,379,700.41	3,190,649,687.55
基金投资		-	-
债券投资		734,509,000.00	896,949,000.00
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		26,466,604.93	33,416,156.20
应收利息	6.4.7.5	14,841,406.53	19,627,357.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,746,464.55	-
资产总计		3,327,830,215.91	4,257,458,237.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		23,213,359.07	5,234,196.25
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,037,296.35	5,332,952.39
应付托管费		672,882.75	888,825.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,387,818.31	5,622,874.21
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	1,078,739.42	1,150,000.00
负债合计		31,390,095.90	18,228,848.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	296,440,120.01	1,239,229,389.31
所有者权益合计		3,296,440,120.01	4,239,229,389.31
负债和所有者权益总计		3,327,830,215.91	4,257,458,237.54

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0988 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：丰和价值证券投资基金

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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-20,957,517.55	1,194,469,064.70
1.利息收入		14,973,616.26	18,797,396.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	649,343.07	743,508.81
债券利息收入		14,324,273.19	18,053,888.12
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		-34,085,831.87	1,640,086,132.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-35,870,928.15	1,634,784,310.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,786,493.64	209,283.33
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	4,571,589.92	5,092,539.27
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-1,845,301.94	-464,414,465.16
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		41,031,751.75	74,082,444.02
1. 管理人报酬		25,422,086.76	32,342,817.36
2. 托管费		4,237,873.75	5,390,469.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	10,072,923.18	34,966,269.22
5. 利息支出		166,798.84	798,608.22
其中：卖出回购金融资产支出		166,798.84	798,608.22
6. 其他费用	6.4.7.19	1,132,069.22	584,279.61
三、利润总额		-61,989,269.30	1,120,386,620.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-61,989,269.30	1,120,386,620.68

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：丰和价值证券投资基金

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）	3,000,000,000.00	1,239,229,389.31	4,239,229,389.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-61,989,269.30	-61,989,269.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-880,800,000.00	-880,800,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	296,440,120.01	3,296,440,120.01
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	3,000,000,000.00	572,366,740.69	3,572,366,740.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,120,386,620.68	1,120,386,620.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-339,000,000.00	-339,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	1,353,753,361.37	4,353,753,361.37

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：

赵学军
基金管理人负责人

王红
主管会计工作负责人

常旭
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

丰和价值证券投资基金(以下简称“本基金”)由嘉实基金管理有限公司、广发证券股份有限公司、北京证券有限责任公司、中诚信托有限责任公司和吉林省信托投资有限责任公司五家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《丰和价值证券投资基金基金合同》发起,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[2001]60 号文批准,于 2002 年 3 月 22 日募集成立。本基金为契约型封闭式,存续期为 15 年,发行规模为 30 亿份基金份额。

本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2002]19 号文审核同意,于 2002 年 4 月 4 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《丰和价值证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行、上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票、债券的比重不低于基金资产总值的 80%,投资于国债的比重不低于基金资产净值的 20%。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《丰和价值证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。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、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产(质押式、买断式)；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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	62,402,227.51
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计：	62,402,227.51

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	2,232,296,825.48	2,480,379,700.41	248,082,874.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	723,728,705.71	734,509,000.00
	合计	723,728,705.71	734,509,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,956,025,531.19	3,214,888,700.41	258,863,169.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016年6月30日），本基金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

本期末（2016年6月30日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016年6月30日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	15,776.34
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	2,167.65
应收债券利息	14,822,598.90
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	863.64
合计	14,841,406.53

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	1,746,464.55
其他	-
合计	1,746,464.55

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	2,386,418.31
银行间市场应付交易费用	1,400.00
合计	2,387,818.31

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	-
预提费用	328,739.42
应付指数使用费	-
其他	-
合计	1,078,739.42

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	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回	-	-
本期末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

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	978,520,918.15	260,708,471.16	1,239,229,389.31
本期利润	-60,143,967.36	-1,845,301.94	-61,989,269.30
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-880,800,000.00	-	-880,800,000.00
本期末	37,576,950.79	258,863,169.22	296,440,120.01

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	553,643.97
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	56,342.08
其他	39,357.02
合计	649,343.07

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,113,333,199.91
减：卖出股票成本总额	4,149,204,128.06
买卖股票差价收入	-35,870,928.15

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	641,138,682.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	622,979,913.64
减：应收利息总额	20,945,262.29
买卖债券差价收入	-2,786,493.64

6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,571,589.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,571,589.92

6.4.7.16 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	-1,845,301.94
——股票投资	-263,575.58
——债券投资	-1,581,726.36
——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	-1,845,301.94

6.4.7.17 其他收入

本期（2016年1月1日至2016年6月30日），本基金无其他收入。

6.4.7.18 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	10,070,173.18
银行间市场交易费用	2,750.00
合计	10,072,923.18

6.4.7.19 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	49,726.04
信息披露费	149,178.12
债券托管账户维护费	18,000.00
银行划款手续费	2,006.35
指数使用费	-
上市年费	29,835.26
红利手续费	882,723.45
其他	600.00
合计	1,132,069.22

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，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大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**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	25,422,086.76	32,342,817.36
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的 20%，超过部分不计提基金管理人报酬。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,237,873.75	5,390,469.61

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2002 年 3 月 22 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	12,010,000.00	12,010,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	12,010,000.00	12,010,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.40%	0.40%

注：基金管理人作为本基金发起人，于本基金发行期间 2002 年 3 月 15 日至 2002 年 3 月 18 日通过网下配售认购本基金份额 6,000,000 份，每份发行价格为 1.01 元，其中：面值为 1.00 元；发行费用为 0.01 元；通过二级市场买入本基金基金份额 6,010,000 份，交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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
中诚信托有限责任公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
立信投资有限责任公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
广发证券股份有限公	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%

司				
---	--	--	--	--

注（1）中诚信托有限责任公司（原中煤信托投资有限责任公司）、吉林省信托投资有限责任公司、广发证券股份有限公司作为本基金发起人，均于本基金发行期间 2002 年 3 月 15 日至 2002 年 3 月 18 日通过网下配售各认购本基金份额 6,000,000 份，每份发行价格为 1.01 元，其中：面值为 1.00 元；发行费用为 0.01 元。基金合同生效一年以后的存续期间，各基金发起人持有的基金份额不得低于其认购基金份额的 50%。

（2）吉林省信托投资有限责任公司作为本基金发起人，其持有的本基金 3,000,000 份转让给立信投资有限责任公司，于 2008 年 3 月 31 日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完过户手续。

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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	62,402,227.51	553,643.97	397,771,828.72	581,375.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 1 日	-	2.9360	880,800,000.00	-	880,800,000.00	2015 年年度收益分配于 2016 年实施
合计	-	-	-	2.9360	880,800,000.00	-	880,800,000.00	

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

本期末（2016 年 6 月 30 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000401	冀东水泥	2016年4月6日	重大事项停牌	10.60	2016年7月14日	11.32	1,212,946	11,839,190.90	12,857,227.60	-
000504	*ST生物	2016年6月13日	重大事项停牌	14.96	-	-	78,600	1,531,434.00	1,175,856.00	-
000932	华菱钢铁	2016年3月28日	重大事项停牌	3.95	2016年8月8日	4.35	8,273,993	27,858,238.54	32,682,272.35	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	重大事项停牌	2.76	-	-	130,900	378,301.00	361,284.00	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项停牌	4.90	-	-	341,000	1,770,790.00	1,670,900.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本期末（2016年6月30日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2016年6月30日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

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**

本基金为进行价值型投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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投资于依照有关区分股票价值、成长特征的指标所界定的价值型股票，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

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。董事会下设风险控制与内审委员会，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，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，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，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，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、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、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建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：无)。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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，其余均能以合理价格适时变现。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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	62,402,227.51	-	-	-	62,402,227.51
结算备付金	5,352,347.91	-	-	-	5,352,347.91
存出保证金	2,132,464.07	-	-	-	2,132,464.07
交易性金融资产	480,952,000.00	146,712,000.00	106,845,000.00	2,480,379,700.41	3,214,888,700.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	26,466,604.93	26,466,604.93
应收利息	-	-	-	14,841,406.53	14,841,406.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,746,464.55	1,746,464.55
资产总计	550,839,039.49	146,712,000.00	106,845,000.00	2,523,434,176.42	3,327,830,215.91
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	-	-	-	23,213,359.07	23,213,359.07
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,037,296.35	4,037,296.35
应付托管费	-	-	-	672,882.75	672,882.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,387,818.31	2,387,818.31
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,078,739.42	1,078,739.42
负债总计	-	-	-	31,390,095.90	31,390,095.90
利率敏感度缺口	550,839,039.49	146,712,000.00	106,845,000.00	2,492,044,080.52	3,296,440,120.01
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	94,730,027.23	-	-	-	94,730,027.23
结算备付金	14,155,777.99	-	-	-	14,155,777.99

存出保证金	7,930,231.39	-	-	-	7,930,231.39
交易性金融资产	642,039,000.00	52,280,000.00	202,630,000.00	3,190,649,687.55	4,087,598,687.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	33,416,156.20	33,416,156.20
应收利息	-	-	-	19,627,357.18	19,627,357.18
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	758,855,036.61	52,280,000.00	202,630,000.00	3,243,693,200.93	4,257,458,237.54
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	-	-	-	5,234,196.25	5,234,196.25
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	5,332,952.39	5,332,952.39
应付托管费	-	-	-	888,825.38	888,825.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,622,874.21	5,622,874.21
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,150,000.00	1,150,000.00
负债总计	-	-	-	18,228,848.23	18,228,848.23
利率敏感度缺口	758,855,036.61	52,280,000.00	202,630,000.00	3,225,464,352.70	4,239,229,389.31

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	3,024,908.23	3,246,218.45

	市场利率上升 25 个基点	-2,986,150.33	-3,206,892.03
--	---------------	---------------	---------------

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。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、债券及基金，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，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，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	2,480,379,700.41	75.24	3,190,649,687.55	75.26
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	2,480,379,700.41	75.24	3,190,649,687.55	75.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	146,691,585.34	163,221,099.90
	沪深 300 指数下降 5%	-146,691,585.34	-163,221,099.90

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,431,632,160.46 元，属于第二层次的余额为 783,256,539.95 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 2,705,546,253.94 元，第二层次 1,382,052,433.61 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在

证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本基金于 2015 年 3 月 31 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值, 并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末: 无)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	2,480,379,700.41	74.53
	其中: 股票	2,480,379,700.41	74.53
2	固定收益投资	734,509,000.00	22.07
	其中: 债券	734,509,000.00	22.07
	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	67,754,575.42	2.04
7	其他各项资产	45,186,940.08	1.36
	合计	3,327,830,215.91	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	212,174,971.12	6.44
B	采矿业	333,236,838.14	10.11
C	制造业	1,431,969,464.94	43.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	32,166,516.33	0.98
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	336,550,349.56	10.21
J	金融业	1,508,920.00	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	512,164.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	82,173,485.52	2.49
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	50,086,990.80	1.52
S	综合	-	-
	合计	2,480,379,700.41	75.24

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	000969	安泰科技	13,134,444	184,276,249.32	5.59
2	600259	广晟有色	3,073,393	175,982,483.18	5.34
3	300047	天源迪科	7,309,466	145,823,846.70	4.42
4	002192	融捷股份	3,081,693	113,868,556.35	3.45
5	002299	圣农发展	4,361,444	112,961,399.60	3.43
6	300359	全通教育	3,508,150	104,051,729.00	3.16
7	002746	仙坛股份	2,380,364	99,213,571.52	3.01
8	002425	凯撒股份	4,449,066	97,879,452.00	2.97

9	300232	洲明科技	5,916,120	93,770,502.00	2.84
10	002155	湖南黄金	6,924,388	91,194,189.96	2.77
11	002308	威创股份	5,550,177	91,189,408.11	2.77
12	600661	新南洋	2,928,492	82,173,485.52	2.49
13	300065	海兰信	1,942,800	75,147,504.00	2.28
14	600988	赤峰黄金	3,542,100	66,060,165.00	2.00
15	300306	远方光电	2,489,900	59,085,327.00	1.79
16	300327	中颖电子	1,023,327	54,676,361.61	1.66
17	002362	汉王科技	1,910,389	52,516,593.61	1.59
18	002286	保龄宝	3,354,450	50,249,661.00	1.52
19	002502	骅威文化	2,006,042	49,348,633.20	1.50
20	300078	思创医惠	1,474,263	49,299,354.72	1.50
21	600136	当代明诚	2,112,792	48,911,134.80	1.48
22	002446	盛路通信	1,527,744	48,368,375.04	1.47
23	000807	云铝股份	7,231,500	47,366,325.00	1.44
24	002463	沪电股份	8,913,700	47,064,336.00	1.43
25	300369	绿盟科技	1,110,800	46,997,948.00	1.43
26	300346	南大光电	966,000	43,209,180.00	1.31
27	300377	赢时胜	801,714	39,676,825.86	1.20
28	300034	钢研高纳	1,633,671	36,104,129.10	1.10
29	002548	金新农	2,035,550	35,744,258.00	1.08
30	000932	华菱钢铁	8,273,993	32,682,272.35	0.99
31	002588	史丹利	2,616,100	32,308,835.00	0.98
32	600682	南京新百	1,129,839	32,166,516.33	0.98
33	600595	中孚实业	4,570,340	25,776,717.60	0.78
34	600328	兰太实业	1,911,304	22,973,874.08	0.70
35	601908	京运通	2,970,700	22,785,269.00	0.69
36	002240	威华股份	1,690,100	22,579,736.00	0.68
37	002311	海大集团	997,025	15,723,084.25	0.48
38	000401	冀东水泥	1,212,946	12,857,227.60	0.39
39	000911	南宁糖业	338,100	8,479,548.00	0.26
40	002434	万里扬	234,100	2,547,008.00	0.08
41	000709	河钢股份	634,900	1,758,673.00	0.05
42	600019	宝钢股份	341,000	1,670,900.00	0.05
43	000504	*ST 生物	78,600	1,175,856.00	0.04
44	000796	凯撒旅游	29,300	512,164.00	0.02
45	601818	光大银行	104,700	393,672.00	0.01
46	601328	交通银行	68,000	382,840.00	0.01
47	601939	建设银行	78,300	371,925.00	0.01

48	600005	武钢股份	130,900	361,284.00	0.01
49	601988	中国银行	112,300	360,483.00	0.01
50	000779	三毛派神	13,400	300,830.00	0.01

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	000795	英洛华	135,302,984.08	3.19
2	000969	安泰科技	132,166,622.29	3.12
3	600259	广晟有色	126,997,824.50	3.00
4	600338	西藏珠峰	121,575,055.98	2.87
5	002155	湖南黄金	115,651,984.01	2.73
6	300359	全通教育	98,145,404.40	2.32
7	600682	南京新百	93,955,056.30	2.22
8	002746	仙坛股份	88,200,059.70	2.08
9	300034	钢研高纳	87,459,027.77	2.06
10	600988	赤峰黄金	85,686,068.32	2.02
11	002299	圣农发展	85,075,188.83	2.01
12	300047	天源迪科	82,121,724.59	1.94
13	300327	中颖电子	79,993,539.17	1.89
14	000709	河钢股份	79,493,216.77	1.88
15	002070	众和股份	71,685,513.39	1.69
16	000630	铜陵有色	71,649,179.26	1.69
17	000603	盛达矿业	67,098,249.21	1.58
18	600136	当代明诚	66,979,148.96	1.58
19	300065	海兰信	63,696,795.33	1.50
20	300033	同花顺	63,166,881.26	1.49

7.4.2 累计卖出金额前 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	601388	怡球资源	192,066,956.45	4.53

2	600338	西藏珠峰	162,108,349.21	3.82
3	000795	英洛华	157,395,216.26	3.71
4	600988	赤峰黄金	134,133,234.79	3.16
5	000911	南宁糖业	130,990,110.27	3.09
6	002192	融捷股份	123,800,722.00	2.92
7	300006	莱美药业	114,510,918.89	2.70
8	002446	盛路通信	114,493,538.69	2.70
9	002714	牧原股份	103,181,697.82	2.43
10	600654	中安消	98,481,721.65	2.32
11	300327	中颖电子	97,449,946.33	2.30
12	002477	雏鹰农牧	96,952,237.92	2.29
13	002070	众和股份	92,051,760.42	2.17
14	600313	农发种业	76,876,834.07	1.81
15	002376	新北洋	68,291,968.58	1.61
16	000630	铜陵有色	67,798,173.11	1.60
17	000603	盛达矿业	65,654,802.05	1.55
18	300034	钢研高纳	64,723,134.62	1.53
19	600259	广晟有色	64,204,495.65	1.51
20	000709	河钢股份	61,590,162.04	1.45

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	3,439,197,716.50
卖出股票收入（成交）总额	4,113,333,199.91

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	国家债券	147,997,000.00	4.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	586,512,000.00	17.79
	其中：政策性金融债	586,512,000.00	17.79
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	734,509,000.00	22.28

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	160401	16 农发 01	2,300,000	229,954,000.00	6.98
2	130340	13 进出 40	900,000	90,945,000.00	2.76
3	150222	15 国开 22	900,000	89,991,000.00	2.73
4	110248	11 国开 48	500,000	53,915,000.00	1.64
5	110015	11 付息国债 15	500,000	53,015,000.00	1.61

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的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	2,132,464.07
2	应收证券清算款	26,466,604.93
3	应收股利	-
4	应收利息	14,841,406.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	1,746,464.55
8	其他	-
	合计	45,186,940.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
23,090	129,926.38	1,788,529,873.00	59.62%	1,211,470,127.00	40.38%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	泰康人寿保险股份有限公司	365,529,617.00	12.18%

	—分红—个人分红 —019L-FH002 深		
2	伦敦市投资管理有限公司— 客户资金	173,765,359.00	5.79%
3	中国人寿保险股份有限公司	86,223,196.00	2.87%
4	农银人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品	76,152,583.00	2.54%
5	建信人寿保险有限公司—普 通	65,938,291.00	2.20%
6	泰康人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品 —019L-CT001 深	65,905,604.00	2.20%
7	泰康人寿保险股份有限公司 —万能—个险万能	65,535,162.00	2.18%
8	阳光财产保险股份有限公司 —自有资金	61,442,578.00	2.05%
9	阳光人寿保险股份有限公司 —万能保险产品	56,343,545.00	1.88%
10	西部证券股份有限公司	54,547,300.00	1.82%

注：上表数据由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供。

§ 9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

9.2 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) 基金管理人的重大人事变动情况

2016 年 1 月 20 日本基金管理人发布公告，戴京焦女士因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

9.3 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。

9.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

9.6 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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
申万宏源证券有限公司	2	2,117,645,935.03	28.04%	1,482,366.60	28.04%	-
中国银河证券股份有限公司	2	2,015,116,476.65	26.68%	1,410,595.54	26.68%	-
中银国际证券有限责任公司	1	1,109,973,184.59	14.70%	776,981.23	14.70%	-
国信证券股份有限公司	1	1,050,980,815.23	13.92%	735,694.90	13.92%	-
光大证券股份有限公司	1	971,450,595.05	12.86%	680,025.07	12.86%	-
华泰证券股份有限公司	1	287,363,909.86	3.80%	201,154.73	3.80%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本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等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：德邦证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

9.8 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	丰和价值证券投资基金 2015 年年度收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 3 月 28 日

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准丰和价值证券投资基金设立的文件；
- (2) 《丰和价值证券投资基金基金合同》；
- (3) 《丰和价值证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《丰和价值证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内丰和价值证券投资基金公告的各项原稿。

10.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

10.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016年8月27日