

**泓德泓业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：泓德基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

**送出日期：2016年8月27日**

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设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、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.....	6
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.....	7
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遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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情况.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49

10.1	基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4	基金投资策略的改变 .....	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8	其他重大事件 .....	52
§11	备查文件目录 .....	54
11.1	备查文件目录 .....	54
11.2	存放地点 .....	55
11.3	查阅方式 .....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓业混合
基金主代码	001695
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月27日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	812,992,422.58份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过科学的、谨慎的大类资产配置策略，和重点投资于具有较高安全边际证券的组合策略，力争实现绝对收益的目标。
投资策略	本基金在对宏观经济周期及宏观调控政策规律的分析与研究的基础上，结合股票、债券、货币等大类资产的市场变化趋势、风险收益对比、估值情况等因素，对基金资产进行灵活配置。股票投资方面，本基金主要采取自上而下和自下而上相结合的方法选择具有较高安全边际的股票进行投资。债券投资方面，本基金将采取久期策略、信用策略、时机策略等多策略。本基金力争通过科学、谨慎的大类资产配置策略，和重点投资于具有较高安全边际证券的组合策略，力争为投资人带来稳健的投资回报。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 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		泓德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	田青
	联系电话	010-59850177	010-67595096
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4009-100-888	010-67595096
传真		010-59322130	010-66275853
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100088	100033
法定代表人		王德晓	王洪章

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hongdefund.com">http://www.hongdefund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

## §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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	9,857,791.32
本期利润	60,097,397.37
加权平均基金份额本期利润	0.0741
本期加权平均净值利润率	7.09%
本期基金份额净值增长率	7.16%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	20,128,266.93
期末可供分配基金份额利润	0.0248
期末基金资产净值	901,159,915.41
期末基金份额净值	1.108
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	10.80%

注：

- (1) 所述基金业绩指标不包括基金份额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。
- (2) 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。
- (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（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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	3.45%	0.38%	0.36%	0.01%	3.09%	0.37%

过去三个月	6.03%	0.39%	1.09%	0.01%	4.94%	0.38%
过去六个月	7.16%	0.43%	2.21%	0.01%	4.95%	0.42%
自基金合同生效日起 至今（2015年08月27 日-2016年06月30日）	10.80%	0.34%	3.85%	0.01%	6.95%	0.33%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准：一年期银行定期存款利率（税后）+3%

基准指数的构建原则如下：

- (1) 本基金的投资目标旨在通过科学的、谨慎的大类资产配置策略，和重点投资于具有较高安全边际证券的组合策略，力争实现绝对收益。从过往历史数据看，“一年期银行定期存款利率（税后）+3%”绝大部分时间都能战胜通货膨胀，市场上同类基金也多采用类似的业绩比较基准，该业绩比较基准能够匹配本基金的投资目标和市场情况。
- (2) 本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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



注：

- (1) 本基金的基金合同于2015年8月27日生效，截至2016年6月30日止，本基金成立未满1年。
- (2) 根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截止报告日，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

## §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

本基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于2015年3月3日，是我国第一家由专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币12,000万元，公司注册地在拉萨市。目前，公司股东及其出资比例为：王德晓26%，阳光保险集团股份有限公司25%，珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）16.667%，南京民生租赁股份有限公司13.875%，江苏岛村实业发展有限公司13.875%，上海捷朔信息技术有限公司4.583%。截至2016年6月30日，总资产管理规模为231.27亿元，其中：公募基金管理规模129.63亿元，专户产品管理规模101.64亿元。公司发行九只公募基金产品以及多只专户产品，包括：偏股型基金七只、债券型基金、货币基金各一只，完成了从权益类产品到固定收益类产品、从公募基金到专户的全方位产品布局。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邬传雁	本基金基金经理、公司副总经理	2015年8月27日	—	16年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任幸福人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理、阳光保险集团股份有限公司资产投资管理中心投资负责人、阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理负责人、光大永明人寿保险公司投资部投资分析主管、光大证券股份有限公司研究所分析师、华泰财产保险公司投资管理中心基金部副经理。2015年6月至今担任泓德泓富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，

					2015年8月至今担任泓德远见回报混合型证券投资基金的基金经理。2015年12月至今担任泓德裕泰债券型证券投资基金的基金经理。2015年12月至今担任泓德泓利货币市场基金的基金经理。
李倩	本基金基金经理	2016年2月4日	—	7年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任中国农业银行股份有限公司金融市场部、资产管理部理财组合投资经理；中信建投证券股份有限公司资产管理部债券交易员、债券投资经理助理。2015年12月至今担任泓德裕泰债券型证券投资基金的基金经理，2015年12月至今担任泓德泓利货币市场基金的基金经理，2016年2月至今担任泓德泓富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：

- (1) 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
- (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《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，

为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合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%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

### 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年开局A股市场因推出熔断机制出现大幅下跌，一月份上证指数下跌幅度超过25%，之后在取消熔断后市场逐渐走稳。春节后伴随着宏观数据走好及货币政策宽松预期的确立，市场逐渐回暖，二季度市场整体呈现区间震荡走势，指数先抑后扬，随着供给侧改革方向趋于明朗，以及宏观经济形势的逐步好转，市场活跃度较一季度明显提高，期间白酒、小金属、化工品、新能源汽车产业链个股都有较好表现。

上半年通缩环境明显改善，伴随着食品价格的季节性反弹和生产端补库存加速，温和通胀预期逐渐形成。人民币汇率逐渐稳定后，市场最担心的外生变量预期趋于稳定，美联储在进行了一次加息后政策导向也开始趋于温和，也给市场增加了做多的信心，市

场迎来反弹窗口期。上半年最大的宏观事件是英国脱欧公投成功，导致国际金融市场出现剧烈波动，英镑出现快速贬值走势，人民币汇率也出现了一定幅度的波动。

上半年我们总体持仓保持稳定，前期参与的定增项目仍处在锁定期，二级市场出于谨慎考虑没有增加新的持仓，债券部位阶段性参与了高收益信用债的投资，总体持仓也保持稳定。本基金一直采取稳健谨慎的投资策略，后市为提高产品收益率，我们将积极发掘定增市场及债券市场的投资机会，适度增加基金业绩弹性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金的基金份额净值为1.108元，本报告期份额净值增长率为7.16%，同期业绩比较基准增长率为2.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年上半年宏观经济出现了一系列积极变化，随着美元持续加息预期减弱，市场之前担心的外部风险逐步化解。一季度货币政策继续保持宽松积极，贷款总规模继续稳步提升，财政政策也开始出现偏积极信号，供给侧改革进入落实阶段，部分产能过剩行业开始整合，从二季度开始微观层面企业经营形势也有所好转，部分行业出现需求回暖和明显的补库存行为。

上半年房地产复苏势头仍保持延续，涨价范围从一线城市逐步蔓延至二三线城市，房地产市场的回暖带动了钢铁、建材、汽车、家电等行业需求出现好转；年初以来部分化工产品和原材料如维生素、钛白粉等价格大幅上涨，二季度涨价范围继续扩大，特别是随着石油价格探明阶段性底部，煤炭、有色金属、钢材等上游周期品价格上半年总体出现上涨。尽管上半年宏观经济出现了阶段性复苏的良好势头，但我们认为在产能问题、债务问题还没有得到全面解决的情况下，经济回暖也不会一蹴而就，预计2016年GDP增速仍将继续缓慢下行，年内通胀水平温和可控，M2增速总体稳定中略有回落，年内宏观经济长期拐点预计仍难看到，但在供给侧改革过程中局部性的减免税、转移支付也将逐步落实，高铁及轨道交通、城市地下管网、环保、医疗等领域的政府投资可能加大。

市场趋势上，我们预计今年股指走势总体呈现宽幅震荡可能较大。未来投资方向选择上，经济转型仍是最大的看点，我们认为目前新兴产业虽然仍存在局部高估的现象，但其中也不乏大量优质公司，这些公司的高成长将逐步化解其估值压力，未来会逐步出

现一批智能制造、大数据、新能源、新材料、生物科技类的优秀上市公司。在货币政策、财政政策偏积极，市场风险有所化解的基础上，我们认为未来投资热点将呈现多元化格局，服务业、大消费、新兴产业等均存在投资机会；周期股在二季度经历了一轮小幅上涨后，未来投资机会将主要取决于供给侧改革政策落地的实际效果。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理、督察长、研究部、监察稽核部、运营支持部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基

金利润分配原则的约定，本基金报告期内未实施利润分配。

本基金截至2016年6月30日，期末可供分配利润为20,128,266.93元，其中：未分配利润已实现部分为20,128,266.93元，未分配利润未实现部分为68,039,225.90元。

#### **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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人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。

#### **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**

本托管人复核审查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。

### **§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：泓德泓业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	2,612,330.37	13,479,211.38
结算备付金		—	309,523.81
存出保证金		5,172.60	15,578.00
交易性金融资产	6.4.7.2	988,274,997.39	774,405,057.99
其中：股票投资		275,676,997.39	196,192,557.99
基金投资		—	—
债券投资		712,598,000.00	578,212,500.00
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	—	40,000,140.00
应收证券清算款		61,375,811.80	1,440,544.16
应收利息	6.4.7.5	9,536,887.94	10,051,374.02
应收股利		—	—
应收申购款		4,861.70	1,988.07
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		1,061,810,061.80	839,703,417.43
<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		159,824,450.26	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		7,232.67	4,087.81

应付管理人报酬		578,660.78	563,701.62
应付托管费		108,498.89	105,694.02
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	30,096.55	50,996.77
应交税费		—	—
应付利息		11,698.81	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	89,508.43	98,007.74
负债合计		160,650,146.39	822,487.96
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	812,992,422.58	810,988,981.68
未分配利润	6.4.7.10	88,167,492.83	27,891,947.79
所有者权益合计		901,159,915.41	838,880,929.47
负债和所有者权益总计		1,061,810,061.80	839,703,417.43

注：

- (1) 报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.108元，基金份额总额812,992,422.58份。
- (2) 本基金合同于2015年8月27日生效，上年度财务报表实际编制期间为2015年8月27日至2015年12月31日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：泓德泓业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
一、收入		65,701,478.22
1.利息收入		15,411,095.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,936.23
债券利息收入		15,277,269.90
资产支持证券利息收入		—



买入返售金融资产收入		105,889.52
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		48,758.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	—
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	-443,736.52
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	492,495.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	50,239,606.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,017.87
<b>减：二、费用</b>		5,604,080.85
1. 管理人报酬		3,367,092.89
2. 托管费		631,329.84
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	28,958.17
5. 利息支出		1,454,078.06
其中：卖出回购金融资产支出		1,454,078.06
6. 其他费用	6.4.7.19	122,621.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		60,097,397.37
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		60,097,397.37

注：本基金合同于2015年8月27日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德泓业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)	810,988,981.68	27,891,947.79	838,880,929.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	60,097,397.37	60,097,397.37
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)	2,003,440.90	178,147.67	2,181,588.57
其中：1.基金申购款	2,584,265.25	213,312.68	2,797,577.93
2.基金赎回款	-580,824.35	-35,165.01	-615,989.36
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)	812,992,422.58	88,167,492.83	901,159,915.41

注：本基金合同于2015年8月27日生效，无上年度可比期间。

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：

王德晓

王德晓

李娇

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

泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委

员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1158号《关于准予泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集811,007,625.49元,且经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1051号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年8月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为811,010,666.55份,其中认购资金利息折合3,041.06份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标为通过科学的、谨慎的大类资产配置策略和重点投资于具有较高安全边际证券的组合策略,力争实现绝对收益的目标。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交易的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会准予投资的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券等)、银行存款(包括通知存款、定期存款、协议存款等)、权证、货币市场工具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相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的0%-95%;保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+3%。

#### 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》、《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、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

本基金2016年1月1日至2016年6月30日止期间的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6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日期间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

本基金在本报告期间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[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[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

(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。自2013年1月1日起，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	2,612,330.37
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	2,612,330.37

##### 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	205,939,443.80	275,676,997.39	69,737,553.59	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	—	—	
	银行间市场	714,427,150.77	712,598,000.00	-1,829,150.77
	合计	714,427,150.77	712,598,000.00	-1,829,150.77
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	920,366,594.57	988,274,997.39	67,908,402.82	

##### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	684.87
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	9,536,200.63
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.04
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	2.40
合计	9,536,887.94

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	30,096.55
合计	30,096.55

#### 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	0.83
预提费用	89,507.60
合计	89,508.43

#### 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	810,988,981.68	810,988,981.68
本期申购	2,584,265.25	2,584,265.25
本期赎回（以“-”号填列）	-580,824.35	-580,824.35
本期末	812,992,422.58	812,992,422.58

注：申购含转换入份额，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	10,226,256.65	17,665,691.14	27,891,947.79
本期利润	9,857,791.32	50,239,606.05	60,097,397.37
本期基金份额交易产生的变动数	44,218.96	133,928.71	178,147.67

其中：基金申购款	56,162.26	157,150.42	213,312.68
基金赎回款	-11,943.30	-23,221.71	-35,165.01
本期已分配利润	—	—	—
本期末	20,128,266.93	68,039,225.90	88,167,492.83

#### 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	26,794.19
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	1,036.94
其他	105.10
合计	27,936.23

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 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	346,565,288.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	340,450,312.74
减：应收利息总额	6,558,712.13
买卖债券差价收入	-443,736.52

#### 6.4.7.14 衍生工具收益



本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 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	492,495.17
基金投资产生的股利收益	—
合计	492,495.17

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	50,239,606.05
——股票投资	57,542,439.18
——债券投资	-7,302,833.13
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	50,239,606.05

#### 6.4.7.17 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	2,006.13
转换费收入	11.74

合计	2,017.87
----	----------

注：

- (1) 本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。
- (2) 本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

#### 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	20,645.67
银行间市场交易费用	8,312.50
合计	28,958.17

#### 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	39,781.56
信息披露费	49,726.04
其他	500.00
汇划手续费	16,114.29
账户维护费	16,500.00
合计	122,621.89

### 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

截至本财务报表批准日，本基金无须做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

本报告期内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
泓德基金管理有限公司(以下简称“泓德基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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

本基金在报告期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 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	3,367,092.89
其中：支付销售机构的客户维护费	121.76

注：

- (1) 本基金合同于2015年8月27日生效，无上年度可比期间。
- (2) 支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.8%的年费率每日计提，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 \* 0.8% / 当年天数。

#### 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
当期发生的基金应支付的托管费	631,329.84

注：

- (1) 本基金合同于2015年8月27日生效，无上年度可比期间。
- (2) 支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 \* 0.15 % / 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

本基金本报告期末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 2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	10,001,700.00
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	10,001,700.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.23%

注：

- (1) 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。
- (2) 基金管理人泓德基金在本会计期间认购本基金的交易委托泓德基金直销柜台办理，适用费率为1,000元/笔。
- (3) 本基金基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。
- (4) 本基金合同于2015年8月27日生效，无上年度可比期间。

##### 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	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,612,330.37	26,794.19

注：

- (1) 本基金合同于2015年8月27日生效，无上年度可比期间。
- (2) 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末发生其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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

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	期末成本总额	期末估值总额	说明
000833	贵糖股份	2015-10-13	2016-10-13	非公开发行股票	7.02	12.56	7,327,436	51,438,600.72	92,032,596.16	
002663	普邦园林	2015-10-30	2016-11-02	非公开发行股	5.55	6.76	4,505,405	25,004,997.75	30,456,537.8	该股票于2016年6月16日实施权

				票						益分派方案：每10股派0.107953元人民币现金（含税）。
600708	光明地产	2015-11-23	2016-11-17	非公开发行股票	10.96	8.39	1,824,817	19,999,994.32	15,310,214.63	
601908	京运通	2015-12-01	2016-11-28	非公开发行股票	7.88	7.67	1,713,197	13,499,992.36	13,140,220.99	
300334	津膜科技	2015-12-23	2016-12-26	非公开发行股票	26.52	18.05	339,366	8,999,986.32	6,125,556.3	
300102	乾照光电	2015-11-11	2016-11-16	非公开发行股票	6.94	8.29	1,008,645	6,999,996.3	8,361,667.05	
002407	多氟多	2015-11-11	2016-11-14	非公开发行股票	29.88	31.48	412,500	4,930,200	12,985,500	该股票于2016年5月12日实施权益分派方案：每10股派1.50元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10股转增15股。
300247	乐金健康	2015-11-10	2016-11-14	非公开发行股票	11.45	7.37	873,362	4,999,997.45	6,436,677.94	该股票于2016年4月29日实施权益分派方案：每10股派0.30元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10

										股转增10股。
300256	星星科技	2015-11-09	2016-11-11	非公开发行股票	15	14.34	666,666	4,999,995	9,559,990.44	该股票于2016年4月29日实施权益分派方案：以资本公积向全体股东每10股转增10股。
300370	安控科技	2015-11-06	2016-11-09	非公开发行股票	12.3	9.53	813,000	4,999,950	7,747,890	该股票于2016年5月27日实施权益分派方案：每10股派0.60元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10股转增10股。
002562	兄弟科技	2015-11-30	2016-12-02	非公开发行股票	15.55	21.97	321,543	4,999,993.65	7,064,299.71	
300051	三五互联	2015-12-02	2016-12-05	非公开发行股票	14.1	17.58	354,610	5,000,001	6,234,043.8	
002217	合力泰	2015-11-17	2016-11-18	非公开发行股票	12.9	14.39	387,597	5,000,001.3	5,577,520.83	
002253	川大智胜	2015-12-08	2016-12-12	非公开发行股票	40.28	32.66	186,196	4,999,996.68	6,081,161.36	该股票于2016年5月19日实施权益分派方案：每10股派2.00元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全

										体股东每10股转增5股。
300303	聚飞光电	2015-12-02	2016-12-14	非公开发行股票	9.13	9.32	547,645	4,999,998.85	5,104,051.4	该股票于2016年6月24日实施权益分派方案：每10股派0.50元人民币现金（含税）。
002373	千方科技	2015-12-16	2016-12-19	非公开发行股票	38.56	14.94	259,336	4,999,998.08	3,874,479.84	该股票于2016年5月10日实施权益分派方案：每10股派1.00元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10股转增10股。
002052	同洲电子	2015-12-28	2016-12-29	非公开发行股票	9.98	10.01	480,000	4,790,400	4,804,800	
600682	南京新百	2015-11-27	2016-11-24	非公开发行股票	20.1	25.12	165,838	3,333,343.8	4,165,850.56	
300508	维宏股份	2016-04-12	2017-04-19	新股锁定	20.08	254.5	10,383	208,490.64	2,642,473.5	
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股未上市	12.98	12.98	7,341	95,286.18	95,286.18	
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股未上市	5.8	5.8	971	5,631.8	5,631.8	
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股未上市	10.05	10.05	926	9,306.3	9,306.3	



注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截至本报告期末2016年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额159,824,450.26元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150213	15国开13	2016-07-01	102.89	400,000	41,156,000.00
150209	15国开09	2016-07-01	105.14	500,000	52,570,000.00
101461017	14神华MTN002	2016-07-07	105.21	400,000	42,084,000.00
101454050	14厦港务MTN001	2016-07-07	102.83	300,000	30,849,000.00
101460042	14济西城投MTN002	2016-07-07	103.01	35,000	3,605,350.00
合计				1,635,000	170,264,350.00

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有交易所市场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由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，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致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的账户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	—	10,058,000.00
A-1以下	—	—
未评级	60,279,000.00	135,424,500.00
合计	60,279,000.00	145,482,500.00

注：未评级债券为政策性金融债及超短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 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	288,683,000.00	145,823,000.00
AAA以下	218,930,000.00	200,219,000.00
未评级	144,706,000.00	86,688,000.00
合计	652,319,000.00	432,730,000.00

注：未评级债券均为政策性金融债，债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 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。

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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除6.4.13.4.1.1中列示的卖出回购金融资产款外，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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产

等，其余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。

#### 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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,612,330.37	—	—	—	2,612,330.37
存出保证金	5,172.60	—	—	—	5,172.60
交易性金融资产	152,015,000.00	508,013,000.00	52,570,000.00	275,676,997.39	988,274,997.39
应收证券清算款	—	—	—	61,375,811.80	61,375,811.80
应收利息	—	—	—	9,536,887.94	9,536,887.94
应收申购款	—	—	—	4,861.70	4,861.70
资产总计	154,632,502.97	508,013,000.00	52,570,000.00	346,594,558.83	1,061,810,061.80
负债					
卖出回购金融资产款	159,824,450.26	—	—	—	159,824,450.26
应付赎回款	—	—	—	7,232.67	7,232.67
应付管理人报酬	—	—	—	578,660.78	578,660.78
应付托管费	—	—	—	108,498.89	108,498.89
应付交易费用	—	—	—	30,096.55	30,096.55
应付利息	—	—	—	11,698.81	11,698.81
其他负债	—	—	—	89,508.43	89,508.43
负债总计	159,824,450.26	—	—	825,696.13	160,650,146.39

	.26				.39
利率敏感度缺口	-5,191,947.29	508,013,000.00	52,570,000.00	345,768,862.70	901,159,915.41
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	13,479,211.38	—	—	—	13,479,211.38
结算备付金	309,523.81	—	—	—	309,523.81
存出保证金	15,578.00	—	—	—	15,578.00
交易性金融资产	145,482,500.00	346,042,000.00	86,688,000.00	196,192,557.99	774,405,057.99
买入返售金融资产	40,000,140.00	—	—	—	40,000,140.00
应收证券清算款	—	—	—	1,440,544.16	1,440,544.16
应收利息	—	—	—	10,051,374.02	10,051,374.02
应收申购款	—	—	—	1,988.07	1,988.07
资产总计	199,286,953.19	346,042,000.00	86,688,000.00	207,686,464.24	839,703,417.43
负债					
应付赎回款	—	—	—	4,087.81	4,087.81
应付管理人报酬	—	—	—	563,701.62	563,701.62
应付托管费	—	—	—	105,694.02	105,694.02
应付交易费用	—	—	—	50,996.77	50,996.77
其他负债	—	—	—	98,007.74	98,007.74
负债总计	—	—	—	822,487.96	822,487.96
利率敏感度缺口	199,286,953.19	346,042,000.00	86,688,000.00	206,863,976.28	838,880,929.47

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
	市场利率上升25个基点	-3,499,733.65	-2,758,620.67
	市场利率下降25个基点	3,539,124.97	2,801,742.84

#### 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，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围0-95%；保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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VaR(Value at Risk)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	275,676,997.39	30.59	196,192,557.99	23.39
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	275,676,997.39	30.59	196,192,557.99	23.39

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2016年6月30日，本基金成立尚不足一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净值的影响。

#### 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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	275,676,997.39	25.96
	其中：股票	275,676,997.39	25.96
2	固定收益投资	712,598,000.00	67.11



	其中：债券	712,598,000.00	67.11
	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	2,612,330.37	0.25
7	其他各项资产	70,922,734.04	6.68
8	合计	1,061,810,061.80	100.00

## 7.2 报告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	191,361.36	0.02
B	采矿业	—	—
C	制造业	196,555,811.29	21.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	31,094,798.29	3.45
F	批发和零售业	6,428,899.22	0.71
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	18,902,650.90	2.10
J	金融业	7,056,453.85	0.78
K	房地产业	15,310,214.63	1.70
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	136,807.85	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	275,676,997.39	30.59

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000833	贵糖股份	7,327,436	92,032,596.16	10.21
2	002663	普邦园林	4,505,405	30,456,537.80	3.38
3	600708	光明地产	1,824,817	15,310,214.63	1.70
4	601908	京运通	1,713,197	13,140,220.99	1.46
5	002407	多氟多	412,500	12,985,500.00	1.44
6	300256	星星科技	666,666	9,559,990.44	1.06
7	300102	乾照光电	1,008,645	8,361,667.05	0.93
8	300370	安控科技	813,000	7,747,890.00	0.86
9	002562	兄弟科技	321,543	7,064,299.71	0.78
10	300247	乐金健康	873,362	6,436,677.94	0.71
11	300051	三五互联	354,610	6,234,043.80	0.69
12	300334	津膜科技	339,366	6,125,556.30	0.68
13	002253	川大智胜	186,196	6,081,161.36	0.67
14	002217	合力泰	387,597	5,577,520.83	0.62
15	300303	聚飞光电	547,645	5,104,051.40	0.57
16	002052	同洲电子	480,000	4,804,800.00	0.53
17	600682	南京新百	165,838	4,165,850.56	0.46
18	002373	千方科技	259,336	3,874,479.84	0.43
19	600519	贵州茅台	10,000	2,919,200.00	0.32
20	000858	五粮液	85,000	2,765,050.00	0.31

21	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.29
22	000538	云南白药	35,000	2,250,500.00	0.25
23	601318	中国平安	70,000	2,242,800.00	0.25
24	601169	北京银行	215,000	2,229,550.00	0.25
25	600276	恒瑞医药	54,000	2,165,940.00	0.24
26	000963	华东医药	32,000	2,156,800.00	0.24
27	000001	平安银行	246,000	2,140,200.00	0.24
28	600741	华域汽车	150,000	2,101,500.00	0.23
29	000625	长安汽车	139,000	1,900,130.00	0.21
30	601611	中国核建	25,916	542,162.72	0.06
31	002797	第一创业	10,985	443,903.85	0.05
32	300474	景嘉微	2,467	372,196.29	0.04
33	603528	多伦科技	3,112	304,944.88	0.03
34	002792	通宇通讯	4,621	276,335.80	0.03
35	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.03
36	002791	坚朗五金	3,973	213,628.21	0.02
37	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
38	603868	飞科电器	3,293	194,780.95	0.02
39	300511	雪榕生物	2,872	191,361.36	0.02
40	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.02
41	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.02
42	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.02
43	603779	威龙股份	2,809	117,865.64	0.01
44	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.01
45	603101	汇嘉时代	3,563	106,248.66	0.01
46	603798	康普顿	1,590	101,585.10	0.01
47	002795	永和智控	1,450	98,716.00	0.01
48	603028	赛福天	3,309	97,317.69	0.01
49	300506	名家汇	1,819	96,097.77	0.01
50	601966	玲珑轮胎	7,341	95,286.18	0.01

51	300510	金冠电气	1,365	92,219.40	0.01
52	002793	东音股份	1,413	91,859.13	0.01
53	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.01
54	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
55	603029	天鹅股份	1,618	72,211.34	0.01
56	603726	朗迪集团	1,361	68,798.55	0.01
57	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
58	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
59	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
60	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	—
61	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	—
62	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	—
63	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	—
64	300520	科大国创	926	9,306.30	—
65	002805	丰元股份	971	5,631.80	—

#### 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	000963	华东医药	2,120,963.00	0.25
2	000538	云南白药	2,102,553.00	0.25
3	601318	中国平安	2,088,716.65	0.25
4	000625	长安汽车	2,072,141.00	0.25
5	000858	五粮液	2,060,626.00	0.25
6	600741	华域汽车	2,059,126.12	0.25
7	000001	平安银行	2,036,737.00	0.24
8	600519	贵州茅台	2,020,687.44	0.24
9	600276	恒瑞医药	2,018,900.00	0.24
10	601169	北京银行	2,001,703.00	0.24

11	300508	维宏股份	208,490.64	0.02
12	002797	第一创业	116,880.40	0.01
13	601966	玲珑轮胎	95,286.18	0.01
14	601611	中国核建	89,928.52	0.01
15	002791	坚朗五金	85,697.61	0.01
16	002792	通宇通讯	70,678.14	0.01
17	603868	飞科电器	59,372.79	0.01
18	601127	小康股份	50,326.22	0.01
19	300511	雪榕生物	48,307.04	0.01
20	300512	中亚股份	39,164.43	—

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	21,942,000.22
卖出股票的收入（成交）总额	—

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	144,706,000.00	16.06
	其中：政策性金融债	144,706,000.00	16.06
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	60,279,000.00	6.69
6	中期票据	507,613,000.00	56.33
7	可转债	—	—

8	其他	—	—
9	合计	712,598,000.00	79.08

## 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	101469010	14丰台国资 MTN001	500,000	53,430,000.00	5.93
2	150209	15国开09	500,000	52,570,000.00	5.83
3	140208	14国开08	500,000	50,980,000.00	5.66
4	101461017	14神华 MTN002	400,000	42,084,000.00	4.67
5	101558037	15扬城建 MTN001	400,000	41,384,000.00	4.59

## 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

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

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 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。

## 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	5,172.60
2	应收证券清算款	61,375,811.80
3	应收股利	—
4	应收利息	9,536,887.94
5	应收申购款	4,861.70
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	70,922,734.04

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000833	贵糖股份	92,032,596.16	10.21	非公开发行股票
2	002663	普邦园林	30,456,537.80	3.38	非公开发行股票
3	600708	光明地产	15,310,214.63	1.70	非公开发行股票
4	601908	京运通	13,140,220.99	1.46	非公开发行股票
5	002407	多氟多	12,985,500.00	1.44	非公开发行股票
6	300256	星星科技	9,559,990.44	1.06	非公开发行股票
7	300102	乾照光电	8,361,667.05	0.93	非公开发行股票
8	300370	安控科技	7,747,890.00	0.86	非公开发行股票
9	002562	兄弟科技	7,064,299.71	0.78	非公开发行股票
10	300247	乐金健康	6,436,677.94	0.71	非公开发行股票

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §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
239	3,401,641.94	810,000,700.00	99.63%	2,991,722.58	0.37%



**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	28,321.34	0.0035%

**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

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2015年8月27日)基金份额总额	811,010,666.55
本报告期期初基金份额总额	810,988,981.68
本报告期基金总申购份额	2,584,265.25
减：本报告期基金总赎回份额	580,824.35
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	812,992,422.58

注：总申购份额含转换入份额。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，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) 基金管理人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，本基金基金管理人于2016年5月10日发布公告，经泓德基金管理有限公司董事会审议，聘任温永鹏先生为公司副总经理。

公司已根据相关法律法规要求，在指定媒体公开披露了公司人员的变更信息，并已在监管机构备案。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

**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**

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

**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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	20,582,153.21	100.00%	18,756.21	100.00%	—

国泰君安证券	2	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—

### 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比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
中信建投证券	1,403,970.50	100.00%	90,000,000	100.00%	—	—
国泰君安证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—

注：

#### 1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

#### 2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究部、投资部等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每季度对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租

用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

## 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	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金因指数熔断实施调整开放时间的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-04
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金因指数熔断实施调整开放时间的公告0107	公司官网、中国证券报	2016-01-07
3	泓德基金关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-08
4	泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告	公司官网、中国证券报	2016-01-21
5	关于泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金增加销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-28
6	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金最低赎回份额和最低保有份额限制的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-29
7	泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金增聘基金经理公告	公司官网、中国证券报	2016-02-03
8	关于旗下基金增加杭州数米基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-02-29
9	关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-03-01

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
10	关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-03-04
11	泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告	公司官网、中国证券报	2016-03-28
12	泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2016-03-28
13	关于旗下基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-14
14	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金调整申购费率结构的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-19
15	泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告	公司官网、中国证券报	2016-04-20
16	关于参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-21
17	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金通过直销柜台向养老金客户实施特定费率的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-27
18	关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-28
19	关于旗下部分基金在首创证券有限责任公司开通定投和转换业务的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
20	关于旗下基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通定投业务并参	公司官网、中国证券报	2016-05-16

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	与其费率优惠的公告		
21	关于旗下基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
22	关于旗下基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
23	关于旗下基金增加珠海盈米财富管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
24	泓德基金管理有限公司关于旗下基金在上海陆金所资产管理有限责任公司开通定投业务的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-12
25	关于旗下基金增加北京创金启富投资管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-25
26	关于旗下基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-25

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德泓业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

- 4、《泓德泓业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和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

## 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 11.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.hongdefund.com](http://www.hongdefund.com)

泓德基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日