

# 丰和价值证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 29 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 2017 年 3 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
8.6 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.....	48
8.7 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.....	48
8.8 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.....	48

8.9 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 .....	48
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	48
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
8.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	50
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	错误!未定义书签。
9.4 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 .....	错误!未定义书签。
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
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 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 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
场内简称	基金丰和
基金简称	嘉实丰和价值封闭
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）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	96,707,448.54	977,519,170.30	527,345,522.16
本期利润	-294,268,641.03	1,005,862,648.62	369,167,665.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0981	0.3353	0.1231
本期加权平均净值利润率	-8.82%	24.44%	11.56%
本期基金份额净值增长率	-6.91%	28.23%	11.53%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	64,160,748.28	978,520,918.15	340,001,747.85
期末可供分配基金份额利润	0.0214	0.3262	0.1133
期末基金资产净值	3,064,160,748.28	4,239,229,389.31	3,572,366,740.69
期末基金份额净值	1.0214	1.4131	1.1908
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	572.43%	622.31%	463.27%

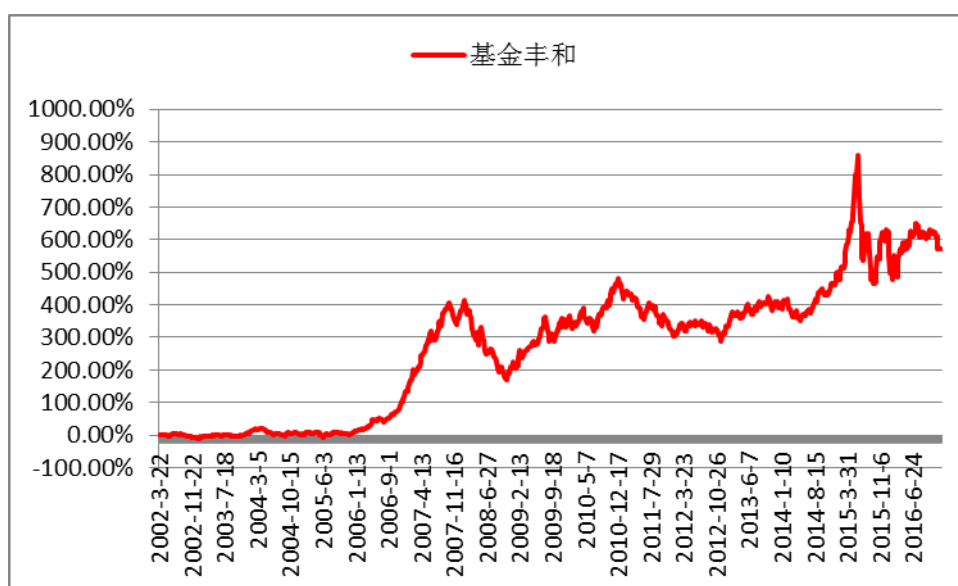
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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
过去三个月	-5.17%	1.81%				
过去六个月	-7.04%	1.96%				
过去一年	-6.91%	3.55%				
过去三年	33.14%	3.67%				
过去五年	60.96%	3.14%				
自基金合同生效起至今	572.43%	2.86%				

### 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

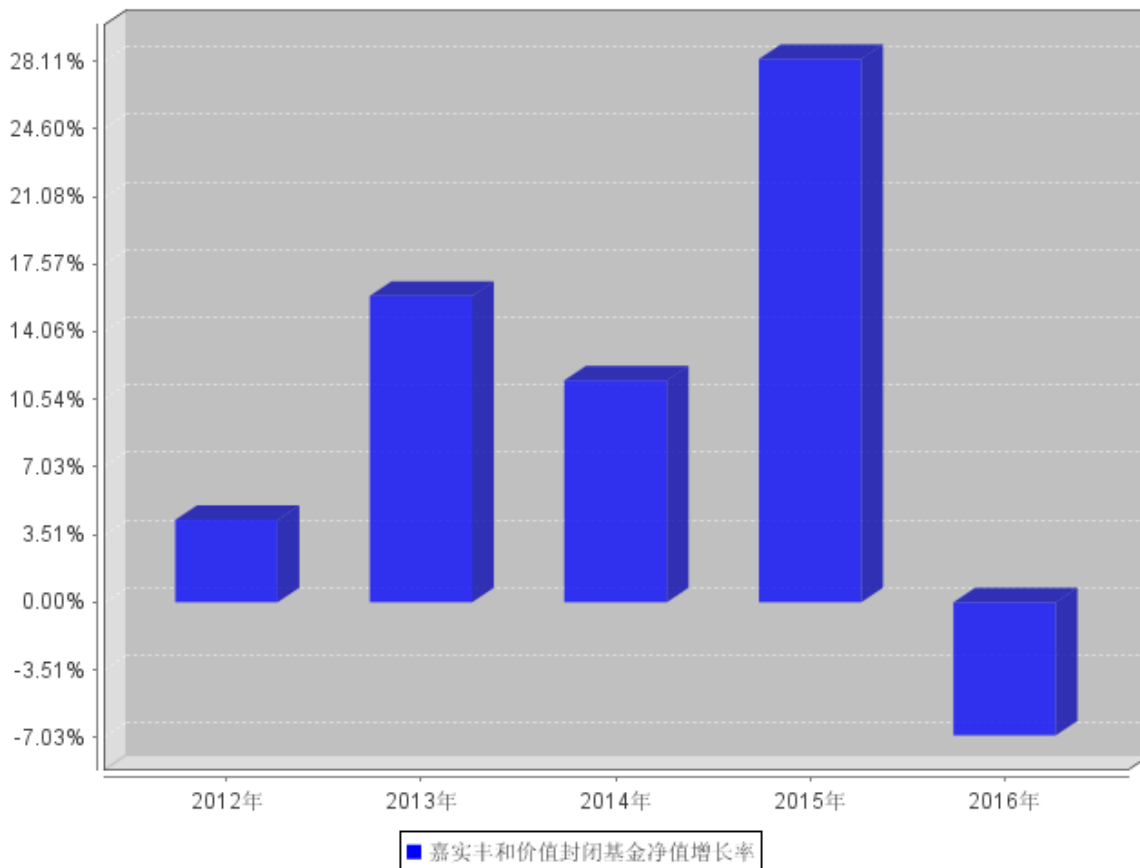
(2002年3月22日至2016年12月31日)

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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实丰和价值封闭过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2016	2.9360	880,800,000.00	-	880,800,000.00	
2015	1.1300	339,000,000.00	-	339,000,000.00	
2014	-	-	-	-	
合计	4.0660	1,219,800,000.00	-	1,219,800,000.00	

## § 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 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、111 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、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、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、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉

实丰安 6 个月定期债券。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	-	8 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遵规守信情况的说明

在报告期内，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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价

交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 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 6 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 年整体 A 股市场呈现前低后高的走势，年初受到人民币贬值等宏观因素冲击，市场出现了熔断式的下跌，后续在经济逐步企稳、人民币汇率逐步稳定、企业盈利复苏等利好因素的作用下，市场开始逐步反弹。全年来看，上证综指下跌 12.31%、沪深 300 指数下跌 11.28%、创业板指数下跌 27.71%、中小板指数下跌 22.89%。具体分板块来看，食品饮料、家电、银行、煤炭等行业排名靠前，国防军工、计算机、传媒等板块涨幅靠后。

在经历年初的大幅下跌之后，A 股市场在 2016 年 2 月底以后开始反弹主要的行情驱动力就两个：1、中央推动的宏观供给侧改革带来的传统周期性行业的投资机会，这方面以煤炭、钢铁、有色等板块为代表，尤其是焦煤等黑色产业链在 2016 年商品价格大幅上涨，企业的盈利在 2016 年下半年也出现了大幅的反弹；2、低利率环境叠加市场风险偏好的变化带来了稳定成长类行业的价值重估，这里以 PPP、建筑、白酒、家电行业为代表；过去这些行业由于盈利成长稳定，估值相

对新兴成长行业来说弹性不大，但是 2016 年在保险等追求绝对收益的市场边际增量资金驱动下，整体这些低估值的稳定成长行业出现了一定的估值修复。从去年的全年行情比较来看，周期板块整体行情波动幅度较大，银行、白酒、建筑等几个行业全年来看涨幅靠前。

本组合在 2016 年整体收益率为-6.91%，跑赢组合的业绩基准，在同类型的基金业绩当中排名靠前。在上半年组合整体应对较好，对稀土、OLED、黄金等板块进行了重点投资，获得较好的收益。但是对于下半年的稳定成长类股票的价值重估应对不当，前期研究的储备当中该类股票投资标的储备有限，错失了较多的投资机会。在整体 2016 年下半年集中对 PPP、食品饮料等板块进行了进行研究，储备了一些标的，希望后续能够抓住该类资产的投资机会。

#### 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 1.0214 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，宏观流动性层面可能出现的变化在于三点：1、随着国内金融去杠杆的政策推动，叠加 2017 年上半年宏观经济仍然在补库存的过程当中，国内基准利率面临上升的压力，整体金融市场会面临边际上央行收紧流动性的压力；2、国际上美国川普上任之后，美联储的加息节奏有可能加快，加上川普可能会推行制造业重回美国的政策，这些因素可能会导致美元升值压力较大；3、大宗商品经过前面 2-3 年的价格低迷期以后很多产品产能去化比较充分，可能会面临阶段性反弹压力，尤其是原油价格在 OPEC 减产的带动下可能会出现较大幅度上涨，这就会带来整体通胀压力的上升。这三个因素叠加起来都指向国内金融市场在 2017 年会面临比 2016 年更差的流动性格局，这会整体制约股票市场的行情延伸。在经济增长方面，2017 年上半年国内仍然处于补库存的阶段当中，宏观经济仍然会保持平稳，企业的盈利也会维持复苏的态势。同时目前的经济情况表明，众多行业都出现了份额向龙头企业集中的现象，这会有利于龙头企业的盈利回升。但是 2017 年下半年随着流动性的边际收紧，加上房地产调控政策逐步起效，经济可能会面临下行的压力，这时候需要观察财政刺激政策对冲的效果。

综合来看，我们认为 2017 年整体 A 股市场行情空间会比较有限，主要机会会出现在 2017 年上半年，下半年由于面临经济下滑压力同时流动性紧缩，下半年的市场风险较大，届时需要观察国家财政政策的对冲效果，进而判断相关行业是否具备投资机会。整天来看，由于 A 股市场较之其他金融市场在 2015 年已经去过杠杆，因此相对其他金融资产，A 股市场 2017 年具备更多的配置价值，整体市场还会有一定的结构性机会。我们判断 2017 年 A 股市场可能的投资机在于：1、经济补库存叠加宏观供给侧改革可能会带来部分周期股的投资机会。例如农业、钢铁等；2、随着

整体通胀压力的显现，部分抗通胀的行业会有重估机会。例如贵金属等板块；3、部分跌幅较大，估值已经较为合理的新兴成长行业的优质成长股；4、在美国收缩战略以后，中国的一带一路政策可能会带来相关投资机会。

基于上述的判断，本组合会采取很中性的仓位，积极应对 2017 年的变化，争取在农业、贵金属、钢铁、一带一路、消费类电子等行业寻找到优质投资标的。另外本组合在 2017 年面临封转开的流程，我们会在该过程当中平稳操作，力争给持有人带来更多的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，在投资范围、投资工具、运作规则等方面，重点关注防控风险。

(2) 合规管理：主要从事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续发起公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

(4) 法律事务：完成大量的日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续完善公司整体风险架构表，推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制，努力实现适当风险水平下的效益最大化。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项统计、专题报告。

#### 4.7 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但不限于上海、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。

#### 4.8 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“7.4.11 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-294,268,641.03 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。

#### 4.9 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 12 月 31 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 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20612 号

丰和价值证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的丰和价值证券投资基金(以下简称“嘉实丰和价值封闭基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 一、 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是嘉实丰和价值封闭基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；
- (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 二、 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 审计意见

我们认为，上述嘉实丰和价值封闭基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了嘉实丰和价值封闭基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

会计师事务所(特殊普通合伙)

中国 · 上海市

注册会计师

许 康 玮

张 勇

2017 年 3 月 22 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	243,588,987.59	94,730,027.23
结算备付金		8,973,632.02	14,155,777.99



存出保证金		1,598,319.84	7,930,231.39
交易性金融资产	7.4.7.2	2,820,274,543.27	4,087,598,687.55
其中：股票投资		2,189,198,543.27	3,190,649,687.55
基金投资		-	-
债券投资		631,076,000.00	896,949,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	33,416,156.20
应收利息	7.4.7.5	11,566,164.44	19,627,357.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,086,001,647.16	4,257,458,237.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,681,585.75	5,234,196.25
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,987,546.38	5,332,952.39
应付托管费		664,591.08	888,825.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,357,175.67	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	7.4.7.8	1,150,000.00	1,150,000.00
负债合计		21,840,898.88	18,228,848.23
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	64,160,748.28	1,239,229,389.31
所有者权益合计		3,064,160,748.28	4,239,229,389.31
负债和所有者权益总计		3,086,001,647.16	4,257,458,237.54

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0214 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-209,690,828.87	1,136,422,094.89
1.利息收入		27,830,629.22	36,007,746.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,532,075.70	1,833,658.42
债券利息收入		26,253,365.76	34,174,087.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		45,187.76	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		153,454,631.48	1,072,070,870.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	148,891,928.88	1,061,811,084.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-780,339.35	531,603.64
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,343,041.95	9,728,182.31
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	-390,976,089.57	28,343,478.32
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		84,577,812.16	130,559,446.27
1. 管理人报酬		50,041,905.51	61,508,952.47
2. 托管费		8,341,176.91	10,251,492.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	22,897,156.58	56,483,925.16
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	7.4.7.19	3,130,774.32	1,516,468.31
<b>三、利润总额</b>		-294,268,641.03	1,005,862,648.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-294,268,641.03	1,005,862,648.62

## 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	-294,268,641.03	-294,268,641.03
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	64,160,748.28	3,064,160,748.28
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	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）	-	1,005,862,648.62	1,005,862,648.62
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	1,239,229,389.31	4,239,229,389.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵学军</u>	<u>王红</u>	<u>常旭</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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%。

### 7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 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。

根据《丰和价值证券投资基金基金合同》的规定，本基金将于 2017 年 3 月 21 日到期。本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议对本基金实施转型，并于 2017 年 1 月 16 日召开基金份额持有人大会，表决通过了《关于丰和价值证券投资基金转型有关事项的议案》(附注 7.4.8.2)，丰和价值证券投资基金将由封闭式基

金转型为开放式基金，存续期调整为不定期。因此，本财务报表仍以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产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，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

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其他各类应收款项等。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。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债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，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 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和金融负债，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已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证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和金融负债，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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(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。

#### 7.4.4.6 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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息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后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用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则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

基金收益分配的比例不低于基金净收益的 90%。基金收益分配采用现金形式，每年至少分配一次。基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配。基金投资当年亏损，则不进行收益分配。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。



### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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[2004]78 号《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政策的补充通知》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，对国债、地方政府债以及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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

活期存款	243,588,987.59	94,730,027.23
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	243,588,987.59	94,730,027.23

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,320,950,391.68	2,189,198,543.27	-131,751,848.41	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	629,591,770.00	631,076,000.00	1,484,230.00
	合计	629,591,770.00	631,076,000.00	1,484,230.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,950,542,161.68	2,820,274,543.27	-130,267,618.41	
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,942,303,237.04	3,190,649,687.55	248,346,450.51	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	884,586,979.35	896,949,000.00	12,362,020.65
	合计	884,586,979.35	896,949,000.00	12,362,020.65
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,826,890,216.39	4,087,598,687.55	260,708,471.16	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	48,446.94	21,267.65
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	4,038.10	6,370.10
应收债券利息	11,512,960.20	19,596,150.83
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	719.20	3,568.60
合计	11,566,164.44	19,627,357.18

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,354,241.17	5,621,474.21
银行间市场应付交易费用	2,934.50	1,400.00
合计	3,357,175.67	5,622,874.21

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	750,000.00
应付赎回费	-	-
预提费用	400,000.00	400,000.00
应付指数使用费	-	-
其他	-	-
合计	1,150,000.00	1,150,000.00

## 7.4.7.9 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 12 月 31 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

## 7.4.7.10 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	96,707,448.54	-390,976,089.57	-294,268,641.03
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	194,428,366.69	-130,267,618.41	64,160,748.28

## 7.4.7.11 存款利息收入

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 12 月	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31

	31 日	日
活期存款利息收入	1,359,547.10	1,489,223.61
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	122,228.01	285,765.25
其他	50,300.59	58,669.56
合计	1,532,075.70	1,833,658.42

#### 7.4.7.12 股票投资收益

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	9,117,368,902.01	21,816,514,663.43
减：卖出股票成本总额	8,968,476,973.13	20,754,703,579.02
买卖股票差价收入	148,891,928.88	1,061,811,084.41

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,057,203,039.75	1,094,977,718.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,026,281,559.35	1,060,108,636.36
减：应收利息总额	31,701,819.75	34,337,478.70
买卖债券差价收入	-780,339.35	531,603.64

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本期（2016年1月1日至2016年12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,343,041.95	9,728,182.31
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,343,041.95	9,728,182.31

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-390,976,089.57	28,343,478.32
——股票投资	-380,098,298.92	19,712,211.96
——债券投资	-10,877,790.65	8,631,266.36
——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	-390,976,089.57	28,343,478.32

#### 7.4.7.17 其他收入

本期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金无其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	22,891,906.58	56,473,775.16
银行间市场交易费用	5,250.00	10,150.00
合计	22,897,156.58	56,483,925.16

### 7.4.7.19 其他费用

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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券托管账户维护费	36,000.00	34,500.00
银行划款手续费	4,386.32	8,603.31
指数使用费	-	-
上市年费	60,000.00	60,000.00
红利手续费	2,629,188.00	1,011,915.00
其他	1,200.00	1,450.00
合计	3,130,774.32	1,516,468.31

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

1、财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

上述通知是对财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)的补充，该通知要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

2、根据本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司于 2016 年 12 月 7 日发布的《嘉实基金管理有限公司关于召开丰和价值证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，本基金将于 2017 年 3 月 21 日到期，为消除基金到期及折价的影响，维护基金份额持有人利益，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》、《丰和价值证券投资基金基金合同》

等有关规定，嘉实基金管理有限公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议关于本基金转型的相关事宜。根据嘉实基金管理有限公司于 2017 年 1 月 17 日发布的《嘉实基金管理有限公司关于丰和价值证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2017 年 1 月 16 日表决通过了《关于丰和价值证券投资基金转型有关事项的议案》。

3、根据本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司于 2017 年 3 月 15 日发布的《丰和价值证券投资基金终止上市公告》，嘉实基金管理有限公司根据转型安排向深圳证券交易所申请终止丰和价值证券投资基金的上市交易，并获得深圳证券交易所（《终止上市通知书》深证上[2017]168 号）同意。终止上市日为 2017 年 3 月 20 日，终止上市的权益登记日为 2017 年 3 月 17 日，即在 2017 年 3 月 17 日下午深圳证券交易所交易结束后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人享有终止上市后的相关权利。自 2017 年 3 月 20 日起，本基金名称变更为嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金，由《丰和价值证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《丰和价值证券投资基金基金合同》失效，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》为准。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金发起人、基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
吉林省信托投资有限责任公司	基金发起人
广发证券股份有限公司	基金发起人
北京证券有限责任公司	基金发起人

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。



## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	50,041,905.51	61,508,952.47
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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,341,176.91	10,251,492.11

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。

## 7.4.10.3 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 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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。

## 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

### 7.4.10.4.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
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	0.40%	0.40%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注 1：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。

注 2：本报告期内（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

#### 7.4.10.4.2 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 12 月 31 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 份有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%

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过户手续。

（3）中诚信托有限责任公司于 2014 年通过二级市场卖出本基金基金份额 3,000,000 份，交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

#### 7.4.10.5 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	243,588,987.59	1,359,547.10	94,730,027.23	1,489,223.61

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。

#### 7.4.10.6 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12月31日）及上年度可比期间（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.11 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	

#### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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
300047	天源迪科	2016年8月15日	重大事项停牌	18.36	2017年1月6日	19.00	6,361,166	127,694,899.38	116,791,007.76	-
002462	嘉事堂	2016年9月28日	重大事项停牌	43.68	2017年1月12日	38.98	1,878,776	75,405,270.37	82,064,935.68	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2016 年 12 月 31 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2016 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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 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。

#### 7.4.13.2 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)。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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约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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	243,588,987.59	-	-	-	243,588,987.59
结算备付金	8,973,632.02	-	-	-	8,973,632.02
存出保证金	1,598,319.84	-	-	-	1,598,319.84
交易性金融资产	538,754,000.00	92,322,000.00	-	2,189,198,543.27	2,820,274,543.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	11,566,164.44	11,566,164.44
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	792,914,939.45	92,322,000.00	-	2,200,764,707.71	3,086,001,647.16
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	-	-	-	12,681,585.75	12,681,585.75
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,987,546.38	3,987,546.38
应付托管费	-	-	-	664,591.08	664,591.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,357,175.67	3,357,175.67
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	-	-	-	21,840,898.88	21,840,898.88
利率敏感度缺口	792,914,939.45	92,322,000.00	-	2,178,923,808.83	3,064,160,748.28
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	852,370.02	3,246,218.45
	市场利率上升 25 个基点	-846,269.77	-3,206,892.03

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	2,189,198,543.27	71.45	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	2,189,198,543.27	71.45	3,190,649,687.55	75.26

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	155,510,343.49	163,221,099.90
沪深 300 指数下降 5%	-155,510,343.49	-163,221,099.90	

#### 7.4.13.4.4 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。

#### 7.4.14 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 1,990,342,599.83 元，属于第二层次的余额为 829,931,943.44 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	2,189,198,543.27	70.94
	其中：股票	2,189,198,543.27	70.94
2	固定收益投资	631,076,000.00	20.45
	其中：债券	631,076,000.00	20.45
	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	252,562,619.61	8.18
7	其他各项资产	13,164,484.28	0.43
8	合计	3,086,001,647.16	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,331,507.49	0.66
C	制造业	1,465,892,916.58	47.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,379,465.00	0.50
F	批发和零售业	82,064,935.68	2.68
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	414,303,764.42	13.52
J	金融业	1,614,001.00	0.05
K	房地产业	22,775,428.00	0.74
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	64,148,115.79	2.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	102,688,409.31	3.35
S	综合	-	-
	合计	2,189,198,543.27	71.45

### 8.3 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	000639	西王食品	6,347,181	154,046,082.87	5.03
2	600110	诺德股份	12,050,391	128,457,168.06	4.19
3	300047	天源迪科	6,361,166	116,791,007.76	3.81
4	300033	同花顺	1,665,100	114,525,578.00	3.74
5	002343	慈文传媒	2,244,543	101,386,007.31	3.31
6	002192	融捷股份	4,490,943	98,261,832.84	3.21
7	300232	洲明科技	6,560,120	97,876,990.40	3.19
8	002425	凯撒文化	4,236,252	96,374,733.00	3.15
9	000930	中粮生化	6,407,400	86,115,456.00	2.81
10	002462	嘉事堂	1,878,776	82,064,935.68	2.68
11	300025	华星创业	6,736,100	74,097,100.00	2.42
12	300444	双杰电气	3,071,547	73,717,128.00	2.41
13	300346	南大光电	2,310,780	70,340,143.20	2.30
14	600661	新南洋	2,256,353	64,148,115.79	2.09
15	300188	美亚柏科	2,958,900	63,290,871.00	2.07
16	600737	中粮屯河	5,046,900	62,884,374.00	2.05
17	601388	怡球资源	16,315,900	62,489,897.00	2.04
18	300203	聚光科技	2,013,833	61,522,598.15	2.01
19	300078	思创医惠	2,298,914	59,564,861.74	1.94
20	002074	国轩高科	1,911,300	59,231,187.00	1.93
21	002470	金正大	7,408,000	58,523,200.00	1.91
22	002637	赞宇科技	4,020,138	56,482,938.90	1.84
23	002313	日海通讯	2,157,300	50,265,090.00	1.64

24	002643	万润股份	1,330,500	48,297,150.00	1.58
25	002008	大族激光	2,055,400	46,452,040.00	1.52
26	300359	全通教育	2,304,154	45,599,207.66	1.49
27	000778	新兴铸管	6,947,200	35,917,024.00	1.17
28	000911	南宁糖业	1,786,462	31,995,534.42	1.04
29	000505	*ST 珠江	1,904,300	22,775,428.00	0.74
30	600259	广晟有色	478,501	20,331,507.49	0.66
31	000606	*ST 易桥	1,461,700	16,634,146.00	0.54
32	600068	葛洲坝	1,673,500	15,379,465.00	0.50
33	000651	格力电器	318,100	7,831,622.00	0.26
34	600019	宝钢股份	341,000	2,165,350.00	0.07
35	000504	*ST 生物	78,600	1,302,402.00	0.04
36	600005	武钢股份	130,900	446,369.00	0.01
37	601939	建设银行	78,300	425,952.00	0.01
38	601818	光大银行	104,700	409,377.00	0.01
39	601328	交通银行	68,000	392,360.00	0.01
40	601988	中国银行	112,300	386,312.00	0.01

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%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	600259	广晟有色	187,808,635.13	4.43
2	300033	同花顺	181,593,312.59	4.28
3	600110	诺德股份	157,551,806.89	3.72
4	000639	西王食品	149,910,613.02	3.54
5	000795	英洛华	135,302,984.08	3.19
6	000969	安泰科技	132,166,622.29	3.12
7	600338	西藏珠峰	124,262,447.54	2.93
8	600418	江淮汽车	123,551,692.94	2.91
9	300359	全通教育	122,766,200.02	2.90
10	000060	中金岭南	121,591,292.52	2.87
11	002155	湖南黄金	115,651,984.01	2.73
12	600050	中国联通	107,113,154.06	2.53
13	000709	河钢股份	102,076,649.38	2.41

14	002245	澳洋顺昌	98,663,727.38	2.33
15	002343	慈文传媒	95,728,846.43	2.26
16	002192	融捷股份	95,204,574.27	2.25
17	600682	南京新百	93,955,056.30	2.22
18	600782	新钢股份	91,976,378.35	2.17
19	300346	南大光电	90,599,612.02	2.14
20	000930	中粮生化	88,584,536.77	2.09
21	002746	仙坛股份	88,200,059.70	2.08
22	300444	双杰电气	87,841,093.51	2.07
23	600328	兰太实业	87,815,022.02	2.07
24	300034	钢研高纳	87,459,027.77	2.06
25	600988	赤峰黄金	85,686,068.32	2.02
26	002299	圣农发展	85,075,188.83	2.01

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%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	600259	广晟有色	251,840,440.44	5.94
2	600988	赤峰黄金	208,470,421.25	4.92
3	601388	怡球资源	192,066,956.45	4.53
4	002299	圣农发展	168,064,170.01	3.96
5	600338	西藏珠峰	165,030,707.76	3.89
6	002446	盛路通信	161,022,135.11	3.80
7	000969	安泰科技	158,026,493.55	3.73
8	000795	英洛华	157,395,216.26	3.71
9	300327	中颖电子	151,583,357.54	3.58
10	000060	中金岭南	149,415,111.14	3.52
11	002155	湖南黄金	148,783,405.96	3.51
12	000911	南宁糖业	139,570,376.34	3.29
13	002192	融捷股份	123,800,722.00	2.92
14	600418	江淮汽车	115,467,028.96	2.72
15	300006	莱美药业	114,510,918.89	2.70
16	002308	威创股份	113,845,761.12	2.69
17	002746	仙坛股份	113,593,653.24	2.68
18	600050	中国联通	110,422,563.81	2.60

19	002714	牧原股份	103,181,697.82	2.43
20	300034	钢研高纳	102,710,723.98	2.42
21	000807	云铝股份	101,030,463.35	2.38
22	000937	冀中能源	98,577,319.41	2.33
23	600654	中安消	98,481,721.65	2.32
24	002477	雏鹰农牧	96,952,237.92	2.29
25	000952	广济药业	93,412,928.61	2.20
26	002070	众和股份	92,051,760.42	2.17
27	002120	新海股份	91,374,330.63	2.16
28	600328	兰太实业	89,265,267.76	2.11
29	600682	南京新百	87,804,909.89	2.07
30	002245	澳洋顺昌	87,107,373.30	2.05
31	601699	潞安环能	86,165,057.17	2.03
32	600782	新钢股份	86,010,852.73	2.03
33	300197	铁汉生态	85,061,192.45	2.01

#### 8.4.3 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	8,347,124,127.77
卖出股票收入（成交）总额	9,117,368,902.01

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

#### 8.5 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	100,786,000.00	3.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	530,290,000.00	17.31
	其中：政策性金融债	530,290,000.00	17.31
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	-	-
10	合计	631,076,000.00	20.60

**8.6 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	230,000,000.00	7.51
2	160414	16 农发 14	1,400,000	139,790,000.00	4.56
3	160209	16 国开 09	700,000	69,930,000.00	2.28
4	169956	16 贴现国债 56	600,000	59,214,000.00	1.93
5	110411	11 农发 11	500,000	50,750,000.00	1.66

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 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。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

(1) 根据 2016 年 11 月 28 日《浙江核新同花顺网络信息股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会〈行政处罚决定书〉的公告》，证监会决定没收公司违法所得 2,176,997.22 元，并处以 6,530,991.66 元罚款。

本基金投资于“同花顺（300033）”的决策程序说明：基于对同花顺基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“同花顺”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	1,598,319.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,566,164.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,164,484.28

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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	300047	天源迪科	116,791,007.76	3.81	重大事项停牌
2	002462	嘉事堂	82,064,935.68	2.68	重大事项停牌

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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

21,866	137,199.30	1,819,700,771.00	60.66%	1,180,299,229.00	39.34%
--------	------------	------------------	--------	------------------	--------

## 9.2 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—分红—个人分红-019L-FH002 深	356,089,721.00	11.87%
2	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	159,765,359.00	5.33%
3	中国人寿保险股份有限公司	89,557,562.00	2.99%
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	64,445,804.00	2.15%
7	泰康人寿保险股份有限公司—万能—个险万能	63,584,462.00	2.12%
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	中国人寿资产管理有限公司	54,662,165.00	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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

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。

### 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

报告期内本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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 100,000.00 元，该审计机构已连续 15 年为本基金提供审计服务。

#### 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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 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	
中国银河证券股份有限公司		27,151,791,810.78	40.95%	5,006,286.74	40.95%	-
申万宏源集团股份有限公司		24,415,099,124.61	25.28%	3,090,600.80	25.28%	-
国信证券股份有限公司		11,988,293,831.18	11.38%	1,391,819.32	11.38%	-
中银国际证券有限责任公司		11,442,058,979.86	8.26%	1,009,441.29	8.26%	-
光大证券股份有限公司		11,257,716,657.96	7.20%	880,413.88	7.20%	-
华泰证券股份有限公司		11,209,532,625.39	6.93%	846,672.83	6.93%	-
安信证券股份有限公司	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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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。国都证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

## 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	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
2	关于召开丰和价值证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 12 月 7 日
3	关于丰和价值证券投资基金基金份额持有人大会停牌的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 12 月 15 日
4	关于召开丰和价值证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、	2016 年 12 月 30 日

		管理人网站	
--	--	-------	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

2017 年 1 月 16 日本基金以现场方式召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于丰和价值证券投资基金转型有关事项的议案》，权益登记日为 2016 年 12 月 14 日。2017 年 1 月 17 日，本基金管理人发布《关于丰和价值证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，该决议自 2017 年 1 月 16 日起生效。依据中国证监会 2016 年 11 月 24 日《关于准予嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2016]2830 号）及上述基金份额持有人大会决议，丰和价值证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“嘉实丰和灵活配置混合证券投资基金”。自 2017 年 3 月 20 日起，由《丰和价值证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《丰和价值证券投资基金基金合同》同日失效。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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

### 12.3 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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2017 年 3 月 29 日