

# 华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 华富国泰民安灵活配置混合    |
| 基金主代码      | 000767          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2015年2月4日       |
| 基金管理人      | 华富基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 上海浦东发展银行股份有限公司  |
| 报告期末基金份额总额 | 185,040,384.25份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金将从与国泰民安主题相关的证券中精选优质标的进行投资，分享我国国泰民安领域未来发展的红利，力求取得超额收益。   |
| 投资策略   | 本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及国泰民安相关行业的发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人            | 基金托管人              |
|---------|------|------------------|--------------------|
| 名称      |      | 华富基金管理有限公司       | 上海浦东发展银行股份有限公司     |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 满志弘              | 朱萍                 |
|         | 联系电话 | 021-68886996     | 021-61618888       |
|         | 电子邮箱 | manzh@hffund.com | zhup02@spdb.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-700-8001     | 95528              |
| 传真      |      | 021-68887997     | 021-63602540       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                       |
|---------------------|-----------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.hffund.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人的办公场所      |

## § 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 2 月 4 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 | 2014 年  |
|---------------|----------------|--|---------|
| 本期已实现收益       | 3,626,447.28   | 154,465,707.40                           | -       |
| 本期利润          | 3,258,607.80   | 153,639,965.67                           | -       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0156         | 0.3561                                   | -       |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.35%          | -4.00%                                   | -       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末        | 2015 年末                                  | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0267        | -0.0405                                  | -       |
| 期末基金资产净值      | 180,092,020.69 | 221,749,692.46                           | -       |
| 期末基金份额净值      | 0.973          | 0.960                                    | -       |

注：1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2) 以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

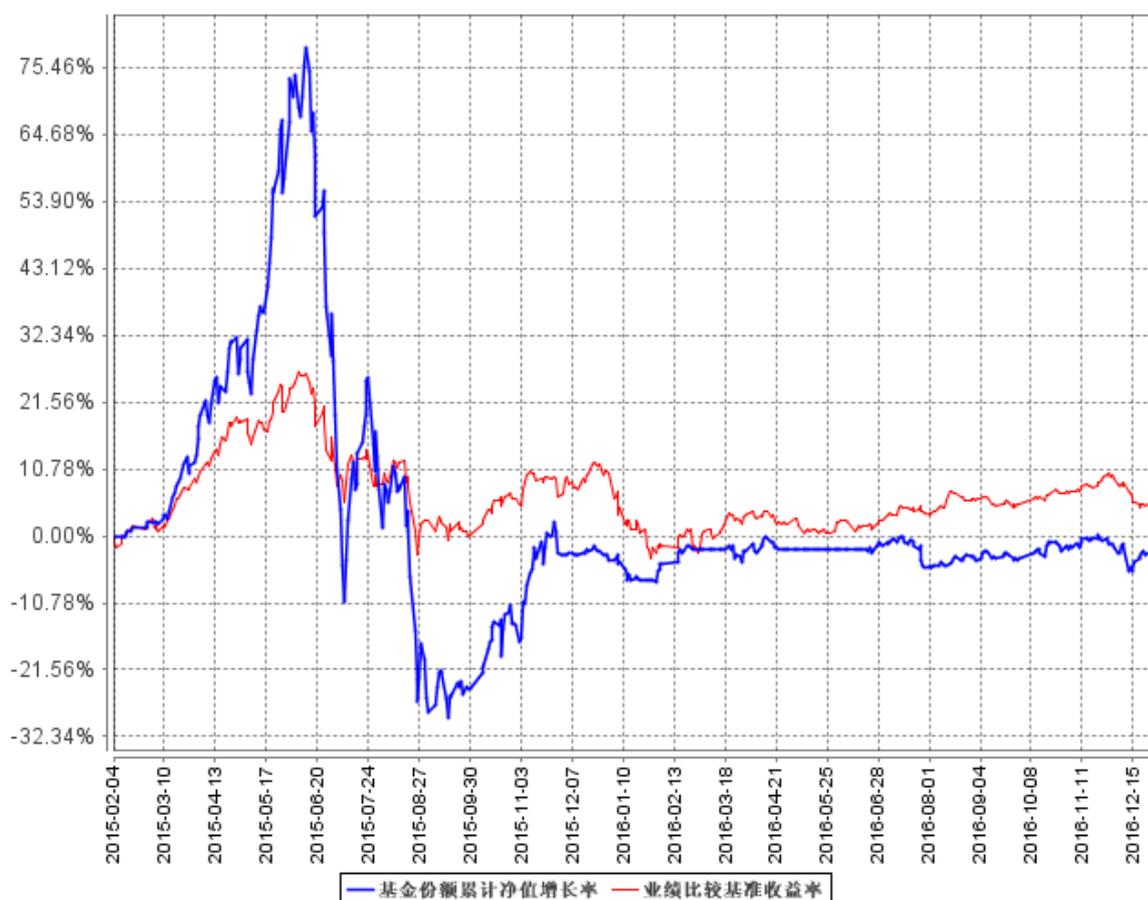
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.83%    | 0.75%       | 0.00%      | 0.39%         | 0.83% | 0.36% |

|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月      | -1.42% | 0.63% | 2.72%  | 0.40% | -4.14% | 0.23%  |
| 过去一年       | 1.35%  | 0.59% | -4.29% | 0.71% | 5.64%  | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.70% | 2.24% | 5.24%  | 1.00% | -7.94% | 1.24%  |

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

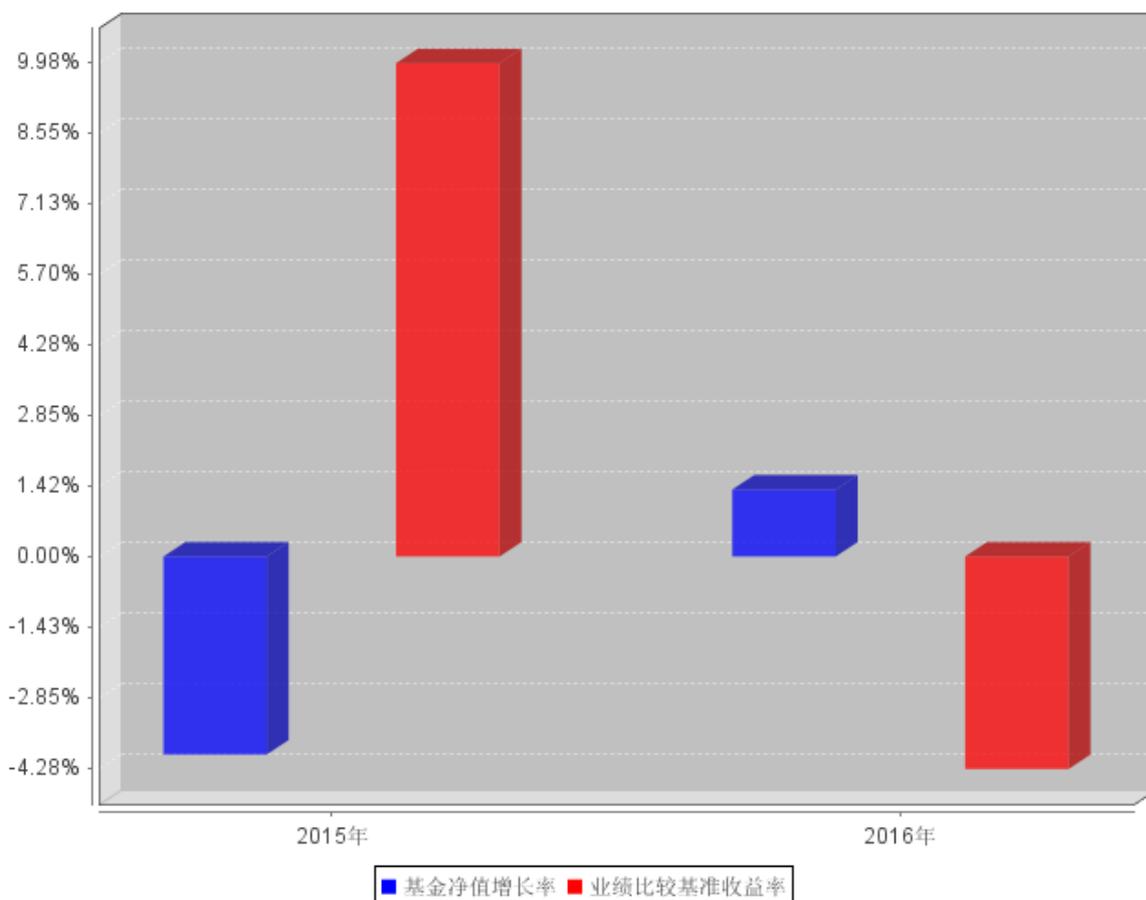
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%，投资于本合同界定的国泰民安相关证券不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。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。本基金建仓期为 2015 年 2 月 4 日到 2015 年 8 月 4 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 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<br>分红数 | 现金形式发<br>放总额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计 | 备注 |
|----|-----------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 合计 | -               | -            | -             | -            |    |

注：本基金未进行利润分配

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字 [2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立，注册资本 2 亿元，公司股东为华安证券股份有限

公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富分级债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富旺财保本混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享保本混合型证券投资基金、华富安福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金共三十只基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---|-----------------|------|--------|--|
|    |   | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 龚炜 | 华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、华富成长趋势混合型基金基金经理、公司 | 2015年2月4日       | -    | 十二年    | 安徽财经大学金融学硕士，研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监，2012年9月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公 |

|     |  |            |   |     |  |
|-----|--|------------|---|-----|--|
|     | 公募投资决策委员会主席、公司副总经理   |            |   |     | 司总经理助理，2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。   |
| 刘文正 | 华富国泰民安灵活配置混合型基金经理，华富智慧城市灵活配置混合型基金经理、公司公募投资决策委员会成员、基金投资部副总监 | 2015年2月4日  | - | 十二年 | 工商管理硕士，研究生学历。历任天治基金管理有限公司系统管理员、行业研究员，2010年9月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部行业研究员、华富竞争力优选混合型基金经理助理，研究发展部总监助理。2013年6月7日至2015年5月27日任华富策略精选混合型基金经理。 |
| 张亮  | 华富国泰民安灵活配置混合型基金经理  | 2015年2月27日 | - | 六年  | 上海交通大学材料加工工程学硕士，研究生学历。曾任天治基金管理有限公司行业研究员，2013年7月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究发展部行业研究员、华富竞争力优选混合型基金经理助理。   |

注：龚炜、刘文正的任职日期指该基金成立之日，张亮的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部

纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年全年沪深 300 指数累计下跌 11.28%，上证综指下跌 12.31%，深证成指下跌 19.64%，创业板指下跌 27.71%，市场在经历了一季度的大幅下跌，二季度的小幅反弹之后，呈现严重分化的局面，上证震荡向上，深成指和创业板震荡向下，尤其是创业板，下半年表现尤其差。下半年以上证为代表的蓝筹在险资举牌，一路一带等带领下，取得较明显上涨，而中小创则处于持续挤泡沫过程。

本基金组合年初控制仓位，有效的避免了熔断的风险，之后的操作结构总体均衡，配置中传统周期性行业和新兴产业整体均衡，重点关注处于行业周期性拐点的行业，以及行业仍处于上升期，且估值相对合理的标的。熔断之后指数处于窄幅震荡的状态，主要的机会来自于自下而上的行业和个股的选择，本基金基于自下而上和自上而下的角度对部分结构性的机会进行了把握，并取得了正的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2015 年 2 月 4 日正式成立。截止 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.973 元，累计份额净值为 0.973 元。报告期，本基金份额净值增长率为 1.35%，同期业绩比较基准收益率为 -4.29%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于地产的持续向好，宏观经济在四季度继续反弹，大宗商品强势上涨，ppi 进入持续扩张区间，经济的向好局面可能持续到 17 年 2 季度。但人民币走出截然不同的走势，基于对经济的悲观预期和美元的不断强势，人民币在四季度延续跌势，并且阶段的跌幅不小，在一定程度上影响

市场的预期。

展望 2017 年，基本面临着较大的不确定性。国内基本面最大的不确定因素在于由于房地产投资增速的大概率下行对整体经济增速的影响，经济基本面将更大程度上依赖财政政策托底。国际方面最大的不确定性在于特朗普执政后的政策推行效果以及美国经济能否继续保持复苏态势。海外经济的复苏态势将很大程度上影响国内人民币将面临的贬值和输入性通胀压力，进而影响央行货币政策。此外，要密切关注美联储的加息进程和英国的脱欧进程，美联储年底如期加息，并且对 17 年加息做了正面展望，英国将正式开始脱欧进程，届时会对世界经济和资本市场产生巨大影响。权益方面，市场近期或将继续震荡，延续前期的结构行情，指数波动空间或许有限，但结构性的热点有望层出不穷，自年初开始大跌以来，市场经历了一季度的大幅下跌，二、三、四季度进入分化窄幅震荡，部分景气度较高的行业和个股自 2 月份以来，经历了大幅上涨，但同时大量股票跌幅较大，四季度总体上市场仍然是结构性行情，指数波动空间或许有限，但结构性的热点有望层出不穷。对于 17 年一季度，对市场预期偏乐观，我们下一阶段的布局将围绕以下几个方面来进行：一、股价处于周期底部、受益于供给侧改革的传统行业标的。二、部分质地优良，估值相对合理的新型成长标的。三、部分出现了拐点的符合消费升级大方向消费股。四、细分领域处于景气周期上升期且估值相对合理的标的。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、加强内部控制制度建设，完善内部控制环境。2016 年，为构建和完善员工常规管理的制度框架，促进公司各项工作有序运作，对《员工手册》进行了修订；为规范公司旗下基金产品投资中小企业私募债的行为，制定了《中小企业私募债投资管理办法》；为规范公司参与股指期货交易的行为，明确股指期货交易的投资决策流程和风险控制措施，制定了《股指期货投资管理办法》；为更好地规范投资决策流程、有效控制交易风险，制定了《国债期货投资管理办法》；为更好地规范费用报销流程、合理控制经营成本，对《费用报销管理办法》进行了修订。进一步健全和完善了公司制度体系建设。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所（特殊普通合伙）进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 3,258,607.80 元，期末可供分配利润为 -4,948,363.56。本报告期内未进行利润分配。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

-

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

|            |         |
|------------|---------|
| 财务报表是否经过审计 | 是       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见 |

|        |                 |
|--------|-----------------|
| 审计报告编号 | 天健审（2017）6-68 号 |
|--------|-----------------|

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告  |    |
|--------------|---|----|
| 审计报告收件人      | 华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金全体持有人  |    |
| 引言段          | 我们审计了后附的华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华富国泰民安灵活配置混合基金”）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。   |    |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是华富国泰民安灵活配置混合基金的基金管理人华富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。  |    |
| 注册会计师的责任段    | <p>我们的责任是在实施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职业道德规范，计划和实施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。</p> <p>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，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，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做出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p> |    |
| 审计意见段        | 我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了华富国泰民安灵活配置混合基金 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。  |    |
| 注册会计师的姓名     | 曹小勤   | 林晶 |
| 会计师事务所的名称    | 天健会计师事务所（特殊普通合伙）  |    |
| 会计师事务所的地址    | 浙江省杭州市钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 层   |    |
| 审计报告日期       | 2017 年 3 月 20 日   |    |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金

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<br>2016 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            |            | 60,130,227.93                   | 208,908,486.69                   |
| 结算备付金           |            | 384,052.65                      | 1,167,739.24                     |
| 存出保证金           |            | 211,407.14                      | 707,946.48                       |
| 交易性金融资产         |            | 120,322,779.83                  | 6,033,492.92                     |
| 其中：股票投资         |            | 120,322,779.83                  | 6,033,492.92                     |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          |            | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        |            | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | 6,975,200.03                     |
| 应收利息            |            | 27,993.63                       | 91,369.10                        |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,198.20                        | 32,905.32                        |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            |            | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 181,077,659.38                  | 223,917,139.78                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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          |            | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 65,617.11                       | 618,778.93                       |
| 应付管理人报酬         |            | 231,585.52                      | 293,130.87                       |
| 应付托管费           |            | 38,597.59                       | 48,855.13                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          |            | 159,722.48                      | 805,260.46                       |

|               |  |                |                |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 应交税费          |  | -              | -              |
| 应付利息          |  | -              | -              |
| 应付利润          |  | -              | -              |
| 递延所得税负债       |  | -              | -              |
| 其他负债          |  | 490,115.99     | 401,421.93     |
| 负债合计          |  | 985,638.69     | 2,167,447.32   |
| <b>所有者权益：</b> |  |                |                |
| 实收基金          |  | 185,040,384.25 | 231,104,549.04 |
| 未分配利润         |  | -4,948,363.56  | -9,354,856.58  |
| 所有者权益合计       |  | 180,092,020.69 | 221,749,692.46 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 181,077,659.38 | 223,917,139.78 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.973 元，基金份额总额 185,040,384.25 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华富国泰民安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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日(基<br>金合同生效日)至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------------------|-----|---|---|
| <b>一、收入</b>            |     | 9,037,945.78                              | 169,045,957.50  |
| 1. 利息收入                |     | 2,458,088.43                              | 3,024,055.34  |
| 其中：存款利息收入              |     | 2,426,610.99                              | 2,686,990.59  |
| 债券利息收入                 |     | 421.26                                    | -   |
| 资产支持证券利息收入             |     | -   | -   |
| 买入返售金融资产收入             |     | 31,056.18                                 | 337,064.75  |
| 其他利息收入                 |     | -   | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |     | 6,852,906.32                              | 160,726,986.57  |
| 其中：股票投资收益              |     | 6,700,968.11                              | 159,320,585.89  |
| 基金投资收益                 |     | -   | -   |
| 债券投资收益                 |     | 63,965.32                                 | -   |
| 资产支持证券投资收益             |     | -   | -   |
| 贵金属投资收益                |     | -   | -   |
| 衍生工具收益                 |     | -   | -   |
| 股利收益                   |     | 87,972.89                                 | 1,406,400.68  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |     | -367,839.48                               | -825,741.73   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |     | -   | -   |

|                            |           |              |                |
|----------------------------|-----------|--------------|----------------|
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         |           | 94,790.51    | 6,120,657.32   |
| <b>减：二、费用</b>              |           | 5,779,337.98 | 15,405,991.83  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.8.2.1 | 3,051,647.37 | 6,569,844.12   |
| 2. 托管费                     | 7.4.8.2.2 | 508,607.93   | 1,094,973.96   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.8.2.3 | -            | -              |
| 4. 交易费用                    |           | 1,807,538.77 | 7,318,573.98   |
| 5. 利息支出                    |           | -            | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | -            | -              |
| 6. 其他费用                    |           | 411,543.91   | 422,599.77     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | 3,258,607.80 | 153,639,965.67 |
| 减：所得税费用                    |           | -            | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | 3,258,607.80 | 153,639,965.67 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富国泰民安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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 231,104,549.04                         | -9,354,856.58 | 221,749,692.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                      | 3,258,607.80  | 3,258,607.80   |
| 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）      | -46,064,164.79                         | 1,147,885.22  | -44,916,279.57 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 15,444,217.55                          | -619,978.20   | 14,824,239.35  |
| 2. 基金赎回款                               | -61,508,382.34                         | 1,767,863.42  | -59,740,518.92 |
| 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）                        | 185,040,384.25                         | -4,948,363.56 | 180,092,020.69 |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日(基金合同生效日)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）                        | 1,073,507,334.60                                     | -               | 1,073,507,334.60  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -  | 153,639,965.67  | 153,639,965.67    |
| 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）      | -842,402,785.56                                      | -162,994,822.25 | -1,005,397,607.81 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 387,819,061.86                                       | 103,141,424.21  | 490,960,486.07    |
| 2. 基金赎回款                               | -1,230,221,847.42                                    | -266,136,246.46 | -1,496,358,093.88 |
| 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）                        | 231,104,549.04                                       | -9,354,856.58   | 221,749,692.46    |

注：本基金合同于 2015 年 2 月 4 日生效，上年度可比期间为 2015 年 2 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日。报表附注为财务报表的组成部分。

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>章宏韬</u> | <u>余海春</u> | <u>陈大毅</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

华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）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[2014]793号）核准，基金合同于 2015 年 2 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2015）6-14 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为

具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的规定）。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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### 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，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本报告期本基金会计政策无变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

#### 7.4.6 税项

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

（一）2016年5月1日前，发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收营业税。

(二) 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(三) 对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

(四) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称              | 与本基金的关系              |
|--------------------|----------------------|
| 华富基金管理有限公司         | 基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司     | 基金托管人、代销机构           |
| 华安证券股份有限公司（“华安证券”） | 基金管理人的股东、代销机构        |
| 安徽省信用担保集团有限公司      | 基金管理人的股东             |
| 合肥兴泰控股集团有限公司       | 基金管理人的股东             |
| 上海华富利得资产管理有限公司     | 基金管理人的子公司            |

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|--|----------------------|--|----------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额   | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 华安证券  | 150,702,830.90                         | 12.21%               | -  | -                    |

##### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |              |
|-------|--|--------------|--|--------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券成交总额的比例 |
| 华安证券  | 683,965.32                             | 100.00%      | -  | -            |

注：本表中“当期债券成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券交易成交总额。

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |                |
|-------|--|----------------|--|----------------|
|       | 回购成交金额                                 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 华安证券  | 100,000,000.00                         | 100.00%        | -  | -              |

#### 7.4.8.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |              |
|-------|--|--------------|--|--------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期权证成交总额的比例 |
|       |  |              |  |              |

注：本基金本报告期末和上年度无权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日                 |                |            |                  |
|-------|--|----------------|------------|------------------|
|       | 当期佣金   | 占当期佣金总量的比例     | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金总量的比例     |
| 华安证券  | 139,494.14   | 12.30%         | 100,187.82 | 62.73%           |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |                |            |                  |
|       | 当期佣金   | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金总量的比例 (%) |
|       |  |                |            |                  |

注：上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 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 12 月 31 日 | 2015 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,051,647.37                     | 6,569,844.12                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,144,980.84                     | 2,165,922.84                              |

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日 | 2015 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 508,607.93                       | 1,094,973.96                              |

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费各关联方名称 | 本期  |
|---------------|---|
|               | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日          |
|               | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间                                   |
|               | 2015 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|               | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日               |        |      |       |      |       |      |
|--|--------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                                       | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |        |      |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的各关联方名称                                       | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |

注：本基金本报告期内和上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|--------------------------------|--|--|
| 基金合同生效日(2015 年 2 月 4 日)持有的基金份额 | -                                      | -  |
| 期初持有的基金份额                      | -                                      | -  |
| 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                      | -                                      | -  |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例              | -                                      | -  |

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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<br>2016 年 12 月 31 日 |                  | 上年度末<br>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 |
|       |                         |                  |                          |                  |

注：本基金本报告期内和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

#### 7.4.8.5 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日(基金合同生效日)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       |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 60,130,227.93                          | 2,411,188.37 | 208,908,486.69                                       | 2,640,751.36 |

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日               |      |      |      |           |     |
|--|------|------|------|-----------|-----|
| 关联方名称  | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |     |
|  |      |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额 |
| 上年度可比期间<br>2015 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |      |      |      |           |     |
| 关联方名称  | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |     |
|  |      |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额 |

注：本基金在本报告期内和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

##### 7.4.9.1 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

| 7.4.10.1.1 受限证券类别：股票 |      |                  |                |        |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|------------------|----------------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日            | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300583               | 赛托生物 | 2016 年 12 月 29 日 | 2017 年 1 月 6 日 | 新股流通受限 | 40.29 | 40.29  | 1,582    | 63,738.78 | 63,738.78 | -  |
| 601375               | 中原证券 | 2016 年 12 月 20 日 | 2017 年 1 月 3 日 | 新股流通受限 | 4.00  | 4.00   | 15,527   | 62,108.00 | 62,108.00 | -  |
| 603877               | 太平鸟  | 2016 年 12 月 29 日 | 2017 年 1 月 9 日 | 新股流通受限 | 21.30 | 21.30  | 1,685    | 35,890.50 | 35,890.50 | -  |
| 300587               | 天铁股份 | 2016 年 12 月 28 日 | 2017 年 1 月 5 日 | 新股流通受限 | 14.11 | 14.11  | 1,151    | 16,240.61 | 16,240.61 | -  |

|        |      |                     |                    |            |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|---------------------|--------------------|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 603035 | 常熟汽饰 | 2016年<br>12月27<br>日 | 2017年<br>1月5<br>日  | 新股流<br>通受限 | 10.44 | 10.44 | 1,202 | 12,548.88 | 12,548.88 | - |
| 002840 | 华统股份 | 2016年<br>12月29<br>日 | 2017年<br>1月10<br>日 | 新股流<br>通受限 | 6.55  | 6.55  | 1,814 | 11,881.70 | 11,881.70 | - |
| 002838 | 道恩股份 | 2016年<br>12月28<br>日 | 2017年<br>1月6<br>日  | 新股流<br>通受限 | 15.28 | 15.28 | 681   | 10,405.68 | 10,405.68 | - |
| 300586 | 美联新材 | 2016年<br>12月26<br>日 | 2017年<br>1月4<br>日  | 新股流<br>通受限 | 9.30  | 9.30  | 1,006 | 9,355.80  | 9,355.80  | - |
| 300591 | 万里马  | 2016年<br>12月30<br>日 | 2017年<br>1月10<br>日 | 新股流<br>通受限 | 3.07  | 3.07  | 2,397 | 7,358.79  | 7,358.79  | - |
| 300588 | 熙菱信息 | 2016年<br>12月27<br>日 | 2017年<br>1月5<br>日  | 新股流<br>通受限 | 4.94  | 4.94  | 1,380 | 6,817.20  | 6,817.20  | - |

7.4.10.1.2 受限证券类别：债券

| 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<br>(单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|-------|------|--------|------|--------|--------------|--------|--------|----|
|------|------|-------|------|--------|------|--------|--------------|--------|--------|----|

7.4.10.1.3 受限证券类别：权证

| 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<br>(单位：份) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|-------|------|--------|------|--------|--------------|--------|--------|----|
|------|------|-------|------|--------|------|--------|--------------|--------|--------|----|

7.4.9.2 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 |
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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 |
|------|------|-------|--------|-------|--------|
| 合计   |      |       |        | -     | -      |

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据“财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好 2010 年年报工作的通知（财会〔2010〕25 号）”（以下简称“通知”）要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

| 类别   | 2016 年 12 月 31 日公允价值 | 2015 年 12 月 31 日公允价值 |
|------|----------------------|----------------------|
| 第一层次 | 120,086,433.89       | 6033492.92           |
| 第二层次 | -                    | 236,345.94           |
| 第三层次 | -                    | -                    |
| 合计   | -                    | 120322779.83         |

6033492.92

根据《关于发布〈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〉的通知》（中基协发[2014]24 号）的要求，本基金自 2015 年 3 月 30 日起，对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值（估值标准另有规定的除外），本报告期末本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

## § 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              | 120,322,779.83 | 66.45  |
|   | 其中：股票             | 120,322,779.83 | 66.45  |
| 2 | 固定收益投资            | -              | -      |
|   | 其中：债券             | -              | -      |
|   | 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      | 60,514,280.58  | 33.42  |
| 7 | 其他各项资产            | 240,598.97     | 0.13   |
| 8 | 合计                | 181,077,659.38 | 100.00 |

注：本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 其他各项资产构成。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 44,581.34     | 0.02          |
| C  | 制造业              | 95,510,675.01 | 53.03         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | 133,954.56    | 0.07          |
| F  | 批发和零售业           | 3,584,197.33  | 1.99          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 10,357,189.00 | 5.75          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,215,493.14  | 2.90          |
| J  | 金融业              | 84,617.76     | 0.05          |
| K  | 房地产业             | 5,278,046.40  | 2.93          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 29,911.50     | 0.02          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 84,113.79     | 0.05          |
| 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        | 120,322,779.83 | 66.81 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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  | 600183 | 生益科技 | 948,500   | 10,433,500.00 | 5.79         |
| 2  | 000823 | 超声电子 | 765,900   | 9,520,137.00  | 5.29         |
| 3  | 300321 | 同大股份 | 160,386   | 6,190,899.60  | 3.44         |
| 4  | 002636 | 金安国纪 | 369,100   | 6,034,785.00  | 3.35         |
| 5  | 002057 | 中钢天源 | 350,900   | 5,954,773.00  | 3.31         |
| 6  | 600328 | 兰太实业 | 438,568   | 5,754,012.16  | 3.20         |
| 7  | 600569 | 安阳钢铁 | 1,890,700 | 5,653,193.00  | 3.14         |
| 8  | 600561 | 江西长运 | 398,100   | 5,525,628.00  | 3.07         |
| 9  | 600809 | 山西汾酒 | 214,960   | 5,378,299.20  | 2.99         |
| 10 | 300353 | 东土科技 | 351,400   | 5,337,766.00  | 2.96         |

## 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%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  | 600395 | 盘江股份 | 25,828,783.68 | 11.65          |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 2  | 000555 | 神州信息 | 12,820,992.76 | 5.78 |
| 3  | 002348 | 高乐股份 | 12,794,711.72 | 5.77 |
| 4  | 600872 | 中炬高新 | 12,677,082.19 | 5.72 |
| 5  | 300016 | 北陆药业 | 12,643,179.00 | 5.70 |
| 6  | 002741 | 光华科技 | 12,396,857.18 | 5.59 |
| 7  | 002313 | 日海通讯 | 11,807,191.79 | 5.32 |
| 8  | 600183 | 生益科技 | 11,605,698.80 | 5.23 |
| 9  | 600685 | 中船防务 | 10,986,202.00 | 4.95 |
| 10 | 000630 | 铜陵有色 | 9,655,792.00  | 4.35 |
| 11 | 300358 | 楚天科技 | 9,534,681.57  | 4.30 |
| 12 | 002081 | 金螳螂  | 9,399,746.37  | 4.24 |
| 13 | 600569 | 安阳钢铁 | 7,998,179.00  | 3.61 |
| 14 | 000960 | 锡业股份 | 7,768,645.00  | 3.50 |
| 15 | 000561 | 烽火电子 | 7,759,469.55  | 3.50 |
| 16 | 000823 | 超声电子 | 7,701,168.52  | 3.47 |
| 17 | 600764 | 中电广通 | 7,538,890.01  | 3.40 |
| 18 | 300353 | 东土科技 | 7,210,928.66  | 3.25 |
| 19 | 002697 | 红旗连锁 | 7,012,063.00  | 3.16 |
| 20 | 002636 | 金安国纪 | 6,918,036.90  | 3.12 |
| 21 | 002245 | 澳洋顺昌 | 6,802,689.36  | 3.07 |
| 22 | 300336 | 新文化  | 6,725,786.43  | 3.03 |
| 23 | 000733 | 振华科技 | 6,660,169.50  | 3.00 |
| 24 | 002673 | 西部证券 | 6,614,567.00  | 2.98 |
| 25 | 600158 | 中体产业 | 6,513,298.16  | 2.94 |
| 26 | 600325 | 华发股份 | 6,510,344.38  | 2.94 |
| 27 | 600409 | 三友化工 | 6,505,224.35  | 2.93 |
| 28 | 601233 | 桐昆股份 | 6,504,820.48  | 2.93 |
| 29 | 600776 | 东方通信 | 6,502,492.97  | 2.93 |
| 30 | 002229 | 鸿博股份 | 6,501,688.04  | 2.93 |
| 31 | 600549 | 厦门钨业 | 6,501,366.00  | 2.93 |
| 32 | 000877 | 天山股份 | 6,498,976.71  | 2.93 |
| 33 | 600888 | 新疆众和 | 6,494,665.13  | 2.93 |
| 34 | 600005 | 武钢股份 | 6,479,443.00  | 2.92 |
| 35 | 000655 | 金岭矿业 | 6,464,805.58  | 2.92 |
| 36 | 002353 | 杰瑞股份 | 6,353,603.63  | 2.87 |
| 37 | 300352 | 北信源  | 6,303,267.00  | 2.84 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 38 | 002224 | 三力士  | 6,283,708.74 | 2.83 |
| 39 | 002243 | 通产丽星 | 6,281,979.01 | 2.83 |
| 40 | 002405 | 四维图新 | 6,281,138.00 | 2.83 |
| 41 | 000971 | 高升控股 | 6,241,513.32 | 2.81 |
| 42 | 600386 | 北巴传媒 | 6,161,093.92 | 2.78 |
| 43 | 300354 | 东华测试 | 6,154,260.66 | 2.78 |
| 44 | 300327 | 中颖电子 | 6,149,644.60 | 2.77 |
| 45 | 601208 | 东材科技 | 6,146,482.33 | 2.77 |
| 46 | 300007 | 汉威电子 | 6,145,550.00 | 2.77 |
| 47 | 300012 | 华测检测 | 6,145,217.15 | 2.77 |
| 48 | 300254 | 仟源医药 | 6,140,340.03 | 2.77 |
| 49 | 600711 | 盛屯矿业 | 6,131,703.50 | 2.77 |
| 50 | 300228 | 富瑞特装 | 6,127,498.05 | 2.76 |
| 51 | 603609 | 禾丰牧业 | 5,941,842.36 | 2.68 |
| 52 | 600460 | 士兰微  | 5,939,534.75 | 2.68 |
| 53 | 300137 | 先河环保 | 5,932,182.24 | 2.68 |
| 54 | 300400 | 劲拓股份 | 5,928,349.50 | 2.67 |
| 55 | 600328 | 兰太实业 | 5,899,978.82 | 2.66 |
| 56 | 002548 | 金新农  | 5,866,750.00 | 2.65 |
| 57 | 603968 | 醋化股份 | 5,861,263.56 | 2.64 |
| 58 | 600099 | 林海股份 | 5,835,437.00 | 2.63 |
| 59 | 300476 | 胜宏科技 | 5,828,838.40 | 2.63 |
| 60 | 603328 | 依顿电子 | 5,818,929.10 | 2.62 |
| 61 | 002365 | 永安药业 | 5,815,878.00 | 2.62 |
| 62 | 002463 | 沪电股份 | 5,813,983.74 | 2.62 |
| 63 | 600297 | 广汇汽车 | 5,805,677.00 | 2.62 |
| 64 | 600586 | 金晶科技 | 5,803,084.20 | 2.62 |
| 65 | 000608 | 阳光股份 | 5,800,440.64 | 2.62 |
| 66 | 600110 | 诺德股份 | 5,790,385.57 | 2.61 |
| 67 | 002436 | 兴森科技 | 5,786,884.08 | 2.61 |
| 68 | 002051 | 中工国际 | 5,701,812.08 | 2.57 |
| 69 | 002016 | 世荣兆业 | 5,688,452.40 | 2.57 |
| 70 | 300321 | 同大股份 | 5,684,906.33 | 2.56 |
| 71 | 300240 | 飞力达  | 5,553,229.00 | 2.50 |
| 72 | 600561 | 江西长运 | 5,413,011.60 | 2.44 |
| 73 | 300183 | 东软载波 | 5,406,850.00 | 2.44 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 74 | 002057 | 中钢天源 | 5,371,144.14 | 2.42 |
| 75 | 603799 | 华友钴业 | 5,370,577.65 | 2.42 |
| 76 | 600500 | 中化国际 | 5,335,584.20 | 2.41 |
| 77 | 600809 | 山西汾酒 | 5,257,778.40 | 2.37 |
| 78 | 000959 | 首钢股份 | 5,122,533.01 | 2.31 |
| 79 | 000666 | 经纬纺机 | 5,104,156.35 | 2.30 |
| 80 | 000503 | 海虹控股 | 4,981,252.13 | 2.25 |
| 81 | 002362 | 汉王科技 | 4,930,036.00 | 2.22 |
| 82 | 600295 | 鄂尔多斯 | 4,866,047.00 | 2.19 |
| 83 | 000768 | 中航飞机 | 4,833,297.02 | 2.18 |
| 84 | 002371 | 七星电子 | 4,832,741.00 | 2.18 |
| 85 | 300390 | 天华超净 | 4,493,043.24 | 2.03 |

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600395 | 盘江股份 | 25,074,663.34 | 11.31          |
| 2  | 002348 | 高乐股份 | 15,062,132.20 | 6.79           |
| 3  | 000971 | 高升控股 | 14,391,635.34 | 6.49           |
| 4  | 000555 | 神州信息 | 13,795,916.60 | 6.22           |
| 5  | 300016 | 北陆药业 | 12,726,808.27 | 5.74           |
| 6  | 002741 | 光华科技 | 12,506,445.65 | 5.64           |
| 7  | 600872 | 中炬高新 | 12,186,744.95 | 5.50           |
| 8  | 002313 | 日海通讯 | 11,999,745.20 | 5.41           |
| 9  | 300358 | 楚天科技 | 11,312,717.26 | 5.10           |
| 10 | 002081 | 金螳螂  | 9,701,785.87  | 4.38           |
| 11 | 600764 | 中电广通 | 8,889,269.04  | 4.01           |
| 12 | 600685 | 中船防务 | 8,852,129.70  | 3.99           |
| 13 | 000630 | 铜陵有色 | 8,751,348.42  | 3.95           |
| 14 | 600549 | 厦门钨业 | 7,422,772.54  | 3.35           |
| 15 | 002405 | 四维图新 | 7,262,775.04  | 3.28           |
| 16 | 002224 | 三力士  | 7,178,381.00  | 3.24           |
| 17 | 002365 | 永安药业 | 7,160,583.87  | 3.23           |
| 18 | 600158 | 中体产业 | 7,042,867.67  | 3.18           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 19 | 000608 | 阳光股份 | 7,041,185.65 | 3.18 |
| 20 | 600888 | 新疆众和 | 6,834,069.28 | 3.08 |
| 21 | 600711 | 盛屯矿业 | 6,831,766.32 | 3.08 |
| 22 | 600099 | 林海股份 | 6,791,990.00 | 3.06 |
| 23 | 002243 | 通产丽星 | 6,776,250.50 | 3.06 |
| 24 | 300352 | 北信源  | 6,670,400.93 | 3.01 |
| 25 | 002673 | 西部证券 | 6,612,043.09 | 2.98 |
| 26 | 000877 | 天山股份 | 6,506,913.00 | 2.93 |
| 27 | 600776 | 东方通信 | 6,433,968.49 | 2.90 |
| 28 | 002245 | 澳洋顺昌 | 6,406,402.28 | 2.89 |
| 29 | 603328 | 依顿电子 | 6,377,447.23 | 2.88 |
| 30 | 000655 | 金岭矿业 | 6,358,015.50 | 2.87 |
| 31 | 300228 | 富瑞特装 | 6,317,700.28 | 2.85 |
| 32 | 002229 | 鸿博股份 | 6,201,666.25 | 2.80 |
| 33 | 601208 | 东材科技 | 6,164,542.57 | 2.78 |
| 34 | 600005 | 武钢股份 | 6,076,249.26 | 2.74 |
| 35 | 603609 | 禾丰牧业 | 6,066,059.47 | 2.74 |
| 36 | 600409 | 三友化工 | 6,030,023.10 | 2.72 |
| 37 | 300400 | 劲拓股份 | 5,988,663.74 | 2.70 |
| 38 | 600325 | 华发股份 | 5,958,830.50 | 2.69 |
| 39 | 601233 | 桐昆股份 | 5,932,916.50 | 2.68 |
| 40 | 600586 | 金晶科技 | 5,929,390.89 | 2.67 |
| 41 | 000561 | 烽火电子 | 5,920,731.00 | 2.67 |
| 42 | 600460 | 士兰微  | 5,915,968.55 | 2.67 |
| 43 | 300137 | 先河环保 | 5,902,476.38 | 2.66 |
| 44 | 300354 | 东华测试 | 5,899,586.17 | 2.66 |
| 45 | 300012 | 华测检测 | 5,871,588.90 | 2.65 |
| 46 | 000960 | 锡业股份 | 5,852,410.24 | 2.64 |
| 47 | 300254 | 仟源医药 | 5,720,667.23 | 2.58 |
| 48 | 300336 | 新文化  | 5,663,124.80 | 2.55 |
| 49 | 600297 | 广汇汽车 | 5,659,165.53 | 2.55 |
| 50 | 002548 | 金新农  | 5,613,184.05 | 2.53 |
| 51 | 600386 | 北巴传媒 | 5,611,227.32 | 2.53 |
| 52 | 300007 | 汉威电子 | 5,592,930.00 | 2.52 |
| 53 | 002051 | 中工国际 | 5,520,242.87 | 2.49 |
| 54 | 002436 | 兴森科技 | 5,518,042.79 | 2.49 |
| 55 | 603968 | 醋化股份 | 5,475,005.49 | 2.47 |
| 56 | 002697 | 红旗连锁 | 5,402,073.66 | 2.44 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 57 | 000503 | 海虹控股 | 5,270,760.62 | 2.38 |
| 58 | 601789 | 宁波建工 | 5,248,532.31 | 2.37 |
| 59 | 002362 | 汉王科技 | 5,199,197.00 | 2.34 |
| 60 | 603799 | 华友钴业 | 5,172,053.30 | 2.33 |
| 61 | 000733 | 振华科技 | 5,158,733.00 | 2.33 |
| 62 | 002463 | 沪电股份 | 5,117,418.72 | 2.31 |
| 63 | 000666 | 经纬纺机 | 5,053,745.20 | 2.28 |
| 64 | 300327 | 中颖电子 | 5,047,727.32 | 2.28 |
| 65 | 000959 | 首钢股份 | 5,024,634.50 | 2.27 |
| 66 | 300093 | 金刚玻璃 | 4,952,946.89 | 2.23 |
| 67 | 000768 | 中航飞机 | 4,940,667.85 | 2.23 |
| 68 | 002371 | 七星电子 | 4,686,405.44 | 2.11 |
| 69 | 300259 | 新天科技 | 4,520,879.26 | 2.04 |

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

### 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 | 671,869,178.91 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 563,913,020.63 |

### 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      | -    | -            |
| 2  | 央行票据      | -    | -            |
| 3  | 金融债券      | -    | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -    | -            |
| 4  | 企业债券      | -    | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -    | -            |
| 6  | 中期票据      | -    | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -    | -            |
| 8  | 同业存单      | -    | -            |
| 9  | 其他        | -    | -            |
| 10 | 合计        | -    | -            |

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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（%） |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|--------|
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -      |
| 国债期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | -      |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | -      |

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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   | 211,407.14 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 27,993.63  |
| 5  | 应收申购款   | 1,198.20   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 240,598.97 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|------|------|---------------|
|----|------|------|------|---------------|

注：本基金本报告期末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 |
|----|------|------|-------------|---------------|----------|
|----|------|------|-------------|---------------|----------|

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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  |
| 4,344     | 42,596.77 | 0.00  | 0.00%  | 185,040,384.25 | 100.00% |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 6,839.59   | 0.0037%  |

### 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

| 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10               |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015年2月4日）基金份额总额 | 1,073,507,334.60 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 231,104,549.04   |
| 本报告期基金总申购份额              | 15,444,217.55    |
| 减:本报告期基金总赎回份额            | 61,508,382.34    |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 本报告期期末基金份额总额             | 185,040,384.25   |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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、2016年1月7日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，高靖瑜女士不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

2、2016年2月19日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任翁海波先生为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

3、2016年6月23日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，孔庆卿先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

4、2016年6月23日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

5、2016年6月23日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任胡伟先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、2016年6月23日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任张惠女士为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、2016年8月23日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王夏儒先生

为华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

8、2016 年 9 月 2 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王翔先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

9、2016 年 9 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王翔先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

10、2016 年 9 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

11、2016 年 11 月 10 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任张惠女士为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

12、2016 年 11 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

13、2016 年 11 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富安福保本混合型证券投资基金的基金经理职务。

14、2016 年 11 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

15、自 2016 年 1 月起，浦发银行进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 7 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国信证券 | 2      | 62,369,844.07  | 5.05%        | 57,789.28  | 5.10%      | -  |
| 华安证券 | 2      | 150,702,830.90 | 12.21%       | 139,494.14 | 12.30%     | -  |
| 民生证券 | 2      | 220,277,574.73 | 17.85%       | 205,144.07 | 18.09%     | -  |
| 广州证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 光大证券 | 1      | 88,999,323.39  | 7.21%        | 82,885.23  | 7.31%      | -  |
| 华创证券 | 1      | 263,130,290.47 | 21.32%       | 239,790.44 | 21.14%     | -  |
| 方正证券 | 1      | 357,956,313.92 | 29.00%       | 326,205.28 | 28.76%     | -  |
| 安信证券 | 1      | 90,883,281.15  | 7.36%        | 82,822.12  | 7.30%      | -  |

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。本报告期本基金新增交易单元的情况：华安证券新增 2 个交易席位，广州证券新增 1 个交易席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易       |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|------|------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国信证券 | -          | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华安证券 | 683,965.32 | 100.00%      | 100,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 民生证券 | -          | -            | -              | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华富基金管理有限公司  
2017年3月29日