

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度 报告

2017-06-30

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2017-08-26

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金简介](#)

[基金基本情况](#)

[基金产品说明](#)

[基金管理人和基金托管人](#)

[信息披露方式](#)

[其他相关资料](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要会计数据和财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[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](#)

[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](#)

[管理人报告](#)

[基金管理人及基金经理情况](#)

[基金管理人及其管理基金的经验](#)

[基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介](#)

[管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

[管理人对报告期内公平交易情况的专项说明](#)

[公平交易制度的执行情况](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明](#)

[管理人对报告期内基金利润分配情况的说明](#)

[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](#)

[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](#)

[托管人报告](#)

[报告期内本基金托管人遵规守信情况声明](#)

[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](#)

托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

半年度财务会计报告（未经审计）

资产负债表

利润表

所有者权益（基金净值）变动表

报表附注

基金基本情况

会计报表的编制基础

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

重要会计政策和会计估计

会计年度

记账本位币

金融资产和金融负债的分类

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债的估值原则

金融资产和金融负债的抵销

实收基金

损益平准金

收入/(损失)的确认和计量

费用的确认和计量

基金的收益分配政策

其他重要的会计政策和会计估计

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

会计估计变更的说明

差错更正的说明

税项

重要财务报表项目的说明

银行存款

衍生金融资产/负债

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

期末买断式逆回购交易中取得的债券

应收利息

其他资产

应付交易费用

其他负债

实收基金

未分配利润

存款利息收入

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

债券投资收益

债券投资收益项目构成

债券投资收益——买卖债券差价收入
债券投资收益——赎回差价收入
债券投资收益——申购差价收入
资产支持证券投资收益
衍生工具收益
衍生工具收益——买卖权证差价收入
衍生工具收益——其他投资收益
股利收益
公允价值变动收益
其他收入
交易费用
其他费用
分部报告
或有事项、资产负债表日后事项的说明
或有事项
资产负债表日后事项
关联方关系
本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本报告期与基金发生关联交易的各关联方
本报告期及上年度可比期间的关联方交易
通过关联方交易单元进行的交易
股票交易
债券交易
权证交易
应支付关联方的佣金
关联方报酬
基金管理费
基金托管费
销售服务费
与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
各关联方投资本基金的情况
报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
其他关联交易事项的说明
利润分配情况
利润分配情况——非货币市场基金
期末本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
期末持有的暂时停牌等流通受限股票
期末债券正回购交易中作为抵押的债券
银行间市场债券正回购
交易所市场债券正回购

金融工具风险及管理
风险管理政策和组织架构
信用风险
按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资
流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
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
报告期内股票投资组合的重大变动
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
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
买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
期末按债券品种分类的债券投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
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
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金投资股指期货的投资政策
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本期国债期货投资评价
投资组合报告附注
本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明
期末其他各项资产构成
期末持有的处于转股期的可转换债券明细
期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
投资组合报告附注的其他文字描述部分
基金份额持有人信息
期末基金份额持有人户数及持有人结构
期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
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
发起式基金发起资金持有份额情况
开放式基金份额变动
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
其他重大事件
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
其他重大事件
影响投资者决策的其他重要信息
报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录
备查文件目录
存放地点
查阅方式

重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

基金简称

华富价值增长混合

场内简称

基金主代码

410007

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2009-07-15

基金管理人

华富基金管理有限公司

基金托管人

平安银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

147,114,775.61

基金合同存续期

不定期

基金产品说明

投资目标

本基金通过投资于价值相对低估且能为股东创造持续稳定回报的公司，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略

本基金采用较为灵活的投资策略。在资产配置中，本基金采用自上而下的方式，通过分析证券市场投资环境，预测股票市场和债券市场未来收益和风险，确定资产配置方案；在股票选择中，本基金采用定量分析、定性分析和实地调研等方法，自下而上，精选个股。

业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

风险收益特征

本基金属于灵活配置混合型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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

平安银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

满志弘

方琦

联系电话

021-68886996

0755-22160168

电子邮箱

manzh@hffund.com

FANGQI275@pingan.com.cn

客户服务电话

400-700-8001

95511-3

传真

021-68887997

0755-82080387

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1000 号 31 层

深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址

上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层

深圳市罗湖区深南东路 5047 号

邮政编码

200120

518001

法定代表人

章宏韬

谢永林

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》和《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.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

其他相关资料

项目

名称
办公地址
注册登记机构
华富基金管理有限公司
上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期

报告期(2017-01-01 至 2017-06-30)

本期已实现收益

-7,126,458.72

本期利润

-3,113,506.35

加权平均基金份额本期利润

-0.0164

本期加权平均净值利润率

-1.59 %

本期基金份额净值增长率

-1.94 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

期末可供分配利润

2,735,500.06

期末可供分配基金份额利润

0.0186

期末基金资产净值

149,850,275.67

期末基金份额净值

1.0186

报告期末

报告期末(2017-06-30)

基金份额累计净值增长率

76.52 %

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 6 月 30 日。

基金净值表现

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

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

业绩比较基准收益率标准差④

①-③

②-④

过去一个月

2.86 %

1.22 %

3.46 %

0.40 %

-0.60 %

0.82 %

过去三个月

-3.55 %

1.20 %

3.70 %

0.38 %

-7.25 %

0.82 %

过去六个月

-1.94 %

1.04 %

6.30 %

0.35 %

-8.24 %

0.69 %

过去一年

-4.11 %

0.97 %

9.67 %

0.41 %

-13.78 %

0.56 %

过去三年

87.33 %

2.06 %

49.66 %

1.05 %

37.67 %

1.01 %

自基金合同生效起至今

76.52 %

1.62 %

24.71 %

0.95 %

51.81 %

0.67 %

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

注：根据《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票投资占基金资产的比例为 30%-80%；债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-70%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 7 月 15 日到 2010 年 1 月 15 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《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

基金管理人及基金经理情况

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 日在上海正式成立。注册资本 2.5 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 2017 年 6 月 30 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、华富成长趋势混合型证券投资基金、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、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金三十三只基金。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

陈启明

华富价值增长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

健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富成长趋势混合型基金基金经理、华富产业升级灵活配置混合型基金基金经理、公司公募投资决策委员会委员、基金投资部总监

2014-09-26

-

十一年

复旦大学会计学硕士，本科学历，历任日盛嘉富证券上海代表处研究员、群益证券上海代表处研究员、中银国际证券产品经理，2010年2月加入华富基金管理有限公司，曾任行业研究员、研究发展部副总监，2013年3月1日至2014年9月25日任成长趋势股票型基金基金经理助理。

注：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。

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

2017年上半年沪深300指数累计上涨10.78%，创业板指累计下跌7.34%。上半年，市场分化非常明显，二八分化甚至一九分化现象向极致化演绎。上半年，监管趋严、金融去杠杆进一步深化，资金面紧张，风险偏好下降明显，资金持续向蓝筹龙头白马集中，上半年上涨较好的行业主要是家电、食品饮料、电子元器件、银行、煤炭等行业。

本基金组合结构总体均衡，配置中传统周期性行业和新产业整体均衡，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。整体来看，大盘指数震荡上升，而小盘成长股出现明显回调，投资机会主要来自于蓝筹，本基金着重医药、新能源、计算机板块表现落后，整体基金表现落后。维持前期观点：从价值角度观察，成长股跟随创业板以及壳资源股估值出现泥沙俱下的大幅杀跌，恰恰有利于从中挑选未来数年真正能够跟随甚至超越行业成长的龙头公司进行左侧配置。下一阶段本基金将继续踏实寻找基本面真正良好、成长性突出的行业、个股加以重点配置。

报告期内基金的业绩表现

本基金2009年7月15日生效，截止2017年6月30日，本基金份额净值为1.0186元，累计份额净值为1.8186元。报告期，本基金份额净值增长率为-1.94%，同期业绩比较基准收益率为6.30%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场整体预期二季度经济数据回落，但从分月数据来看，经济回落幅度低于预期。6月PMI51.7，环比提高0.7个百分点，其中：生产指数为54.4%，环比回升1个百分点，新订单指数为53.1%，环比提升0.8个百分点，新出口订单和进口指数分别为52.0%、51.2%，分别环比提升1.3、1.2个百分点；从PMI数据看，整体内外需月度环比都有所改善。自2016年年初开始，市场经历了大幅震荡之后开始走向分化，大量的个股在经历熔断回调之后，开始走向分化，传统行业蓝筹随着市场风格切换开始稳步上涨，而创业板则继续下调。对2017年第三季度的行情，我们持相对中性的态度。一方面宏观经济可能短阶段见顶，货币政策的大幅紧缩仍然相对遥远，而从相对来看，股票资产在未来大类资产中仍然属于较优资产。另一方面部分质地优良的成长股，未来的市场空间较大，潜在成长性突出，经过充分调整之后，性价比凸显，我们会积极布局。

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。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投资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。

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《华富价值增长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-3,113,506.35元，期末可供分配利润为2,735,500.06元。本报告期内未进行利润分配。

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

-

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。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）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、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、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、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。

资产负债表

会计主体：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

资产：

银行存款

12,571,093.40

13,942,268.28

结算备付金

219,799.18

655,080.41

存出保证金

268,967.28

467,345.26

交易性金融资产

128,170,618.13

282,630,270.15

其中：股票投资

118,040,618.13

238,238,217.99

基金投资

-

-

债券投资

10,130,000.00

44,392,052.16

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

9,511,168.11
9,863,970.81
应收利息
32,490.33
63,644.04
应收股利
-
-
应收申购款
18,732.90
133,386.77
递延所得税资产
-
-
其他资产
-
-
资产总计
150,792,869.33
307,755,965.72
负债和所有者权益
本期末
2017-06-30
上年度末
2016-12-31
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
-
-
应付赎回款
421,923.98
108,565.24

应付管理人报酬	
182,498.07	
402,675.46	
应付托管费	
30,416.36	
67,112.61	
应付销售服务费	
-	
-	
应付交易费用	
182,774.84	
409,312.76	
应交税费	
-	
-	
应付利息	
-	
-	
应付利润	
-	
-	
递延所得税负债	
-	
-	
其他负债	
124,980.41	
275,400.62	
负债合计	
942,593.66	
1,263,066.69	
所有者权益：	
-	
-	
实收基金	
147,114,775.61	
295,086,231.43	
未分配利润	
2,735,500.06	
11,406,667.60	
所有者权益合计	
149,850,275.67	
306,492,899.03	
负债和所有者权益总计	
150,792,869.33	

307,755,965.72

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0186 元，基金份额总额 147,114,775.61 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

利润表

会计主体：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

一、收入

-427,280.81

15,144,995.29

1.利息收入

108,805.53

425,354.87

其中：存款利息收入

73,900.30

425,354.87

 债券利息收入

34,905.23

-

 资产支持证券利息收入

-

-

 买入返售金融资产收入

-

-

 其他利息收入

-

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

-4,752,217.61

-5,478,595.55

其中：股票投资收益

-4,460,904.83

-6,158,758.50

 基金投资收益

-

-

 债券投资收益

-762,094.68

-
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
470,781.90
680,162.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）
4,012,952.37
18,941,616.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）
-
-
5.其他收入（损失以“-”号填列）
203,178.90
1,256,619.24
减：二、费用
2,686,225.54
5,572,263.19
1. 管理人报酬
1,470,856.77
2,649,912.12
2. 托管费
245,142.77
441,652.03
3. 销售服务费
-
-
4. 交易费用
846,253.67
2,387,677.56
5. 利息支出
-
-
其中：卖出回购金融资产支出
-
-
6. 其他费用

123,972.33

93,021.48

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

-3,113,506.35

9,572,732.10

减：所得税费用

-

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

-3,113,506.35

9,572,732.10

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

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）

396,489,573.87

24,700,803.11

306,492,899.03

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

-3,113,506.35

-3,113,506.35

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）

-147,971,455.82

-5,557,661.19

-153,529,117.01

其中：1.基金申购款

12,960,159.87

362,676.34

13,322,836.21

2.基金赎回款

-160,931,615.69

-5,920,337.53

-166,851,953.22

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）

147,114,775.61

2,735,500.06

149,850,275.67

项目

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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）

880,641,359.45

78,981,913.56

959,623,273.01

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

9,572,732.10

9,572,732.10

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）

-484,151,785.58

-63,853,842.55

-548,005,628.13

其中：1.基金申购款

468,466,306.18

-9,757,318.30

458,708,987.88

2.基金赎回款

-952,618,091.76

-54,096,524.25

-1,006,714,616.01

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）

396,489,573.87

24,700,803.11

306,492,899.03

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署；

基金管理人负责人：章宏韬

主管会计工作负责人：余海春

会计机构负责人：

陈大毅

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

华富价值增长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[2009]309号）核准，基金合同于2009年7月15日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健光华（北京）会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健华证验（2009）综字第070003号）。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《华富价值增长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，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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。

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。

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。

会计年度

-

记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

金融资产和金融负债的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

活期存款

12,571,093.40

-

定期存款

-

-

其中：存款期限1-3个月

-

-

其他存款

-

-

合计

12,571,093.40

13,942,268.28

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

成本

公允价值

公允价值变动

股票

120,403,611.58

118,040,618.13

-2,362,993.45

贵金属投资-金交所黄金合约

-

-

-

债券

交易所市场

11,894,248.57

10,130,000.00

-1,764,248.57

银行间市场

-

-

-

合计

11,894,248.57

10,130,000.00

-1,764,248.57

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

132,297,860.15

128,170,618.13

-4,127,242.02

项目

上年度末

2016-12-31

成本

公允价值

公允价值变动

股票

-

-

-

贵金属投资-金交所黄金合约

-

-

-

债券

交易所市场

-

-

-

银行间市场

-

-

-

合计

-

-

-

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

-

-

-

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

项目

上年度末

2016-12-31

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

项目

上年度末

2016-12-31

账面余额

其中：买断式逆回购

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

项目

上年度末

2016-12-31

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应收活期存款利息

2,725.22

-

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

98.90

-

应收债券利息

29,545.21

-

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

121.00

-

合计

32,490.33

63,644.04

注：注：其他所列款项为应收结算保证金利息。

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

其他应收款

-

-

待摊费用

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期末无其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

交易所市场应付交易费用

182,774.84

-
银行间市场应付交易费用

-

-

合计

182,774.84

409,312.76

其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应付券商交易单元保证金

-

-

应付赎回费

1,008.08

-

预提费用

-

-

应付审计费

34,712.18

-

应付信息披露费

89,260.15

-

合计

124,980.41

275,400.62

实收基金

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

基金份额（份）

账面金额

上年度末

295,086,231.43

295,086,231.43

本期申购

12,960,159.87

12,960,159.87

本期赎回（以“-”号填列）

-160,931,615.69

-160,931,615.69

本期末

147,114,775.61

147,114,775.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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

47,688,072.28

-36,281,404.68

11,406,667.60

本期利润

-7,126,458.72

4,012,952.37

-3,113,506.35

本期基金份额交易产生的变动数

-21,557,879.27

16,000,218.08

-5,557,661.19

其中：基金申购款

1,636,885.13

-1,274,208.79

362,676.34

基金赎回款

-23,194,764.40

17,274,426.87

-5,920,337.53

本期已分配利润

-

-

-

本期末

19,003,734.29

-16,268,234.23

2,735,500.06

存款利息收入

单位：人民币元

项目
本期
2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
活期存款利息收入
67,393.91
-
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
3,640.07
-
其他
2,866.32
-
合计
73,900.30

425,354.87

注：其他所列本期金额为结算保证金利息收入。

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目
本期
2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
卖出股票成交总额
322,619,776.32
-
减：卖出股票成本总额
327,080,681.15
-
买卖股票差价收入
-4,460,904.83
-
债券投资收益
债券投资收益项目构成
单位：人民币元

项目
 本期
 2017-01-01 至 2017-06-30
 上年度可比期间
 2016-01-01 至 2016-06-30
 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入
 -762,094.68
 -
 债券投资收益——赎回差价收入
 -
 -
 债券投资收益——申购差价收入
 -
 -
 合计
 -762,094.68
 -

债券投资收益——买卖债券差价收入
 单位：人民币元

项目
 本期
 2017-01-01 至 2017-06-30
 上年度可比期间
 2016-01-01 至 2016-06-30
 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额
 50,244,208.43
 -
 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额
 50,951,456.15
 -
 减：应收利息总额
 54,846.96
 -
 买卖债券差价收入
 -762,094.68
 -

债券投资收益——赎回差价收入
 单位：人民币元

项目
 本期
 2017-01-01 至 2017-06-30
 上年度可比期间
 2016-01-01 至 2016-06-30
 赎回基金份额对价总额

-

-

减：现金支付赎回款总额

-

-

减：赎回债券成本总额

-

-

减：赎回债券应收利息总额

-

-

赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-

申购差价收入

-

-

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

资产支持证券投资收益

-

-

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出权证成交总额

-

-

减：卖出权证成本总额

-

-

买卖权证差价收入

-

-

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间收益金额

2016-01-01 至 2016-06-30

国债期货投资收益

-

-

股指期货-投资收益

-

-

股利收益

单位：人民币元

项目
本期
2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
股票投资产生的股利收益
470,781.90

-
基金投资产生的股利收益

-

-

合计
470,781.90

680,162.95

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

4,012,952.37

-

——股票投资

4,443,779.56

-

——债券投资

-430,827.19

-

——资产支持证券投资

-

-

——基金投资

-

-

——贵金属投资

-

-

——其他

-

-

2.衍生工具

-

-
——权证投资

-

-

3.其他

-

-

合计

4,012,952.37

18,941,616.73

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

基金赎回费收入

172,535.11

-

转换费收入

30,643.79

-

合计

203,178.90

1,256,619.24

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

交易所市场交易费用

846,253.67

-

银行间市场交易费用

-

-

合计

846,253.67

2,387,677.56

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

审计费用

34,712.18

-

信息披露费

89,260.15

-

自营托管账户维护费

-

-

合计

123,972.33

93,021.48

分部报告

无

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

无

资产负债表日后事项

无

关联方关系

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

-

本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称

与本基金的关系

华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

平安银行股份有限公司

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

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
成交金额
占当期股票成交总额的比例
成交金额
占当期股票成交总额的比例
华安证券
68,472,554.45
13.13 %

-
-%
债券交易
金额单位：人民币元
关联方名称

本期
2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
成交金额
占当期股票成交总额的比例
成交金额
占当期股票成交总额的比例
华安证券
19,249,914.30
28.89 %

-
-%
权证交易
单位：人民币元
关联方名称
本期

2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
成交金额
占当期股票成交总额的比例
成交金额
占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

应支付关联方的佣金
金额单位：人民币元
关联方名称
本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期佣金
占当期佣金总量的比例
期末应付佣金余额
占期末应付佣金总额的比例
华安证券
62,939.42
13.20 %

-
-%

关联方名称
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30

当期佣金
占当期佣金总量的比例
期末应付佣金余额
占期末应付佣金总额的比例

关联方报酬

基金管理费
单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

1,470,856.77

2,649,912.12

其中：支付销售机构的客户维护费

219,031.22

145,589.63

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%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）

。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

245,142.77

441,652.03

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)

。

销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期应支付的销售服务费

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

2017-01-01 至 2017-06-30

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

2016-01-01 至 2016-06-30

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

各关联方投资本基金的情况

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
2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
基金合同生效日（2009-07-15）持有的基金份额

-
-
报告期初持有的基金份额
-
-
报告期间申购/买入总份额
-
-
报告期间因拆分变动份额
-
-
减：期间赎回/卖出总份额
-
-
报告期末持有的基金份额

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例
-%
-%

注：本基金本报告期和上年度可比期间内本基金管理人没有运用自有资金投资本基金。
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

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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：本基金本报告期末和上年度末基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

期末余额

当期利息收入

期末余额

当期利息收入

平安银行股份有限公司

12,571,093.40

67,393.91

87,099,408.06

408,085.42

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

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：股/张）

总金额

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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：股/张）

总金额

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

其他关联交易事项的说明

无。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券
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

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

002859

洁美科技

2017-03-24

2018-04-07

公开发行有锁定期

29.82

39.72

6,666

198,780.12

264,773.52

-

002860

星帅尔

2017-03-31

2018-04-12

公开发行有锁定期

19.81

26.13

7,980

158,083.80

208,517.40

-

002879

长缆科技

2017-06-05

2017-07-07

新股流通受限

18.02
18.02
1,313
23,660.26
23,660.26
-
002882
金龙羽
2017-06-15
2017-07-17
新股流通受限
6.20
6.20
2,966
18,389.20
18,389.20
-
300670
大烨智能
2017-06-26
2017-07-03
新股流通受限
10.93
10.93
1,259
13,760.87
13,760.87
-
300672
国科微
2017-06-30
2017-07-12
新股流通受限
8.48
8.48
1,257
10,659.36
10,659.36
-
300671
富满电子
2017-06-27
2017-07-05
新股流通受限

8.11

8.11

942

7,639.62

7,639.62

-

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（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

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

300075

数字政通

2017-06-29

临时停牌

20.94

2017-07-17

18.86

160,000

3,352,960.55

3,350,400.00

-

603238

诺邦股份

2017-05-15
重大事项停牌
29.38
2017-08-23
31.99
1,750
23,292.50
51,415.00

-
002856
美芝股份
2017-06-19
重大事项停牌
31.86
-
-
1,230
14,280.30
39,187.80
-

300582
英飞特
2017-06-05
重大事项停牌
18.92
2017-08-02
17.50
2,038
20,181.15
38,558.96
-

603501
韦尔股份
2017-06-05
重大事项停牌
20.15
-
-
1,657
11,632.14
33,388.55
-

期末债券正回购交易中作为抵押的债券
银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

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。

金融工具风险及管理

-

风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

A-1

0.00

0.00

A-1 以下

0.00

0.00
未评级
0.00
0.00
合计

-
-

注：注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券、一年期以内的资产支持证券等债券基金可投资的短期信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。信用等级按期末评级结果列示。

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

AAA

0.00

0.00

AAA 以下

10,130,000.00

44,392,052.16

其中低于 AA 以下

0.00

0.00

未评级

0.00

0.00

合计

10,130,000.00

44,392,052.16

注：注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金

融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

上年度末

2016-12-31

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1个月以内

3个月-1年

不计息

合计

资产

银行存款	
12,571,093.40	
-	
-	
12,571,093.40	
结算备付金	
219,799.18	
-	
-	
219,799.18	
存出保证金	
268,967.28	
-	
-	
268,967.28	
交易性金融资产	
10,130,000.00	
-	
118,040,618.13	
128,170,618.13	
应收证券清算款	
-	
-	
9,511,168.11	
9,511,168.11	
应收利息	
-	
-	
32,490.33	
32,490.33	
应收申购款	
-	
-	
18,732.90	
18,732.90	
其他资产	
-	
-	
-	
-	
资产总计	
23,189,859.86	
-	
127,603,009.47	

150,792,869.33
负债
应付赎回款
-
-
421,923.98
421,923.98
应付管理人报酬
-
-
182,498.07
182,498.07
应付托管费
-
-
30,416.36
30,416.36
应付交易费用
-
-
182,774.84
182,774.84
其他负债
-
-
124,980.41
124,980.41
负债总计
-
-
942,593.66
942,593.66
利率敏感度缺口
23,189,859.86
-
126,660,415.81
149,850,275.67
上年度末
2016-12-31
1 个月以内
3 个月-1 年
不计息
合计
资产

银行存款	
13,942,268.28	
-	
-	
13,942,268.28	
结算备付金	
655,080.41	
-	
-	
655,080.41	
存出保证金	
467,345.26	
-	
-	
467,345.26	
交易性金融资产	
18,292,500.00	
26,099,552.16	
238,238,217.99	
282,630,270.15	
应收证券清算款	
-	
-	
9,863,970.81	
9,863,970.81	
应收利息	
-	
-	
63,644.04	
63,644.04	
应收申购款	
-	
-	
133,386.77	
133,386.77	
其他资产	
-	
-	
-	
-	
资产总计	
33,357,193.95	
26,099,552.16	
248,299,219.61	

307,755,965.72

负债

应付赎回款

-

-

108,565.24

108,565.24

应付管理人报酬

-

-

402,675.46

402,675.46

应付托管费

-

-

67,112.61

67,112.61

应付交易费用

-

-

409,312.76

409,312.76

其他负债

-

-

275,400.62

275,400.62

负债总计

-

-

1,263,066.69

1,263,066.69

利率敏感度缺口

33,357,193.95

26,099,552.16

247,036,152.92

306,492,899.03

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

利率风险的敏感性分析

假设

除利率外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
 2017-06-30
 上年度末
 2016-06-30
 市场利率下降 25 基点
 123,079.50
 593,993.40
 市场利率上升 25 基点
 -123,079.50
 -584,615.58
 外汇风险
 -
 外汇风险敞口
 单位：人民币元
 项目
 本期末
 2017-06-30
 美元折合人民币
 港币折合人民币
 其他币种折合人民币
 合计
 以外币计价的资产
 资产合计
 -
 -
 -
 -
 以外币计价的负债
 负债合计
 -
 -
 -
 -
 资产负债表外汇风险敞口净额
 -
 -
 -
 -
 项目
 上期末
 2016-06-30
 美元折合人民币
 港币折合人民币
 其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

外汇风险的敏感性分析

假设

-

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

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	
118,040,618.13	
78.77	
238,238,217.99	
77.73	
交易性金融资产—基金投资	
-	
-	
-	
-	
交易性金融资产—债券投资	
10,130,000.00	
6.76	
44,392,052.16	
14.48	
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	
128,170,618.13	
85.53	
282,630,270.15	
92.21	
其他价格风险的敏感性分析	
假设	
除沪深 300 指数外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	
2017-06-30	

上年度末
 2016-12-31
 沪深 300 指数上升 5%
 4,123,045.64
 11,333,212.59
 沪深 300 指数下降 5%
 -4,123,045.64
 -11,333,212.59
 采用风险价值法管理风险
 -
 假设
 95%
 1 年
 分析
 风险价值（金额单位：人民币元）
 本期末
 2017-06-30
 上年度末
 2016-12-31
 合计
 30,214,080.62
 42,416,884.61
 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
 无
 期末基金资产组合情况
 金额单位：人民币元
 序号
 项目
 金额（元）
 占基金总资产的比例（%）
 1
 权益类投资
 118,040,618.13
 78.28
 其中：股票
 118,040,618.13
 78.28
 2
 固定收益投资
 10,130,000.00
 6.72
 其中：债券
 10,130,000.00
 6.72

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	12,790,892.58
	8.48
7	
其他各项资产	9,831,358.62
	6.52
8	
合计	150,792,869.33
	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.12.3 期末其他各项资产构成。

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

代码

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

-

-

B

采矿业

2,338,529.00

1.56

C

制造业

67,739,494.48

45.20

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

3,138,800.00

2.09

E

建筑业

5,227,056.16

3.49

F

批发和零售业

15,438,269.60

10.30

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

10,843,248.72

7.24

J

金融业

86,614.92

0.06

K

房地产业

4,029,600.00

2.69

L

租赁和商务服务业

41,847.12

0.03

M

科学研究和技术服务业

1,558.20

0.00

N

水利、环境和公共设施管理业

5,930,210.22

3.96

O

居民服务、修理和其他服务业

-

-

P

教育

3,220,500.00

2.15

Q

卫生和社会工作

-

-

R

文化、体育和娱乐业

4,889.71

0.00

S

综合

-

-

合计

118,040,618.13

78.77

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别

公允价值（人民币）

占基金资产净值比例（%）

A 基础材料

-

-

B 消费者非必需品

-

-

C 消费者常用品

-

-

D 能源

-

-

E 金融

-

-

F 医疗保健

-

-

G 工业

-

-

H 信息技术

-

-

I 电信服务

-

-

J 公用事业

-

-

注：注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

数量（股）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

603939

益丰药房

458,000

15,434,600.00

10.30

2

002665

首航节能

1,600,000

11,520,000.00

7.69

3

600750

江中药业

287,500

9,990,625.00

6.67

4

000597

东北制药

729,920

8,160,505.60

5.45

5

000823

超声电子

500,000

7,210,000.00

4.81

6

603588

高能环境

380,000

5,928,000.00

3.96

7

300567

精测电子

64,100

5,123,513.00

3.42

8

002325

洪涛股份

700,000

5,110,000.00

3.41

9

002466

天齐锂业

79,936

4,344,521.60

2.90

10

002439

启明星辰

224,489

4,175,495.40

2.79

11
300346
南大光电
183,200
4,171,464.00
2.78
12
600967
内蒙一机
300,000
4,089,000.00
2.73
13
600340
华夏幸福
120,000
4,029,600.00
2.69
14
300446
乐凯新材
100,000
3,407,000.00
2.27
15
300075
数字政通
160,000
3,350,400.00
2.24
16
002460
赣锋锂业
70,000
3,237,500.00
2.16
17
300113
顺网科技
120,000
3,228,000.00
2.15
18
600661

新南洋
150,000
3,220,500.00
2.15
19
600116
三峡水利
280,000
3,138,800.00
2.09
20
002229
鸿博股份
240,000
2,688,000.00
1.79
21
601168
西部矿业
304,100
2,338,529.00
1.56
22
603986
兆易创新
28,836
2,243,729.16
1.50
23
002859
洁美科技
6,666
264,773.52
0.18
24
002860
星帅尔
7,980
208,517.40
0.14
25
601878
浙商证券
5,092

86,614.92
0.06
26
603186
华正新材
1,874
80,150.98
0.05
27
002880
卫光生物
998
75,548.60
0.05
28
603179
新泉股份
1,495
65,645.45
0.04
29
300600
瑞特股份
1,124
62,606.80
0.04
30
603628
清源股份
2,581
57,556.30
0.04
31
603239
浙江仙通
2,160
56,224.80
0.04
32
603197
保隆科技
999
52,996.95
0.04

33
002846
英联股份
1,492
51,921.60
0.03
34
002850
科达利
570
51,750.30
0.03
35
603238
诺邦股份
1,750
51,415.00
0.03
36
300588
熙菱信息
1,380
48,010.20
0.03
37
300666
江丰电子
2,276
43,448.84
0.03
38
300662
科锐国际
1,656
41,847.12
0.03
39
603228
景旺电子
842
40,626.50
0.03
40
002856

美芝股份
1,230
39,187.80
0.03
41
603316
诚邦股份
1,824
38,778.24
0.03
42
300582
英飞特
2,038
38,558.96
0.03
43
300606
金太阳
1,228
38,080.28
0.03
44
603388
元成股份
892
33,512.44
0.02
45
603501
韦尔股份
1,657
33,388.55
0.02
46
603488
展鹏科技
1,837
32,074.02
0.02
47
300663
科蓝软件
1,293

30,812.19
0.02
48
603326
我乐家居
1,089
30,459.33
0.02
49
002879
长缆科技
1,313
23,660.26
0.02
50
002881
美格智能
989
22,608.54
0.02
51
002882
金龙羽
2,966
18,389.20
0.01
52
300669
沪宁股份
841
14,650.22
0.01
53
300670
大烨智能
1,259
13,760.87
0.01
54
300672
国科微
1,257
10,659.36
0.01

55
300616
尚品宅配
57
7,726.92
0.01
56
300671
富满电子
942
7,639.62
0.01
57
002841
视源股份
90
6,679.80
0.00
58
300623
捷捷微电
85
5,712.00
0.00
59
603165
荣晟环保
67
4,445.45
0.00
60
603665
康隆达
85
3,412.75
0.00
61
300610
晨化股份
144
3,379.68
0.00
62
300630

普利制药

88

3,176.80

0.00

63

603303

得邦照明

94

3,138.66

0.00

64

300620

光库科技

86

2,973.88

0.00

65

603096

新经典

70

2,966.60

0.00

66

603225

新凤鸣

79

2,858.22

0.00

67

603926

铁流股份

82

2,782.26

0.00

68

300625

三雄极光

82

2,689.60

0.00

69

002849

威星智能

60

2,562.00
0.00
70
603819
神力股份
98
2,479.40
0.00
71
603042
华脉科技
86
2,444.12
0.00
72
300622
博士眼镜
80
2,434.40
0.00
73
002869
金溢科技
55
2,392.50
0.00
74
002866
传艺科技
88
2,369.84
0.00
75
002843
泰嘉股份
77
2,291.52
0.00
76
603113
金能科技
96
2,238.72
0.00

77
603955
大千生态
50
2,234.00
0.00
78
300589
江龙船艇
89
2,185.84
0.00
79
603050
科林电气
56
2,181.76
0.00
80
603266
天龙股份
62
2,098.70
0.00
81
603929
亚翔集成
93
2,094.36
0.00
82
002875
安奈儿
58
2,079.30
0.00
83
603320
迪贝电气
58
2,062.48
0.00
84
603811

诚意药业

53

1,997.57

0.00

85

603035

常熟汽饰

96

1,938.24

0.00

86

300592

华凯创意

83

1,923.11

0.00

87

603578

三星新材

42

1,918.14

0.00

88

603630

拉芳家化

51

1,898.22

0.00

89

603826

坤彩科技

99

1,787.94

0.00

90

300591

万里马

126

1,726.20

0.00

91

002826

易明医药

81

1,696.14
0.00
92
300635
达安股份
49
1,558.20
0.00
93
603081
大丰实业
82
1,556.36
0.00
94
300641
正丹股份
80
1,544.00
0.00
95
002870
香山股份
46
1,543.30
0.00
96
603177
德创环保
79
1,505.74
0.00
97
002827
高争民爆
59
1,421.90
0.00
98
603196
日播时尚
83
1,302.27
0.00

99
300609
汇纳科技
37
1,267.99
0.00
100
300621
维业股份
58
1,249.32
0.00
101
002867
周大生
40
1,235.20
0.00
102
300603
立昂技术
34
1,114.52
0.00
103
300647
超频三
44
1,082.40
0.00
104
603041
美思德
34
1,030.54
0.00
105
603313
梦百合
32
1,026.56
0.00
106
300587

天铁股份

38

1,019.16

0.00

107

300657

弘信电子

21

989.10

0.00

108

002868

绿康生化

34

988.38

0.00

109

603787

新日股份

49

958.93

0.00

110

300658

延江股份

22

854.26

0.00

111

601882

海天精工

48

834.24

0.00

112

603229

奥翔药业

40

792.80

0.00

113

002863

今飞凯达

49

791.84
0.00
114
300537
广信材料
38
783.56
0.00
115
603797
联泰环保
37
704.48
0.00
116
300514
友讯达
24
645.36
0.00
117
002774
快意电梯
41
574.00
0.00
118
300605
恒锋信息
16
508.80
0.00
119
300593
新雷能
19
501.41
0.00
120
300633
开立医疗
24
446.88
0.00

121
603728
鸣志电器
19
443.27
0.00
122
603855
华荣股份
28
428.96
0.00
123
603920
世运电路
19
425.98
0.00
124
300643
万通智控
26
425.62
0.00
125
300596
利安隆
19
409.64
0.00
126
603906
龙蟠科技
16
361.12
0.00
127
002840
华统股份
14
356.58
0.00
128
002851

麦格米特

8

318.96

0.00

129

603668

天马科技

21

309.54

0.00

130

300637

扬帆新材

12

279.84

0.00

131

300626

华瑞股份

8

232.72

0.00

132

603639

海利尔

3

159.36

0.00

报告期内股票投资组合的重大变动

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

600570

恒生电子

11,016,898.19

3.59

2

600750

江中药业

10,108,873.57

3.30

3

600498

烽火通信

9,088,334.00

2.97

4

600820

隧道股份

8,902,931.88

2.90

5

000423

东阿阿胶

8,222,164.92

2.68

6

002466

天齐锂业

7,973,416.92

2.60

7

000597

东北制药

7,761,078.90

2.53

8

603588

高能环境

7,637,510.72

2.49

9

000915

山大华特

7,131,219.10

2.33

10

002325

洪涛股份

6,900,248.14

2.25

11

600392

盛和资源
6,817,310.93
2.22
12
600889
南京化纤
6,793,846.00
2.22
13
000997
新大陆
6,159,798.00
2.01
14
300567
精测电子
5,477,654.00
1.79
15
300346
南大光电
5,350,888.00
1.75
16
600651
飞乐音响
5,336,982.05
1.74
17
002140
东华科技
5,272,504.00
1.72
18
300446
乐凯新材
4,673,457.11
1.52
19
600884
杉杉股份
4,313,905.00
1.41
20

600340

华夏幸福

4,166,230.96

1.36

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。

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

600110

诺德股份

26,815,283.76

8.75

2

002519

银河电子

16,296,699.12

5.32

3

600498

烽火通信

16,167,277.63

5.27

4

000823

超声电子

15,542,803.59

5.07

5

002281

光迅科技

14,315,787.88

4.67

6

600661

新南洋

14,246,735.70

4.65

7

603883
老百姓
12,557,588.89
4.10
8
000426
兴业矿业
12,453,814.88
4.06
9
002466
天齐锂业
11,241,791.86
3.67
10
600570
恒生电子
10,916,046.16
3.56
11
600068
葛洲坝
10,871,878.56
3.55
12
300446
乐凯新材
10,087,208.00
3.29
13
600820
隧道股份
9,002,323.44
2.94
14
000752
西藏发展
8,507,043.01
2.78
15
000423
东阿阿胶
8,403,446.15
2.74

16
001979
招商蛇口
8,340,106.00
2.72
17
603939
益丰药房
8,260,989.75
2.70
18
300183
东软载波
7,775,248.32
2.54
19
000915
山大华特
7,725,968.90
2.52
20
300369
绿盟科技
7,226,228.85
2.36
21
300354
东华测试
7,216,819.65
2.35
22
600392
盛和资源
6,909,549.71
2.25

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。

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

202,439,301.73

卖出股票收入（成交）总额

322,619,776.32

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖

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。买入包括新股、配股、
债转股及行权等获得的股票。

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）

10,130,000.00

6.76

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

10,130,000.00

6.76

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（元）

占基金资产净值比例（%）

1

128013

洪涛转债

100,000

10,130,000.00

6.76

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值

公允价值变动

风险说明

公允价值变动总额合计

-

股指期货投资本期收益

-
股指期货投资本期公允价值变动

-
注：本基金本报告期末未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

-
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

-
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持有国债期货。

本期国债期货投资评价

-
投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

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

268,967.28

2

应收证券清算款

9,511,168.11

3

应收股利

-
4
应收利息
32,490.33
5
应收申购款
18,732.90
6
其他应收款
-
7
待摊费用
-
8
其他
-
9
合计
9,831,358.62

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（%）
----	------	------	------	--------------

1	128013	洪涛转债	10,130,000.00	6.76
---	--------	------	---------------	------

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

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

5,431

27,087.97

74,591,798.59

50.70 %

72,522,977.02

49.30 %

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

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

58,247.50

0.0396 %

期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目

持有基金份额总量的数量区间（万份）

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金

0~10

本基金基金经理持有本开放式基金

0~10

发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-

-%

-

-%

-

基金管理人高级管理人员

-

-%

-

-%

-

基金经理等人员

-

-%

-

-%

-

基金管理人股东

-

-%

-

-%

-

其他

-

-%

-

-%

-

合计

-

-%

-

-%

-

开放式基金份额变动

单位：份

项目

数值

基金合同生效日（2009-07-15）的基金份额总额

679,121,902.68

本报告期期初基金份额总额

295,086,231.43

本报告期期间基金总申购份额

12,960,159.87

减：本报告期期间基金总赎回份额

160,931,615.69

本报告期期间基金拆分变动份额

-

本报告期期末基金份额总额

147,114,775.61

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。

基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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、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，增聘姚姣姣女士为华富货币市场基金基金经理。

2、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，增聘姚姣姣女士为华富恒稳纯债债券型证券投资基金基金经理。

3、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，增聘姚姣姣女士为华富天益货币市场基金基金经理。

4、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，王翔先生不再担任华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理的职务。

5、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，增聘陈启明先生为华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理。

6、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，增聘姚姣姣女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

7、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，刘文正先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

8、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，刘文正先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

9、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，增聘高靖瑜女士为华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

10、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，翁海波先生不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

11、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，增聘高靖瑜女士为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

12、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，翁海波先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

13、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，增聘龚炜先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

14、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，增聘龚炜先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

15、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，增聘翁海波先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

16、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，增聘龚炜先生为华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

17、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，增聘翁海波先生为华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

18、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

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

成交金额

占当期基金成交总额的比例

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

佣金

占当期佣金总量的比例

中泰证券

1

170,264,939.29

32.65 %

-

-%

22,487,244.20

33.75 %

-

-%

-

-%

155,196.86

32.56 %

-

中投证券

1

122,471,263.61

23.49 %

-
-%
8,665,946.18
13.01 %
-
-%
-
-%
111,607.41
23.41 %
-
天风证券
2
73,746,826.47
14.14 %
-
-%
-
-%
-
-%
-
-%
67,205.36
14.10 %
-
华安证券
2
68,472,554.45
13.13 %
-
-%
19,249,914.30
28.89 %
-
-%
-
-%
62,939.42
13.20 %
-
光大证券
1
22,845,120.38

4.38 %

-

-%

6,823,636.40

10.24 %

-

-%

-

-%

21,275.50

4.46 %

-

海通证券

1

21,625,068.32

4.15 %

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

19,707.12

4.13 %

-

国泰君安证券

1

18,745,242.06

3.59 %

-

-%

9,396,511.80

14.10 %

-

-%

-

-%

17,457.35

3.66 %

-

民生证券

1

13,840,158.38

2.65 %

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

12,612.35

2.65 %

-

川财证券

1

5,458,562.29

1.05 %

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

4,974.36

1.04 %

-

民族证券

1

3,959,665.86

0.76 %

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

3,687.60

0.77 %

-

国海证券

1

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

国信证券

2

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

浙商证券

1

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

申银万国

1

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

-%

-

注：注：1)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），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在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券商租用了基金专用交易单元。

2)本报告期本基金退租中国中投证券1个席位。。

3)此处的佣金指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券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。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。

其他重大事件

序号

公告事项

法定披露方式

法定披露日期

1

《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-01-19

2

《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费费率优惠的公告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-02-23

3

《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新及摘要（2017 年第 1 号）》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-02-28

4

《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海万得投资顾问有限公司为代销机构的公告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-03-08

5

《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告及摘要》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-03-29

6

《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-03-30

7

《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费费率优惠的公告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-04-22

8

《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告》

在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-04-24

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别

报告期内持有基金份额变化情况

报告期末持有基金情况

序号

持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间

期初份额

申购份额

赎回份额

持有份额

份额占比

机构

-

-

-

-

-

-

-

个人

-

-

-

-

-
-
-

产品特有风险

-

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

影响投资者决策的其他重要信息

无

备查文件目录

- 1、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

存放地点

基金管理人、基金托管人处

查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。