

华富中证 100 指数证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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
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
债券回购交易
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
期末按公允价值报告期末按行业分类的股票投资组合值占基金资产净值比例大小排序的所有
权益投资明细
报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合
报告期末积极投资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
期末指数投资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
积极投资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

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末积极投资前五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。

基金托管人交通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

华富中证 100 指数证券投资基金

基金简称

华富中证 100 指数

场内简称

基金主代码

410008

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2009-12-30

基金管理人

华富基金管理有限公司

基金托管人

交通银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

79,172,718.64

基金合同存续期

不定期

基金产品说明

投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资约束和数量化风险控制，力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%和年跟踪误差不超过 4%，以实现中证 100 指数的有效跟踪。

投资策略

本基金为被动式指数基金，本基金的标的指数为中证 100 指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略，即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。

业绩比较基准

中证 100 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×5%

风险收益特征

本基金属于股票型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下，其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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

交通银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

满志弘

陆志俊

联系电话

021-68886996

95559

电子邮箱

manzh@hffund.com

luzj@bankcomm.com

客户服务电话

400-700-8001

95559

传真

021-68887997

021-62701216

注册地址

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1000 号 31 层

上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址

上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层

上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码

200120

200120

法定代表人

章宏韬

牛锡明

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

2,231,746.23

本期利润

10,274,129.08

加权平均基金份额本期利润

0.1676

本期加权平均净值利润率

15.77 %

本期基金份额净值增长率

15.15 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

期末可供分配利润

12,373,494.65

期末可供分配基金份额利润

0.1563

期末基金资产净值

91,546,213.29

期末基金份额净值

1.1563

报告期末

报告期末(2017-06-30)

基金份额累计净值增长率

15.63 %

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) 期末可供分配利润指标的计算方法为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期末余额的孰低数，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

5.34 %

0.69 %

4.50 %

0.73 %

0.84 %

-0.04 %

过去三个月

10.65 %

0.61 %

9.27 %

0.62 %

1.38 %

-0.01 %

过去六个月

15.15 %

0.55 %

14.37 %

0.56 %

0.78 %

-0.01 %

过去一年

24.11 %

0.64 %

20.84 %

0.64 %

3.27 %

0.00 %

过去三年

83.16 %

1.68 %

77.19 %

1.65 %

5.97 %

0.03 %

自基金合同生效起至今

15.63 %

1.46 %

7.57 %

1.44 %

8.06 %

0.02 %

注：业绩比较基准收益率=中证 100 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×5%，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：根据基金合同的规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的 90%~95%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年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 12 月 30 日至 2010 年 6 月 30 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《华富中证 100 指数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 日在上海正式注册成立。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

朱蓓

华富中证 100 指数基金基金经理、华富量子生命力混合型基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理

2012-12-19

-

十年

上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历，曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理，2009 年 11 月进入华富基金管理有限公司，曾任金融工程研究员、产品设计经理。

注：任职日期为公司作出决定之日。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

今年以来，政策监管有所加强，对资本市场有显著影响。四月份以来，金融监管政策频繁出台，影子银行收缩明显，金融去杠杆初见成效。五月份以来，为了对冲年中各种流动性缺口，货币政策出现放松迹象。2017 年上半年，市场呈 N 型震荡，价值白马股表现好于成长股。沪深 300 指数上涨 10.78%，中小板指数上涨 7.33%。其中，表现最好的三个行业分别为家用电器、食品饮料、非银金融，表现最差的三个行业分别为农林牧渔、纺织服装、综合。

本基金是完全复制的指数基金，为投资者提供有效跟踪市场的投资工具，通过严格的投资约束和数量化风险控制，力争实现对业绩基准的有效跟踪。我们将恪守基金合同的规定，保持对基准的紧密跟踪，使投资者分享中国经济长期快速增长的成果。

报告期内基金的业绩表现

本基金于 2009 年 12 月 30 日正式成立。截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1563 元，累计基金份额净值为 1.1563 元。本基金本报告期份额净值增长率为 15.15%，

同期业绩比较基准收益率为 14.37%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年，前期对市场影响较大的监管及政策因素，将由“紧货币+严监管”逐渐转向“严监管+稳货币”。监管政策在一定程度上与杠杆变化密切相关，而杠杆变化与企业盈利有关，因此，严监管对 EPS 不利。同时，货币政策在很大程度上与无风险利率相关，进而对股票估值有显著影响，所以紧货币对 PE 不利。

6 月份市场整体虽然出现反弹，但热点扩散，成交低迷。市场整体资金净流出缩减，未来进一步缩减空间有限。上证 50 指数上行力度减弱，强势行业中家电、食品饮料呈加速上涨，银行上行减弱且资金转为净流出。下半年，我们对市场持谨慎态度，本基金将严格控制仓位，寻求更加均衡的配置结构。

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《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 10,274,129.08 元，期末可供分配利润为 12,373,494.65 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

从 2017 年 1 月 1 日起至本报告期中（2017 年 3 月 14 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于五千万元的情形，但是至本报告期期末（2017 年 6 月 30 日）基金资产净值已经高于 5000 万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年上半年度，基金托管人在华富中证 100 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年上半年度，华富基金管理有限公司在华富中证 100 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2017 年上半年度，由华富基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华富中证 100 指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

资产负债表

会计主体：华富中证 100 指数证券投资基金

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

86,384.01

1,014,538.72

结算备付金

435,199.58

1,041,250.61

存出保证金

21,972.65

1,550.02

交易性金融资产

89,577,426.48

31,049,599.25

其中：股票投资

84,496,119.68

31,049,599.25

基金投资

-

-

债券投资

5,081,306.80

-

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

5,600,000.00

-

应收证券清算款

84,596.57
-
应收利息
48,404.12
735.61
应收股利
-
-
应收申购款
109,287.08
10,015.75
递延所得税资产
-
-
其他资产
-
-
资产总计
95,963,270.49
33,117,689.96
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
4,010,000.00
-
应付证券清算款
225,226.99
-
应付赎回款
39,586.10
76,541.37

应付管理人报酬	
36,611.96	
14,270.23	
应付托管费	
10,983.59	
4,281.06	
应付销售服务费	
-	
-	
应付交易费用	
31,731.57	
5,420.17	
应交税费	
-	
-	
应付利息	
786.05	
-	
应付利润	
-	
-	
递延所得税负债	
-	
-	
其他负债	
62,130.94	
245,067.56	
负债合计	
4,417,057.20	
345,580.39	
所有者权益：	
-	
-	
实收基金	
79,172,718.64	
32,634,574.05	
未分配利润	
12,373,494.65	
137,535.52	
所有者权益合计	
91,546,213.29	
32,772,109.57	
负债和所有者权益总计	
95,963,270.49	

33,117,689.96

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1563 元，基金份额总额 79,172,718.64 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：华富中证 100 指数证券投资基金

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

10,666,092.62

-4,763,330.72

1.利息收入

73,404.25

17,770.82

其中：存款利息收入

14,891.16

14,916.62

 债券利息收入

31,198.98

-

 资产支持证券利息收入

-

-

 买入返售金融资产收入

27,314.11

2,854.20

 其他利息收入

-

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

2,548,298.07

588,965.80

其中：股票投资收益

1,789,704.26

254,868.80

 基金投资收益

-

-

 债券投资收益

1,977.22

-	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	-
756,616.59		
334,097.00		
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		
8,042,382.85		
-5,371,471.39		
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		
-		
-		
5.其他收入（损失以“-”号填列）		
2,007.45		
1,404.05		
减：二、费用		
391,963.54		
204,223.55		
1. 管理人报酬		
159,624.16		
82,021.84		
2. 托管费		
47,887.28		
24,606.59		
3. 销售服务费		
-		
-		
4. 交易费用		
102,572.09		
20,453.12		
5. 利息支出		
19,844.75		
-		
其中：卖出回购金融资产支出		
19,844.75		
-		
6. 其他费用		

62,035.26

77,142.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

10,274,129.08

-4,967,554.27

减：所得税费用

-

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

10,274,129.08

-4,967,554.27

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：华富中证 100 指数证券投资基金

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）

35,773,530.60

-2,444,601.77

33,328,928.83

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

10,274,129.08

10,274,129.08

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）

46,538,144.59

1,961,830.05

48,499,974.64

其中：1.基金申购款

50,751,719.43

2,289,866.12

53,041,585.55

2.基金赎回款

-4,213,574.84

-328,036.07

-4,541,610.91

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）

79,172,718.64

12,373,494.65

91,546,213.29

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）

35,990,591.38

2,503,869.75

38,494,461.13

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

-4,967,554.27

-4,967,554.27

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）

-217,060.78

19,082.75

-197,978.03

其中：1.基金申购款

2,996,496.90

-227,349.42

2,769,147.48

2.基金赎回款

-3,213,557.68

246,432.17

-2,967,125.51

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）

35,773,530.60

-2,444,601.77

33,328,928.83

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

华富中证 100 指数型证券投资基金（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】1158 号）核准，基金合同于 2009 年 12 月 30 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》（天健光华验（2009）综字第 070007 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。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，基金托管人为交通银行股份有限公司。根据《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》的规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。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

86,384.01

-

定期存款

-

-

其中：存款期限1-3个月

-

-

其他存款

-

-

合计

86,384.01

1,014,538.72

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

73,887,638.89

84,496,119.68

10,608,480.79

贵金属投资-金交所黄金合约

-

-

-

债券

交易所市场

5,086,775.52

5,081,306.80

-5,468.72

银行间市场

-

-

-

合计

5,086,775.52

5,081,306.80

-5,468.72

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

78,974,414.41

89,577,426.48

10,603,012.07

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

买入返售证券

5,600,000.00

-

合计

5,600,000.00

-

项目

上年度末

2016-12-31

账面余额

其中：买断式逆回购

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：本基金本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

12.25

-

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
204.17
-
应收债券利息
35,616.10
-
应收买入返售证券利息
12,561.58
-
应收申购款利息
0.12
-
应收黄金合约拆借孳息
-
-
其他
9.90
-
合计
48,404.12
735.61

注：本表列示的其他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
31,731.57
-
银行间市场应付交易费用
-
-
合计
31,731.57
5,420.17

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
145.68
-

预提信息披露费
42,149.47
-

预提审计费
19,835.79
-

合计
62,130.94
245,067.56

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
32,634,574.05
32,634,574.05

本期申购

50,751,719.43

50,751,719.43

本期赎回（以“-”号填列）

-4,213,574.84

-4,213,574.84

本期末

79,172,718.64

79,172,718.64

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

5,351,724.63

-5,214,189.11

137,535.52

本期利润

2,231,746.23

8,042,382.85

10,274,129.08

本期基金份额交易产生的变动数

7,716,083.43

-5,754,253.38

1,961,830.05

其中：基金申购款

8,468,102.08

-6,178,235.96

2,289,866.12

基金赎回款

-752,018.65

423,982.58

-328,036.07

本期已分配利润

-

-

-

本期末

15,299,554.29

-2,926,059.64

12,373,494.65

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

6,937.33

-

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

7,872.21

-

其他

81.62

-

合计

14,891.16

14,916.62

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

19,417,358.15

-

减：卖出股票成本总额

17,627,653.89

-

买卖股票差价收入

1,789,704.26

-

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

1,977.22

-

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

1,977.22

-

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

5,323,711.95

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

5,218,440.78

-

减：应收利息总额

103,293.95

-

买卖债券差价收入

1,977.22

-

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：本基金本报告期内无衍生工具收益。

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

756,616.59

-

基金投资产生的股利收益

-

-

合计

756,616.59

334,097.00

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

8,042,382.85

-

——股票投资

8,047,851.57

-

——债券投资

-5,468.72

-

——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

8,042,382.85

-5,371,471.39

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

1,884.64

-

转换费收入

122.81

-

合计

2,007.45

1,404.05

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

102,572.09

-

银行间市场交易费用

-

-

合计

102,572.09

20,453.12

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

19,835.79

-

信息披露费

42,149.47

-

银行汇划费用

50.00

-

合计

62,035.26

77,142.00

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

交通银行股份有限公司

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
56,046,763.91
68.44 %
9,383,748.94
68.92 %

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
4,299,434.80
37.77 %
-
-%

注：本基金上年度可比期间内无通过关联方交易单元发生的债券交易。

债券回购交易
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
58,400,000.00
56.02 %
10,400,000.00
100.00 %

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：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元发生的权证交易。

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

52,196.24

68.91 %

17,501.44

55.15 %

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

华安证券

8,739.20

69.38 %

1,875.01

68.50 %

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

159,624.16

82,021.84

其中：支付销售机构的客户维护费

27,680.51

27,687.14

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%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

47,887.28

24,606.59

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%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：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（2009-12-30）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：本基金本报告期内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：本基金本报告期和上年度可比期间内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

交通银行股份有限公司

86,384.01

6,937.33

215,374.37

1,596.22

注：1)本表仅列示活期存款余额及产生利息。

2) 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。本期末和上年度末的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

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

603933

睿能科技

2017-06-28

2017-07-06

新股流通受限

20.20

20.20

857

17,311.40

17,311.40

-

603305

旭升股份

2017-06-30

2017-07-10

新股流通受限

11.26

11.26

1,351

15,212.26

15,212.26

-

603331

百达精工

2017-06-27

2017-07-05

新股流通受限

9.63

9.63

999

9,620.37

9,620.37

-

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

600050

中国联通

2017-04-05

重大事项停牌

7.47

2017-08-21

8.22

106,383

632,092.04

794,681.01

-

601989

中国重工

2017-05-31

重大事项停牌

6.21

-

-

119,004

885,206.10

739,014.84

-

601088

中国神华

2017-06-05

重大事项停牌

22.29

-

-

25,201

569,041.59

561,730.29

-
600795
国电电力
2017-06-05
重大事项停牌
3.60
-
-
153,323
485,747.50
551,962.80
-
300104
乐视网
2017-04-17
重大事项停牌
30.68
-
-
15,294
624,705.38
469,219.92
-
002252
上海莱士
2017-04-21
重大事项停牌
20.24
-
-
12,780
243,686.84
258,667.20
-
601727
上海电气
2017-06-22
重大事项停牌
7.57
2017-07-03
7.54
17,196
194,607.40
130,173.72

-

600485

信威集团

2016-12-26

重大事项停牌

14.59

-

-

7,924

217,414.82

115,611.16

-

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

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 4,010,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日、2017 年 7 月 17 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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公司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

0.00

0.00

其中低于 AA 以下

0.00

0.00

未评级

0.00

0.00

合计

0.00

0.00

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

86,384.01

-

-

86,384.01

结算备付金

435,199.58

-

-

435,199.58

存出保证金

21,972.65

-

-

21,972.65

交易性金融资产

-

5,081,306.80

84,496,119.68

89,577,426.48

买入返售金融资产

5,600,000.00

-

-

5,600,000.00

应收证券清算款

-

-
84,596.57
84,596.57
应收利息
-
-
48,404.12
48,404.12
应收申购款
-
-
109,287.08
109,287.08
资产总计
6,143,556.24
5,081,306.80
84,738,407.45
95,963,270.49
负债
卖出回购金融资产款
4,010,000.00
-
-
4,010,000.00
应付证券清算款
-
-
225,226.99
225,226.99
应付赎回款
-
-
39,586.10
39,586.10
应付管理人报酬
-
-
36,611.96
36,611.96
应付托管费
-
-
10,983.59
10,983.59

应付交易费用
-
-
31,731.57
31,731.57
应付利息
-
-
786.05
786.05
其他负债
-
-
62,130.94
62,130.94
负债总计
4,010,000.00
-
407,057.20
4,417,057.20
利率敏感度缺口
2,133,556.24
5,081,306.80
84,331,350.25
91,546,213.29
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
1,014,538.72
-
-
1,014,538.72
结算备付金
1,041,250.61
-
-
1,041,250.61
存出保证金
1,550.02

-
-
1,550.02
交易性金融资产
-
-
31,049,599.25
31,049,599.25
应收利息
-
-
735.61
735.61
应收申购款
-
-
10,015.75
10,015.75
资产总计
2,057,339.35
-
31,060,350.61
33,117,689.96
负债
应付赎回款
-
-
76,541.37
76,541.37
应付管理人报酬
-
-
14,270.23
14,270.23
应付托管费
-
-
4,281.06
4,281.06
应付交易费用
-
-
5,420.17
5,420.17

其他负债

-

-

245,067.56

245,067.56

负债总计

-

-

345,580.39

345,580.39

利率敏感度缺口

2,057,339.35

-

30,714,770.22

32,772,109.57

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

9,792.15

0.00

市场利率上升 25 基点

-9,770.88

0.00

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

84,496,119.68

92.30

31,049,599.25

94.74

交易性金融资产—基金投资

-

-

-

-

交易性金融资产—债券投资

5,081,306.80

5.55

-

-

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

89,577,426.48

97.85

31,049,599.25

94.74

其他价格风险的敏感性分析

假设

除中证 100 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

中证 100 指数上升 5%

3,946,822.05

1,550,736.56

中证 100 指数下降 5%

-3,946,822.05

-1,550,736.56

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

12,549,717.14

1,604,645.96

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

84,496,119.68

88.05

其中：股票

84,496,119.68

88.05

2

固定收益投资

5,081,306.80

5.30

其中：债券

5,081,306.80

5.30

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

5,600,000.00

5.84

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

521,583.59

0.54

7
其他各项资产

264,260.42

0.28

8

合计

95,963,270.49

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

报告期末指数投资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

2,528,292.54

2.76

C

制造业

24,639,182.83

26.91

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

2,612,590.38

2.85

E

建筑业

4,471,553.25

4.88

F

批发和零售业

540,843.75

0.59

G

交通运输、仓储和邮政业

1,811,905.83

1.98

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

2,214,826.55

2.42

J

金融业

39,992,379.46

43.69

K

房地产业

4,610,787.06

5.04

L

租赁和商务服务业

105,952.00

0.12

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

422,791.62

0.46

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

307,196.19

0.34

S

综合

-

-

合计

84,258,301.46

92.04

注： 本基金本报告期指数投资部分含拟于 2017 年 7 月 1 日调入中证 100 指数的备选成分股，具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

报告期末积极投资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

-

-

C

制造业

237,818.22

0.26

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

-

-

F

批发和零售业

-

-

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

-

-

J

金融业

-

-

K

房地产业

-

-

L

租赁和商务服务业

-

-

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

-

-

O

居民服务、修理和其他服务业

-

-

P

教育

-

-

Q

卫生和社会工作

-

-

R

文化、体育和娱乐业

-

-

S

综合

-

-

合计

237,818.22

0.26

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：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

期末指数投资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

601318
中国平安
132,125
6,554,721.25
7.16

2

600036
招商银行
124,162
2,968,713.42
3.24

3

600519
贵州茅台
6,059
2,858,939.15
3.12

4

601166
兴业银行
150,115
2,530,938.90
2.76

5

000651
格力电器
60,121
2,475,181.57
2.70

6

600016
民生银行
284,723
2,340,423.06
2.56

7

600000
浦发银行
174,203

2,203,667.95

2.41

8

000002

万科A

87,478

2,184,325.66

2.39

9

000333

美的集团

49,015

2,109,605.60

2.30

10

601288

农业银行

574,311

2,021,574.72

2.21

11

601668

中国建筑

191,446

1,853,197.28

2.02

12

600030

中信证券

102,143

1,738,473.86

1.90

13

600887

伊利股份

78,245

1,689,309.55

1.85

14

600837

海通证券

105,276

1,563,348.60

1.71

15
601398
工商银行
277,464
1,456,686.00
1.59
16
601169
北京银行
154,816
1,419,662.72
1.55
17
601601
中国太保
40,641
1,376,510.67
1.50
18
600104
上汽集团
44,087
1,368,901.35
1.50
19
601988
中国银行
368,821
1,364,637.70
1.49
20
000858
五粮液
24,382
1,357,102.12
1.48
21
600900
长江电力
84,902
1,305,792.76
1.43
22
000725

京东方 A
307,266
1,278,226.56
1.40
23
601766
中国中车
125,634
1,271,416.08
1.39
24
002415
海康威视
38,127
1,231,502.10
1.35
25
601211
国泰君安
59,400
1,218,294.00
1.33
26
601818
光大银行
287,451
1,164,176.55
1.27
27
600276
恒瑞医药
21,565
1,090,973.35
1.19
28
000001
平安银行
110,000
1,032,900.00
1.13
29
600048
保利地产
91,720

914,448.40

1.00

30

600518

康美药业

38,254

831,641.96

0.91

31

601390

中国中铁

95,693

829,658.31

0.91

32

600028

中国石化

136,303

808,276.79

0.88

33

600050

中国联通

106,383

794,681.01

0.87

34

600019

宝钢股份

115,909

777,749.39

0.85

35

600015

华夏银行

82,855

763,923.10

0.83

36

601688

华泰证券

42,080

753,232.00

0.82

37
601989
中国重工
119,004
739,014.84
0.81
38
601186
中国铁建
59,265
712,957.95
0.78
39
000063
中兴通讯
29,688
704,793.12
0.77
40
002304
洋河股份
7,643
663,488.83
0.72
41
001979
招商蛇口
30,800
657,888.00
0.72
42
000776
广发证券
37,282
643,114.50
0.70
43
601006
大秦铁路
76,504
641,868.56
0.70
44
000538

云南白药
6,628
622,037.80
0.68
45
600690
青岛海尔
39,435
593,496.75
0.65
46
600585
海螺水泥
26,028
591,616.44
0.65
47
601628
中国人寿
21,357
576,211.86
0.63
48
601088
中国神华
25,201
561,730.29
0.61
49
600958
东方证券
40,375
561,616.25
0.61
50
600795
国电电力
153,323
551,962.80
0.60
51
601336
新华保险
10,699

549,928.60

0.60

52

002024

苏宁云商

48,075

540,843.75

0.59

53

601901

方正证券

54,086

537,073.98

0.59

54

601009

南京银行

47,000

526,870.00

0.58

55

600999

招商证券

29,608

509,849.76

0.56

56

601899

紫金矿业

142,487

488,730.41

0.53

57

601857

中国石油

62,908

483,762.52

0.53

58

601939

建设银行

76,300

469,245.00

0.51

59
300104
乐视网
15,294
469,219.92
0.51
60
601985
中国核电
59,900
467,819.00
0.51
61
002142
宁波银行
23,700
457,410.00
0.50
62
000166
申万宏源
77,854
435,982.40
0.48
63
000069
华侨城 A
42,027
422,791.62
0.46
64
002736
国信证券
31,882
422,436.50
0.46
65
601669
中国电建
53,137
420,845.04
0.46
66
300059

东方财富
33,024
396,948.48
0.43
67
600010
包钢股份
177,945
389,699.55
0.43
68
600340
华夏幸福
11,500
386,170.00
0.42
69
601788
光大证券
25,313
377,923.09
0.41
70
600637
东方明珠
16,862
365,399.54
0.40
71
000625
长安汽车
25,293
364,725.06
0.40
72
002594
比亚迪
6,935
346,403.25
0.38
73
601618
中国中冶
68,959

345,484.59

0.38

74

601800

中国交建

19,472

309,410.08

0.34

75

002739

万达电影

6,027

307,196.19

0.34

76

000895

双汇发展

12,626

299,867.50

0.33

77

601018

宁波港

51,007

288,189.55

0.31

78

600023

浙能电力

52,567

287,015.82

0.31

79

002673

西部证券

19,430

276,294.60

0.30

80

600018

上港集团

42,158

267,281.72

0.29

81
600893
航发动力
9,784
267,103.20
0.29
82
600115
东方航空
38,300
260,440.00
0.28
83
002252
上海莱士
12,780
258,667.20
0.28
84
601198
东兴证券
14,400
248,256.00
0.27
85
601998
中信银行
39,418
247,939.22
0.27
86
601111
中国国航
25,416
247,806.00
0.27
87
600606
绿地控股
31,500
246,330.00
0.27
88
600061

国投安信
14,400
223,920.00
0.24
89
600663
陆家嘴
9,375
221,625.00
0.24
90
601633
长城汽车
15,947
211,935.63
0.23
91
002558
巨人网络
4,080
188,577.60
0.21
92
601225
陕西煤业
26,279
185,792.53
0.20
93
601229
上海银行
5,400
137,916.00
0.15
94
601881
中国银河
11,600
137,576.00
0.15
95
600919
江苏银行
14,400

133,776.00

0.15

96

601727

上海电气

17,196

130,173.72

0.14

97

600485

信威集团

7,924

115,611.16

0.13

98

002352

顺丰控股

2,000

106,320.00

0.12

99

002027

分众传媒

7,700

105,952.00

0.12

100

002797

第一创业

5,120

47,155.20

0.05

注：本基金本报告期指数投资部分含拟于 2017 年 7 月 1 日调入中证 100 指数的备选成分股，具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

期末积极投资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

603801

志邦股份

1,406

47,522.80

0.05

2

603380

易德龙

1,298

35,370.50

0.04

3

603043

广州酒家

1,267

32,017.09

0.03

4

603335

迪生力

2,230

24,864.50

0.03

5

603679

华体科技

809

21,438.50

0.02

6

603938

三孚股份

1,246

20,932.80

0.02

7

603933

睿能科技

857

17,311.40

0.02

8

603305

旭升股份

1,351

15,212.26

0.02

9

603286

日盈电子

890

13,528.00

0.01

10

603331

百达精工

999

9,620.37

0.01

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

000651

格力电器

3,579,251.00

10.92

2

601318

中国平安

3,127,757.00

9.54

3

000002

万科A

2,872,267.00

8.76

4

600519

贵州茅台

2,617,150.70

7.99

5

600690

青岛海尔
2,196,994.00
6.70
6
600048
保利地产
2,139,641.00
6.53
7
601166
兴业银行
1,687,056.00
5.15
8
000001
平安银行
1,627,101.00
4.96
9
600016
民生银行
1,593,126.00
4.86
10
600036
招商银行
1,531,644.00
4.67
11
000858
五粮液
1,505,223.26
4.59
12
601169
北京银行
1,453,461.00
4.44
13
600000
浦发银行
1,432,101.00
4.37
14

000333
美的集团
1,296,425.99
3.96
15
601288
农业银行
1,251,607.00
3.82
16
601688
华泰证券
1,033,892.00
3.15
17
600030
中信证券
997,024.00
3.04
18
601668
中国建筑
993,685.00
3.03
19
600837
海通证券
984,783.00
3.00
20
600015
华夏银行
961,418.00
2.93
21
000776
广发证券
942,793.10
2.88
22
600887
伊利股份
842,514.00
2.57

23
601988
中国银行
795,123.00
2.43
24
601766
中国中车
783,178.00
2.39
25
601818
光大银行
774,433.00
2.36
26
601398
工商银行
766,559.00
2.34
27
002142
宁波银行
702,963.00
2.15
28
600104
上汽集团
692,265.00
2.11
29
601211
国泰君安
675,672.00
2.06
30
601601
中国太保
660,292.00
2.01

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
000651
格力电器
2,643,941.99
8.07

2
600690
青岛海尔
1,863,447.00
5.69

3
000002
万科A
1,796,711.70
5.48

4
600048
保利地产
1,625,044.00
4.96

5
600519
贵州茅台
1,406,273.80
4.29

6
000001
平安银行
1,032,239.18
3.15

7
000858
五粮液
951,220.80
2.90

8
000776
广发证券
593,286.20

1.81
9
601688
华泰证券
590,640.00
1.80
10
601318
中国平安
535,663.00
1.63
11
601169
北京银行
498,220.00
1.52
12
600015
华夏银行
477,002.88
1.46
13
601377
兴业证券
442,555.00
1.35
14
000333
美的集团
430,550.68
1.31
15
600886
国投电力
394,435.89
1.20
16
601166
兴业银行
373,440.00
1.14
17
601600
中国铝业

370,042.53

1.13

18

600705

中航资本

359,936.12

1.10

19

600111

北方稀土

308,781.25

0.94

20

002142

宁波银行

271,670.00

0.83

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

63,026,322.75

卖出股票收入（成交）总额

19,417,358.15

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

5,081,306.80

5.55

其中：政策性金融债

5,081,306.80

5.55

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

5,081,306.80

5.55

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

108601

国开 1703

50,920

5,081,306.80

5.55

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。

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

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

21,972.65

2

应收证券清算款

84,596.57

3

应收股利

-

4

应收利息

48,404.12

5

应收申购款

109,287.08

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

264,260.42

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

期末指数投资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。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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

2,187

36,201.52

47,910,118.82

60.51 %

31,262,599.82

39.49 %

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

860.21

0.0011 %

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

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（2009-12-30）的基金份额总额

337,421,352.99

本报告期期初基金份额总额

32,634,574.05

本报告期期间基金总申购份额

50,751,719.43

减：本报告期期间基金总赎回份额

4,213,574.84

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

79,172,718.64

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

华安证券

2
56,046,763.91
68.44 %
-
-%
4,299,434.80
37.77 %
58,400,000.00
56.02 %
-
-%
52,196.24
68.91 %
-
国信证券
1
25,845,237.86
31.56 %
-
-%
7,084,199.50
62.23 %
45,841,000.00
43.98 %
-
-%
23,552.69
31.09 %
-

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)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。 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

《华富中证 100 指数证券投资基金 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

《华富中证 100 指数证券投资基金招募说明书更新及摘要（16 年 2 号）》
在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告

2017-02-11

3

《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

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

《华富中证 100 指数证券投资基金 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

《华富中证 100 指数证券投资基金 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

1

3.15-6.30

0.00

47,910,118.82

0.00

47,910,118.82

60.510000 %

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

无

影响投资者决策的其他重要信息

无

备查文件目录

- 1、《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富中证 100 指数型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富中证 100 指数型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富中证 100 指数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。