

华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告 摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：华融证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 10 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华融新锐混合
基金主代码	001068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日
基金管理人	华融证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	257,854,560.97 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险的前提下获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	本基金将采取积极主动的资产配置策略，注重风险与收益的平衡，选择适应经济转型升级、能够为股东持续创造价值的优质标的，运用多样化的投资策略实行组合管理，实现基金资产的长期增值。 1、资产配置策略 从全球经济格局和中国经济发展方式的变化，分析经济的驱动力和阶段性特征，结合宏观政策、产业政策、结构变迁、市场情绪等对比分析大类资产风险收益比，合理分配各大类资产配置比例，以实现基金资产的稳健增值。 2、股票投资策略 本基金的股票投资秉承价值投资理念，采取定量和定性相结合的方法，深挖符合经济升级转型、发展潜力巨大的行业与公司，通过上下游产业链的实地调研对研究逻辑和结论进行验证，灵活运用多种低风险投资策略，把握市场投资机会。 3、债券投资策略 本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上，灵活采用类属配置、个券选择、套利等投资策略。
业绩比较基准	1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%。
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		华融证券股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	肖琦	林葛
	联系电话	010-85556728	010-66060069
	电子邮箱	xiaoqio@hrsec.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-898-9999	95599
传真		010-85556592	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund.hrsec.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-38,594,432.16
本期利润	-29,511,427.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1088
本期基金份额净值增长率	-10.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1550
期末基金资产净值	230,033,309.02
期末基金份额净值	0.892

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

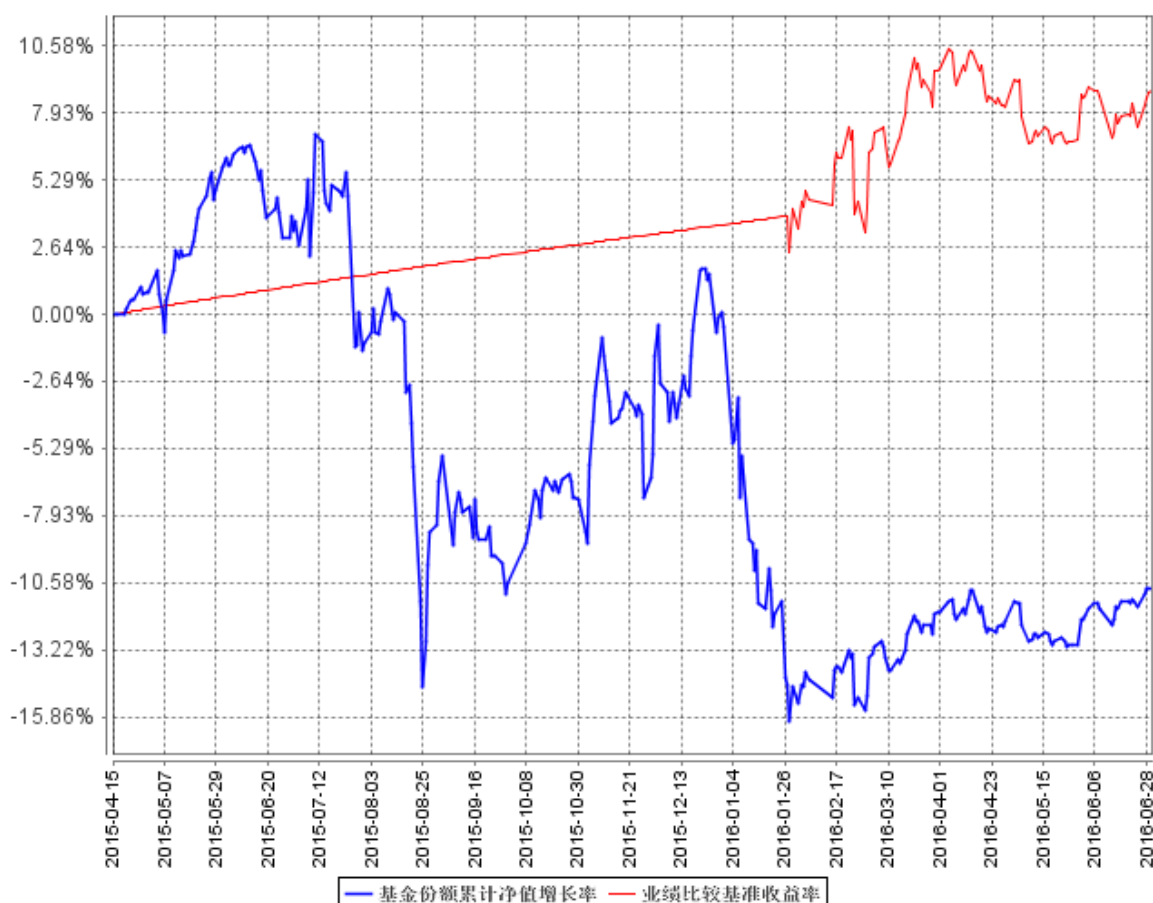
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.36%	0.29%	0.13%	0.49%	1.23%	-0.20%
过去三个月	1.02%	0.39%	-0.75%	0.51%	1.77%	-0.12%
过去六个月	-10.35%	0.98%	5.08%	0.65%	-15.43%	0.33%
过去一年	-14.15%	1.27%	7.60%	0.45%	-21.75%	0.82%
自基金合同 生效起至今	-10.80%	1.17%	8.80%	0.41%	-19.60%	0.76%

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：根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。为提高本基金业绩与业绩比较基准的可比性，公司自 2016 年 1 月 28 日起将本基金的业绩比较基准由原先的“1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%”变更为“沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%”。

§ 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

华融证券股份有限公司（以下简称“公司”）是经中国证监会批准，由中国华融资产管理股份有限公司（以下简称“中国华融”）作为主发起人，联合中国葛洲坝集团公司共同发起设立的全国性证券公司。2007 年 9 月，公司在北京正式挂牌成立。目前，公司注册资本 46.74 亿元，其中：中国华融出资 38.12 亿元，中国葛洲坝集团公司、中国葛洲坝集团股份有限公司、北京纽森特投资有限公司、九江和汇进出口有限公司、江苏德源纺织服饰有限公司、星星集团有限公司、浙江金财控股集团有限公司、广州南雅房地产开发有限公司、吉林昊融集团有限公司、深圳市科铭实业有限公司、北京双融福泰投资有限公司、张家港市中达针织服饰制造有限公司、等 12 家股东共出资 8.62 亿元。公司的注册地址：北京市西城区金融大街 8 号。

公司总部设在北京，下设深圳总部、上海总部，北京、上海、深圳、湖南、新疆、陕西、贵州、四川、江西、海南、浙江、山东、福建等 14 家分公司，63 家营业部，上海和深圳 2 家投行业务部，控股华融期货有限责任公司。公司紧紧依托中国华融在资产管理、银行、信托和金融租赁等方面的综合优势，可为客户提供证券经纪、融资融券、证券承销与保荐、与证券交易及证券投资活动有关的财务顾问、证券投资咨询、证券自营、证券资产管理、投资顾问等综合化的财富管理。公司 2011-2014 年连续四年被中国证监会评为 A 类 A 级券商，2015 年被中国证监会评为 A 类 AA 级券商，2014 年最佳资产管理券商，2009 年、2011 年两次获评为“首都文明单位”，2014 年获评“首都精神文明建设标兵单位”。

公司坚持以市场为导向，以客户为中心，以诚信、专业、稳健、共赢为经营宗旨，在社会各界和投资者的大力支持下，努力打造一家有尊严、有价值、有内涵、有实力、有责任的“五有”现代一流投资银行！

公司目前旗下管理基金产品 3 只，分别为华融现金增利货币市场基金、华融新锐灵活配置混合型证券投资基金和华融新利灵活配置混合型证券投资基金。

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		
范贵龙	本基金的基金	2015 年 4 月 15 日	-	10	范贵龙, 男, 汉族, 1981 年生, 武汉大学金融学硕士,

	经理				特许金融分析师(CFA), 金融风险管理师(FRM), 具备 9 年金融行业工作经验。2006 年就职于中国建设银行, 2009 年 6 月就职于华融证券市场研究部, 2013 年 8 月就职于华融证券资产管理二部、基金业务部。2015 年 4 月起任华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 9 月起任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	----	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，公司依照《公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影

响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

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 年上半年经济保持平稳，前期稳增长政策逐渐见效。物价随着猪肉和蔬菜价格的波动出现冲高回落态势，通胀预期有所缓解，利率经过一段时间的回升后也出现调整。

在美联储加息预期、英国脱欧、A 股纳入 MSCI、熔断机制等因素影响下，沪指在 1 月份快速下跌后，始终在 2800 点到 3100 点之间震荡整理。

本基金在报告期内根据市场变化积极调整仓位和配置结构，在市场债券价格调整之际，择机增加债券品种的配置，并积极参与新股和新债的申购增厚基金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.892 元，本报告期份额净值增长率为-10.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，我们认为，中国经济内生增长动力仍显不足，政策保持一定的支持力度，但货币政策放松的边际效果递减，稳增长将更多的依赖财政政策的扩张。下半年供给侧改革、国企改革等可以很好的平衡短期增长和长期改革的措施有望继续发力，但是随着改革的深入，其曲折性和复杂性也逐渐浮出水平。

股票市场在经历了 1 月份的单边下跌后，维持窄幅整理，期间结构性机会此起彼伏。下半年市场面临的宏观环境要好于上半年，但是仍需警惕“去杠杆”政策带来的潜在风险。

综合来看，2016 年下半年的股票市场可能维持震荡行情，在改革大幅推进之前，不存在大的趋势性机会，更多的在于自下而上的个股机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华融证券股份有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华融证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华融证券股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办

法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华融新锐灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		143,866,763.73	45,748,850.01
结算备付金		410,057.74	-
存出保证金		146,329.77	493,101.14
交易性金融资产		88,492,880.02	236,843,859.68
其中：股票投资		77,894,668.42	236,843,859.68
基金投资		-	-
债券投资		10,598,211.60	-
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		-	-
应收利息		59,142.10	7,795.61
应收股利		-	-
应收申购款		99.05	4,061.36
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		232,975,272.41	283,097,667.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
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		2,365,349.80	-
应付赎回款		98,238.82	502,816.18

应付管理人报酬		282,496.52	401,317.91
应付托管费		47,082.76	66,886.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		49,162.24	54,437.12
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		99,633.25	1,888.41
负债合计		2,941,963.39	1,027,345.93
所有者权益：			
实收基金		257,854,560.97	283,518,608.71
未分配利润		-27,821,251.95	-1,448,286.84
所有者权益合计		230,033,309.02	282,070,321.87
负债和所有者权益总计		232,975,272.41	283,097,667.80

6.2 利润表

会计主体：华融新锐灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-26,664,785.03	44,685,090.38
1.利息收入		586,667.09	3,232,245.93
其中：存款利息收入		404,669.79	2,784,343.72
债券利息收入		18,633.89	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		163,363.41	447,902.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-36,361,045.52	39,626,269.54
其中：股票投资收益		-36,516,371.14	39,257,729.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,948.13	-
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		153,377.49	368,540.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		9,083,004.57	1,000,757.49

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		26,588.83	825,817.42
减：二、费用		2,846,642.56	5,533,838.07
1. 管理人报酬		1,781,726.48	3,229,762.65
2. 托管费		296,954.39	538,293.78
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		659,143.63	1,758,355.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		108,818.06	7,425.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-29,511,427.59	39,151,252.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-29,511,427.59	39,151,252.31

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华融新锐灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	283,518,608.71	-1,448,286.84	282,070,321.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-29,511,427.59	-29,511,427.59
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）	-25,664,047.74	3,138,462.48	-22,525,585.26
其中：1.基金申购款	1,810,011.66	-180,916.23	1,629,095.43
2. 基金赎回款	-27,474,059.40	3,319,378.71	-24,154,680.69
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）	257,854,560.97	-27,821,251.95	230,033,309.02
项目	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	39,151,252.31	39,151,252.31
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)	797,832,534.21	-7,708,621.13	790,123,913.08
其中：1.基金申购款	1,010,330,838.42	10,057.87	1,010,340,896.29
2.基金赎回款	-212,498,304.21	-7,718,679.00	-220,216,983.21
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）	797,832,534.21	31,442,631.18	829,275,165.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

祝献忠	杨铭海	董维
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华融新锐灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 1 月 28 日经中国证监会（证监许可[2015]132 号文）核准，由华融证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具信会师报字[2015]第 722880 号验资报告。经向中国证监会备案，《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。截止 2015 年 4 月 13 日，本基金募集资金人民币

1,010,044,560.32 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 67,004.87 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 1,010,044,560.32 元,折合 1,010,044,560.32 份基金份额。本基金的基金管理人为华融证券股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、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相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 0%-95%投资于股票,本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)并参考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》的规定而编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

—

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置

试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华融证券股份有限公司	基金管理人、注册登记与过户机构、销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
中国华融资产管理股份有限公司	基金管理人的控股股东
华融天泽投资有限公司	基金管理人的控股子公司
华融期货有限责任公司	基金管理人的控股子公司

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日	
	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
华融证券	447,433,312.48	100.00%	1,948,013,866.18	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 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
华融证券	111,949.77	100.00%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 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
华融证券	1,377,700,000.00	100.00%	3,225,100,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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 总额的比例
华融证券	329,598.49	100.00%	48,987.24	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 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 总额的比例
华融证券	1,395,722.65	100.00%	1,395,722.65	100.00%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,781,726.48	3,229,762.65
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	296,954.39	538,293.78

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未产生销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金于本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

6.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 4 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国农业银行 活期存款	143,866,763.73	394,007.26	643,960,332.51	2,765,953.48
----------------	----------------	------------	----------------	--------------

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内未有其他关联交易事项的说明。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.10.1.1 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
601611	中国核建	2016 年 5 月 27 日	2016 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.47	20.92	5,848	20,292.56	122,340.16	-

6.4.9.2 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
000002	万科 A	-	临时停牌	18.20	-	-	1,009,991	14,108,340.54	18,381,836.20	-
000401	冀东水泥	2016 年 4 月 6 日	临时停牌	10.90	-	-	308,000	3,461,102.70	3,357,200.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	77,894,668.42	33.43
	其中：股票	77,894,668.42	33.43
2	固定收益投资	10,598,211.60	4.55
	其中：债券	10,598,211.60	4.55
	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	144,276,821.47	61.93
7	其他各项资产	205,570.92	0.09
8	合计	232,975,272.41	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	2,336,545.50	1.02
C	制造业	35,355,395.86	15.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	122,340.16	0.05
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	3,246,000.00	1.41
J	金融业	18,452,550.70	8.02
K	房地产业	18,381,836.20	7.99
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	77,894,668.42	33.86

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 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	000002	万科A	1,009,991	18,381,836.20	7.99
2	601398	工商银行	2,690,000	11,943,600.00	5.19
3	000858	五粮液	322,300	10,484,419.00	4.56
4	600276	恒瑞医药	118,440	4,750,628.40	2.07
5	000568	泸州老窖	127,000	3,771,900.00	1.64
6	600030	中信证券	209,100	3,393,693.00	1.48
7	000401	冀东水泥	308,000	3,357,200.00	1.46
8	600016	民生银行	331,400	2,959,402.00	1.29
9	002007	华兰生物	82,000	2,574,800.00	1.12
10	601012	隆基股份	187,000	2,440,350.00	1.06

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	9,407,415.41	3.34
2	600276	恒瑞医药	8,398,626.00	2.98
3	600409	三友化工	7,215,000.00	2.56
4	002007	华兰生物	6,871,860.88	2.44
5	002033	丽江旅游	5,754,390.68	2.04
6	000568	泸州老窖	5,429,740.00	1.92
7	300017	网宿科技	5,344,104.00	1.89
8	000860	顺鑫农业	5,327,368.36	1.89
9	600804	鹏博士	5,181,105.00	1.84
10	002601	佰利联	5,170,067.00	1.83
11	000625	长安汽车	5,065,430.00	1.80
12	601012	隆基股份	4,969,950.00	1.76
13	600309	万华化学	3,980,223.00	1.41
14	002281	光迅科技	3,861,708.00	1.37
15	000423	东阿阿胶	3,614,300.00	1.28
16	600176	中国玻纤	3,256,580.00	1.15
17	603308	应流股份	3,113,441.00	1.10
18	002501	利源精制	2,833,600.00	1.00
19	600674	川投能源	2,833,500.00	1.00
20	600694	大商股份	2,633,308.00	0.93

7.4.2 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	601939	建设银行	16,863,100.00	5.98
2	601006	大秦铁路	14,039,129.26	4.98
3	600036	招商银行	12,870,028.59	4.56
4	601166	兴业银行	11,628,083.00	4.12

5	600028	中国石化	10,993,834.40	3.90
6	601988	中国银行	10,641,638.00	3.77
7	002142	宁波银行	9,302,714.91	3.30
8	601601	中国太保	8,638,658.40	3.06
9	601328	交通银行	7,554,041.00	2.68
10	600409	三友化工	7,223,768.62	2.56
11	601398	工商银行	7,067,285.00	2.51
12	000858	五粮液	6,968,242.80	2.47
13	600660	福耀玻璃	6,539,902.20	2.32
14	600267	海正药业	5,892,024.00	2.09
15	002033	丽江旅游	5,658,782.87	2.01
16	002601	佰利联	5,529,514.66	1.96
17	000726	鲁泰A	5,526,061.00	1.96
18	600000	浦发银行	5,463,882.00	1.94
19	600804	鹏博士	5,025,656.00	1.78
20	000860	顺鑫农业	4,970,557.94	1.76

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	158,261,354.03
卖出股票收入（成交）总额	289,677,697.12

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,994,000.00	4.34
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）	604,211.60	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,598,211.60	4.61

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160011	16 付息国债 11	100,000	9,994,000.00	4.34
2	113010	江南转债	2,420	281,470.20	0.12
3	110035	白云转债	1,940	229,909.40	0.10
4	128011	汽模转债	640	92,832.00	0.04

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，中信证券（600030）于 2015 年 11 月 26 日发布公告，收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）调查通知书（稽查总队调查通字 153121 号），其中提及：因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。公司将全面配合中国证监会的相关调查工作，同时严格按照有关规定履行信息披露义务。

投资决策流程符合公司的制度要求，目前公司经营状况良好，业绩稳定，对投资无重大影响。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制期日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	146,329.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	59,142.10
5	应收申购款	99.05

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	205,570.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000002	万 科 A	18,381,836.20	7.99	临时停牌
2	000401	冀东水泥	3,357,200.00	1.46	临时停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,144	41,968.51	5,213,598.52	2.02%	252,640,962.45	97.98%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金属于未上市基金。

8.3 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	8,247,924.30	3.1986%
------------------	--------------	---------

8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月15日）基金份额总额	1,010,044,560.32
本报告期期初基金份额总额	283,518,608.71
本报告期基金总申购份额	1,810,011.66
减：本报告期基金总赎回份额	27,474,059.40
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	257,854,560.97

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华融证券	2	447,433,312.48	100.00%	48,987.24	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
华融证券	111,949.77	100.00%	1,377,700,000.00	100.00%	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华融证券股份有限公司
2016 年 8 月 27 日