华融新锐灵活配置混合型证券投资基金
2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2015 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....6
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....6
3.1 主要会计数据和财务指标.....6
3.2 基金净值表现.....7
3.3 其他指标.....8
§4 管理人报告.....8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....12
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.....12
§5 托管人报告.....12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....12
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.....12
5.3 托管人对本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.....12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....12
6.1 资产负债表.....12
6.2 利润表.....14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....15
6.4 报表附注.....16
§7 投资组合报告.....34
7.1 期末基金资产组合情况.....34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....37
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.....37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....38
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.....38
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.....38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....38

7.12 投资组合报告附注.....38
§8 基金份额持有人信息.....39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....40
8.3 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.....40
§9 开放式基金份额变动.....40
§10 重大事件揭示.....40
10.1 基金份额持有人大会决议.....40
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.....40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....41
10.4 基金投资策略的改变.....41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....41
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.....41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....41
10.8 其他重大事件.....42
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....43
§12 备查文件目录.....43
12.1 备查文件目录.....43
12.2 存放地点.....43
12.3 查阅方式.....44

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华融新锐
场内简称	-
基金主代码	001068
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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	797,832,534.21 份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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	庞博	林葛
	联系电话	010-58315380	010-66060069
	电子邮箱	pangbo@hrsec.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-898-9999	95599
传真		010-58315262	010-68121816
注册地址		北京市西城区金融大街 8 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 8 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100005
法定代表人		祝献忠	刘士余

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券日报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华融证券股份有限公司	北京市西城区金融大街 8 号 A 座

§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(2015 年 4 月 15 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	38,150,494.82

本期利润	39,151,252.31
加权平均基金份额本期利润	0.0390
本期加权平均净值利润率	3.78%
本期基金份额净值增长率	3.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	29,433,205.49
期末可供分配基金份额利润	0.0369
期末基金资产净值	829,275,165.39
期末基金份额净值	1.039
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2015 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	3.90%

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	-0.95%	0.56%	0.46%	0.01%	-1.41%	0.55%
过去三个月	3.90%	0.54%	1.14%	0.01%	2.76%	0.53%
自基金合同生效起至今	3.90%	0.54%	1.14%	0.01%	2.76%	0.53%

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期末无其他指标。

§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 37.55 亿元。

公司下设 55 家营业部，北京、上海、深圳、湖南、南昌、新疆 6 家分公司，上海和深圳 2 家投行业务部，控股华融期货有限责任公司和华融天泽投资有限公司。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、公募基金管理等综合化的财富管理服务。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，2009 年、2011 年两次获评为"首都文明单位"。

公司具备强大的资产管理能力，截至 2015 年 6 月底，公司受托资产管理规模已近 1200 亿元。公司公募证券投资基金管理业务和具有华融特色的创新型产品构成全资管业务体系。借助于公募牌照优势，公司走互联网金融战略，积极开展渠道创新，打造全新的、具有华融特色的业务模式。

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	本基金的基金经理	2015 年 4 月 15 日	-	5	范贵龙，男，汉族，1981 年生，武汉大学金融学硕士，特许金融分析师(CFA)，金融风险管理师(FRM)，具备 8 年金融行业工作经验，超过 5 年时间在证券公司从事证券研究和投资管理等方面的工作经历。2006 年就职于中国建设银行，2009 年 6 月到

					2013 年 7 月在华融证券市场研究部从事证券投资分析工作,并服务于投资。2013 年 8 月加入华融证券资产管理二部、基金业务部,担任投资主办助理,从事投研工作。在华融证券工作期间,曾任公司证券投资部投资决策委员会委员、投资银行部项目审核委员会委员,具备较强的投研能力。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券法》《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，上证指数上涨了 32%，中小板指数上涨了 69%，创业板指数上涨了 94%。二季度，市场经历了一轮强势上涨和一波崩溃式调整，6 月份以后，在流动性边际变化的触发下，市场掉头向下，场外配资、融资融券、伞形信托等杠杆资金出现强行平仓，导致以创业板和中小板为代表的成长股出现了断崖式下跌，但本基金始终坚持持有人利益优先的原则，坚持价值投资的理念，在调整配置方向的同时，逐渐降低总体仓位，保持了业绩的稳定性。

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 1.039 元，本报告期份额净值增长率为 3.90%。

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 2015 年下半年，中国宏观经济经济有望在各项稳增长政策作用下逐步企稳，但是下行压力仍然没有解除，货币政策继续维持宽松是大概率事件。随着实体经济对资金需求的增加、地方债务置换的增加，资金供求状况也难以出现上半年的宽松局面。中概股的回归和注册制的临近将对场内资金形成一定分流，牵引高估值板块向价值回归，并伴随资金向绩优蓝筹股的回流。新兴板块的股票具备广阔的成长空间，随着估值的回归，也将呈现出更好的投资价值。因此，下半年业绩优秀、高分红、低估值的蓝筹股有望取得相对，甚至是绝对收益。同时，优质成长股的长期投资价值也将逐渐显现。本基金在下半年将继续围绕低估值蓝筹股进行布局。同时，优选商业模式清晰的优质成长股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相

关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华融新锐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《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。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人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。

5.3 托管人对本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

本托管人复核审查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。

§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： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

资 产：			
银行存款	6.4.7.1	643,960,332.51	-
结算备付金		8,905,558.39	-
存出保证金		174,888.87	-
交易性金融资产	6.4.7.2	145,803,660.00	-
其中：股票投资		145,803,660.00	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,000,000.00	-
应收证券清算款		33,507.59	-
应收利息	6.4.7.5	128,079.02	-
应收股利		-	-
应收申购款		92,172.85	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,099,098,199.23	-
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2015 年 6 月 30 日**	**上年度末 2014 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		199,739,854.49	-
应付赎回款		65,257,433.89	-
应付管理人报酬		3,229,762.65	-
应付托管费		538,293.78	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	975,708.49	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,980.54	-
负债合计		269,823,033.84	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	797,832,534.21	-
未分配利润	6.4.7.10	31,442,631.18	-
所有者权益合计		829,275,165.39	-
负债和所有者权益总计		1,099,098,199.23	-

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：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		44,685,090.38	-
1.利息收入		3,232,245.93	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,784,343.72	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		447,902.21	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,626,269.54	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	39,257,729.39	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	368,540.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	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）	6.4.7.18	825,817.42	-
减：二、费用		5,533,838.07	-
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,229,762.65	-
2．托管费	6.4.10.2.2	538,293.78	-
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	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	6.4.7.20	7,425.85	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,151,252.31	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		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：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持	-	-	-

有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

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	杜向杰	曹艳春
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

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基

金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映本基金本期末的财务状况以及本报告期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

本基金本报告期不涉及上年度会计报表相关事项。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报表的实际编制期间为 2015 年 4 月 15 日（基金成立日期）至 2015 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产

生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

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

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

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	-
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	643,960,332.51
合计：	643,960,332.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	144,802,902.51	145,803,660.00	1,000,757.49

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		144,802,902.51	145,803,660.00	1,000,757.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	300,000,000.00	-
合计	300,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	124,401.44
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	3,606.75
应收债券利息	-
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	70.83
合计	128,079.02

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
其他应收款	67,004.87
待摊费用	-
合计	67,004.87

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	975,708.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	975,708.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	81,980.54
合计	81,980.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,010,044,560.32	1,010,044,560.32
本期申购	286,278.10	286,278.10
本期赎回(以"-"号填列)	-212,498,304.21	-212,498,304.21
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-

本期末	797,832,534.21	797,832,534.21

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	38,150,494.82	1,000,757.49	39,151,252.31
本期基金份额交易产生的变动数	-8,717,289.33	1,008,668.20	-7,708,621.13
其中：基金申购款	11,591.96	-1,534.09	10,057.87
基金赎回款	-8,728,881.29	1,010,202.29	-7,718,679.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,433,205.49	2,009,425.69	31,442,631.18

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,765,953.48
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	18,082.78
其他	307.46
合计	2,784,343.72

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	631,131,952.15
减：卖出股票成本总额	591,874,222.76
买卖股票差价收入	39,257,729.39

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益项目构成。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	368,540.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	368,540.15

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,000,757.49
——股票投资	1,000,757.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	1,000,757.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	825,817.42
合计	825,817.42

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,758,355.79
银行间市场交易费用	-
合计	1,758,355.79

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
银行费用	7,425.85
合计	7,425.85

6.4.7.21 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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

华融期货有限责任公司	基金管理人的控股子公司
华融天泽投资有限公司	基金管理人的控股子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 4 月 15 日（基金成立日）至 2015 年 6 月 30 日止，无上年度可比期间数据。

债券交易

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 4 月 15 日（基金成立日）至 2015 年 6 月 30 日止，无上年度可比期间数据。

债券回购交易

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 4 月 15 日（基金成立日）至 2015 年 6 月 30 日止，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 4 月 15 日（基金成立日）至 2015 年 6 月 30 日止，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金于本报告期未发生应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,229,762.65	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	538,293.78	-

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金于本报告期未发生销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：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的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2015 年 6 月 30 日未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国农业银行股份有限公司	643,960,332.51	2,765,953.48	-	-

注：本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 4 月 15 日（基金成立日）至 2015 年 6 月 30 日止，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（ 2015 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
300487	蓝晓科技	2015 年 6 月 24 日	2015 年 7 月 2 日	新股流通受限	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600869	智慧能源	-	临时停牌	29.14	-	-	803,296	21,078,395.38	23,408,045.44	-
000793	华闻传媒	-	临时停牌	20.75	-	-	40,000	642,000.00	830,000.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由基金业务部风险管理委员会、督察长、合规审查部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合

久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	643,960,332.51	-	-	-	-	-	643,960,332.51
结算备付金	8,905,558.39	-	-	-	-	-	8,905,558.39
存出保证金	174,888.87	-	-	-	-	-	174,888.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	145,803,660.00	145,803,660.00
买入返售金融资产	300,000,000.00	-	-	-	-	-	300,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	33,507.59	33,507.59
应收利息	-	-	-	-	-	128,079.02	128,079.02
应收申购款	-	-	-	-	-	92,172.85	92,172.85
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	953,040,779.77	-	-	-	-	146,057,419.46	1,099,098,199.23
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	199,739,854.49	199,739,854.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	65,257,433.89	65,257,433.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,229,762.65	3,229,762.65
应付托管费	-	-	-	-	-	538,293.78	538,293.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	975,708.49	975,708.49
其他负债	-	-	-	-	-	81,980.54	81,980.54
负债总计	-	-	-	-	-	269,823,033.84	269,823,033.84
利率敏感度缺口	953,040,779.77	-	-	-	-	-123,765,614.38	829,275,165.39
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
负债							

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期内未涉及利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	145,803,660.00	17.58	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	145,803,660.00	17.58	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
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（ 2015 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2014 年 12 月 31 日 ）
	+5%	6,819,278.25	-

	-5%	-6,819,278.25	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金本报告期内未采用风险价值法管理风险。			
假设	1.置信区间 -		
	2.观察期 -		
分析	风险价值（单位：人民币元）	本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）

注：本基金本报告期内未采用风险价值法管理风险。

6.4.14 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	145,803,660.00	13.27
	其中：股票	145,803,660.00	13.27
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	300,000,000.00	27.30
	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	652,865,890.90	59.40
7	其他各项资产	428,648.33	0.04
8	合计	1,099,098,199.23	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,785,750.00	2.51
C	制造业	23,725,094.84	2.86
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	302,360.64	0.04
J	金融业	88,196,632.90	10.64
K	房地产业	11,615,869.32	1.40
L	租赁和商务服务业	347,952.30	0.04
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	830,000.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	145,803,660.00	17.59

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	4,800,000	34,224,000.00	4.13
2	600869	智慧能源	803,296	23,408,045.44	2.82
3	600028	中国石化	2,350,000	16,591,000.00	2.00
4	002142	宁波银行	650,046	13,748,472.90	1.66
5	601318	中国平安	150,000	12,291,000.00	1.48
6	000002	万　科Ａ	799,991	11,615,869.32	1.40
7	601818	光大银行	2,000,000	10,720,000.00	1.29
8	601398	工商银行	1,700,000	8,976,000.00	1.08
9	601628	中国人寿	263,000	8,237,160.00	0.99

10	601088	中国神华	200,000	4,170,000.00	0.50
11	000793	华闻传媒	40,000	830,000.00	0.10
12	002769	普路通	7,710	347,952.30	0.04
13	300469	信息发展	6,596	302,360.64	0.04
14	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	0.02
15	300483	沃施股份	9,356	153,438.40	0.02
16	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.00
17	002770	科迪乳业	500	4,930.00	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	40,674,639.68	4.90
2	601939	建设银行	40,235,701.00	4.85
3	600480	凌云股份	25,860,165.00	3.12
4	002649	博彦科技	25,823,995.25	3.11
5	002142	宁波银行	24,347,829.20	2.94
6	000718	苏宁环球	23,527,175.04	2.84
7	002194	武汉凡谷	23,224,667.20	2.80
8	000970	中科三环	22,605,033.75	2.73
9	000598	兴蓉投资	21,967,186.20	2.65
10	601111	中国国航	21,340,759.55	2.57
11	600869	智慧能源	21,078,395.38	2.54
12	600111	北方稀土	20,857,623.01	2.52
13	600150	中国船舶	20,685,049.84	2.49
14	600316	洪都航空	19,773,539.08	2.38
15	000922	佳电股份	19,291,089.00	2.33
16	600118	中国卫星	18,302,012.00	2.21
17	002520	日发精机	17,895,182.72	2.16
18	002216	三全食品	17,803,186.30	2.15
19	601318	中国平安	17,425,714.30	2.10
20	600028	中国石化	16,198,225.00	1.95

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	51,060,226.89	6.16
2	002649	博彦科技	30,666,967.10	3.70
3	600480	凌云股份	30,034,255.76	3.62
4	002194	武汉凡谷	25,710,873.18	3.10
5	000970	中科三环	24,363,156.36	2.94
6	000718	苏宁环球	24,268,231.34	2.93
7	600111	北方稀土	23,107,000.00	2.79
8	600150	中国船舶	22,933,648.00	2.77
9	002216	三全食品	22,708,120.58	2.74
10	000598	兴蓉投资	22,320,936.33	2.69
11	600316	洪都航空	21,686,225.00	2.62
12	601111	中国国航	21,548,722.00	2.60
13	000922	佳电股份	20,918,938.94	2.52
14	600118	中国卫星	17,811,497.00	2.15
15	002520	日发精机	17,618,198.73	2.12
16	600838	上海九百	16,233,050.00	1.96
17	000090	深 天 健	15,409,148.00	1.86
18	002052	同洲电子	14,953,148.78	1.80
19	601992	金隅股份	14,303,475.99	1.72
20	002342	巨力索具	12,676,365.36	1.53

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	736,677,125.27
卖出股票收入（成交）总额	631,131,952.15

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

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

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

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

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现基金投资前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	174,888.87
2	应收证券清算款	33,507.59
3	应收股利	-
4	应收利息	128,079.02
5	应收申购款	92,172.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	428,648.33

7.12.4 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。

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	600869	智慧能源	23,408,045.44	2.82	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
13,243	60,245.60	99,304,278.27	12.45%	698,528,255.94	87.55%

8.2 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	20,277,345.38	2.5416%

8.3 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	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	286,278.10
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	212,498,304.21
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	797,832,534.21

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、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

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

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

本报告期内本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或者处罚 。

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	1,365,655,070.86	100%	975,708.49	-	-

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	-	-	2,900,000,000	100%	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准

后与被选择的证券经营机构签订协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 3 月 19 日
2	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 3 月 19 日
3	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 3 月 19 日
4	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 4 月 16 日
5	华融证券股份有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 4 月 21 日
6	华融证券股份有限公司关于旗下部分基金增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 4 月 27 日
7	华融证券股份有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 4 月 28 日
8	华融证券股份有限公司关于华融新锐灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 6 月 23 日
9	华融证券股份有限公司关于旗下基金参加好买基金、天天基金、	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管	2015 年 6 月 23 日

	数米基金申购费率优惠活动的公告	理人网站	
10	华融证券股份有限公司关于旗下基金参加中国农业银行网上银行和手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 6 月 23 日
11	华融证券股份有限公司关于旗下基金实行申购与定投费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券日报》及本基金管理人网站	2015 年 6 月 24 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会核准华融新锐灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

12.1.2《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

12.1.3《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

12.1.4《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

12.1.5《华融证券股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

12.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.hrsec.com.cn）查阅。

华融证券股份有限公司
2015 年 8 月 28 日