# 华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月24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2018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2018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 | 华融新锐灵活配置混合 |
| 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 | 132,430,497.36份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 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 | 通过灵活运用多种投资策略，在有效控制组合风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 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优质标的，运用多样化的投资策略实行组合管理。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 华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 | 徐乾,Li | 贺婷 |
| | 联系电话 | 010-85556728 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | xuqianshan@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(2018年1月1日 – 2018年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 7,490,708.37 |
| 本期利润 | –4,591,852.05 |
| 加权平均基金份额本期利润 | –0.0321 |
| 本期基金份额净值增长率 | –4.17% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | –0.0583 |
| 期末基金资产净值 | 124,709,444.23 |
| 期末基金份额净值 | 0.942 |

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 | –4.17% | 0.87% | –3.54% | 0.64% | –0.63% | 0.23% |
| 过去三个月 | –4.75% | 0.60% | –3.98% | 0.57% | –0.77% | 0.03% |
| 过去六个月 | –4.17% | 0.56% | –4.46% | 0.58% | 0.29% | –0.02% |
| 过去一年 | –1.15% | 0.44% | 0.18% | 0.47% | –1.33% | –0.03% |
| 过去三年 | –9.34% | 0.80% | 16.47% | 0.43% | –25.81% | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | –5.80% | 0.78% | 17.78% | 0.41% | –23.58% | 0.37% |

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

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有限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58.41亿元。

公司总部设在北京,下设北京、上海、深圳、湖南、新疆、湖北、陕西、贵州、四川、江西、海南、浙江、山东、福建、辽宁、广东等16家分公司,66家营业部，控股华融期货有限责任公司与华融瑞泽投资管理有限公司。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、投资顾问等综合化的财富管理服务。公司先后荣获2014年度最佳资产管理券商、2015年度中国新三板最具投资眼光券商、2015–2016年度中国最佳资管创新产品、2016年度中国最佳财富管理品牌、2016年度金牛券商集合资产管理人、2017年度中国区突破债券投行君鼎奖、2017年度中国最佳券商资管、2018中国区十大创新项目君鼎奖等荣誉。

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 | – | 10 | 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12年金融行业工作经验。2006年就职于中国建设银行,2009年6月加入华融证券，历任市场研究部、资产管理二部、基金业务部。2015年9月–2017年6月任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年4月至今任华融新锐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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,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。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。

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,通过交易系统中的公平交易程序,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。未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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。不存在基金管理人管理的所有基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,市场冲高回落,上证综指创下3587点的高点后一路震荡下跌,并在季度末跌破2800点,市场风格快速切换,一月份绩优白马龙头股领涨,随后出现持续下跌,二月份创业板出现明显的反弹,但是季末又三年多创新低,5月份消费领涨,季末亦出现快速调整。整个上半年金融地产、计算机军工、医药食品饮料等三大类别都出现了一波行情,但是随后的下跌也十分明显,操作难度明显增加。

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。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,积极参与新股和新债申购增厚基金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.942元；本报告期基金份额净值增长率为–4.17%,业绩比较基准收益率为–4.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年经济稳中趋缓,先行指标制造业PMI始终处于温和扩张之中。从需求端看,投资增速延续近年来的下滑态势,出口面临贸易战的影响,消费增速在汽车行业的拖累下也出现回落。从供给端和企业经营效益看,工业增加值以及工业企业利润增速延续稳中向好态势。物价方面,受春节因素影响2、3月CPI有所上升,上半年大部分时间CPI维持在2%以内。

在美国加息以及国内防风险、去杠杆、治乱象等政策影响下,国内债券市场违约案例明显增加,5月份社会融资总额数据大幅减少,M2增速维持低位。央行在今年1月、4月和7月分别实施三次定向降准,并扩大中期借贷便利(MLF)担保品范围,以缓解信用收缩带来的影响,利率在一季度下降后,二季度维持在相对较低的位置。

展望2018年三季度，我们认为，中国经济可能出现一定程度的放缓,三大攻坚战以及中美贸易战仍是宏观政策的焦点,在经过持续的防风险、去杠杆、治乱象后,出现了融资下降、需求乏力、债券违约增加、本币贬值等现象,三季度货币政策保持中性的同时可能出现预调微调。

综合来看,经过二季度市场的快速持续的下跌后,整体估值已经接近历史底部,投资机会逐渐显现,但是结构性分化难以改变,自下而上选择优质股票仍是较好的选择。

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。

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 2018年 1月 1 日至 2018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的真实、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半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：2018年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 228,058.37 | 1,232,654.40 |
| 结算备付金 | | 5,917,628.18 | 8,541,612.36 |
| 存出保证金 | | 127,498.45 | 206,219.93 |
| 交易性金融资产 | | 88,730,399.88 | 78,365,414.44 |
| 其中:股票投资 | | 78,734,399.88 | 68,381,414.44 |
| 基金投资 | | – | – |
| 债券投资 | | 9,996,000.00 | 9,984,000.00 |
| 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 | | 29,900,000.00 | 80,400,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 666,668.16 | 528,487.65 |
| 应收利息 | | 229,489.08 | 246,656.00 |
| 应收股利 | | – | – |
| 应收申购款 | | 1,983.34 | 595.94 |
| 递延所得税资产 | | – | – |
| 其他资产 | | – | – |
| 资产总计 | | 125,801,725.46 | 169,521,640.72 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017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 | | 472,633.89 | – |
| 应付赎回款 | | 100,927.94 | 668,054.54 |
| 应付管理人报酬 | | 159,070.00 | 215,237.29 |
| 应付托管费 | | 26,511.66 | 35,872.89 |
| 应付销售服务费 | | – | – |
| 应付交易费用 | | 163,713.38 | 351,457.03 |
| 应交税费 | | – | – |
| 应付利息 | | – | – |
| 应付利润 | | – | – |
| 递延所得税负债 | | – | – |
| 其他负债 | | 169,424.36 | 100,000.00 |
| 负债合计 | | 1,092,281.23 | 1,370,621.75 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 132,430,497.36 | 171,087,582.67 |
| 未分配利润 | | –7,721,053.13 | –2,936,563.70 |
| 所有者权益合计 | | 124,709,444.23 | 168,151,018.97 |
| 负债和所有者权益总计 | | 125,801,725.46 | 169,521,640.72 |

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.942元,基金份额总额132430497.36份。

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：2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | –2,413,485.12 | 15,888,952.05 |
| 1.利息收入 | | 1,472,379.83 | 1,490,563.77 |
| 其中:存款利息收入 | | 74,533.58 | 120,431.12 |
| 债券利息收入 | | 126,749.18 | 121,697.98 |
| 资产支持证券利息收入 | | – | – |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,271,097.07 | 1,248,434.67 |
| 其他利息收入 | | – | – |
| 2.投资收益(损失以“–”填列) | | 8,196,612.39 | 7,535,813.65 |
| 其中:股票投资收益 | | 7,921,548.91 | 7,176,769.43 |
| 基金投资收益 | | – | – |
| 债券投资收益 | | 22,302.48 | 33,325.02 |
| 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 | | 251,761.00 | 325,719.20 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“–”号填列) | | –12,082,560.42 | 6,853,189.07 |
| 4.汇兑收益(损失以“–”号填列) | | – | – |
| 5.其他收入(损失以“–”号填列) | | 1,083.08 | 9,385.56 |
| 减:二、费用 | | 2,178,366.93 | 2,815,182.77 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,053,224.33 | 1,507,348.04 |
| 2. 托管费 | | 175,537.35 | 251,224.70 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.8.2.3 | – | – |
| 4. 交易费用 | | 864,750.27 | 971,051.67 |
| 5. 利息支出 | | – | – |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | – | – |
| 6. 其他费用 | | 84,853.98 | 85,558.36 |
| 三、利润总额(亏损总额以“–”号填列) | | –4,591,852.05 | 13,073,769.28 |
| 减:所得税费用 | | – | – |
| 四、净利润(净亏损以“–”号填列) | | –4,591,852.05 | 13,073,769.28 |

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:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018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) | 171,087,582.67 | –2,936,563.70 | 168,151,018.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | – | –4,591,852.05 | –4,591,852.05 |
| 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) | –38,657,085.31 | –192,637.38 | –38,849,722.69 |
| 其中:1.基金申购款 | 767,661.68 | –9,024.07 | 758,637.61 |
| 2.基金赎回款 | –39,424,746.99 | –183,613.31 | –39,608,360.30 |
| 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) | 132,430,497.36 | –7,721,053.13 | 124,709,444.23 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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) | 229,756,520.50 | –24,481,942.96 | 205,274,577.54 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | – | 13,073,769.28 | 13,073,769.28 |
| 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) | –22,862,903.88 | 1,582,218.31 | –21,280,685.57 |
| 其中:1.基金申购款 | 389,603.15 | –26,379.13 | 363,224.02 |
| 2.基金赎回款 | –23,252,507.03 | 1,608,597.44 | –21,643,909.59 |
| 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) | 206,893,616.62 | –9,825,955.37 | 197,067,661.25 |

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:沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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

本基金财务报表的编制所遵循的会计政策与上年度会计报表相一致未发生变动。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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 |
| 华融瑞泽投资有限公司 | 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 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 656,875,307.39 | 100.00% | 722,007,696.78 | 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 1,384,161.10 | 100.00% | 527,681.00 | 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 7,089,700,000.00 | 100.00% | 7,598,600,000.00 | 100.00% |

6.4.8.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |

注:本基金本报告期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 2018年1月1日至2018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 | 485,069.51 | 100.00% | 163,638.38 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 534,300.66 | 100.00% | 534,300.66 | 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,053,224.33 | 1,507,348.04 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | – | 797,735.08 |

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 175,537.35 | 251,224.70 |

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费各关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |

注: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

单位:人民币元

| 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| | | | | | | |
| 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| | | | | | | |

注:本基金本报告期内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

份额单位:份

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2015年4月15日)持有的基金份额 | – | – |
| 期初持有的基金份额 | – | – |
| 期间申购/买入总份额 | – | – |
| 期间因拆分变动份额 | – | – |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | – | – |
| 期末持有的基金份额 | – | – |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | – | – |

注:本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

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末 2018年6月30日 | | 上年度末 2017年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| | | | | |

注:本基金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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 228,058.37 | 13,631.52 | 4,389,795.17 | 63,904.03 |

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

| 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:份) | 总金额 |
| 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:份) | 总金额 |

注:本基金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

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

6.4.9 期末( 2018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

6.4.9.1.1 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

6.4.9.1.2 受限证券类别:债券

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

6.4.9.1.3 受限证券类别:权证

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:份) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

注:截至报告期末,本基金无因认购/增发而于期末持有的流通受限证券。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

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

–

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 合计 | | | | – | – |

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 | 78,734,399.88 | 62.59 |
| | 其中:股票 | 78,734,399.88 | 62.59 |
| 2 | 固定收益投资 | 9,996,000.00 | 7.95 |
| | 其中:债券 | 9,996,000.00 | 7.95 |
| | 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 | 29,900,000.00 | 23.77 |
| | 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 | 6,145,686.55 | 4.89 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,025,639.03 | 0.82 |
| 8 | 合计 | 125,801,725.46 | 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 | 1,793,036.00 | 1.43 |
| C | 制造业 | 51,777,019.88 | 41.52 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 727,000.00 | 0.58 |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 批发和零售业 | 750,700.00 | 0.60 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,610,900.00 | 1.29 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,121,994.00 | 2.50 |
| J | 金融业 | 17,742,150.00 | 14.23 |
| 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 | 1,221,600.00 | 0.98 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 78,734,399.88 | 63