华富恒利债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2017年3月29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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月28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。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富恒利债券	
基金主代码	001086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年8月31日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	429,065,030.04份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富恒利债券A	华富恒利债券C
下属分级基金的交易代码:	001086	001087
报告期末下属分级基金的份额总额	337,864,844.89份	91,200,185.15份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求较高的当期收益和长期回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心,在动态避险的基础上,追求适度收益。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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		华富基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	张燕
	联系电话	021-68886996	0755-83199084
	电子邮箱	manzh@hfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-700-8001	95555
传真		021-68887997	0755-83195201

2.4信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年		2015年8月31日(基金合同生效日)-2015年12月31日		2014年	
	华富恒利债券A	华富恒利债券C	华富恒利债券A	华富恒利债券C	华富恒利债券A	华富恒利债券C
本期已实现收益	7,169,631.54	1,712,714.40	4,586,605.81	1,373,168.66	-	-
本期利润	-1,278,185.77	583,538.67	5,605,544.90	1,701,665.79	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0036	0.0058	0.0173	0.0157	-	-
本期基金份额净值增长率	0.98%	0.49%	1.70%	1.60%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0273	0.0213	0.0141	0.0126	-	-
期末基金资产净值	347,098,288.33	93,141,935.27	408,368,095.52	110,856,181.83	-	-
期末基金份额净值	1.027	1.021	1.017	1.016	-	-

注:1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2)以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3)期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数,表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日。

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

华富恒利债券A

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
过去三个月	-1.15%	0.14%	-1.79%	0.15%	0.64%	-0.01%
过去六个月	1.88%	0.16%	0.37%	0.11%	1.51%	0.05%
过去一年	0.98%	0.22%	2.00%	0.09%	-1.02%	0.13%
自基金合同生效起至今	2.70%	0.20%	5.48%	0.09%	-2.78%	0.11%

华富恒利债券C

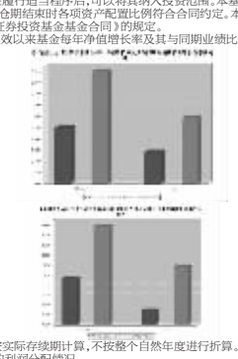
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.26%	0.14%	-1.79%	0.15%	0.53%	-0.01%
过去六个月	1.69%	0.15%	0.37%	0.11%	1.32%	0.04%
过去一年	0.49%	0.22%	2.00%	0.09%	-1.51%	0.13%
自基金合同生效起至今	2.10%	0.20%	5.48%	0.09%	-3.38%	0.11%

注:业绩比较基准收益率=中证全债指数,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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《华富恒利债券型证券投资基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为2015年8月31日至到2016年2月29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《华富恒利债券型证券投资基金合同》的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

华富恒利债券A

年度	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	年度利润分配合计	备注
合计	-	-	-	-	

华富恒利债券C

年度	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	年度利润分配合计	备注
合计	-	-	-	-	

注:注:本基金本报告期末进行利润分配。

§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

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2016年12月31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、华富成长趋势股票型证券投资基金、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、华富恒利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、华富证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共三十只基金。

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		
胡伟	华富恒利债券型基金经理、华富旺财保本混合型基金经理、华富恒稳纯债债券型基金经理、华富收益增强债券型基金经理、华富保本混合型基金经理、华富恒富分级债券型基金经理、华富恒利分级债券型基金经理、华富安福保本混合型基金经理、华富灵活配置混合型基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金经理、公司公募投资决策委员会成员、公司总经理助理、固定收益部总监	2015年8月31日	-	十二年	中南财经政法大学经济学学士、本科学历,曾任珠海市商业银行资金营运需交易员,从事债券研究及债券交易工作,2006年11月加入华富基金管理有限公司,曾任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监,2009年10月19日至2014年11月17日任华富货币市场基金基金经理,2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。
张惠	华富恒利债券型基金基金经理、华富旺财保本混合型基金基金经理、华富保本混合型基金基金经理、华富安享保本混合型基金基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理、华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富益鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理	2015年8月31日	-	九年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历,2007年6月加入华富基金管理有限公司,先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员,2012年5月21日至2014年3月19日任华富策略精选混合型基金基金经理助理,2014年3月20日至2014年11月18日任华富保本混合型基金基金经理助理。

注:根据《华富恒利债券型证券投资基金合同》的规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、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、权证、资产支持证券以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)。

7.4.2 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。

7.4.3 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,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。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

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
招商银行股份有限公司	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
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年8月31日(基金合同生效日)至2015年12月31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
华安证券股份有限公司	112,529,877.50	21.34%	-	-

7.4.8.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2015年8月31日(基金合同生效日)至2015年12月31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
华安证券股份有限公司	33,060,467.56	24.67%	-	-

7.4.8.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2015年8月31日(基金合同生效日)至2015年12月31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
华安证券股份有限公司	358,600,000.00	7.44%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年8月31日(基金合同生效日)至2015年12月31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
华安证券股份有限公司	-	-	1,474.38	1,474.38
合计	-	-	144,905.07	144,905.07

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费;C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。计算公式H = E ×年销售服务费率÷当年天数(H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费,E为C类基金份额前一日基金资产净值)。

7.4.8.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日					
	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 2015年8月31日(基金合同生效日)至2015年12月31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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2016年1月1日至2016年12月31日	
	华富恒利债券A	华富恒利债券C
基金合同生效日(2015年8月31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	-	-

项目	上年度可比期间 2015年8月31日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	华富恒利债券A	华富恒利债券C
基金合同生效日(2015年8月31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:本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

华富恒利债券A				
关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015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

份额单位:份

华富恒利债券C				
关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015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:本基金本报告期和上年度可比期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年8月31日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	5,580,202.25	59,290.14	5,961,232.72	143,587.27

注:本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.8.6 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 2016年1月1日至2016年12月31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 2015年8月31日(基金合同生效日)至2015年12月31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

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.10.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月21日	2017年1月10日	新股流通受限	4.00	4.00	1,000	4,000.00	4,000.00	-

7.4.10.1.2 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

7.4.10.1.3 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

7.4.9.2 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
600626	申达股份	2016年12月15日	重大事项停牌	13.69	2017年1月21日	13.70	254,700	2,999,703.00	3,486,843.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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			-	-	-

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 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47000000元,于2017年1月3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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据"财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好2010年年报工作的通知(财会(2010)25号)"(以下简称"通知")要求,本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层:第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求,年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下:

类别2016年12月31日公允价值2015年12月31日公允价值

第一层次	39,909,040.76	39,490,532.24
第二层次	431,716,550.69	533,310,272.33
第三层次	-	-
合 计	471,625,591.5	572,800,804.57

根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)的要求,本基金自2015年3月30日起,对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值(估值标准另有规定的除外),本报告期末本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

§8 投资组合报告

8.1 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	40,367,889.56	8.15
	其中:股票	40,367,889.56	8.15
2	固定收益投资	431,257,701.89	87.09
	其中:债券	431,257,701.89	87.09
	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	6,735,287.85	1.36
7	其他各项资产	16,853,322.82	3.40
8	合计	495,214,202.12	100.00

注:本表列示的其他各项资产详见8.12.3 其他各项资产构成。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,934,384.00	0.67
C	制造业	23,671,567.48	5.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,697,763.08	1.29
F	批发和零售业	3,486,843.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	2,764,944.00	0.63
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	1,812,388.00	0.41
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	40,367,889.56	9.17

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

8.3 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	600820	隧道股份	517,508	5,697,763.08	1.29
2	300446	乐凯新材	130,600	4,813,916.00	1.09
3	600519	贵州茅台	13,000	4,343,950.00	0.99
4	600702	沱牌舍得	165,700	3,744,820.00	0.85
5	600626	申达股份	254,700	3,486,843.00	0.79
6	002690	美亚光电	143,453	3,035,465.48	0.69
7	600028	中国石化	542,400	2,934,384.00	0.67
8	600630	龙头股份	183,900	2,839,416.00	0.64
9	600717	天津港	274,300	2,764,944.00	0.63
10	600894	广日股份	200,000	2,734,000.00	0.62

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600701	*ST工新	11,120,304.53	2.14
2	601088	中国神华	8,392,680.92	1.62
3	600562	国睿科技	7,779,914.00	1.50
4	000937	冀中能源	6,981,428.84	1.34
5	002519	银河电子	6,440,541.00	1.24
6	600116	三峡水利	5,995,371.00	1.15
7	000983	西山煤电	5,968,433.66	1.15
8	000060	中金岭南	5,810,137.54	1.12
9	002522	浙江众成	5,795,969.00	1.12
10	002099	海翔药业	5,641,052.00	1.09
11	600820	隧道股份	5,497,084.12	1.06
12	600216	浙江医药	5,186,191.15	1.00
13	600118	中国卫星	5,174,832.00	1.00
14	002245	澳洋顺昌	5,090,266.00	0.98
15	002042	华孚色纺	4,998,901.20	0.96
16	300446	乐凯新材	4,996,825.00	0.96
17	300491	通合科技	4,908,939.00	0.95
18	600188	兖州煤业	4,488,410.00	0.86
19	600589	广东榕泰	4,166,842.00	0.80
20	002001	新 和 成	4,124,915.20	0.79

8.4.2 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	600701	*ST工新	11,939,097.35	2.30
2	600562	国睿科技	8,281,734.00	1.60
3	002522	浙江众成	7,878,406.00	1.52
4	601088	中国神华	7,805,356.99	1.50
5	000937	冀中能源	7,624,230.50	1.47
6	000983	西山煤电	6,293,449.85	1.21
7	002519	银河电子	6,104,478.52	1.18
8	600116	三峡水利	6,031,518.00	1.16
9	002099	海翔药业	5,603,888.20	1.08
10	600118	中国卫星	5,504,581.00	1.06
11	601058	赛轮金宇	5,475,959.50	1.05
12	300491	通合科技	5,357,455.00	1.03
13	002245	澳洋顺昌	5,321,943.35	1.02
14	600837	海通证券	5,293,000.00	1.02
15	600216	浙江医药	5,205,687.00	1.00
16	000060	中金岭南	5,116,378.60	0.99
17	600048	保利地产	4,826,803.77	0.93
18	600188	兖州煤业	4,820,360.74	0.93
19	002042	华孚色纺	4,816,499.00	0.93
20	002001	新 和 成	4,561,664.21	0.88

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。

8.4.3 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	287,516,468.85
卖出股票收入(成交)总额	259,735,031.64

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、债转股及行权等获得的股票。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,000,000.00	6.81
	其中:政策性金融债	30,000,000.00	6.81
4	企业债券	296,953,707.69	67.45
5	企业短期融资券	29,859,000.00	6.78
6	中期票据	71,413,000.00	16.22
7	可转债(可交换债)	3,031,994.20	0.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	431,257,701.89	97.96

8.6 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	122204	12双良节	320,000	32,332,800.00	7.34
2	1280448	12沪电港债	300,000	31,476,000.00	7.15
3	1382214	13隧桥铝MTN2	300,000	30,714,000.00	6.98
4	160401	16农发01	300,000	30,000,000.00	6.81
5	1380369	13哈高新债	300,000	25,101,000.00	5.70

8.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1本期国债期货投资政策

-

8.11.2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。

8.11.3本期国债期货投资评价

-

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

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。

8.12.3 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	69,775.34
2	应收证券清算款	7,386,088.75
3	应收股利	-
4	应收利息	9,388,458.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款