华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金 2017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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年3月28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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月26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。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富智慧城市灵活配置混合
基金主代码	000757
交易代码	000757
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月31日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	116,091,681.38份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究并积极投资与智慧城市相关的优质上市公司,分享其发展和成长的机会,力求获取超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及智慧城市相关行业的发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。
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		华富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	郭明
	联系电话	021-68886996	(010)66105799
	电子邮箱	manzh@hffund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95588
传真		021-68887997	(010)66105798

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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	-17,705,339.97	-215,632,667.33	559,647,437.10
本期利润	-7,118,150.44	-234,963,830.76	611,772,334.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0524	-0.7101	0.7362
本期基金份额净值增长率	-5.10%	-30.84%	62.24%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0829	-0.0004	0.4460
期末基金资产净值	110,208,522.76	147,138,934.89	914,380,744.45
期末基金份额净值	0.949	1.000	1.446

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。

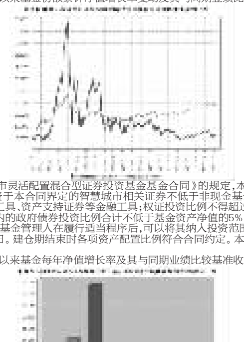
3.2 基金净值表现

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

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	-1.96%	0.86%	2.19%	0.41%	-4.15%	0.45%
过去六个月	0.21%	0.76%	4.86%	0.35%	-4.65%	0.41%
过去一年	-5.10%	0.89%	10.30%	0.32%	-15.40%	0.57%
过去三年	6.48%	2.25%	15.30%	0.84%	-8.82%	1.41%
自基金合同生效起至今	4.67%	2.20%	39.33%	0.85%	-34.66%	1.35%

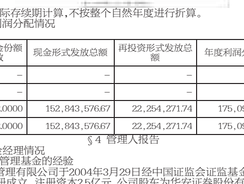
注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡

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《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%,投资于本合同界定的智慧城市相关证券不低于非现金基金资产的80%;其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资比例不得超过基金资产净值的3%;保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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2014年10月31日到2015年4月31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,本基金严格执行了基金合同的相关规定。

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

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
2017	-	-	-	-	注:-
2016	-	-	-	-	注:-
2015	2.0000	152,843,576.67	22,254,271.74	175,097,848.41	注:-
合计	2.0000	152,843,576.67	22,254,271.74	175,097,848.41	注:-

§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2.5亿元,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18个月定期开放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、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金,共三十四只基金。

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		
王翔	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富物联世界灵活配置混合型基金基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理	2014年11月19日	-	七年	墨尔本大学工程管理学硕士、研究生学历。2010年3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,2014年5月12日至2014年11月18日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理助理,2015年5月11日至2017年3月14日任华富成长趋势混合型基金基金经理。
龚炜	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、华富成长趋势混合型基金基金经理、华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富物联世界灵活配置混合型基金基金经理、华富量子生命力混合型基金基金经理、公司公募投资决策委员会主席、公司副总经理	2014年10月31日	-	十三年	安徽财经大学金融学硕士,研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治核心成长股票型基金的基金经理、权益投资部总监,2012年9月加入华富基金管理有限公司,曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理,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。
高靖瑜	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理	2017年5月9日	-	十七年	复旦大学金融学硕士,本科学历。历任国信证券(维京)股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员,2007年7月加入华富基金管理有限公司,任行业研究员,2013年3月1日至2014年12月14日任华富价值增长混合型基金基金经理助理,2014年12月15日至2016年1月12日任华富策略精选灵活配置混合型基金经理。
刘文正	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理、公司公募投资决策委员会成员、基金投资部副总监	2014年11月17日	2017年3月28日	十三年	工商管理硕士,研究生学历。历任天治基金管理有限公司系统管理员、行业研究员,2010年9月加入华富基金管理有限公司,曾任研究发展部行业研究员、华富竞争力优选混合型基金基金经理助理,研究发展部总监助理,2013年6月7日至2015年5月27日任华富策略精选混合型基金基金经理,2015年2月4日至2017年3月28日任华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理,2014年11月17日至2017年3月28日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理。
翁海波	华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富物联世界灵活配置混合型基金基金经理	2016年2月24日	2017年5月9日	八年	清华大学工程硕士,研究生学历。曾任华安证券股份有限公司证券投资部研究员。2012年2月加入华富基金管理有限公司,先后担任行业研究员、行业研究员,2014年8月1日至2015年12月24日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理助理,2015年12月25日至2017年5月9日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理,2016年2月24日至2017年5月9日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理。

注:龚炜的任职日期指该基金成立之日,刘文正、王翔、翁海波、高靖瑜的任职日期指公司作出决定之日,刘文正、翁海波的离职时间指中国基金业协会作出注销决定之日。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。

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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》,公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下:

在研究分析和投资决策环节,公司通过建立规范、完善的研究管理平台,为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合,在保证其决策相对独立的同时,在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略,制定客观、完整的交易决策规则,并按照这些规则进行投资决策,保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节,公司设立独立的集中交易部门,通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则:"价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施",保证交易在各投资组合间的公正实施,保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度,确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节,公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容,加强对投资交易行为的监察稽核力度,公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后,集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记,逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果,由具体执行的交易员签字确认留档,并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差进行分析。本报告期内,根据纳入样本内的数据分析结果,未发现明显异常情况。

4.3.2 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良好。

4.3.3 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。

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

2017年,经济总体平稳运行,略超预期。2017年全年GDP同比6.9%,预期6.8%,四季度GDP同比6.8%,预期6.7%。从支出法看,2017年最终消费支出、资本形成总额、货物和服务净出口对经济增长的贡献率分别为58.8%、32.1%、9.1%,消费比投资贡献高出26.7个百分点。从2018年开年看,经济运行仍然平稳,1月官方制造业PMI51.3,预期51.6,前值51.6,2017年同期51.3,制造业PMI数据虽略低于预期,但仍处51以上。PMI连续18个月处于扩张区间,并高于2012年-2017年六年均值50.3。

2017年,沪深300指数累计上涨21.78%,创业板指累计下跌10.67%;其中,四季度沪深300指数上涨5.07%,创业板指下跌6.12%。从全年看,食品饮料、家电等消费类行业业绩估值双升,涨幅居前;在供给侧改革的推动下,周期类产品价格回暖,相关行业个股业绩增长迅猛,表现也都排名前列;其他如电子、医药等行业也有个股的结构性行情。全年看,龙头企业、业绩成长较好、估值合理的公司成为全年的主线。

本基金年末重点配置行业包括生物医药、电子、房地产、机械等,结构相对均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同2014年10月31日生效,截止2017年12月31日,本基金份额净值为0.949元,累计份额净值为1.149元。本报告期,本基金份额净值增长率为-5.10%,同期业绩比较基准收益率为10.30%。

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2018年,金融去杠杆政策仍在推进,市场风险偏好依旧在相对低位,增量资金较少,市场还是看结构性行情为主,仍以精选个股以及抓阶段性优势板块的操作为主。从低估值蓝筹板块看,部分板块经过连续多年的上涨,估值优势逐渐不明显,在该类板块中,我们相对看好估值低且业绩增长确定的房地产板块;从周期类个股看,业绩波动性将逐步降低,而在供给侧改革不放松的背景下,业绩确定性也在提高,周期存在重新估值的可能,年中也将有机会;另外,经过较长时间调整后,部分成长股业绩预估值的匹配度在提高,个股机会也将涌现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017年度,为加强公司内部控制,监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序,独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

1、加强内部控制制度建设,完善内部控制环境。2017年,为了确保公司旗下基金投资同业存单的行为合法合规、科学有效正常运转,防范和化解基金投资运作过程中可能发生的超过基金资产风险承受能力的投资行为,制定了《同业存单投资管理办法》;为保护基金持有人利益,规范基金的投资与研究业务,有效地控制风险,修订了《股票池管理办法》;为建立压力测试的风险监测与预警制度,规范旗下基金压力测试的流程,制定了《压力测试工作管理办法》;为规范公司网上交易和柜台直销行为,确保基金和专户销售的投资者适当性管理,维护投资者合法权益,制定了《投资者适当性管理制度》;为进一步加强内部控制,预防洗钱活动,规范公司可疑交易报告行为,修订了《大额交易和可疑交易报告制度》与《反洗钱内部控制制度》;为规范公司拟管理的交易型开放式指数证券投资基金的投资与运营活动,防范该种类型基金运作中的风险,制定了《ETF基金风险管理办法》与《ETF投资管理业务流程》;为加强公司内部合规管理,实现持续规范发展,保障公司依法合规、稳健经营,制定了《华富基金管理有限公司合规管理制度》,并修订了《华富基金管理有限公司监察稽核制度》和《华富基金管理有限公司总经理工作细则》;为规范与子公司的关系,加强对子公司的管理、监督、指导和支持,进一步完善子公司的法人治理结构,促进子公司按现代企业制度规范运作,全面落实公司的经营方针,加强财务管理,提高投资效益,制定了《华富基金管理有限公司子公司管理制度》;为进一步规范公司的财务行为,加强财务管理的监督职能,建立规范的财务工作秩序,提高经营效益,修订了《华富基金管理有限公司财务管理制度》;为进一步维护基金投资人利益,加强公司基金销售业务管理,促进诚信、合法、有效开展基金销售业务,修订了《华富基金管理有限公司基金销售管理制度》。

2、多方位开展监察稽核工作,不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展,公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高,各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷,实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控,严格控制投资风险,通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪,及时报告异常情况,确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理,从公司运营整体规范要求,风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门,每月定时向风险控制委员会报告,进行及时的风险揭示。

在今后的工作中,本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念,提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范和控制各种风险,充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所(特殊普通合伙)进行审核并出具报告,由托管银行进行复核。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。

4.8 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《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本期利润为-7,118,150.44元,期末可供分配利润为-9,628,426.35元。本报告期内未进行利润分配。

4.9 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

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现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

本报告期内,本基金托管人在对华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华富基金管理有限公司在华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华富基金管理有限公司编制和披露的华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审(2018)6-53号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金(以下简称华富智慧城市灵活配置混合基金)财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年度的利润表、持有人权益(基金净值)变动表,以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华富智慧城市灵活配置混合基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和持有人权益(基金净值)变动。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华富智慧城市灵活配置混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	华富智慧城市灵活配置混合基金管理人(以下简称管理层)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,管理层负责评估华富智慧城市灵活配置混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金合同终止、清算或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华富智慧城市灵活配置混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对华富智慧城市灵活配置混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华富智慧城市灵活配置混合基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	曹小勤 林晶
会计师事务所的地址	浙江省杭州市钱江路1366号华润大厦B座31层
审计报告日期	2018年3月26日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:			
银行存款		34,707,006.30	7,439,595.77
结算备付金		122,676.66	1,036,845.29
存出保证金		29,273.72	205,289.82
交易性金融资产		78,038,137.90	139,659,236.74
其中:股票投资		78,038,137.90	139,659,236.74
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	220,510.59
应收利息		8,455.82	2,393.08
应收股利		-	-
应收申购款		1,191.99	2,789.59
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		112,906,742.39	148,566,660.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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		2,013,325.69	-
应付赎回款		45,054.94	119,206.41
应付管理人报酬		139,706.98	192,591.62
应付托管费		23,284.53	32,098.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		106,847.49	583,739.70
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		370,000.00	500,089.66
负债合计		2,698,219.63	1,427,725.99
所有者权益:			
实收基金		116,091,681.38	147,199,855.05
未分配利润		-5,883,158.62	-60,920.16
所有者权益合计		110,208,522.76	147,138,934.89
负债和所有者权益总计		112,906,742.39	148,566,660.88

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值0.949元,基金份额总额116,091,681.38份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.2 利润表

会计主体:华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入		-2,975,380.54	-221,800,658.75
1.利息收入		250,409.22	292,486.24
其中:存款利息收入		215,759.24	292,486.24
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		34,649.98	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-13,843,653.97	-204,273,905.61
其中:股票投资收益		-14,486,738.84	-205,676,125.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		643,084.87	1,402,220.13
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		10,587,189.53	-19,331,163.43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		30,674.68	1,511,924.05
减:二、费用		4,142,769.90	13,163,172.01
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,950,946.34	5,392,395.71
2. 托管费	7.4.8.2.2	325,157.77	898,732.66
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,474,916.26	6,447,143.79
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		391,749.53	424,899.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-7,118,150.44	-234,963,830.76
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-7,118,150.44	-234,963,830.76

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31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)	147,199,855.05	-60,920.16	147,138,934.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-7,118,150.44	-7,118,150.44
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)	-31,108,173.67	1,295,911.98	-29,812,261.69
其中:1.基金申购款	10,332,682.27	-330,289.54	10,002,392.73
2.基金赎回款	-41,440,855.94	1,626,201.52	-39,814,654.42
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)	116,091,681.38	-5,883,158.62	110,208,522.76

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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)	632,349,959.60	282,030,784.85	914,380,744.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-234,963,830.76	-234,963,830.76
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)	-485,150,104.55	-47,127,874.25	-532,277,978.80
其中:1.基金申购款	227,972,775.35	11,292,773.05	239,265,548.40
2.基金赎回款	-713,122,879.90	-58,420,647.30	-771,543,527.20
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)	147,199,855.05	-60,920.16	147,138,934.89

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

______章宏韬______ ______余海春______ ______陈大毅______

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金(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[2014]771号)核准,基金合同于2014年10月31日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并出具《验资报告》(天健验(2014)6-75号)。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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、权证、资产支持证券、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规定)。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。

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 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的说明

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)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。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(三) 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
中国工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

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	244,107,721.38	25.48%	1,404,412,746.90	34.14%

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期末和上年度无。

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	100,200,000.00	86.98%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期末及上年度无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31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
华安证券	225,881.30	25.62%	17,197.09	16.09%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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(%)
华安证券	1,302,917.60	34.45%	341,357.94	58.48%

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,950,946.34	5,392,395.71
其中:支付销售机构的客户维护费	953,159.73	1,265,568.13

注:基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×年管理费率÷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)。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	325,157.77	898,732.66

注:基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×年托管费率÷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)。

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

注:本基金本报告期内和上年度可比期间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

注:本基金本报告期内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

注:本基金本报告期和上年度可比期间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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国工商银行股份有限公司	34,707,006.30	206,335.59	7,439,595.77	248,946.20

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

注:本基金在本报告期内和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2017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
002466	天齐锂业	2017年12月26日	2018年1月3日	配股未上市	11.06	53.21	3,000	33,180.00	159,630.00	-

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
002398	建研集团	2017年10月16日	重大事项停牌	13.15	2018年3月15日	13.63	301,700	4,505,460.70	3,967,355.00	-
603986	兆易创新	2017年11月1日	重大事项停牌	153.72	2018年3月2日	150.00	8,000	669,798.00	1,229,760.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 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的,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	2017年12月31日公允价值	2016年12月31日公允价值
第一层次	72,841,022.90	139,482,073.67
第二层次	5,197,115.00	177,163.07
第三层次	-	-
合计	78,038,137.90	139,659,236.74

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	78,038,137.90	69.12
	其中:股票	78,038,137.90	69.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	34,829,682.96	30.85
8	其他各项资产	38,921.53	0.03
9	合计	112,906,742.39	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	2,457,500.00	2.23
C	制造业	56,519,559.90	51.28
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	9,614,940.00	8.72
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	5,478,783.00	4.97
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,967,355.00	3.60
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	78,038,137.90	70.81

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票

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	603939	益丰药房	120,000	5,457,600.00	4.95
2	000063	中兴通讯	150,000	5,454,000.00	4.95
3	000725	京东方A	800,000	4,632,000.00	4.20
4	600048	保利地产	324,020	4,584,883.00	4.16
5	603883	老百姓	66,000	4,157,340.00	3.77
6	002398	建研集团	301,700	3,967,355.00	3.60
7	002008	大族激光	70,000	3,458,000.00	3.14
8	300545	联得装备	49,000	3,199,700.00	2.90
9	600031	三一重工	350,000	3,174,500.00	2.88
10	002045	国光电器	180,000	3,027,600.00	2.75

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	000910	大亚圣象	9,355,413.10	6.36
2	000915	山大华特	8,899,817.45	6.05
3	000807	云铝股份	8,673,272.08	5.89
4	002398	建研集团	7,959,364.05	5.41
5	600873	梅花生物	7,903,874.18	5.37
6	600048	保利地产	7,267,339.72	4.94
7	601116	三江购物	7,019,446.00	4.77
8	002283	天润曲轴	6,312,655.62	4.29
9	000695	滨海能源	6,156,578.91	4.18
10	000980	众泰汽车	6,134,439.60	4.17
11	600270	外运发展	5,967,885.88	4.06
12	300457	赢合科技	5,957,653.00	4.05
13	603939	益丰药房	5,849,746.00	3.98
14	002554	惠博普	5,668,024.48	3.85
15	600328	兰太实业	5,562,776.86	3.78
16	000422	湖北宜化	5,446,498.35	3.70
17	000012	南 玻A	5,442,495.00	3.70
18	600759	洲际油气	5,190,926.58	3.53
19	002240	威华股份	5,085,038.00	3.46
20	002341	新纶科技	4,990,514.32	3.39
21	000409	山东地矿	4,883,951.86	3.32
22	600337	美克家居	4,702,967.30	3.20
23	000937	冀中能源	4,667,995.00	3.17
24	600821	津劝业	4,662,133.00	3.17
25	600856	中天能源	4,582,702.66	3.11
26	000707	双环科技	4,548,334.37	3.09
27	600784	鲁银投资	4,526,219.14	3.08
28	600626	申达股份	4,500,493.00	3.06
29	600153	建发股份	4,494,813.61	3.05
30	600241	时代万恒	4,468,313.38	3.04
31	002242	九阳股份	4,457,964.00	3.03
32	300545	联得装备	4,457,540.00	3.03
33	600477	杭萧钢构	4,436,978.00	3.02
34	000957	中通客车	4,421,247.93	3.00
35	600320	振华重工	4,412,818.50	3.00
36	600031	三一重工	4,403,118.00	2.99
37	002156	通富微电	4,366,461.00	2.97
38	000039	中集集团	4,364,188.18	2.97
39	600848	上海临港	4,337,659.00	2.95
40	601919	中远海控	4,331,370.20	2.94
41	600006	东风汽车	4,314,330.29	2.93
42	002511	中顺洁柔	4,312,581.80	2.93
43	600651	飞乐音响	4,299,151.49	2.92
44	002001	新和成	4,292,159.52	2.92
45	600466	蓝光发展	4,273,204.00	2.90
46	300332	天壕环境	4,245,690.32	2.89
47	002713	东易日盛	4,238,837.00	2.88
48	000063	中兴通讯	4,207,111.00	2.86
49	000725	京东方A	4,164,000.00	2.83
50	600035	楚天高速	4,158,689.00	2.83
51	600367	红星发展	4,153,129.43	2.82
52	300495	美尚生态	4,131,572.00	2.81
53	600076	康欣新材	4,127,292.00	2.81
54	603808	歌力思	4,082,215.98	2.77
55	600283	钱江水利	4,007,717.00	2.72
56	000925	众合科技	3,987,382.00	2.71
57	000985	大庆华科	3,973,757.20	2.70
58	600755	厦门国贸	3,972,504.00	2.70
59	600068	葛洲坝	3,939,500.00	2.68
60	600858	银座股份	3,923,425.86	2.67
61	600573	惠泉啤酒	3,917,792.04	2.66
62	600798	宁波海运	3,864,684.00	2.63
63	603883	老百姓	3,748,702.00	2.55
64	002008	大族激光	3,678,833.00	2.50
65	600498	烽火通信	3,607,209.00	2.45
66	600180	瑞茂通	3,556,180.00	2.42
67	603818	曲美家居	3,437,748.68	2.34
68	002140	东华科技	3,431,452.00	2.33
69	000852	石化机械	3,378,899.38	2.30
70	603800	道森股份	3,316,570.00	2.25
71	600706	曲江文旅	3,303,797.00	2.25
72	000731	四川美丰	3,291,809.94	2.24
73	002045	国光电器	3,231,545.00	2.20
74	002639	雪人股份	3,074,877.00	2.09
75	603626	科森科技	3,049,683.00	2.07
76	000513	丽珠集团	2,980,973.00	2.03
77	300164	通源石油	2,980,357.34	2.03

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。

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	002554	惠博普	12,341,532.15	8.39
2	000910	大亚圣象	10,629,145.88	7.22
3	600759	洲际油气	9,139,684.78	6.21
4	002240	威华股份	8,676,030.49	5.90
5	000915	山大华特	8,387,052.66	5.70
6	002353	杰瑞股份	7,783,947.11	5.29
7	600873	梅花生物	6,801,443.99	4.62
8	002636	金安国纪	6,485,432.48	4.41
9	300308	中际旭创	6,414,628.87	4.36
10	600270	外运发展	6,149,947.96	4.18
11	000807	云铝股份	6,084,505.72	4.14
12	300411	金盾股份	6,018,849.29	4.09
13	002283	天润曲轴	6,004,625.80	4.08
14	000980	众泰汽车	5,831,411.00	3.96
15	600328	兰太实业	5,717,818.03	3.89
16	000695	滨海能源	5,681,840.97	3.86
17	600477	杭萧钢构	5,539,731.01	3.76
18	000059	华锦股份	5,485,380.44	3.73
19	601116	三江购物	5,341,904.50	3.63
20	300457	赢合科技	5,325,965.84	3.62
21	000554	泰山石油	5,280,242.46	3.59
22	600428	中远海特	5,135,187.10	3.49
23	300227	光韵达	5,128,572.38	3.49
24	000012	南 玻A	5,082,634.01	3.45
25	300434	金石东方	4,987,768.28	3.39
26	000422	湖北宜化	4,924,135.69	3.35
27	600110	诺德股份	4,910,952.88	3.34
28	000409	山东地矿	4,907,369.85	3.34
29	600337	美克家居	4,733,400.25	3.22
30	600731	湖南海利	4,634,118.54	3.15
31	002341	新纶科技	4,623,926.60	3.14
32	000731	四川美丰	4,598,269.15	3.13
33	300103	达刚路机	4,597,570.09	3.12
34	300295	三六五网	4,593,788.21	3.12
35	002154	报喜鸟	4,570,767.71	3.11
36	600889	南京化纤	4,558,253.91	3.10
37	600856	中天能源	4,528,443.00	3.08
38	600241	时代万恒	4,473,740.20	3.04
39	600774	汉商集团	4,447,383.28	3.02
40	600755	厦门国贸	4,406,022.00	2.99
41	002001	新和成	4,361,233.00	2.96
42	000937	冀中能源	4,343,490.16	2.95
43	603808	歌力思	4,325,013.18	2.94
44	002156	通富微电	4,312,463.56	2.93
45	600626	申达股份	4,311,088.27	2.93
46	002511	中顺洁柔	4,310,225.73	2.93
47	600784	鲁银投资	4,310,075.80	2.93
48	002780	三夫户外	4,291,150.10	2.92
49	000957	中通客车	4,271,561.94	2.90
50	002713	东易日盛	4,228,299.45	2.87
51	600035	楚天高速	4,222,526.88	2.87
52	002242	九阳股份	4,206,010.53	2.86
53	600320	振华重工	4,196,527.20	2.85
54	000707	双环科技	4,189,714.67	2.85
55	600848	上海临港	4,169,633.28	2.83
56	300120	经纬电材	4,155,852.18	2.82
57	000785	武汉中商	4,137,170.79	2.81
58	600006	东风汽车	4,100,470.12	2.79
59	601919	中远海控	4,091,574.16	2.78
60	600153	建发股份	4,069,832.30	2.77
61	002178	延华智能	4,038,428.59	2.74
62	600560	金自天正	3,998,838.23	2.72
63	600076	康欣新材	3,943,465.21	2.68
64	603800	道森股份	3,935,244.70	2.67
65	000925	众合科技	3,922,594.81	2.67
66	600719	大连热电	3,913,608.74	2.66
67	600858	银座股份	3,904,109.06	2.65
68	000039	中集集团	3,882,063.85	2.64
69	600283	钱江水利	3,873,143.87	2.63
70	600821	津劝业	3,832,222.32	2.60
71	600573	惠泉啤酒	3,790,441.31	2.58
72	002574	明牌珠宝	3,789,499.75	2.58
73	000779	三毛派神	3,783,697.90	2.57
74	600367	红星发展	3,777,926.33	2.57
75	600561	江西长运	3,712,720.18	2.52
76	000985	大庆华科	3,695,348.36	2.51
77	600651	飞乐音响	3,672,116.86	2.50
78	600466	蓝光发展	3,626,923.20	2.46
79	002627	宜昌交运	3,615,815.81	2.46
80	300332	天壕环境	3,597,841.00	2.45
81	600048	保利地产	3,537,000.00	2.40
82	000852	石化机械	3,534,922.34	2.40
83	002398	建研集团	3,444,237.20	2.34
84	600068	葛洲坝	3,431,608.00	2.33
85	603818	曲美家居	3,373,234.36	2.29
86	600507	方大特钢	3,255,006.00	2.21
87	002140	东华科技	3,218,171.64	2.19
88	600706	曲江文旅	3,201,244.92	2.18
89	000599	青岛双星	3,172,155.82	2.16
90	603939	益丰药房	3,037,752.33	2.06
91	600798	宁波海运	3,012,908.00	2.05
92	300495	美尚生态	2,994,261.40	2.03
93	000638	万方发展	2,960,133.32	2.01

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	450,694,762.13
卖出股票收入(成交)总额	508,416,311.66

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

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投资

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

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	29,273.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,455.82
5	应收申购款	1,191.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,921.53

8.12.4 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。

8.12.5 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	002398	建研集团	3,967,355.00	3.60	重大事项停牌

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
3,957	29,338.31	24,618.23	0.02%	116,067,063.15	99.98%

9.3 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	54,871.57	0.0473%

注:本表列示"占总份额比例"中,对下属分级基金,为占各自级别份额的比例,对合计数,为占期末基金份额总额的比例。

9.4 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年10月31日)基金份额总额	1,537,351,831.89
本报告期期初基金份额总额	147,199,855.05
本报告期基金总申购份额	10,332,682.27
减:本报告期基金总赎回份额	41,440,855.94
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	116,091,681.38

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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

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、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,增聘倪莉莎女士为华富恒财分级债券型证券投资基金基金经理。

19、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富18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

20、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量子生命力混合型证券投资基金基金经理。

21、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,增聘倪莉莎女士为华富天盈货币市场基金基金经理。

22、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中小板指数增强型证券投资基金基金经理。

23、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中证100指数证券投资基金基金经理。

24、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,朱蓓女士不再担任华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理的职务。

25、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,朱蓓女士不再担任华富中证100指数证券投资基金基金经理的职务。

26、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,朱蓓女士不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。

27、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,孔庆卿先生不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。

28、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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所(特殊普通合伙)审计报酬为5元人民币。天健会计师事务所(特殊普通合伙)从2012年起为本公司提供审计服务。

11.6 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。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
方正证券	1	266,490,093.13	27.81%	242,853.21	27.55%	-
华安证券	2	244,107,721.38	25.48%	225,881.30	25.62%	-
天风证券	2	188,130,648.79	19.63%	175,206.60	19.88%	-
东方证券	1	64,490,104.80	6.73%	58,770.01	6.67%	-
安信证券	3	40,332,502.85	4.21%	37,119.61	4.21%	-
长江证券	1	36,758,996.27	3.84%	33,498.63	3.80%	-
广发证券	2	28,990,742.88	3.03%	26,419.08	3.00%	-
西南证券	1	19,754,109.72	2.06%	18,397.04	2.09%	-
中泰证券	1	17,236,277.58	1.80%	15,707.60	1.78%	-
招商证券	2	16,386,198.51	1.71%	15,260.67	1.73%	-
华信证券	1	11,798,803.20	1.23%	10,752.35	1.22%	-
浙商证券	1	8,363,395.08	0.87%	7,621.64	0.86%	-
华创证券	1	7,986,653.48	0.83%	7,278.27	0.83%	-
申万宏源	1	4,385,748.50	0.46%	3,996.75	0.45%	-
太平洋证券	2	2,942,792.00	0.31%	2,740.58	0.31%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

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)本报告期本基金新增天风证券、中银国际、广发证券、安信证券、西南证券、太平洋证券、华信证券、中泰证券等八个交易单元。

3)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。

11.7.2 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
方正证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	100,200,000.00	86.98%	-	-
天风证券	-	-	15,000,000.00	13.02%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

注: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。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1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

注:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2影响投资者决策的其他重要信息

无。