

华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：兴银基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 12 月 31 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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	41
8.3 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	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

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	46
8.7 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	46
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	46
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	46
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
8.12 投资组合报告附注	47
§9 基金份额持有人信息.....	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末上市基金前十名持有人	48
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§10 开放式基金份额变动.....	48
§11 重大事件揭示.....	49
11.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
11.4 基金投资策略的改变	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
11.8 其他重大事件	51
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§13 备查文件目录.....	53
13.1 备查文件目录	53
13.2 存放地点	53
13.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华福大健康
基金主代码	001730
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 27 日
基金管理人	兴银基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	283,208,828.31 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，主要投资于大健康相关产业，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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。
业绩比较基准	中证健康产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	中证健康产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

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		兴银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林佳	张志永
	联系电话	021-20296236	021-62677777-212004
	电子邮箱	lj@hffunds.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95561
传真		021-68630069	021-62159217
注册地址		福建省福州市平潭县潭城镇西航路西航住宅新区 11 号楼 4 楼	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号上海招商银行大厦 16 楼	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		陈文奇	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	杭州市西溪路 128 号新湖商务大厦 9 层
注册登记机构	兴银基金管理有限责任公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号 上海招商银行大厦 16 楼

§ 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 27 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-40,967,486.91	7,753,121.65
本期利润	-43,050,620.25	9,076,293.22
加权平均基金份额本期利润	-0.1309	0.0194
本期加权平均净值利润率	-14.07%	1.91%
本期基金份额净值增长率	-12.12%	1.50%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-30,665,167.82	5,577,208.78
期末可供分配基金份额利润	-0.1083	0.0145
期末基金资产净值	252,543,660.49	390,100,435.08
期末基金份额净值	0.892	1.015
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-10.80%	1.50%

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。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（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（以已实现部分扣除为负实现）。

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 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

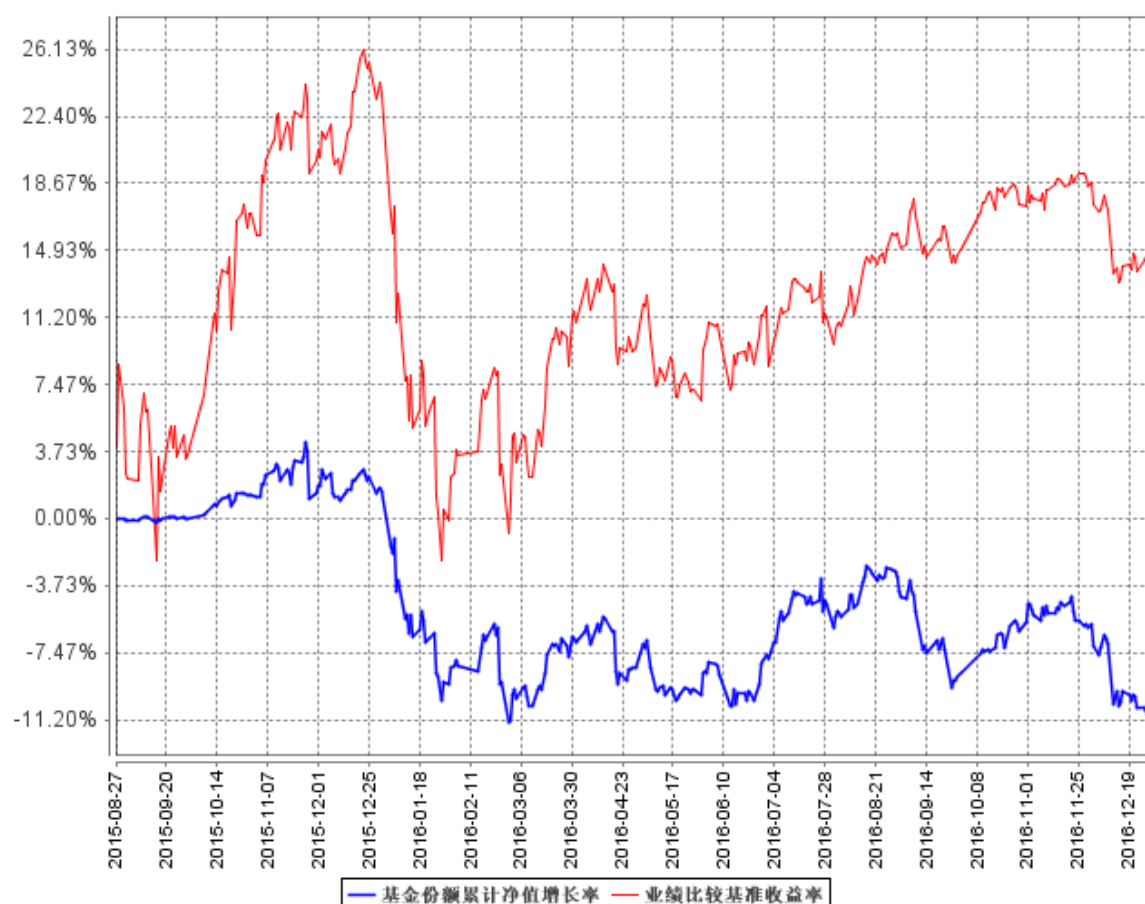
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.01%	0.89%	-3.49%	0.79%	-1.52%	0.10%
过去三个月	-2.41%	0.68%	-0.52%	0.64%	-1.89%	0.04%
过去六个月	-3.25%	0.71%	5.37%	0.70%	-8.62%	0.01%
过去一年	-12.12%	0.80%	-8.34%	1.39%	-3.78%	-0.59%
自基金合同 生效起至今	-10.80%	0.73%	14.42%	1.53%	-25.22%	-0.80%

注：1、本基金成立于 2015 年 8 月 27 日；

2、比较基准=中证健康产业指数收益率(H30344)*80%+中证综合债指数收益率(H11009)*20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

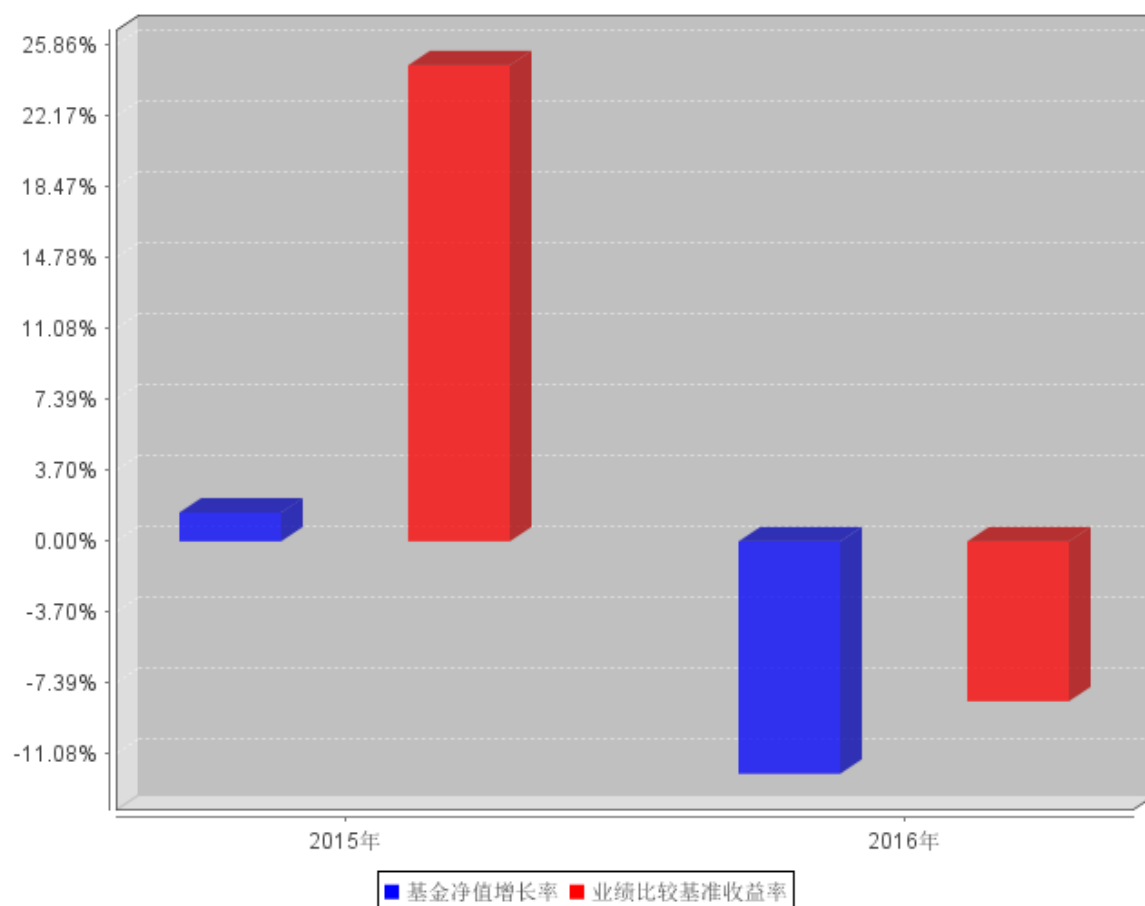


注：1、本基金成立于 2015 年 8 月 27 日；

2、比较基准=中证健康产业指数收益率(H30344)*80%+中证综合债指数收益率(H11009)*20%

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

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对比图



注：1、本基金成立于 2015 年 8 月 27 日；

2、比较基准=中证健康产业指数收益率（H30344）*80%+中证综合债指数收益率（H11009）*20%

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§ 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

兴银基金管理有限责任公司是经中国证监会（证监许可〔2013〕1289 号）批准，于 2013 年

10 月成立。注册地为福建省平潭综合实验区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区陆家嘴。公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。2016 年 9 月 23 日，公司完成了同比例增资的工商变更登记，注册资本由 1 亿元人民币变更为 1.43 亿元人民币。2016 年 10 月 24 日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”正式变更为“兴银基金管理有限责任公司”。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人管理了华福货币市场基金、华福现金增利货币市场基金、华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金、华福瑞益纯债债券型证券投资基金、华福朝阳债券型证券投资基金、华福大健康灵活配置混合型证券投资基金、华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金、华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金、华福稳健债券型证券投资基金、华福长禧半年定期开放债券型证券投资基金、华福现金添利货币市场基金、华福现金收益货币市场基金、华福收益增强债券型证券投资基金和华福长富一年定期开放债券型证券投资基金十四支开放式基金，管理公募基金资产规模人民币 652.92 亿元。

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		
张晓南	基金经理	2015 年 8 月 27 日	-	7 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM），拥有 7 年证券、基金行业工作经验。曾任职于鹏华基金管理有限公司，现任职于兴银基金管理有限责任公司权益投资部，自 2015 年 8 月起担任华福大健康灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 11 月起担任华福丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
方军平	基金经理	2017 年 1 月 4 日	-	10 年	硕士研究生，拥有 10 年证券、基金工作经验。曾任职于国信证券股份有限公司、上海泽熙投资管理有限公司、东方财富证券有限公司和上海宜灵巴巴资产管理有限公司，历任研究员、投资经理。现任职于兴银基金管理有限责任公司权益投资部，自 2016 年 8 月起担任华福鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2017 年 1 月起担任华福大健康灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

张晓南先生为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。报告期后，本基金增聘方军

平先生为基金经理。

2、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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规的规定及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

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

本基金管理人制定了公平交易管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人制定了异常交易监控管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本报告期内，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

一季度整体市场波动较大，1月初连续两次熔断，并创下2000年以来第二大的单月跌幅。2月上旬震荡上行，却被月末再次的下跌抵消；3月存在一定的单边行情，前半个月上涨300点到3000点后进入盘整。由于3月份两会的召开，后期整体市场保持稳定，交易量略为放大，两融在短期见底后略有回升。二季度市场保持箱体运动，在3月份市场小幅反弹后，4月保持平稳，但在4月末5月初整体下降至2800点继续窄幅震荡，6月不确定性消息较多，端午节外盘的震荡导致节后市场大跌，英国脱欧公投的黑天鹅事件也令市场产生了较大的波动。三季度市场整体在2900-3100间震荡，在7月中旬、8月中旬及9月上旬为月中最高点，在月初及月末市场表现均较

差。9 月中旬及下旬两次周一低开低走，虽然影响因素不尽相同，但市场人气低迷、交投冷淡，热点转换较快，且持续时间也都较短，市场整体处于震荡行情中。四季度市场呈现“倒 V”型走势，10 月开始延续 9 月底的涨势，当月上涨 3.19%，随后 11 月上涨 4.82%，当季市场最高点出现在 11 月末，12 月出现两次暴跌，当月跌幅 4.50%。

就基金整体仓位而言，上半年考虑到当前经济形势不甚明朗，投资者风险偏好仍然较低，本基金保持较低仓位运作，在 6 月份较大不确定性落地后适度增加了股票仓位；下半年基金整体仓位保持中性偏多，在市场较弱时对仓位进行了一些控制。

在行业选择上，本基金主要配置在医药、传媒、食品饮料等行业。医药中部分独立于新医改政策或受益于新医改政策的子行业存在相对收益；传媒自年初受到一定的政策压制，同时去年给予了某些子行业较高的预期，在估值逐渐回落至较低水平后，行业自身的高速增长将进一步催化可能的估值修复行情；食品饮料中各子行业龙头仍能保持稳定增长，同时估值处于较低水平。其余相关行业中，环保受益于 PPP 的推动，今年以来订单激增的公司股票也有较好的表现，但在落实为收益前可能出现反复；农林牧渔中部分公司预期有所变化，可能需要蛰伏更长时间。本基金在行业内更多地进行自下而上的个股选择，更多倾向于业绩明确且估值较低的标的，同时也部分配置了高弹性品种以提高组合收益。后续将继续观察各个行业主线投资机会，同时密切关注市场情绪，发挥本基金在仓位控制上的灵活性，力争更高的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期份额净值收益率为-12.12%，同期业绩比较基准收益率为-8.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年中央定调货币政策稳健中性，在防风险和抑制泡沫方面预计对市场阶段性有一定影响，人民币经历 15%的贬值后继续大幅贬值的压力减少将助力资本市场市场化改革。伴随年末的调整行情，部分良好成长性标的再度出现买点。

本基金看好业绩稳定增长的行业龙头、在消费升级的大环境下高速增长的新兴领域公司以及受益于相关政策（如医改等）的细分子行业公司。本基金将更加灵活的进行仓位调整，寻找市场不断变化中可能出现的新的热点，在行业上、主题上适时分散集中，力争更好的投资业绩。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，不断健全完善内控机制，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。本基金管理人主要

监察稽核工作如下：

(1) 加强公司和基金日常运作的合规审核。做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，确保基金运作的诚信和合法合规性符合监管要求。

(2) 深入重点专项稽核工作。本基金管理人进一步梳理业务模式、主要监管规则、潜在风险点等，全面、深入地对关键业务领域进行专项稽核，内容涵盖相关业务领域的各个重要环节的内部控制与风险防范，促进制度规章及时更新，优化操作流程，提升业务线合规管理及风控意识。

(3) 进一步规范对投资研究交易特定岗位的通讯管理。对投资研究交易特定岗位通讯工具在交易时间集中管理，并定期或不定期的对其网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效地防范了各种形式的利益输送行为。

(4) 强化法规学习，开展内控培训，促进合规文化建设。本基金管理人及时根据新颁布的法律法规开展合规宣传培训工作，通过专题培训、律师讲座、合规期刊等多种形式进一步加强内部合规培训力度，深化基金从业人员风合规风险意识，提升职业道德素养，营造良好合规氛围，促进公司稳定健康地发展。

(5) 完成各种定期报告及临时公告的信息披露工作。按照法规要求，做好旗下各支基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

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，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

1. 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管运营保障部的公司领导担任，成员由基金事务部、风险管理部、监察稽核部、研究发展部、投资管理部门(视会议议题内容选择相关投资方向部门)部门负责人或其指定人员组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程

进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

2. 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

3. 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4. 已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

本报告期本基金没有应分配但尚未分配的利润。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

报告期内本基金未出现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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的

监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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〔2017〕7-171 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	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
引言段	我们审计了后附的华福大健康灵活配置混合型证券投资基金（以下简称华福大健康基金）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表和持有人权益（基金净值）变动表，以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华福大健康基金的基金管理人兴银基金管理有限责任公司管理层的责任，这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。	
审计意见段	我们认为，华福大健康基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华福大健康基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和持有人权益（基金净值）变动。	
注册会计师的姓名	谭炼	吴志辉
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国杭州	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华福大健康灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	104,719,687.98	250,842,902.27
结算备付金		3,311,001.69	3,222,160.46
存出保证金		171,822.46	123,189.75
交易性金融资产	7.4.7.2	148,832,680.80	135,019,101.58
其中：股票投资		148,832,680.80	134,809,101.58
基金投资		-	-
债券投资		-	210,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	43,993.03	91,741.93
应收股利		-	-
应收申购款		1,985.11	3,529,736.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		257,081,171.07	392,828,832.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,076,901.51	-
应付赎回款		160,259.52	1,531,091.93
应付管理人报酬		332,127.18	501,714.68
应付托管费		55,354.51	83,619.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	736,859.77	498,133.38
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	176,008.09	113,838.79
负债合计		4,537,510.58	2,728,397.86
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	283,208,828.31	384,252,094.90
未分配利润	7.4.7.10	-30,665,167.82	5,848,340.18
所有者权益合计		252,543,660.49	390,100,435.08
负债和所有者权益总计		257,081,171.07	392,828,832.94

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.892 元，基金份额总额 283,208,828.31 份。

2、本基金合同生效日为 2015 年 8 月 27 日，上年度本基金运作时间未满一年。

7.2 利润表

会计主体：华福大健康灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	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 27 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-34,586,553.47	12,841,921.05
1. 利息收入		2,363,320.40	3,347,253.88
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,957,964.57	3,015,948.38
债券利息收入		13,035.28	32.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		392,320.55	331,273.28
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,009,907.72	7,449,786.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-35,667,186.09	7,439,574.18
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	90,188.42	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-336,240.00	-
股利收益	7.4.7.16	903,329.95	10,212.45
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,083,133.34	1,323,171.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	143,167.19	721,708.97
减：二、费用		8,464,066.78	3,765,627.83
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,597,361.02	2,478,721.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	766,226.73	413,120.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,905,221.59	761,186.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	195,257.44	112,600.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-43,050,620.25	9,076,293.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-43,050,620.25	9,076,293.22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华福大健康灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	384,252,094.90	5,848,340.18	390,100,435.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-43,050,620.25	-43,050,620.25
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）	-101,043,266.59	6,537,112.25	-94,506,154.34
其中：1. 基金申购款	4,371,885.37	-285,294.92	4,086,590.45
2. 基金赎回款	-105,415,151.96	6,822,407.17	-98,592,744.79

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）	283,208,828.31	-30,665,167.82	252,543,660.49
项目	上年度可比期间 2015 年 8 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,076,293.22	9,076,293.22
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）	384,252,094.90	-3,227,953.04	381,024,141.86
其中：1. 基金申购款	588,405,411.63	1,161,850.03	589,567,261.66
2. 基金赎回款	-204,153,316.73	-4,389,803.07	-208,543,119.80
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）	384,252,094.90	5,848,340.18	390,100,435.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 财务报表由下列负责人签署：

<u> 张力 </u>	<u> 刘建新 </u>	<u> 沈阿娜 </u>
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

华福大健康灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可(2015)1615 号文准予注册,本基金首次募集资金总额为人民币 534,705,888.33 元。《华福大健康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 27 日正式生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定

以及《华福大健康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金投资于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（包含中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、债券回购、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货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相关规定）。如法律法规或监管机构允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可将其纳入投资范围。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 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和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。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，其他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。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

2、金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 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。贷款及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按照公允价值进行后续计量，贷款及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。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1、对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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，采

用最近交易市价确定公允价值。

2、对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价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或基金管理人估值委员会认为必要时，应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，确定公允价值。

3、当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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。

4、对于交易所市场和银行间市场交易的主要固定收益品种，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定除外。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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，逐日确认债券利息收入。贴息债视

同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2、投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3、公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times$ 1.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times$ 0.25%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

3、每一基金份额享有同等分配权。

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 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。

2、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得

的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	104,719,687.98	250,842,902.27
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	104,719,687.98	250,842,902.27

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		149,592,642.57	148,832,680.80	-759,961.77
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		149,592,642.57	148,832,680.80	-759,961.77
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		133,485,930.01	134,809,101.58	1,323,171.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	210,000.00	210,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	210,000.00	210,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	133,695,930.01	135,019,101.58	1,323,171.57

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	43,586.03	90,053.77
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	321.97	1,595.00
应收债券利息	-	32.22
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	85.03	60.94
合计	43,993.03	91,741.93

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	736,859.77	498,133.38
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	736,859.77	498,133.38

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	308.09	3,838.79
预提费用	175,700.00	110,000.00
合计	176,008.09	113,838.79

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	384,252,094.90	384,252,094.90
本期申购	4,371,885.37	4,371,885.37
本期赎回（以“-”号填列）	-105,415,151.96	-105,415,151.96
- 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	283,208,828.31	283,208,828.31

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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
上年度末	5,577,208.78	271,131.40	5,848,340.18
本期利润	-40,967,486.91	-2,083,133.34	-43,050,620.25
本期基金份额交易产生的变动数	6,931,427.54	-394,315.29	6,537,112.25
其中：基金申购款	-297,519.32	12,224.40	-285,294.92
基金赎回款	7,228,946.86	-406,539.69	6,822,407.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,458,850.59	-2,206,317.23	-30,665,167.82

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	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 27 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,909,648.28	1,013,964.85
定期存款利息收入	-	1,986,298.61

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	45,332.78	15,415.04
其他	2,983.51	269.88
合计	1,957,964.57	3,015,948.38

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年8月27日(基金 合同生效日)至2015年12月 31日
卖出股票成交总额	1,068,122,705.37	213,931,919.26
减：卖出股票成本总额	1,103,789,891.46	206,492,345.08
买卖股票差价收入	-35,667,186.09	7,439,574.18

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	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27日(基金合 同生效日)至2015年12月31 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	90,188.42	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	90,188.42	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	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27日(基金合 同生效日)至2015年12月31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,877,649.71	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,525,555.00	-
减：应收利息总额	261,906.29	-
买卖债券差价收入	90,188.42	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2015 年 8 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	-336,240.00	

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	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 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	903,329.95	10,212.45

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	903,329.95	10,212.45

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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 27 日(基金合同 生效日)至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,083,133.34	1,323,171.57
——股票投资	-2,083,133.34	1,323,171.57
——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	-2,083,133.34	1,323,171.57

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	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 27 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	143,167.19	721,708.97
合计	143,167.19	721,708.97

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	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 27 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,904,546.59	761,186.02
银行间市场交易费用	675.00	-
合计	2,905,221.59	761,186.02

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	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 27 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	50,000.00
信息披露费	-	-
其他	400.00	-

上清所查询费	1,200.00	-
CFCA 证书费	200.00	-
上证报信披费	100,000.00	60,000.00
帐户维护费	22,500.00	-
银行费用	957.44	2,600.00
合计	195,257.44	112,600.00

7.4.7.21 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴银基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华福证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东
上海兴瀚资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
兴银投资有限公司	基金管理人的股东华福证券全资子公司
兴银成长资本管理有限公司	基金管理人的股东华福证券全资子公司

注：本报告期基金关联方未发生变化，其中“华福资本投资有限公司”法定名称变更为“兴银成长资本管理有限公司”。

本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 27 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
华福证券	671, 202, 829. 61	30. 71%	87, 921, 456. 42	15. 88%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 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27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
华福证券	-	-	325, 000, 000. 00	15. 07%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年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
华福证券	490, 850. 78	29. 94%	283, 754. 92	38. 51%
关联方名称	上年度可比期间 2015年8月27日(基金合同生效日)至2015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
华福证券	64, 297. 18	12. 91%	64, 297. 18	12. 91%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 27 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	4, 597, 361. 02	2, 478, 721. 56

其中：支付销售机构的客 户维护费	1,670,376.95	766,083.11
---------------------	--------------	------------

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 8 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	766,226.73	413,120.25

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

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
上海兴瀚资产管理有限公司	9,999,000.00	3.5306%	9,999,000.00	2.6000%
兴银投资有限公司	2,979,205.98	1.0519%	2,979,205.98	0.7800%

除上海兴瀚资产管理有限公司、兴银投资有限公司投资本基金外，截止报告期末无其他关联方投资本基金情况。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年8月27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
兴业银行股份有限公司	104,719,687.98	1,909,648.28	250,842,902.27	1,524,381.52

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603689	皖天然气	2016年12	2017年1	新股流通受	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	-

		月 30 日	月 10 日	限						
--	--	--------	--------	---	--	--	--	--	--	--

7.4.12.2 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
000411	英特集团	2016 年 12 月 27 日	筹划重大事项	22.10	2017 年 1 月 11 日	24.31	300,000	6,394,095.99	6,630,000.00	-
603986	兆易创新	2016 年 9 月 19 日	重大资产重组	177.97	2017 年 3 月 13 日	195.77	20,915	3,510,681.72	3,722,242.55	-
000558	莱茵体育	2016 年 10 月 17 日	筹划重大事项	14.75	-	-	249,915	3,947,466.30	3,686,246.25	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设合规及风险管理委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极组织对公司各项制度及内部控制的执行情况、业

务的合法合规性进行监督检查，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度及内部控制执行情况的监察稽核工作，风险管理部负责公司业务合法合规性管理，履行合规管理职责。公司管理层重视和支持风险管理和监察稽核工作，并保证合规管理和监察稽核工作的独立性和权威性，配备了充足合格的人员，明确了部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而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金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	210,000.00
合计	—	210,000.00

长期信用评级由中国人民银行许可的信用机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

本报告期末，未持有国债、政策性金融债及央行票据等以外的长期债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式接入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持有金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变化而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存在保证金、债券投资及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	------	-------	-------	-----	----

2016 年 12 月 31 日		月	-1 年				
资产							
银行存款	104,719,687.98	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	104,719,687.98
结算备付金	3,311,001.69	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,311,001.69
存出保证金	171,822.46	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	171,822.46
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	148,832,680.80	148,832,680.80
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	43,993.03	43,993.03
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,985.11	1,985.11
资产总计	108,202,512.13	0.00	0.00	0.00	0.00	148,878,658.94	257,081,171.07
负债							
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,076,901.51	3,076,901.51
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	160,259.52	160,259.52
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	332,127.18	332,127.18
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	55,354.51	55,354.51
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	736,859.77	736,859.77
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	176,008.09	176,008.09
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	4,537,510.58	4,537,510.58
利率敏感度缺口	108,202,512.13	0.00	0.00	0.00	0.00	144,341,148.36	252,543,660.49
上年度末 2015 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							
银行存款	250,842,902.27	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	250,842,902.27
结算备付金	3,222,160.46	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,222,160.46
存出保证金	123,189.75	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	123,189.75
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	210,000.00	134,809,101.58	135,019,101.58
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	91,741.93	91,741.93
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,529,736.95	3,529,736.95
资产总计	254,188,252.48	0.00	0.00	0.00	210,000.00	138,430,580.46	392,828,832.94
负债							
卖出回购金融资 产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,531,091.93	1,531,091.93
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	501,714.68	501,714.68
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	83,619.08	83,619.08
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	498,133.38	498,133.38
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	113,838.79	113,838.79
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,728,397.86	2,728,397.86
利率敏感度缺口	254,188,252.48	0.00	0.00	0.00	210,000.00	135,702,182.60	390,100,435.08

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

上年度末，利率风险对持仓债券的影响几乎可以忽略不计；本年度末，本基金未有债券持仓。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	148,832,680.80	58.93	134,809,101.58	34.56
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	210,000.00	0.05

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	148,832,680.80	58.93	135,019,101.58	34.61

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金的其他价格风险主要源于证券市场的系统性风险，根据本报告的“3.2.3 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”图中可以看出证券市场的系统性风险对本基金收益率的影响不明显。

上年度末，本基金持有的交易性权益类资产占基金资产净值为 34.56%。

报告期末，本基金持有的交易性权益类资产占基金资产净值为 58.93%。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 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。

§ 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	148,832,680.80	57.89
	其中：股票	148,832,680.80	57.89
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	-	-
	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	108,030,689.67	42.02
7	其他各项资产	217,800.60	0.08
8	合计	257,081,171.07	100.00

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	1,935,600.00	0.77
B	采矿业	—	—
C	制造业	100,669,890.21	39.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,994,313.84	1.19
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	18,871,418.00	7.47
G	交通运输、仓储和邮政业	1,979,200.00	0.78
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	219,204.14	0.09
J	金融业	2,295,780.00	0.91
K	房地产业	8,616,746.25	3.41
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	11,250,528.36	4.45
S	综合	—	—
	合计	148,832,680.80	58.93

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 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	002007	华兰生物	255,000	9,116,250.00	3.61

2	000915	山大华特	200,000	8,426,000.00	3.34
3	000538	云南白药	100,400	7,645,460.00	3.03
4	300357	我武生物	199,965	7,002,774.30	2.77
5	000848	承德露露	614,855	6,880,227.45	2.72
6	600594	益佰制药	409,980	6,826,167.00	2.70
7	000910	大亚圣象	356,388	6,807,010.80	2.70
8	601595	上海电影	169,978	6,734,528.36	2.67
9	000530	大冷股份	620,000	6,733,200.00	2.67
10	000651	格力电器	270,000	6,647,400.00	2.63
11	000411	英特集团	300,000	6,630,000.00	2.63
12	600826	兰生股份	210,000	5,737,200.00	2.27
13	300195	长荣股份	309,992	5,189,266.08	2.05
14	002305	南国置业	950,000	4,930,500.00	1.95
15	000793	华闻传媒	400,000	4,516,000.00	1.79
16	603986	兆易创新	20,915	3,722,242.55	1.47
17	000558	莱茵体育	249,915	3,686,246.25	1.46
18	002675	东诚药业	250,000	3,575,000.00	1.42
19	600519	贵州茅台	10,000	3,341,500.00	1.32
20	603002	宏昌电子	499,934	3,319,561.76	1.31
21	600699	均胜电子	100,000	3,309,000.00	1.31
22	600345	长江通信	140,000	3,180,800.00	1.26
23	002758	华通医药	99,950	2,962,518.00	1.17
24	000875	吉电股份	449,983	2,956,388.31	1.17
25	601336	新华保险	50,000	2,189,000.00	0.87
26	002083	孚日股份	300,000	2,121,000.00	0.84
27	002637	赞宇科技	149,977	2,107,176.85	0.83
28	603020	爱普股份	99,923	2,032,433.82	0.80
29	002737	葵花药业	60,000	2,021,400.00	0.80
30	600861	北京城乡	130,000	2,013,700.00	0.80
31	002627	宜昌交运	80,000	1,979,200.00	0.78
32	300106	西部牧业	120,000	1,935,600.00	0.77
33	603108	润达医疗	50,000	1,528,000.00	0.61
34	600996	贵广网络	11,666	219,204.14	0.09
35	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.05
36	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.04
37	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.04
38	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.03
39	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.03
40	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.03

41	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.03
42	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
43	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02
44	603689	皖天然气	4,819	37,925.53	0.02
45	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
46	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
47	603886	元祖股份	1,245	22,036.50	0.01

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	002007	华兰生物	33,177,560.46	8.50
2	600436	片仔癀	21,277,357.40	5.45
3	600826	兰生股份	19,694,865.04	5.05
4	601595	上海电影	18,873,719.64	4.84
5	000915	山大华特	18,655,663.84	4.78
6	600737	中粮屯河	17,324,881.40	4.44
7	000999	华润三九	16,589,549.23	4.25
8	600566	济川药业	16,514,477.72	4.23
9	600637	东方明珠	16,324,751.55	4.18
10	600050	中国联通	16,204,844.00	4.15
11	002732	燕塘乳业	15,965,959.45	4.09
12	002701	奥瑞金	15,910,405.22	4.08
13	600887	伊利股份	15,197,642.23	3.90
14	000793	华闻传媒	14,920,099.57	3.82
15	603108	润达医疗	14,875,222.10	3.81
16	002299	圣农发展	14,663,885.20	3.76
17	600037	歌华有线	14,493,063.00	3.72
18	300070	碧水源	14,167,818.86	3.63
19	600763	通策医疗	13,946,912.00	3.58
20	600711	盛屯矿业	13,047,033.02	3.34
21	300027	华谊兄弟	12,774,165.00	3.27
22	000530	大冷股份	12,582,430.02	3.23
23	000860	顺鑫农业	12,538,383.00	3.21
24	600597	光明乳业	12,214,233.73	3.13

25	600519	贵州茅台	12,013,032.00	3.08
26	600136	当代明诚	11,985,772.27	3.07
27	601607	上海医药	11,760,803.47	3.01
28	000538	云南白药	11,549,537.00	2.96
29	600252	中恒集团	11,482,955.00	2.94
30	002739	万达院线	11,459,507.00	2.94
31	600068	葛洲坝	11,452,721.00	2.94
32	600138	中青旅	11,155,319.00	2.86
33	600572	康恩贝	11,130,408.25	2.85
34	600373	中文传媒	10,826,539.40	2.78
35	000069	华侨城 A	10,818,878.00	2.77
36	300055	万邦达	10,811,056.00	2.77
37	601628	中国人寿	10,617,648.00	2.72
38	000558	莱茵体育	9,874,663.30	2.53
39	002288	超华科技	9,324,880.00	2.39
40	601318	中国平安	9,254,664.28	2.37
41	002519	银河电子	9,203,831.78	2.36
42	002456	欧菲光	9,201,431.29	2.36
43	300396	迪瑞医疗	9,142,469.23	2.34
44	600498	烽火通信	8,725,589.00	2.24
45	600679	上海凤凰	8,693,064.92	2.23
46	600699	均胜电子	8,537,555.00	2.19
47	000411	英特集团	8,499,895.99	2.18
48	600547	山东黄金	8,420,874.00	2.16
49	000848	承德露露	8,193,841.43	2.10
50	002675	东诚药业	8,078,197.65	2.07
51	000910	大亚圣象	8,009,898.00	2.05

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	002007	华兰生物	27,168,516.95	6.96
2	600436	片仔癀	23,780,025.45	6.10
3	000999	华润三九	18,308,499.17	4.69
4	600566	济川药业	18,247,070.85	4.68
5	600737	中粮屯河	17,308,283.18	4.44

6	600037	歌华有线	16,470,286.60	4.22
7	600050	中国联通	16,413,006.00	4.21
8	600637	东方明珠	15,965,640.07	4.09
9	600887	伊利股份	15,845,177.67	4.06
10	002701	奥瑞金	15,490,092.82	3.97
11	300070	碧水源	15,286,440.13	3.92
12	002732	燕塘乳业	15,114,922.91	3.87
13	600826	兰生股份	13,771,508.79	3.53
14	000793	华闻传媒	13,707,223.82	3.51
15	600711	盛屯矿业	13,558,898.00	3.48
16	603108	润达医疗	12,678,185.84	3.25
17	002299	圣农发展	12,565,935.40	3.22
18	600763	通策医疗	12,518,870.33	3.21
19	601607	上海医药	12,210,235.55	3.13
20	600373	中文传媒	12,160,973.05	3.12
21	000069	华侨城 A	11,982,962.61	3.07
22	300027	华谊兄弟	11,962,141.53	3.07
23	002288	超华科技	11,834,025.00	3.03
24	600252	中恒集团	11,792,888.16	3.02
25	600597	光明乳业	11,633,366.61	2.98
26	300055	万邦达	11,428,980.62	2.93
27	600572	康恩贝	11,108,762.40	2.85
28	601318	中国平安	11,065,969.30	2.84
29	601628	中国人寿	10,903,069.00	2.79
30	600138	中青旅	10,505,535.34	2.69
31	600679	上海凤凰	10,452,363.00	2.68
32	000860	顺鑫农业	10,377,773.11	2.66
33	600068	葛洲坝	10,171,259.34	2.61
34	002739	万达院线	10,122,156.00	2.59
35	600519	贵州茅台	9,803,390.18	2.51
36	002519	银河电子	9,775,734.70	2.51
37	000538	云南白药	9,042,526.68	2.32
38	600136	当代明诚	9,034,370.48	2.32
39	300396	迪瑞医疗	8,875,926.47	2.28
40	002456	欧菲光	8,828,150.64	2.26
41	000915	山大华特	8,683,394.42	2.23
42	600079	人福医药	8,554,642.12	2.19
43	601595	上海电影	8,523,068.00	2.18

44	600547	山东黄金	8,260,104.57	2.12
45	600225	天津松江	8,146,243.45	2.09

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	1,119,896,604.02
卖出股票收入（成交）总额	1,068,122,705.37

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

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

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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货，无相关投资评价。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.12.2

本基金不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

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	171,822.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,993.03
5	应收申购款	1,985.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	217,800.60

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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
3,978	71,193.77	12,978,205.98	4.58%	270,230,622.33	95.42%

9.2 期末上市基金前十名持有人

报告期内本基金未上市交易。

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	385,378.89	0.1361%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年8月27日）基金份额总额	534,705,888.33
本报告期期初基金份额总额	384,252,094.90
本报告期基金总申购份额	4,371,885.37
减:本报告期基金总赎回份额	105,415,151.96
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	283, 208, 828. 31
-------------	-------------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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) 报告期内本基金基金管理人人事变动如下：

2016 年 3 月 29 日，基金管理人发布了高级管理人员变更公告，自 2016 年 3 月 28 日起本基金管理人的督察长由林佳同志正式任职，原督察长郑燕洪同志正式离任。

报告期后，2017 年 2 月 14 日，基金管理人发布了高级管理人员变更公告，自 2017 年 2 月 13 日起郑泽星先生和卢银英女士不再担任本基金管理人副总经理。

(2) 报告期内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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

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改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 70,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

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

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
海通证券	2	684,054,264.57	31.30%	500,247.51	30.52%	-
华福证券	2	671,202,829.61	30.71%	490,850.78	29.94%	-
广发证券	2	579,989,675.98	26.54%	540,143.77	32.95%	-
中投证券	2	250,399,613.47	11.46%	107,996.96	6.59%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

- （1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- （3）能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动资源，协助基金投资；
- （4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

选择程序：本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选证券公司的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的证券公司。

2、报告期内租用证券公司交易单元未发生变更。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	395,154.93	64.70%	4,185,000,000.00	100.00%	-	-
中投证券	215,602.54	35.30%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	华福基金 2015 年 12 月 31 日基金净值（收益）	上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	华福基金管理有限责任公司关于 2016 年 1 月 4 日因指数熔断机制实施旗下基金相关业务办理时间调整的公告	公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	华福基金管理有限责任公司关于 2016 年 1 月 7 日因指数熔断机制实施旗下基金相关业务办理时间调整的公告	公司网站	2016 年 1 月 7 日
4	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
5	关于旗下基金新增陆金所资管为代销机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 28 日
6	关于旗下基金新增天天基金为代销机构的公告	上海证券报、公司网站	2016 年 2 月 22 日
7	关于旗下基金参加天天基金费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2016 年 2 月 26 日
8	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告	公司网站	2016 年 3 月 29 日
9	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要	上海证券报	2016 年 3 月 29 日
10	华福基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
11	关于旗下基金新增同花顺基金为代销机构并参加费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 11 日
12	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 1 号）	公司网站	2016 年 4 月 12 日
13	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（2016 年第 1 号）	上海证券报	2016 年 4 月 12 日
14	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 20 日
15	关于旗下部分基金开通定期定额投资业务并参加兴业银行基金定投优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 22 日
16	关于旗下基金新增代销机构的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 27 日
17	关于旗下基金参加平安证券费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 5 月 3 日
18	关于旗下基金参加好买基金费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 5 月 6 日
19	关于旗下部分基金在陆金所资管开通定期定额投资业务并参加定投费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 29 日

20	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 21 日
21	关于旗下基金新增中信证券、中信证券（山东）和中信期货为代销机构的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 8 月 24 日
22	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	公司网站	2016 年 8 月 26 日
23	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	上海证券报	2016 年 8 月 26 日
24	华福基金管理有限责任公司关于增加注册资本的公告	上海证券报、证券日报、公司网站	2016 年 9 月 29 日
25	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	公司网站	2016 年 10 月 12 日
26	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（2016 年第 2 号）	上海证券报	2016 年 10 月 12 日
27	华福大健康灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 25 日
28	关于华福基金管理有限责任公司法定名称变更事宜的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016 年 10 月 26 日
29	关于旗下基金新增长城证券为代销机构并开通定期定额投资的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016 年 11 月 28 日
30	关于旗下基金新增华信证券为代销机构并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016 年 11 月 28 日
31	关于旗下基金新增国泰君安证券为代销机构、开通定期定额投资并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、公司网站	2016 年 11 月 28 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本公司经证监会证监许可〔2013〕1289 号文批准，于 2013 年 10 月 25 日成立。

2016 年 9 月 23 日，公司股东同比例增资，公司注册资本由 10,000 万元变更为 14,300 万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券有限责任公司出资比例为 76%，国脉科技股份有限公司出资比例为 24%。

2016 年 10 月 24 日，公司完成了法定名称变更的工商登记，法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。原以“华福基金管理有限责任公司”名义对外签订的合同、协议及债权、债务关系将全部由“兴银基金管理有限责任公司”承继。

2016 年 11 月 16 日，公司取得了由中国证券监督管理委员会颁发的经营证券期货业务许可

证，完成了资格证书的更新工作。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予华福大健康灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《华福大健康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华福大健康灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《华福大健康灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内华福大健康灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人办公场所，并登载于基金管理人网站（www.hffunds.cn）。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

兴银基金管理有限责任公司

2017 年 3 月 29 日