基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

# 富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

## 【2015】年度报告摘要

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016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。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

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2015年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 富安达新兴成长混合 |
| 基金主代码 | 000755 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年9月11日 |
| 基金管理人 | 富安达基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 606,321,031.54 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过股票与债券等资产的合理配置,通过深入研究并积极投资于新兴产业及其相关行业中的高速成长企业,分享新兴产业发展所带来的投资机会,在有效控制风险的前提下,力争为投资者带来长期的超额收益。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下的富安达多维经济模型,通过对全球经济发展形势,国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测,并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型,辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。一般情况下,本基金将大部分基金资产投资于新兴产业及其相关行业中成长型上市公司所发行的股票等证券,当证券市场系统性风险加大时,本基金将降低相关证券资产的配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金,一般情况,其风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。 |

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 | | 富安达基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘涛 | 汤嵩蓥 |
| | 联系电话 | 021-61870999 | 95559 |
| | 电子邮箱 | service@fadfunds.com | tangsy@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-630-6999(免长途)021-61870666 | 95559 |
| 传真 | | 021-61870888 | 021-62701216 |

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 | www.fadfunds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

§3 主要财务指标、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 | 2015年 | 2014年9月11日-2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 59,240,935.35 | -3,497,051.04 |
| 本期利润 | 67,744,164.49 | -317,614.04 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0618 | -0.0016 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1987 | -0.0510 |
| 期末基金资产净值 | 790,589,353.59 | 99,345,079.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.3039 | 0.9490 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2015年末 | 2014年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 30.39% | -5.10% |

注:1、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:基金的认购、申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润为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。

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 | 1.38% | 0.07% | 13.06% | 1.20% | -11.68% | -1.13% |
| 过去六个月 | 0.30% | 0.08% | -5.64% | 1.97% | 5.94% | -1.89% |
| 过去一年 | 37.40% | 1.02% | 26.71% | 1.71% | 10.69% | -0.69% |
| 自基金合同生效日起至今(2014年09月11日-2015年12月31日) | 30.39% | 1.24% | 37.49% | 1.55% | -7.10% | -0.31% |

注:①本基金业绩比较基准为:60%×中证新兴产业指数+40%×中债总指数,

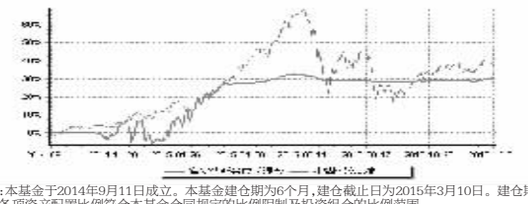
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =60%×[中证新兴产业指数t / 中证新兴产业指数(t-1)-1]+40%×[中债总指数t / 中债总指数(t-1) -1]

Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)

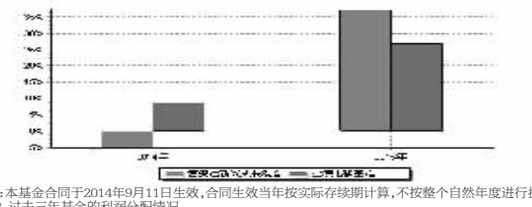
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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:本基金于2014年9月11日成立。本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2015年3月10日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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:本基金合同于2014年9月11日生效,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

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§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

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限责任公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司三家单位共同发起设立。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦,注册资本2.88亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念,以基金持有人利益最大化为首要经营目标,为客户提供卓越的理财服务。

截至2015年12月31日,公司共管理七只开放式基金:富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金通货币市场证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金。

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 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 孔学兵 | 本基金的基金经理、富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理、公司投资管理部总监、公司董事 | 2014年9月11日 | 2015年10月8日 | 19年 | 历任南京证券股份有限公司证券投资总部投资经理;资产管理总部投资主办,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍 |
| 孙绍冰 | 本基金的基金经理、公司研究发展部总监助理 | 2015年5月22日 | - | 8年 | 历任齐鲁证券研究所行业研究员,富安达基金管理有限公司研究发展部高级行业研究员兼基金经理助理,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍 |

注:1、任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其各项实施准则、《富安达策略精选混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金无违法、违规行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。

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颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。

本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起,监察稽核部定期对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,按照特定计算周期,分日、3日、5日和10日时间窗分析同向交易中存在价格差异的样本,通过对各投资组合间以及单个组合与组合类别间的公平交易结果分析,在特定时间窗内交易证券的溢价率和溢价金额均在正常范围内,因此不构成潜在利益输送的显著性。

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。

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

虽然报告期内经历曲折,但全年市场指数均以上涨收盘,其中创业板、中小板表现好于主板。具体可分为三个阶段:年初到6月中旬,"大众创业、万众创新"点燃市场做多行情;6月中旬到9月中旬,受配资清理、汇率等方面影响,市场大幅调整;9月中旬至年底市场进入修复反弹阶段。

投资策略方面:1季度我们积极布局战略新兴产业,后期随着市场进入亢奋阶段,我们逐步降低仓位,对估值优势不强的个股进行了减持,适当配置了安全边际较高的行业以及个股。另外,报告期内随着IPO制度稳定与发行逐步加力,新股赚钱效应明显且也不乏代表经济转型潮流的优质标的,为获得较为稳定的投资回报,我们参与了新股投资。

分化将是未来市场的主旋律:改革与创新是我们关注的两大主题。在行业配置方面,我们认为能够穿越周期的更多是代表未来经济发展方向的战略新兴产业,与此有关的信息技术、智能制造、生物医药、新材料以及环保等行业将进行重点配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.3039元,本报告期份额净值增长率为37.40%,同期业绩比较基准收益率为26.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面:一方面国内经济需求乏力,供给侧改革进入攻坚阶段;另一方面国外经济增长乏力,外需不足。从基本面看,预计未来一段时间宏观经济将呈现L型弱平衡的运行态势。但从微观企业的表现看,在经济转型背景下,尽管宏观增长动力不足,但结构性的增长亮点也会层出不穷。

流动性方面:为改革和转型赢得时间,"稳增长"仍不可或缺,预计整体流动性依然宽松,但2016年经济形势更为复杂,外有美国加息预期,内有供给侧改革推进,因而边际改善可能要弱于2015年。

在对整体宏观经济基本面以及流动性判断的基础上,我们认为2016年市场将会维持震荡走势,结构性机会仍会延续,改革与创新预计将会有较好的市场表现,业绩和成长空间仍将是筛选股票的主要标准,而估值标准依然需要兼顾。目前,市场急跌后,部分优质公司已经进入估值合理区域,随着利空因素逐步消化,市场进入行情修复阶段,我们将重点关注战略新兴产业的投资机会,主要包括信息技术、健康经济、智能装备、环保等。

展望2016年,本基金将在市场分化过程中发挥"自下而上"精选个股的优势,配合适时的仓位控制,力争为投资者带来较好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,公司总经理担任估值委员会主席,研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2015年度,基金托管人在富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015年度,富安达基金管理有限公司在富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2015年度,由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。注册会计师陈玲、沈兆杰于 2016 年 3 月 24日签字出具了普华永道中天审字(2016)第22241号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2015年12月31日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 96,187.07 | 1,512,299.29 |
| 结算备付金 | | 767,942,796.64 | 18,141,292.42 |
| 存出保证金 | | 47,180.60 | 54,579.64 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 22,981,281.62 | 83,778,508.97 |
| 其中:股票投资 | | 22,981,281.62 | 83,778,508.97 |
| 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,743,430.14 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 279,460.67 | 3,265.27 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 42,688.67 | 273,649.06 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 793,133,025.41 | 103,763,594.65 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年12月31日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 3,321,606.32 |
| 应付赎回款 | | 84,419.64 | 273,543.27 |
| 应付管理人报酬 | | 1,522,540.79 | 155,164.34 |
| 应付托管费 | | 253,756.80 | 25,860.73 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 272,881.87 | 401,933.77 |
| 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 | 410,072.72 | 240,406.96 |
| 负债合计 | | 2,543,671.82 | 4,418,515.39 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 606,321,031.54 | 104,679,160.39 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 184,268,322.05 | -5,334,081.13 |
| 所有者权益合计 | | 790,589,353.59 | 99,345,079.26 |
| 负债和所有者权益总计 | | 793,133,025.41 | 103,763,594.65 |

注:1、报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.3039元,基金份额总额606,321,031.54份。

7.2 利润表

会计主体:富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间 2014年9月11日至2014年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 93,374,190.23 | 1,634,715.54 |
| 1.利息收入 | | 18,900,519.52 | 1,576,669.33 |
| 其中:存款利息收入 | 7.4.7.11 | 15,179,848.50 | 1,251,074.37 |
| 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 | | 3,720,671.02 | 325,594.96 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 62,436,668.32 | -3,662,883.13 |
| 其中:股票投资收益 | 7.4.7.12 | 62,149,885.69 | -3,662,883.13 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 286,782.63 | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 7.4.7.17 | 8,503,229.14 | 3,179,437.00 |
| 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 | 3,533,773.25 | 541,492.34 |
| 减:二、费用 | | 25,630,025.74 | 1,952,329.58 |
| 1. 管理人报酬 | | 20,904,986.55 | 925,636.40 |
| 2. 托管费 | | 3,484,164.54 | 154,272.75 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 853,229.65 | 631,090.43 |
| 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 | 387,645.00 | 241,330.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 67,744,164.49 | -317,614.04 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 67,744,164.49 | -317,614.04 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2015年1月1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) | 104,679,160.39 | -5,334,081.13 | 99,345,079.26 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 67,744,164.49 | 67,744,164.49 |
| 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) | 501,641,871.15 | 121,858,238.69 | 623,500,109.84 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,856,653,721.03 | 501,047,813.82 | 2,357,701,534.85 |
| 2.基金赎回款 | -1,355,011,849.88 | -379,189,575.13 | -1,734,201,425.01 |
| 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) | 606,321,031.54 | 184,268,322.05 | 790,589,353.59 |

| 项 目 | 上年度可比期间 2014年9月11日至2014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) | 249,422,328.18 | - | 249,422,328.18 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -317,614.04 | -317,614.04 |
| 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) | -144,743,167.79 | -5,016,467.09 | -149,759,634.88 |
| 其中:1.基金申购款 | 8,071,613.73 | 37,389.16 | 8,109,002.89 |
| 2.基金赎回款 | -152,814,781.52 | -5,053,856.25 | -157,868,637.77 |
| 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) | 104,679,160.39 | -5,334,081.13 | 99,345,079.26 |

报表附注为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:

| 蒋晓刚 | 朱龙芳 | 顾颖 |
|---|---|---|
| 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

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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]697号《关于核准富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由富安达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币249,339,317.51元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第492号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年9月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为249,422,328.18份基金份额,其中认购资金利息折合83,010.67份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,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发行并上市的股票)、债券(包括国债、央票、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%;非现金资产中不低于80%的资产将投资于新兴产业及其相关行业中成长型上市公司的股票;债券资产占基金资产的比例为0%-95%;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%。本基金的业绩比较基准:: 中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2016年3月24日批准报出。

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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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[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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 富安达基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 南京证券股份有限公司(“南京证券”) | 基金管理人的控股股东、基金销售机构 |
| 江苏交通控股有限公司(“江苏交通”) | 基金管理人的股东 |
| 南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司(“南京河西”) | 基金管理人的股东 |
| 富安达资产管理(上海)有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 上年度可比期间 2014年9月11日至2014年12月31日 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 南京证券股份有限公司 | 18,985,781.28 | 3.70% | 148,536,108.62 | 33.64% |

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2015年1月1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 |
|---|---|---|---|---|
| 南京证券股份有限公司 | 17,284.73 | 3.68% | - | - |

| 关联方名称 | 上年度可比期间 2014年9月11日至2014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 |
|---|---|---|---|---|
| 南京证券股份有限公司 | 135,227.31 | 33.64% | 135,227.31 | 33.64% |

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 2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间 2014年9月11日至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 20,904,986.55 | 925,636.40 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 13,722,762.67 | 402,348.83 |

注:1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 | 上年度可比期间 2014年9月11日至2014年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,484,164.54 | 154,272.75 |

注:支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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

本基金本报告内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未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

| 关联方名称 | 本期末 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 | 上年度末 2014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 |
|---|---|---|---|---|
| 南京证券 | - | - | 1,800,000.00 | 1.71% |
| 富安达资产管理(上海)有限公司 | 7,738,565.13 | 1.28% | - | - |

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 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额 | 当期利息收入 | 上年度可比期间 2014年9月11日至2014年12月31日 期末余额 | 当期利息收入 |
|---|---|---|---|---|
| 交通银行活期存款 | 96,187.07 | 4,002,718.49 | 1,512,299.29 | 24,909.32 |

注:1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2015年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

7.4.8.6 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的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 002781 | 奇信股份 | 2015-12-16 | 2016-12-22 | | 13.31 | 37.37 | 204,545 | 2,722,493.96 | 7,643,846.65 |
| 300488 | 恒锋工具 | 2015-06-25 | 2016-07-04 | | 20.11 | 88.80 | 71,341 | 1,434,667.51 | 6,335,080.80 |

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(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300104 | 乐视网 | 2015-12-07 | 重大资产重组 | 58.80 | | - | 10,000 | 381,000.00 | 588,000.00 |

注:注:本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末及上年度可比期末未持有银行间市场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

本基金本报告期末及上年度可比期末未持有交易所市场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

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: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:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为6,826,754.17元,属于第二层次的余额为16,154,527.45元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次64,433,308.97元,第二层次19,345,200.00元,无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃),或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输