华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:华融证券股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2017年3月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017年3月20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,德勤会计师事务所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。

本报告期自 2016年1月1日起至12 月31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华融新利
场内简称	–
基金主代码	001797
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月2日
基金管理人	华融证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,880,896.64份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	–
上市日期	–

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略,把握市场机会,分享中国经济转型和增长的红利,在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采取积极主动的资产配置策略,注重风险与收益的平衡,选择适应经济转型升级、能够为股东持续创造价值的优质标的,运用多样化的投资策略实行组合管理,实现基金资产的长期增值。 1、资产配置策略从全球经济格局和中国经济发展方式的变化,分析经济的驱动力和阶段性特征,结合宏观政策、产业政策、结构变迁、市场情绪等对比分析大类资产风险收益比,合理分配各大类资产配置比例,以实现基金资产的稳健增值。 2、股票投资策略 本基金的股票投资秉承价值投资理念,采取定量和定性相结合的方法,因挖符合经济升级转型,发展潜力巨大的行业与公司,通过上下游产业链的实地调研对研究逻辑和结论进行验证,灵活运用多种低风险投资策略,把握市场投资机会。 3、债券投资策略 本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上,灵活运用类属配置、个券选择、套利等投资策略。 4、股指期货投资策略 本基金认为在符合一定条件的市场环境中,有必要审慎灵活地综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险,降低投资组合波动性并提高资金管理效率。本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。 本基金参与股指期货套期时将综合考虑: 5、套利策略 利用市场的弱有效性,以较低成本、较高效率、承担较低风险情况下把握市场定价偏差带来的机会,主要包括新可转换债券套利、期发套利、转债转股套利等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率* 30%+1年期人民币定期存款基准利率* 70%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华融证券股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	肖琦	林葛
	联系电话	010-85565728	010-66060069
	电子邮箱	xiaoqi@huarsec.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9999	95599
传真		010-85565532	010-68121816

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.fund.huarsec.com.cn
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	2016年	2015年9月2日(基金合同生效日)-2015年12月31日	2014年
本期已实现收益	9,079,254.57	1,396,429.18	–
本期利润	5,563,926.01	4,810,250.19	–
加权平均基金份额本期利润	0.0567	0.0084	–
本期基金份额净值增长率	1.98%	0.90%	–
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0292	0.0053	–
期末基金资产净值	81,180,658.77	1,212,874,657.72	–
期末基金份额净值	1.029	1.009	–

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

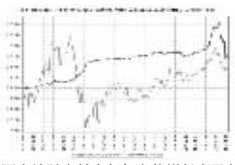
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

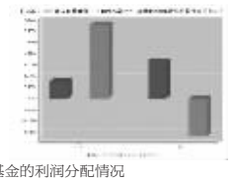
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.39%	0.33%	0.82%	0.21%	-1.21%	0.12%
过去六个月	-0.39%	0.24%	2.08%	0.23%	-2.47%	0.01%
过去一年	1.98%	0.18%	-1.99%	0.42%	3.97%	-0.24%
自基金合同生效起至今	2.90%	0.16%	1.78%	0.45%	1.12%	-0.29%

注:本基金的基金合同自2015年9月2日起生效。根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。

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



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



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
合计	–	–	–	–	

注:本基金自成立至今未进行利润分配活动。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华融证券股份有限公司(以下简称"公司")是经中国证监会批准,由中国华融资产管理股份有限公司(以下简称"中国华融")作为主发起人,联合中国葛洲坝集团有限公司共同发起设立的全国性证券公司。2007年9月,公司在北京正式挂牌成立。目前,公司注册资本51.42亿元,其中:中国华融出资42.04亿元,中国葛洲坝集团有限公司、中国葛洲坝集团股份有限公司、深圳市科铭实业有限公司、北京纽森特投资有限公司、九江和汇进出口有限公司、星星集团有限公司、浙江金财控股集团有限公司、广州南雅房地产开发有限公司、吉林昊融集团股份有限公司、北京双融福泰投资有限公司、张家港市中达针织服饰制造有限公司、北京立磐国际贸易有限公司等12家股东共出资9.38亿元。公司的注册地址:北京市西城区金融大街8号。

公司总部设在北京,下设深圳总部、上海总部,北京、上海、深圳、湖南、新疆、湖北、陕西、贵州、四川、江西、海南、浙江、山东、福建、辽宁、广东等16家分公司,66家营业部,控股华融期货有限责任公司与华融瑞泽投资管理有限公司。公司紧紧依托中国华融在资产管理、银行、信托和金融租赁等方面的综合优势,可为客户提供证券经纪、融资融券、证券承销与保荐、与证券交易及证券投资活动有关的财务顾问、证券投资咨询、证券自营、证券资产管理、投资顾问等综合化的财富管理服务。公司2011-2016年连续六年被中国证监会评为A类A级券商,2015年被中国证监会评为A类AA级券商。2009年、2011年两次获评为"首都文明单位",2014年获评"首都精神文明建设标兵单位",荣获2014年最佳资产管理券商,2015年公司荣获中国债券市场优秀成员及债券业务进步奖第一名,"中国新三板最具投资眼光券商",2016年荣获中国最佳财富管理品牌,最具创新性的证券资产管理公司等奖项。

公司坚持以市场为导向,以客户为中心,以诚信、专业、稳健、共赢为经营宗旨,在社会各界和投资者的大力支持下,努力打造一家有尊严、有价值、有内涵、有实力、有责任的"五有"现代一流投资银行!

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
范贵龙	本基金的基金经理	2015年9月2日	–	10	范贵龙,男,汉族,1981年生,武汉大学金融学硕士,特许金融分析师(CFA),金融风险管理师(FRM),具备10年金融行业工作经验。2006年就职于中国建设银行,2009年6月就职于华融证券市场研究部,2013年8月就职于华融证券资产管理二部、基金业务部,2015年4月起任华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年9月起任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
胡爽	本基金的基金经理助理	2016年8月1日	–	2	胡爽,毕业于英国波士顿大学。硕士研究生学历。2013年9月任职于新华社下属中国证券报研究中心研究员,2015年7月加入华融证券,担任基金业务部研究员。2016年8月担任华融新利基金基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

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

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等,建立健全投资授权制度,确保各投资组合公平获得研究资源,享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务,公司依照《公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,统计了溢价率占优比例。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,公司制定了《异常交易管理办法》,对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度,未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

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

2016年股票市场在经历了年初的熔断,沪深300跌幅一度超过20%,随后市场维持震荡上行态势,临近年末市场再次出现调整,全年沪深300下跌12.1%。

本基金始终坚持持有人利益优先的原则,坚持价值投资的理念,自2015年4月初成立以来,经历了股市巨震的考验,无论是净值回撤还是累计回报均好于大市。截止12月31日,单位净值0.893,累计下跌10.7%,同期沪深300下跌25.4%。

报告期内,本基金在控制总体风险的同时,通过优化低估值价值股和绩优成长股组合,积极参与新股以及可转债申购,提高产品收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.029元,本报告期份额净值增长率为1.98%。

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2017年,我们认为,宏观经济有望企稳,但是上行动力仍然不足;流动性将继续保持宽松,但放松政策的边际效果递减;美联储加息将对全球经济及金融市场产生深远影响,而人民币在经济增速下滑和中美利差收窄的背景下,资本外流或成为2017年市场面的重要风险之一,也对央行的货币政策独立性产生牵制,鉴于政策将防风险放在比较重要的位置,预计2017年即使出现风险点政府也会有充分的准备。

国内货币政策由稳健略偏宽松逐渐走向稳健中性,对市场整体估值构成制约,但是宏观经济以及微观企业业绩的好转也对市场构成一定支撑。国内宏观经济政策重点仍在防风险、稳经济、扩改革等方面,供给侧结构性改革以及国有企业改革将深入推进。大股东减持以及IPO的加速放行使股票供给增加。美国进入加息周期以及新一届总统上台也给全球带来了诸多不确定因素。

综合来看,2017年的股票市场可能维持震荡行情,投资机会依然蕴藏在自下而上的个股机会中。从风格上看,低估值板块会好于高估值板块,估值剪刀差可能继续收敛。随着小盘股估值风险的释放,部分优质成长股票价值也将逐渐显现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会,负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况,未进行利润分配。

4.9 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

–

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,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人一华融证券股份有限公司2016年1月1日至2016年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,华融证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,华融证券股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 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	德师报(审)字(17)第P00377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	华融新利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融新利灵活配置混合型证券投资基金财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表和2016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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是贵基金管理人华融证券股份有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则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,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华融新锐灵活配置混合型证券投资基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	李燕 秦俊
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号30楼
审计报告日期	2017年3月28日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:华融新利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		30,772,002.44	495,858,660.49
结算备付金		2,871,032.97	2,033,030.93
存出保证金		54,370.06	104,494.21
交易性金融资产		20,521,909.90	12,165,061.72
其中:股票投资		20,521,909.90	12,165,061.72
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		50,000,000.00	703,000,000.00
应收证券清算款		–	–
应收利息		5,876.94	635,393.67
应收股利		–	–
应收申购款		575,800.00	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		104,800,992.31	1,213,796,641.02
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		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		19,983,083.32	–
应付赎回款		3,151,522.98	130,621.07
应付管理人报酬		45,394.00	618,522.90
应付托管费		11,348.51	154,630.71
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		225,057.54	17,880.48
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		203,927.19	328.14
负债合计		23,620,333.54	921,983.30
所有者权益:			
实收基金		78,880,896.64	1,201,815,671.75
未分配利润		2,299,762.13	11,058,985.97
所有者权益合计		81,180,658.77	1,212,874,657.72
负债和所有者权益总计		104,800,992.31	1,213,796,641.02

7.2 利润表

会计主体:华融新利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9月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		7,005,624.14	6,450,209.40
1.利息收入		1,472,479.50	2,291,099.92
其中:存款利息收入		600,979.76	1,618,965.81
债券利息收入		300.47	–
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		871,199.27	672,134.11
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		4,399,603.43	111,341.13
其中:股票投资收益		4,315,620.22	111,341.13
基金投资收益		–	–
债券投资收益		39,023.33	–
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		44,959.88	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-3,515,328.56	3,413,821.01
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		4,648,869.77	633,947.34
减:二、费用		1,441,698.13	1,639,959.21
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	621,564.58	1,092,638.79
2. 托管费	7.4.8.2.2	155,391.16	273,159.64
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	–	–
4. 交易费用		429,824.34	264,923.70
5. 利息支出		–	–
其中:卖出回购金融资产支出		–	–
6. 其他费用		234,918.05	9,237.08
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		5,563,926.01	4,810,250.19
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		5,563,926.01	4,810,250.19

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华融新利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)	1,201,815,671.75	11,058,985.97	1,212,874,657.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	5,563,926.01	5,563,926.01
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)	-1,122,934,775.11	-14,323,149.85	-1,137,257,924.96
其中:1.基金申购款	146,745,961.58	5,148,217.77	151,894,179.35
2.基金赎回款	-1,269,680,736.69	-19,471,367.62	-1,289,152,104.31
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)	78,880,896.64	2,299,762.13	81,180,658.77
项目	上年度可比期间 2015年9月2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(本期净利润)	–	4,810,250.19	4,810,250.19
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)	1,201,815,671.75	6,248,735.78	1,208,064,407.53
其中:1.基金申购款	1,406,915,112.30	6,957,891.23	1,413,873,003.53
2.基金赎回款	-205,099,440.55	-709,155.45	-205,808,596.00
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)	1,201,815,671.75	11,058,985.97	1,212,874,657.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 – 至 – 财务报表由下列负责人签署:

祝 献 忠 杨 铭 海 董维

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华融新利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")于2015年8月5日经中国证监会(证监许可[2015]1907号文)核准,由华融证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华融新利灵活配置混合型证券投资基金合同》负责公开募集。募集期结束经立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具信会师报字[2015]第725475号验资报告。经向中国证监会备案,《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年9月2日正式生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。截止2015年9月1日,本基金募集资金人民币263,756,837.54元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币11,080.92元,以上实收基金(本息)合计为人民币263,756,837.54元,折合263,756,837.54份基金份额。本基金的基金管理人为华融证券股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的0%-95%投资于股票,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率* 30%+1年期人民币定期存款基准利率* 70%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于2006 年2 月15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")并参考中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定而编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

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的要求,真实、完整地反映了本基金于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净值变动情况。

7.4.4 重要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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入,由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,基金从上市公司分配取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,全额计入应纳税所得额,持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,减按50%计入应纳税所得额,持股期限超过1年的,减按25%计入应纳税所得额。

4、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华融证券股份有限公司	基金管理人、注册登记与过户机构、销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
中国华融资产管理股份有限公司	基金管理人的控股股东
华融瑞泽投资有限公司	基金管理人的控股子公司
华融期货有限责任公司	基金管理人的控股子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

–

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年9月2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
华融证券	326,544,061.60	100.00%	201,954,441.14	100.00%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年9月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华融证券	329,323.80	100.00%	–	–

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年9月2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
华融证券	2,866,400,000.00	100.00%	3,429,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年9月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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
华融证券	241,335.87	100.00%	225,057.54	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年9月2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(%)
华融证券	149,763.57	100.00%	149,763.57	100.00%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准,与其签订的交易单元租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年9月2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	621,564.58	1,092,638.79
其中:支付销售机构的客户维护费	–	–

7.4.8.2.2 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9月2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	155,391.16	273,159.64

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	–
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2015年9月2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销售服务费
合计	–

注:本基金本报告期内未产生销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2015年9月2日(基金合同生效日)至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内未有其他关联交易事项的说明。

7.4.9 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
7.4.10.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
7.4.10.1.3 受限证券类别:权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份