华富诚鑫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:华富基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
送出日期:2017年3月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2016年5月5日起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富诚鑫灵活配置混合	
基金主代码	002726	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年5月5日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	684,517,358.66份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富诚鑫灵活配置混合A	华富诚鑫灵活配置混合B
下属分级基金的交易代码:	002726	002727
报告期末下属分级基金的份额总额	588,796,072.81份	95,731,285.85份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略的基本思想是在充分控制风险的前提下实现高收益。依据风险-收益-投资策略关系原理,本基金采用包括资产配置策略、行业配置策略和个股精选策略在内的多层次复合投资策略进行实际投资,高层策略作用是规避风险,低层策略用于提高收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中等收益风险特征的基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、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		华富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	朱萍
	联系电话	021-68898996	021-61618888
	电子邮箱	manzh@hffund.com	zhup024@spdb.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95528
传真		021-68887997	021-63602540

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年5月5日(基金合同生效日)-2016年12月31日		2015年		2014年	
	华富诚鑫灵活配置混合A	华富诚鑫灵活配置混合B	华富诚鑫灵活配置混合A	华富诚鑫灵活配置混合B	华富诚鑫灵活配置混合A	华富诚鑫灵活配置混合B
本期已实现收益	14,029,535.98	555,519.09	-	-	-	-
本期利润	9,058,403.21	-143,686.31	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0159	-0.0041	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	1.80%	4.50%	-	-	-	-
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	0.0015	0.0404	-	-	-	-
期末基金资产净值	589,649,547.55	99,602,057.69	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.001	1.040	-	-	-	-

注:1)本基金合同生效不满一年。

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)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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富诚鑫灵活配置混合A

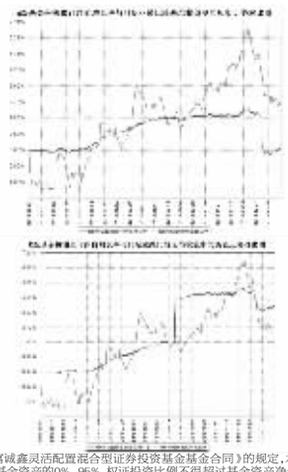
3.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.08%	0.92%	0.36%	-0.92%	-0.28%
过去六个月	1.60%	0.07%	3.22%	0.38%	-1.62%	-0.31%
自基金合同生效起至今	1.80%	0.07%	2.67%	0.42%	-0.87%	-0.35%

华富诚鑫灵活配置混合B

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	0.00%	0.08%	0.92%	0.36%	-0.92%	-0.28%
过去六个月	4.29%	0.25%	3.22%	0.38%	1.07%	-0.13%
自基金合同生效起至今	4.50%	0.22%	2.67%	0.42%	1.83%	-0.20%

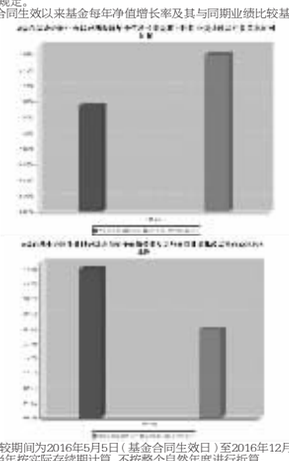
注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%,业绩比较基准在每个交易日实现在平衡。

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《华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票资产占基金资产的0%-95%,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。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为2016年5月5日到2016年11月5日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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:1)上述比较期间为2016年5月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

2)合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

华富诚鑫灵活配置混合A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.1700	11,680,912.90	-	11,680,912.90	注:-
合计	0.1700	11,680,912.90	-	11,680,912.90	注:-
华富诚鑫灵活配置混合B					
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
2016	0.0500	478,638.99	79.78	478,718.77	注:-
合计	0.0500	478,638.99	79.78	478,718.77	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2亿元,公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股(集团)有限公司,截止2016年12月31日,本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富分级债券型证券投资基金、华富恒利分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富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、华富年鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金共三十只基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹培俊	华富诚鑫灵活配置混合型基金经理、华富强化回报债券型基金基金经理、华富货币市场基金基金经理、华富安享保本混合型基金基金经理、华富诚鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理、固定收益部总监助理、公司募投资决策委员会成员	2016年5月5日	-	十年	华东师范大学经济学学士,本科学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、惠邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012年加入华富基金管理有限公司,曾任固定收益部信用研究员。

注:任职日期指公司作出决定之日,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,同时包括投权、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,制定各观、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、不同时间窗下(如1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情况良好。

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

2016年中国经济出现逐步企稳的迹象,GDP增速平稳,工业生产增速稳定,固定资产投资增速与消费增速平稳;CPI温和抬升,PPI快速上行。2016年人民币贬值压力较大,尤其是年末美联储加息落地,美元指数强势上行,人民币承压较重。债券市场在2016年前三季度仍然在相对宽松的资金面和对经济相对悲观预期的情况下收益率趋势下行,但随着经济基本面的恢复和外汇贬值压力,以及对金融市场杠杆监管的要求,央行货币政策从9月份开始的锁短放长操作策略在第四季度开始显现效果,整体资金面偏紧,并且随着10月末理财纳入MPA考核的传闻以及11月特朗普美版"四万亿"财政政策的提出,全年债券收益率从低点开始反弹。11-12月,全球通胀预期再起,国内债券市场资金成本不断上升,银行与非银机构同业资金链脆弱,监管层"去杠杆"态度趋严,随后美联储加息为债市带来最后一击,而之后的代持违约事件彻底冲击了市场情绪,11月底至12月上旬,整个债券市场出现大幅度调整。本基金以债券、新股申购等低风险资产投资为主,2016年全年净值平稳增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2016年5月5日正式成立。截止到2016年12月31日,华富诚鑫A类基金份额净值为1.001元,累计份额净值为1.016元,本报告期的份额累计净值增长率为1.80%,同期业绩比较基准收益率为2.67%;华富诚鑫C基金份额净值为1.040元,累计份额净值为1.045元,本报告期的份额累计净值增长率为4.50%,同期业绩比较基准收益率为2.67%。

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,基本面面临着较大的不确定性。国内基本面最大的不确定因素在于由于房地产投资增速的大概率下行对整体经济增速的影响,经济基本面将更大程度上依赖财政政策托底。国际方面最大的不确定性在于特朗普执政后的政策推行效果以及美国经济能否继续保持复苏态势。海外经济的复苏态势将很大程度上影响国内人民币将面临的贬值和输入性通胀压力,进而影响央行货币政策。相比于2016年,市场对于长期经济的过度悲观预期可能需要有所修正,预计2017年经济基本面对债券市场的影响为中性。政策层面,2017年货币政策总基调稳健中性,而对于金融自由化的监管将延续,资金面维持紧平衡状态,货币政策对债市的影响偏负面。整体来看,短期债券市场难以出现趋势性的行情,基本面、去杠杆压力以及海外因素都使得债券市场承压,预计债券市场将处于震荡行情,区间波动加大。本基金将严控债券信用风险和久期风险,获取稳定回报,权益仓位严格控制大幅波动和回撤,并利用新股申购增强收益,稳健地做好配置策略,均衡投资,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016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。2016年,为构建和完善员工常规管理的制度框架,促进公司各项工作有序运作,对《员工手册》进行了修订;为规范公司旗下基金产品投资中小企业私募债的行为,制定了《中小企业私募债投资管理办法》;为规范公司参与股指期货交易的行为,明确股指期货交易的投资决策流程和风险控制措施,制定了《股指期货投资管理办法》;为更好地规范投资流程、有效控制交易风险,制定了《固债期货投资管理办法》;为更好地规范费用报销流程、合理控制经营成本,对《费用报销管理办法》进行了修订。进一步健全和完善了公司制度体系建设。

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、投资决策委员会成员以及基金核算、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《华富诚鑫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8,914,716.90元,本报告内于2016年12月13日进行利润分配,总金额为12,159,631.67,符合基金合同相关约定。期末可供分配利润4,734,246.58元,滚存至下一期进行分配。

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

从2016年6月7日起至本报告期末(2016年12月31日),本基金基金资产净值存在连续六个工作日不满二百人的情形,至本报告期期末(2016年12月31日)本基金持有人数仍不满二百人。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》,积极采取相关措施,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§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,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,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、托管协议的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履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,本托管人依照《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、托管协议的规定,对华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配,A级分配金额为11,680,912.90元,C级分配金额为478,718.77元。

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

本报告期内,由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、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(2017)6-73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	华富诚鑫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富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"华富诚鑫灵活配置混合基金")财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表,2016年5月5日(基金合同生效日)起至2016年12月31日止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华富诚鑫灵活配置混合基金的基金管理人华富基金管理有限公司管理层的责任。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有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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	我们的责任是在实施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职业道德规范,计划和实施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,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,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做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,上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,在所有重大方面公允反映了华富诚鑫灵活配置混合基金2016年12月31日的财务状况以及2016年5月5日(基金合同生效日)起至2016年12月31日止的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	曹小勤 林瑞
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	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	2017年3月20日

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:华富诚鑫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		283,081.66	-
结算备付金		12,379,382.55	-
存出保证金		114,062.73	-
交易性金融资产		806,506,166.01	-
其中:股票投资		51,010,431.10	-
基金投资		-	-
债券投资		755,495,734.91	-
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		4,973,795.83	-
应收利息		10,969,284.02	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		835,225,772.80	-
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		140,000,000.00	-
应付证券清算款		5,009,766.44	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		378,704.04	-
应付托管费		94,676.01	-
应付销售服务费		16,912.56	-
应付交易费用		166,706.25	-
应交税费		-	-
应付利息		3,402.26	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		304,000.00	-
负债合计		145,974,167.56	-
所有者权益:			
实收基金		684,517,358.66	-
未分配利润		4,734,246.58	-
所有者权益合计		689,251,605.24	-
负债和所有者权益总计		835,225,772.80	-

注:本基金合同于2016年5月5日生效,无上年度末数据。报告截止日2016年12月31日,A类基金份额净值1.001元,C类基金份额净值1.040元,基金份额总额684,517,358.66份,A类基金份额总额588786072.81份,C类基金份额总额95731285.85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:华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016年5月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年5月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		14,806,330.93	-
1.利息收入		16,149,772.20	-
其中:存款利息收入		1,047,727.84	-
债券利息收入		15,052,780.30	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		49,264.06	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		3,954,763.04	-
其中:股票投资收益		5,902,942.79	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-2,384,039.75	-
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		435,860.00	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-5,670,338.17	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		372,133.86	-
减:二、费用		5,891,614.03	-
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	2,405,212.11	-
2. 托管费	7.4.8.2.2	601,303.04	-
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	44,591.60	-
4. 交易费用		479,833.65	-
5. 利息支出		2,034,554.22	-
其中:卖出回购金融资产支出		2,034,554.22	-
6. 其他费用		326,119.41	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		8,914,716.90	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		8,914,716.90	-

注:本基金合同于2016年5月5日生效,报告期为2016年5月5日至2016年12月31日,无上年度可比期间。报表附注为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:华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016年5月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年5月5日(基金合同生效日)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)	500,338,845.14	-	500,338,845.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	8,914,716.90	8,914,716.90
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)	184,178,513.52	7,979,161.35	192,157,674.87
其中:1.基金申购款	283,724,829.14	7,814,187.08	291,539,016.22
2.基金赎回款	-99,546,315.62	164,974.27	-99,381,341.35
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)	-	-12,159,631.67	-12,159,631.67
五、期末所有者权益(基金净值)	684,517,358.66	4,734,246.58	689,251,605.24
项目	上年度可比期间 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注:本基金合同于2016年5月5日生效,报告期为2016年5月5日至2016年12月31日,无上年度可比期间。报表附注为财务报表的组成部分。

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:

曾宏菊	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

华富诚鑫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[2016]844号)核准,基金合同于2016年5月5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〔2016〕6-79)。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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券、中期票据、短期融资券、债券回购、中小企业私募债等)、资产支持证券、货币市场工具以及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)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作,真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

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)、《关于金融机构同业往来等增值税有关政策的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确金融机构同业往来等增值税税务政策的通知》(财税〔2016〕70号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一)2016年5月1日前,发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收营业税。

(二)2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(三)对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(四)证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
华安证券股份有限公司("华安证券")	基金管理人的股东、代销机构
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰控股集团有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年5月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华安证券	194,120,351.94	59.61%	-	-

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5月5日(基金合同生效日)至2016年12月31日