华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年三月二十七日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月22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。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安新泰利灵活配置混合	
基金主代码	003799	
交易代码	003799	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月9日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
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	50,427,938.78份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安新泰利混合A	华安新泰利混合C
下属分级基金的交易代码	003799	003800
报告期末下属分级基金的份额总额	50,425,379.82份	2,558.96份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基采取相对灵活的资产配置策略,通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置,并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。在具体大类资产配置过程中,本基会将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型,基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,确定合适的资产配置比例,动态优化投资组合。
业绩比较基准	中证800指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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		华安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱解	陆志俊
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008850999	95559
传真		021-68863414	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层,32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2017年		2016年12月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	华安新泰利混合A	华安新泰利混合C	华安新泰利混合A	华安新泰利混合C
本期已实现收益	54,389,080.21	48.15	1,393,395.17	0.88
本期利润	54,501,771.33	47.25	1,423,508.17	0.90
加权平均基金份额本期利润	0.0790	0.0562	0.0020	0.0021
本期加权平均净值利润率	7.59%	5.32%	0.20%	0.21%
本期基金份额净值增长率	8.79%	7.92%	0.20%	0.21%
3.1.2期末数据和指标	2017年末		2016年末	
	华安新泰利混合A	华安新泰利混合C	华安新泰利混合A	华安新泰利混合C
期末可供分配基金份额利润	0.0843	0.0759	0.0020	0.0020
期末基金资产净值	54,966,230.75	2,767.53	701,434,725.35	433.92
期末基金份额净值	1.0901	1.0815	1.0020	1.0021

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

1、华安新泰利混合A:

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	2.19%	0.17%	0.48%	0.38%	1.71%	-0.21%
过去六个月	4.56%	0.15%	3.19%	0.34%	1.37%	-0.19%
过去一年	8.79%	0.13%	5.88%	0.33%	2.91%	-0.20%
自基金合同生效起至今	9.01%	0.13%	3.02%	0.34%	5.99%	-0.21%

2、华安新泰利混合C:

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	1.39%	0.14%	0.48%	0.38%	0.91%	-0.24%
过去六个月	3.74%	0.14%	3.19%	0.34%	0.55%	-0.20%
过去一年	7.92%	0.12%	5.88%	0.33%	2.04%	-0.21%
自基金合同生效起至今	8.15%	0.12%	3.02%	0.34%	5.13%	-0.22%

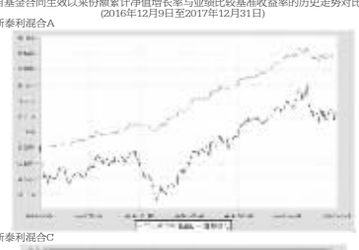
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金

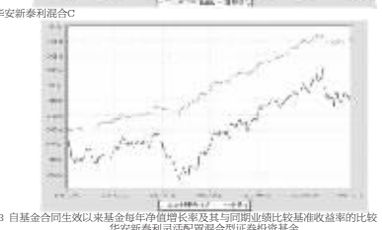
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年12月9日至2017年12月31日)

1、华安新泰利混合A



2、华安新泰利混合C

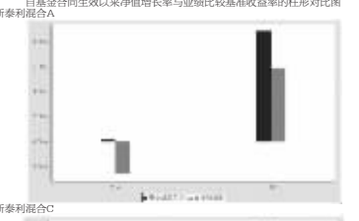


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

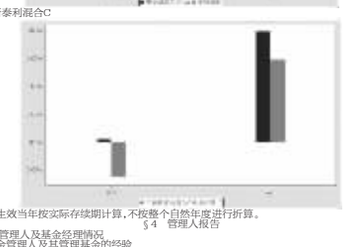
华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、华安新泰利混合A



2、华安新泰利混合C



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

§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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本15亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资有限公司,公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司,在香港和上海设有子公司—华安(香港)资产管理有限公司,华安未来资产管理有限公司。截至2017年12月31日,公司旗下共管理华安创新混合、华安MSCI中国A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等98只开放式基金,管理资产规模达到1851.32亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
朱才敏	本基金的基金经理	2016-12-09	-	10年	金融工程硕士,具有基金从业资格证书,10年基金行业从业经历,2007年7月应届生毕业进入华安基金,历任金融工程部风险管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014年11月至2017年7月,同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基的基金经理。2014年11月起,同时担任华安双债添利债券型证券投资基金、华安汇财通货币市场基金的基金经理,2015年5月起同时担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月起,同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月起,同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年11月起,同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2016年12月起,同时担任本基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
孙晨进	本基金的基金经理	2017-01-26	-	7年	硕士研究生,7年基金行业从业经验,具有基金从业资格证书。2010年应届毕业进入华安基金,先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理,2015年3月起担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2015年3月至2015年12月,同时担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金的基金经理。2017年1月起,同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、本基金的基金经理,2017年12月起,同时担任华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用最会友百、邮件发达、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签是过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察风险监督参与下,进行公平协商分配。(3)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的twind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风险管理理投资监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资端内证券市场上市交易的投资品种,进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合间日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合每笔交易对手之间以价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制,同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内,因组合流动性管理或投资策略调整需要,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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%的次数为1次,未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年,宏观经济复苏继续,失业率继续下行,通胀回升,制造业PMI和非制造业PMI均较上年走高;联储分别于3月、6月、12月调高联邦基准利率,并于10月启动缩表计划,美国长债收益率在下半年明显走高,美元指数全年震荡下行。欧洲经济复苏明显,制造业和服务业PMI均继续改善,失业率持续下降,通胀水平维持低位,欧元在全年保持强势。日本经济略有改善,失业率维持低位并继续下降,通胀略有起色,工业产出增速止跌回升,国内经济保持稳定,进出口增速回升,贸易顺差同比走低,小幅保持平稳,固定资产投资持续下滑,但幅度趋缓,其中制造业、基建投资相对平稳,房地产投资持续下滑,但幅度低于预期;通胀方面,蔬菜、猪肉价格表现被调,带动食品价格走低,非食品价格整续走高,CPI同比回升。人民币兑美元开盘,外汇占款流出压力缓解,央行持续通过公开市场和MLF操作对市场流动性进行调节,"削峰填谷",加强MPA考核、对满足普惠金融条件的银行实施定向降准、春节前启动临时准备金动用安排,维持稳健中性的货币政策基调,金融机构去杠杆已有显著成效。全年来看,货币市场总体处于紧平衡状态,银行间7天回购利率均值3.36%,高出16年的90bps,1年期国债、国开债收益率较上年末分别走高14bps、150bps,NCD发行利率和二级利率较上年末亦大幅走高80bps以上。全年来看,在资金面偏紧、基本面预期差、监管趋严的带动下,债券市场继续走熊,10年国债、国开债收益率较上年末分别走高87bps、114bps;信用债成交清淡,收益率跟随利率债调整的同时,利差明显走阔。A股市场继续分化,优质公司在宏观数据、公司业绩、未来预期相互正向循环驱动下轮番上涨,劣质公司则不断被市场抛弃。四季度市场出现一定调整,但对于优质公司而言仍属于上行趋势中的正常节奏修正。

本基金保持了对利率债券和高等级信用债的基本配置,维持基金中短久期,积极参与新股申购,权益投资上继续坚持精选个股、价值投资、长线投资,取得了不错的回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日,华安新泰利灵活配置混合A份额净值为1.0901元,C份额净值为1.0815元;华安新泰利灵活配置混合A份额净值增长率为8.79%,C份额净值增长率为7.92%,同期业绩比较基准增长率为5.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年,美国经济表现稳健,劳动力市场继续向好,失业率维持低位,时薪走高,通胀回暖,税改利好经济,预计2018年有3-4次加息。欧洲经济持续向好,货币政策继续边际收紧。国内经济保持平稳,重质胜过重量,产能过剩压力正在消退,企业盈利状况继续保持良好。随着供给侧改革的持续推进以及需求的逐步改善,潜在的通胀风险有所上升,但全年来看,通胀压力较小。人民币汇率保持平稳,外汇占款维持小幅正流入,国内货币政策保持稳健中性,央行对资金面具有很强的掌控力,预计资金面较17年会有所缓解,且资金成本会有所下降。监管方面,金融机构杠杆已有明显下降,后续各监管机构将推出相应的监管政策,预计对市场的短期冲击较小,但影响保远。综合上述各方面因素看,债券市场利空因素已逐步兑现,后续表现将逐步走好,利率债收益率预计将震荡略有下行,中高等级信用债具备一定的配置价值。权益市场将继续成呈现结构性行情:优势企业盈利继续改善、市场份额提升,这些公司的股票如果估值合理,则股价仍然具有稳定上扬的中期趋势。与此同时,没有核心竞争力、不适应转型的传统行业公司,以及新兴行业中竞争力不足、股票估值泡沫仍很明显的公司,将随着时间的流逝而被证伪,股价震荡下行。

本基金将继续保持中短久期利率债和高等级信用债的配置,回避中低等级特别是过剩产能行业信用债。权益投资上将继续把握投资价值、长线持有的思路,寻找传统和新兴行业中目标远大、长期专注、构筑了鲜明核心竞争力、业绩表现优秀而稳定,且股价合理或明显低于其内在价值的企业进行投资。

本基金将秉承稳健、专业的投资理念,勤勉尽责地维护持有人利益。

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,负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,评估重大事件对投资品种价值的影响程度,评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值;同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成,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及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间可比市场及交易所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

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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

2017年度,基金托管人在华安新泰利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

2017年度,华安基金管理有限公司在华安新泰利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

2017年度,由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安新泰利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

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 蒋燕华 蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)审字第60971571_B48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 资负债表

会计主体:华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:	-	-
银行存款	9,374,695.53	262,715,371.89
结算备付金	766,923.81	-
存出保证金	40,689.62	-
交易性金融资产	44,497,062.65	29,919,000.00
其中:股票投资	4,284,962.65	-
基金投资	-	-
债券投资	40,212,100.00	29,919,000.00
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	9,000,000.00	408,000,937.00
应收证券清算款	-	40,092.92
应收利息	1,562,343.33	1,085,901.47
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	65,241,714.94	701,761,303.28

负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	9,000,000.00	-
应付赎回款	985.22	-
应付管理人报酬	327,154.30	252,640.31
应付托管费	54,525.69	42,106.70
应付销售服务费	0.31	-
应付交易费用	520,051.14	1,397.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	370,000.00	30,000.00
负债合计	10,272,716.66	326,144.01
所有者权益:	-	-
实收基金	50,427,938.78	700,011,650.20
未分配利润	4,541,059.50	1,423,509.07
所有者权益合计	54,968,998.28	701,435,159.27
负债和所有者权益总计	65,241,714.94	701,761,303.28

注:(1)报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.0901元,基金份额总额50,427,938.78份,其中A类基金份额净值1.0901元,基金份额总额50,425,379.82份;C类基金份额净值1.0815元,基金份额总额2,558.96份。

(2)本基金基金合同于2016年12月9日生效,上年度可比期间自2016年12月9日至2016年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	62,517,675.81	1,748,881.08
1.利息收入	24,954,056.40	1,718,768.06
其中:存款利息收入	3,579,749.10	647,667.01
债券利息收入	18,740,648.30	11,362.19
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,633,659.00	1,059,738.86
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	37,012,537.37	-
其中:股票投资收益	34,659,701.77	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	208,155.95	-
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	2,144,679.65	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	112,690.22	30,113.02
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	438,391.82	-
减:二、费用	8,015,857.23	325,372.01
1. 管理人报酬	4,314,977.11	252,640.31
2. 托管费	719,162.78	42,106.70
3. 销售服务费	0.45	-
4. 交易费用	2,577,966.35	225.00
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	403,750.54	30,400.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	54,501,818.58	1,423,509.07
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	54,501,818.58	1,423,509.07

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	700,011,650.20	1,423,509.07	701,435,159.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	54,501,818.58	54,501,818.58
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)	-649,583,711.42	-51,384,268.15	-700,967,979.57
其中:1.基金申购款	417,229.28	30,814.06	448,043.34
2.基金赎回款	-650,000,940.70	-51,415,082.21	-701,416,022.91
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)	50,427,938.78	4,541,059.50	54,968,998.28

项目	上年度可比期间 2016年12月9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)	700,011,650.20	-	700,011,650.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,423,509.07	1,423,509.07
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)	700,011,650.20	1,423,509.07	701,435,159.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码1-7(含1)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:朱学华,主管会计工作负责人:赵敏,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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]2324号《关于准予华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人华安基金管理有限公司自2016年12月2日到2016年12月6日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第60971571_B25号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年12月9日生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。段文时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币700,011,650.08元,在募集期间产生的存款利息为人民币0.12元,以上实收基金(本息)合计为人民币700,011,650.20元,折合700,011,650.20份基金份额,其中A类基金份额700,011,217.18份,C类基金份额433.02份。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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上市的股票)、权证、股指期货、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单,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。

基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持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%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号《年度报告的内容与格式》》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2017年12月31日的财务状况以及2017年度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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产不于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等;

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

当发现该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认;

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益,股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转;

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确入为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,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,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,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

?

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产