

华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 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

送出日期：2016 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。

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 2016 年 3 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 9 月 2 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	华融新利
场内简称	华融新利混合
基金主代码	001797
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	1,201,815,671.75 份
基金合同存续期	不定期

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，深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，灵活采用类属配置、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、增发套利、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	010-85556728	010-66060069
	电子邮箱	xiaoqio@hrsec.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-898-9999	95599
传真		010-85556592	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.hrsec.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	2015 年 9 月 2 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月	2014 年	2013 年
---------------	-------------------------------------	--------	--------

	31 日		
本期已实现收益	1,396,429.18	-	-
本期利润	4,810,250.19	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0084	-	-
本期基金份额净值增长率	0.90%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0053	-	-
期末基金资产净值	1,212,874,657.72	-	-
期末基金份额净值	1.009	-	-

注：本基金于 2015 年 9 月 2 日成立，截至报告期末，不满一年。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。

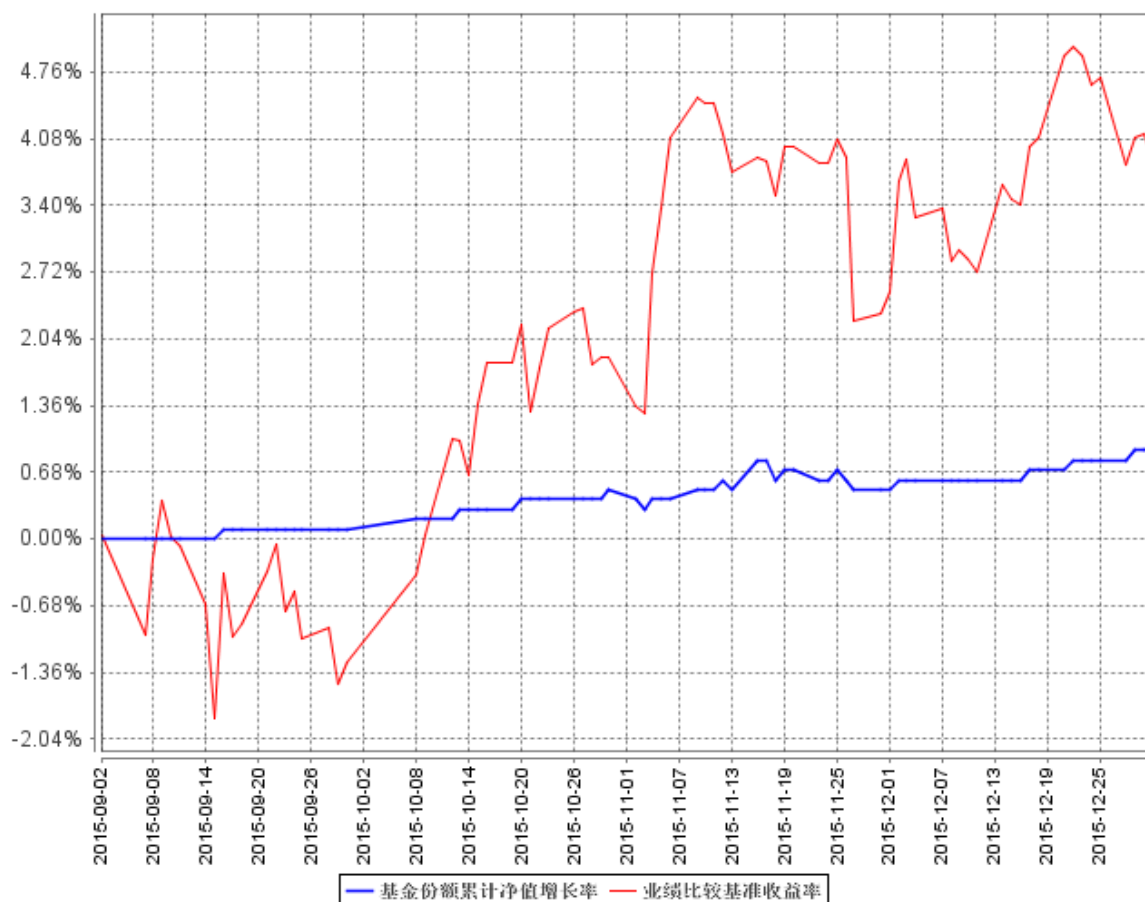
3.2 基金净值表现

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	0.80%	0.07%	5.17%	0.50%	-4.37%	-0.43%
自基金合同 生效起至今	0.90%	0.06%	3.85%	0.54%	-2.95%	-0.48%

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

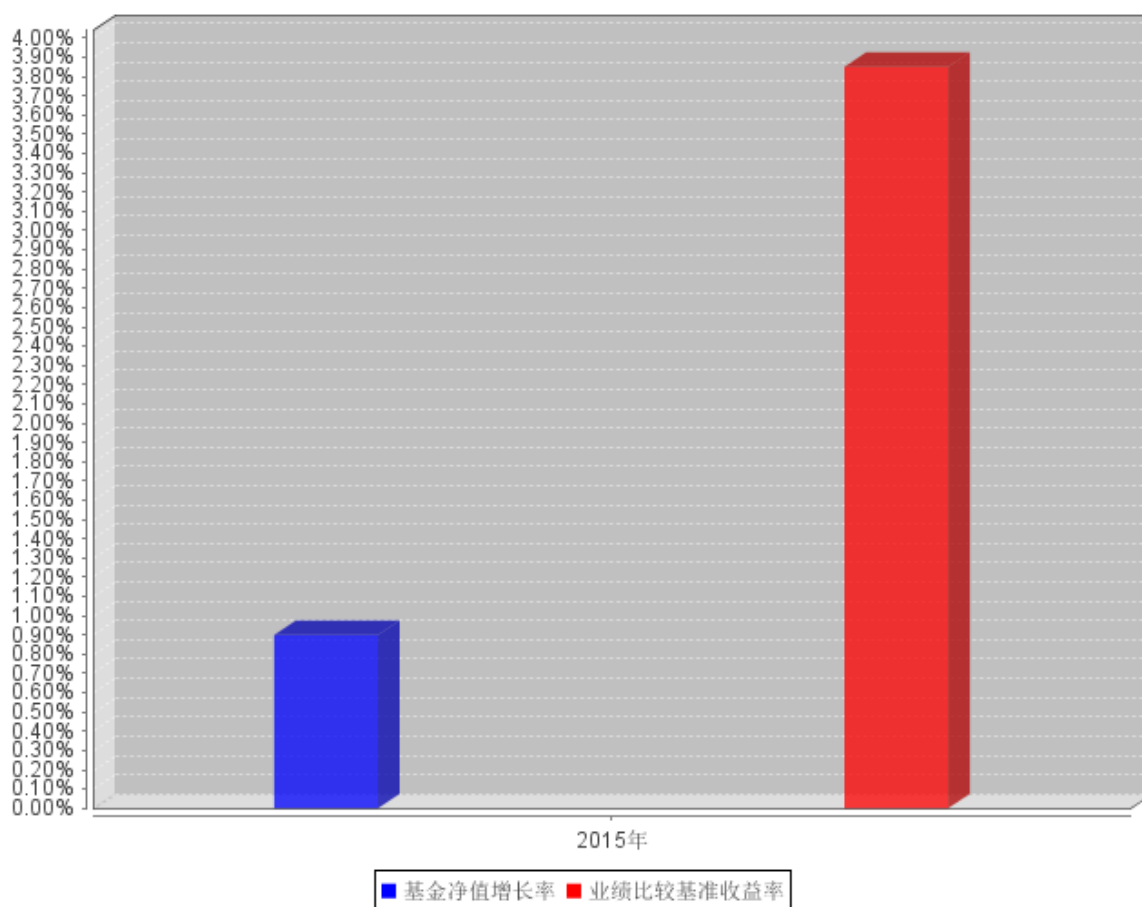
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。截至本报告期末本基金仍在建仓期, 各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

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

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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46.74亿元，其中：中国华融出资38.12亿元，中国葛洲坝集团公司、中国葛洲坝集团股份有限公司、北京纽森特投资有限公司、九江和汇进出口有限公司、江苏德源纺织服饰有限公司、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、吉林昊融集团有限公司、深圳市科铭实

业有限公司、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、等 12 家股东共出资 8.62 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、陕西、贵州、四川、江西、海南、浙江、山东、福建等 14 家分公司，63 家营业部，上海和深圳 2 家投行业务部，控股华融期货有限责任公司。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 2011-2014 年连续四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，2014 年最佳资产管理券商，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”。

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	-	9	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9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。
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，通过交易系统内的公平交易程序，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《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

2015 年股票市场大起大落，上半年轰轰烈烈的股市大涨行情，沪深 300 涨幅一度超过 50%，但是受接踵而来的去杠杆、人民币贬值等冲击，市场出现连续调整，经过 6、7 月份的调整后，沪深 300 全年仅上涨 5.58%。

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，配置上稳中求胜，自 2015 年 9 月初成立以来，单位净值始终在 1 以上。截止 12 月 31 日，单位净值 1.009，累计上涨 0.9%，同期沪深 300 上涨 10.97%。未来本基金将在控制总体风险的同时，以低估值价值股组合为主，争取为投资人带来长期稳定回报。

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 1.009 元，本报告期份额净值增长率为 0.90%。

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 2016 年，我们认为，宏观经济下行的压力依然较大；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 2016 年系统性风险之一，也对央行的货币政策独立性产生牵制。

股票市场在经历了 2015 年的巨幅震荡之后，狭义流动性逐渐收紧，对整个股市估值的支撑在开始减弱。围绕“去产能、去库存、去杠杆”的供给侧改革对企业短期盈利形成牵制，违约事件也提醒着实体经济的下行压力加大。同时，改革已经步入深水区，曲折性和复杂性逐渐浮出水平。无论是新股发行，还是大股东减持，2016 年股票供给都大于 2015 年。

综合来看，2016 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，持续了两年多的估值剪刀差可能开始收敛。

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，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管机构。

内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；网络与信息系统安全情况；资讯监管与员工职业操守规范情况等。

(1) 进一步完善制度建设，构建适时、全面、严谨的内部控制体系。本基金管理人根据最新的法律法规等规范性文件，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，对现有的制度体系进行了进一步梳理，同时，根据公司实际业务情况不断细化制度流程，进一步强化内部控制。

(2) 全面加强风险监控，不断提高风险管理水平。本基金管理人在原有基础上进一步提升内控管理水平，确保内部控制的独立性和权威性，事前、事中、事后风险控制有效结合，通过多种形式提高内控管理质量、优化风险管理水平。

(3) 有计划地开展监察稽核工作，确保工作的及时性、深入性和有效性。本年度内，本基金管理人通过日常监察与专项稽核相结合的方式，深入开展各项监察稽核工作包括对基金销售、宣

传材料、客户服务、合同及其他法律资料、反洗钱工作、信息披露、信息系统与信息安全、基金投资运作（包括证券库、银行间交易对手的维护与管理、投资比例、投资权限、投资限制、研究支持、流动性风险等）、基金投资交易（包括公平交易、异常交易等）、基金运营、网上交易、专户业务管理、投委会管理、公司财务、公司治理、“三条底线”的防范及防控内幕交易等方面进行专项稽核。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化了风险控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

（4）强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，并及时更新相关管理制度，并将上述规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

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（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），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。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

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

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

本报告期，中国农业银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽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，华融新利灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华融证券股份有限公司在华融新利灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华融新利灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华融证券股份有限公司编制和披露的华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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	德师京报(审)字(16)第 P0959 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 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 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。	
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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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	2016 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：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		495,858,660.49	-
结算备付金		2,033,030.93	-
存出保证金		104,494.21	-
交易性金融资产		12,165,061.72	-
其中：股票投资		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		703,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		635,393.67	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,213,796,641.02	-
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		130,621.07	-
应付管理人报酬		618,522.90	-
应付托管费		154,630.71	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		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		328.14	-
负债合计		921,983.30	-
所有者权益：			
实收基金		1,201,815,671.75	-
未分配利润		11,058,985.97	-
所有者权益合计		1,212,874,657.72	-
负债和所有者权益总计		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：2015 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 9 月 2 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		6,450,209.40	-
1. 利息收入		2,291,099.92	-
其中：存款利息收入		1,618,965.81	-
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		672,134.11	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		111,341.13	-
其中：股票投资收益		111,341.13	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		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）		633,947.34	-
减：二、费用		1,639,959.21	-

1. 管理人报酬		1,092,638.79	-
2. 托管费		273,159.64	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		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		9,237.08	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,810,250.19	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		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：2015 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 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）	-	-	-
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）	-	-	-

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：

_____ 祝献忠	_____ 杨铭海	_____ 曹艳春
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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 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

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报表的实际编制期间为 2015 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: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、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金持有的金融资产分类为贷款和应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有

的金融负债分类为其他金融负债，包括各类应付款项等。

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，按公允价值在资产负债表内确认。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。本基金对所持有的贷款及应收款项和其他金融负债以摊余成本法进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在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确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、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。

4、投资人的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此产生的损益由基金资产承担；

5、本基金每份基金份额享有同等分配权；

7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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
华融天泽投资有限公司	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 2015 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	201,954,441.14	100%	-	-

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 9 月 2 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	703,000,000.00	100%	-	-

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2015 年 9 月 2 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%	149,763.57	100%
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 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
华融证券	-	-	-	-

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 2015年9月2日(基金合同生效 日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,092,638.79	-
其中：支付销售机构的客户维护费	10,374.73	-

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年9月2日(基金合同生效 日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	273,159.64	-

7.4.8.2.3 销售服务费

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）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

本基金于本报告期内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

本基金除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

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 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国农业银行 活期存款	115,858,660.49	889,077.90	-	-

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（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

7.4.10.1.1 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
300494	盛天网络	2015 年 12 月 25 日	2016 年 1 月 4 日	新股流通受限	18.10	26.06	6,251	113,143.10	162,901.06	-
300490	华自科技	2015 年 12 月 25 日	2016 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.09	13.09	7,127	64,784.43	93,292.43	-
300491	通合科技	2015 年 12 月 25 日	2016 年 1 月 4 日	新股流通受限	10.48	15.09	6,015	63,037.20	90,766.35	-
002777	久远银海	2015 年 12 月 25 日	2016 年 1 月 4 日	新股流通受限	11.46	16.50	4,264	48,865.44	70,356.00	-
002778	高科石化	2015 年 12 月 28 日	2016 年 1 月 6 日	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期内未持有因认购新发/期末持有的暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 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	12,165,061.72	1.00
	其中：股票	12,165,061.72	1.00
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	703,000,000.00	57.92
	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	497,891,691.42	41.02
7	其他各项资产	739,887.88	0.06
8	合计	1,213,796,641.02	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	—	—

C	制造业	6,755,562.62	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	807,192.00	0.07
F	批发和零售业	222,304.44	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,151,722.66	0.09
J	金融业	1,199,000.00	0.10
K	房地产业	—	—
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	2,029,280.00	0.17
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	12,165,061.72	1.00

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002033	丽江旅游	75,300	1,325,280.00	0.11
2	002250	联化科技	70,000	1,320,900.00	0.11
3	000001	平安银行	100,000	1,199,000.00	0.10
4	000651	格力电器	53,229	1,189,668.15	0.10
5	000568	泸州老窖	40,000	1,084,800.00	0.09
6	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.08
7	000895	双汇发展	40,000	816,400.00	0.07
8	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.07

9	002783	凯龙股份	6,138	784,436.40	0.06
10	000069	华侨城 A	80,000	704,000.00	0.06

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	6,725,479.00	0.55
2	000651	格力电器	6,116,449.88	0.50
3	000568	泸州老窖	5,970,014.84	0.49
4	600519	贵州茅台	5,315,429.40	0.44
5	002033	丽江旅游	5,134,645.08	0.42
6	002250	联化科技	4,425,817.55	0.36
7	000539	粤电力 A	4,376,198.65	0.36
8	000895	双汇发展	3,768,037.36	0.31
9	000423	东阿阿胶	3,515,938.00	0.29
10	002142	宁波银行	3,473,156.00	0.29
11	000333	美的集团	3,455,682.25	0.28
12	000725	京东方 A	3,367,000.00	0.28
13	000538	云南白药	3,148,622.26	0.26
14	601857	中国石油	3,114,000.00	0.26
15	600027	华电国际	3,090,453.00	0.25
16	000100	TCL 集团	2,814,800.00	0.23
17	000157	中联重科	2,802,500.00	0.23
18	600795	国电电力	2,301,000.00	0.19
19	600597	光明乳业	2,281,898.70	0.19
20	601607	上海医药	1,960,000.00	0.16

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值
----	------	------	----------	-----------

				比例（%）
1	000001	平安银行	5,393,393.35	0.44
2	000651	格力电器	5,137,450.00	0.42
3	000568	泸州老窖	5,014,976.93	0.41
4	600519	贵州茅台	4,732,708.00	0.39
5	000539	粤电力 A	4,239,955.17	0.35
6	002033	丽江旅游	4,128,773.38	0.34
7	000423	东阿阿胶	3,592,461.86	0.30
8	002142	宁波银行	3,460,200.00	0.29
9	000725	京东方 A	3,426,000.00	0.28
10	000333	美的集团	3,378,000.00	0.28
11	000538	云南白药	3,210,750.00	0.26
12	002250	联化科技	3,187,645.51	0.26
13	000895	双汇发展	3,052,500.00	0.25
14	601857	中国石油	3,007,297.00	0.25
15	600027	华电国际	2,976,930.78	0.25
16	000100	TCL 集团	2,863,500.00	0.24
17	000157	中联重科	2,861,100.00	0.24
18	600795	国电电力	2,242,000.00	0.18
19	600597	光明乳业	2,136,001.00	0.18
20	000002	万 科 A	2,023,000.00	0.17

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	105,884,886.41
卖出股票收入（成交）总额	97,244,986.83

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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投资。

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投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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投资。

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投资。

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：（1）股指期货交易品种的流动性；（2）股指期货交易品种与现货市场的相关度；（3）通过股指期货进行套期保值交易的必要性；（4）股指期货套期保值交易的综合成本，来判断是否进行套期保值交易或套期保值的合理对冲比率。

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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现基金投资前十名证券的发行主体本期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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	104,494.21
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	635,393.67
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	739,887.88

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

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
1,322	909,809.01	1,163,334,039.34	96.80%	38,481,632.41	3.20%

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	3,015,820.92	0.25%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10-50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年9月2日）基金份额总额	263,756,837.54
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,143,158,274.76
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	205,099,440.55
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,201,815,671.75

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

因中国农业银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。该审计机构首次为本基金提供审计服务。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

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 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
华融证券	2	201,954,441.14	100.00%	149,763.57	100.00%	-

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
华融证券	-	-	703,100,000.00	100%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华融证券股份有限公司
2016 年 3 月 29 日