

华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金

2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 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

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 8 月 26 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	华富元鑫灵活配置混合	
场内简称	—	
基金主代码	002853	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 8 月 26 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	478,454,364.29 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	—	
下属分级基金的基金简称:	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的场内简称:	—	—
下属分级基金的交易代码:	002853	002854
下属分级基金的前端交易代码	—	—
下属分级基金的后端交易代码	—	—
报告期末下属分级基金的份额总额	120,017,966.67 份	358,436,397.62 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	本基金通过合理灵活的资产配置策略，同时结合行业配置策略、个股精选策略、债券投资策略等投资策略，积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇，在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。	
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。	
	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的风险收益特征	—	—

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	021-68886996	021-61618888
	电子邮箱	manzh@hffund.com	zhup02@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 8 月 26 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日		2015 年		2014 年	
	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C
本期已实现收益	1,789,539.28	3,729,261.84	-	-	-	-
本期利润	1,050,675.70	428,140.23	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0019	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	0.90%	0.80%	-	-	-	-
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	0.0088	0.0083	-	-	-	-
期末基金资产净值	121,068,599.77	361,398,891.20	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.009	1.008	-	-	-	-

注：1) 本基金合同生效未满一年。

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

华富元鑫灵活配置混合 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	0.90%	0.15%	0.92%	0.36%	-0.02%	-0.21%
自基金合同生效起至今	0.90%	0.13%	0.26%	0.35%	0.64%	-0.22%

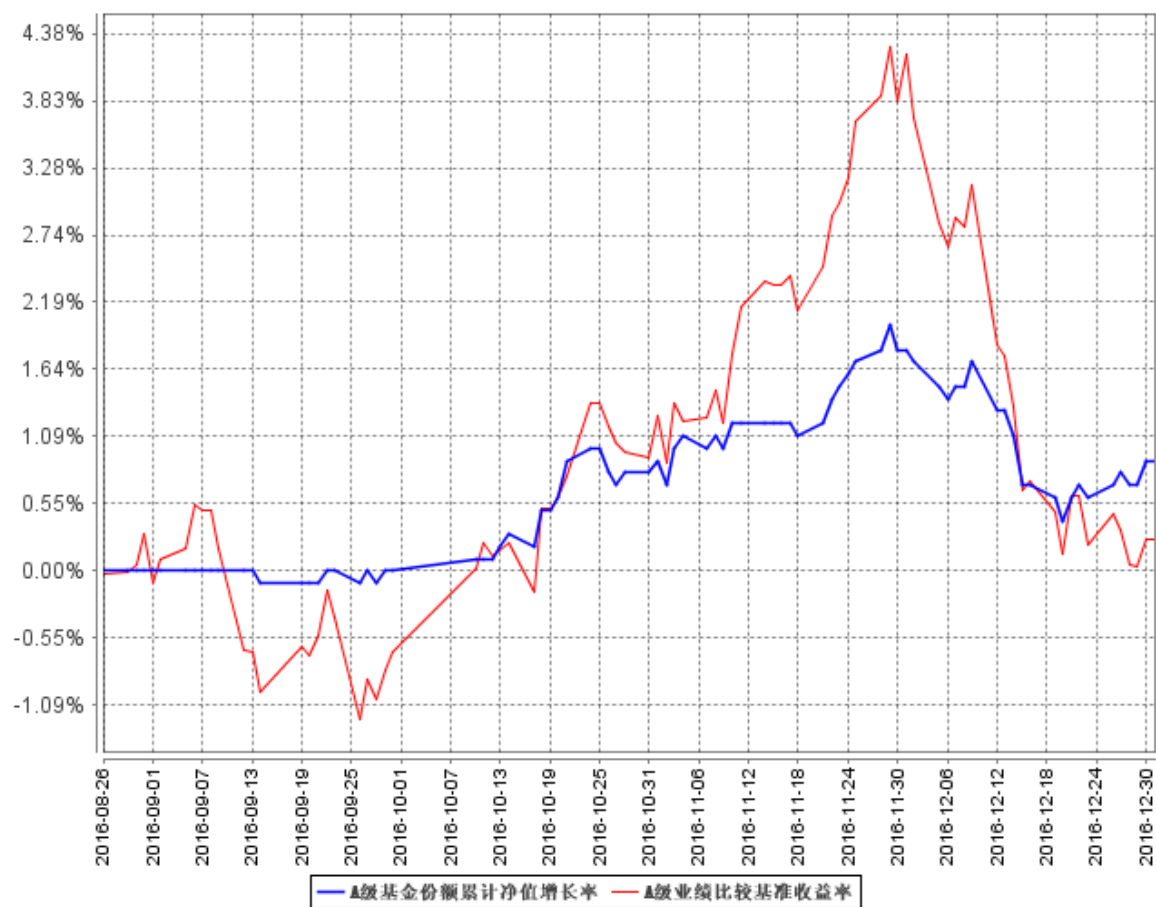
华富元鑫灵活配置混合 C

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	0.80%	0.14%	0.92%	0.36%	-0.12%	-0.22%
自基金合同生效起至今	0.80%	0.12%	0.26%	0.35%	0.54%	-0.23%

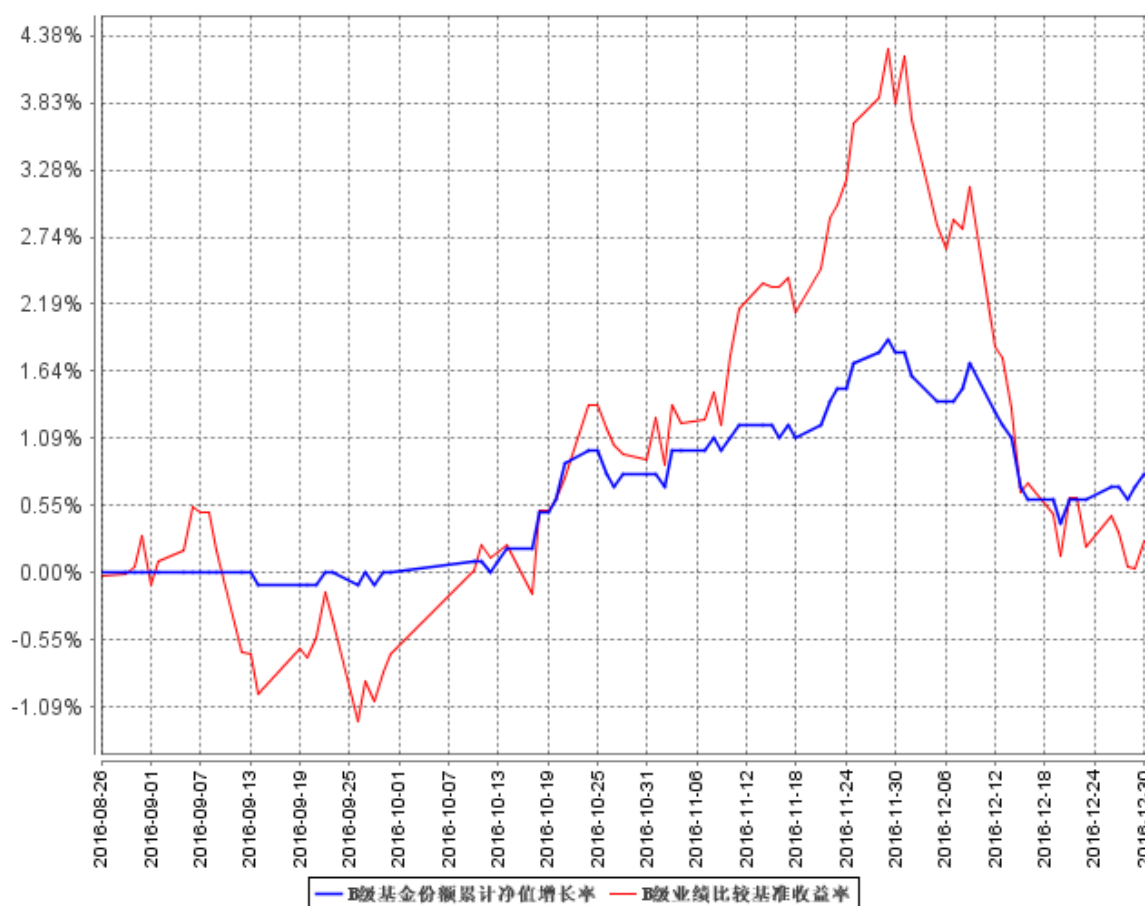
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%，业绩比较基准在每个交易日实现在平衡。

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

A级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



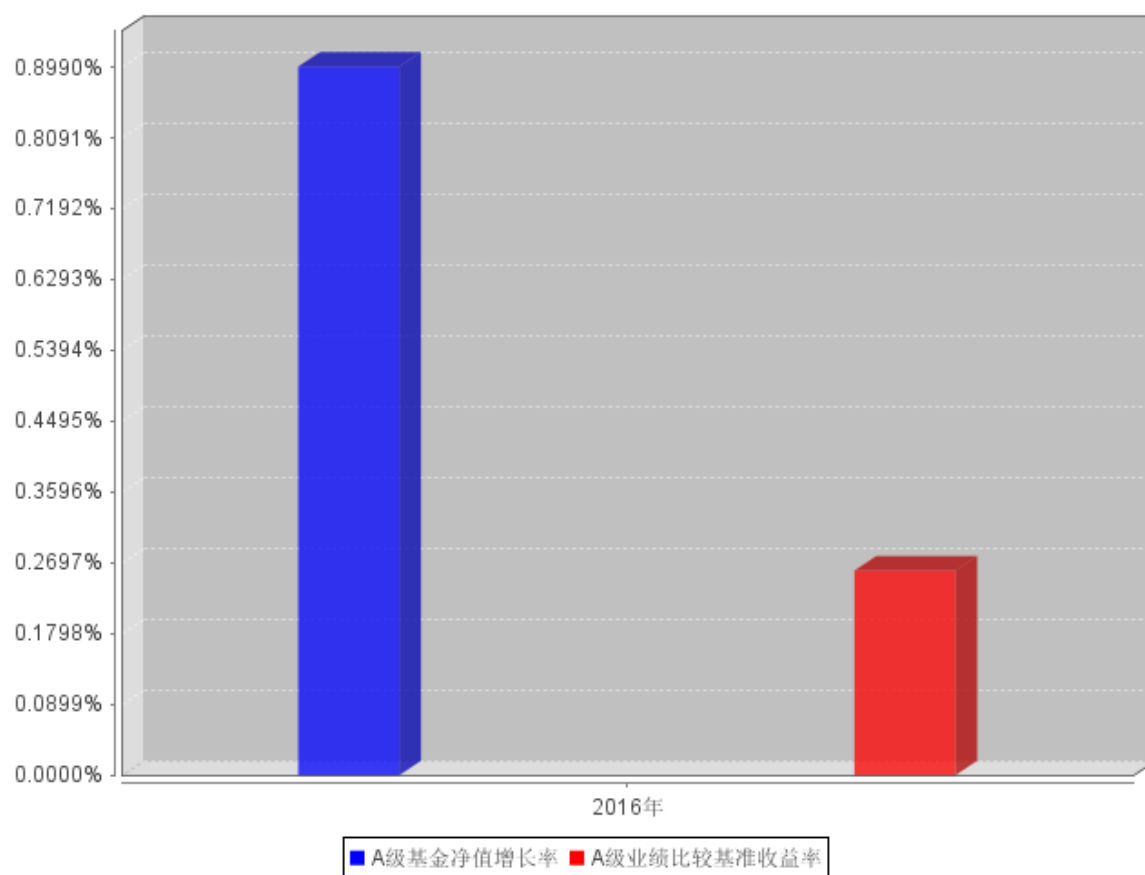
B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



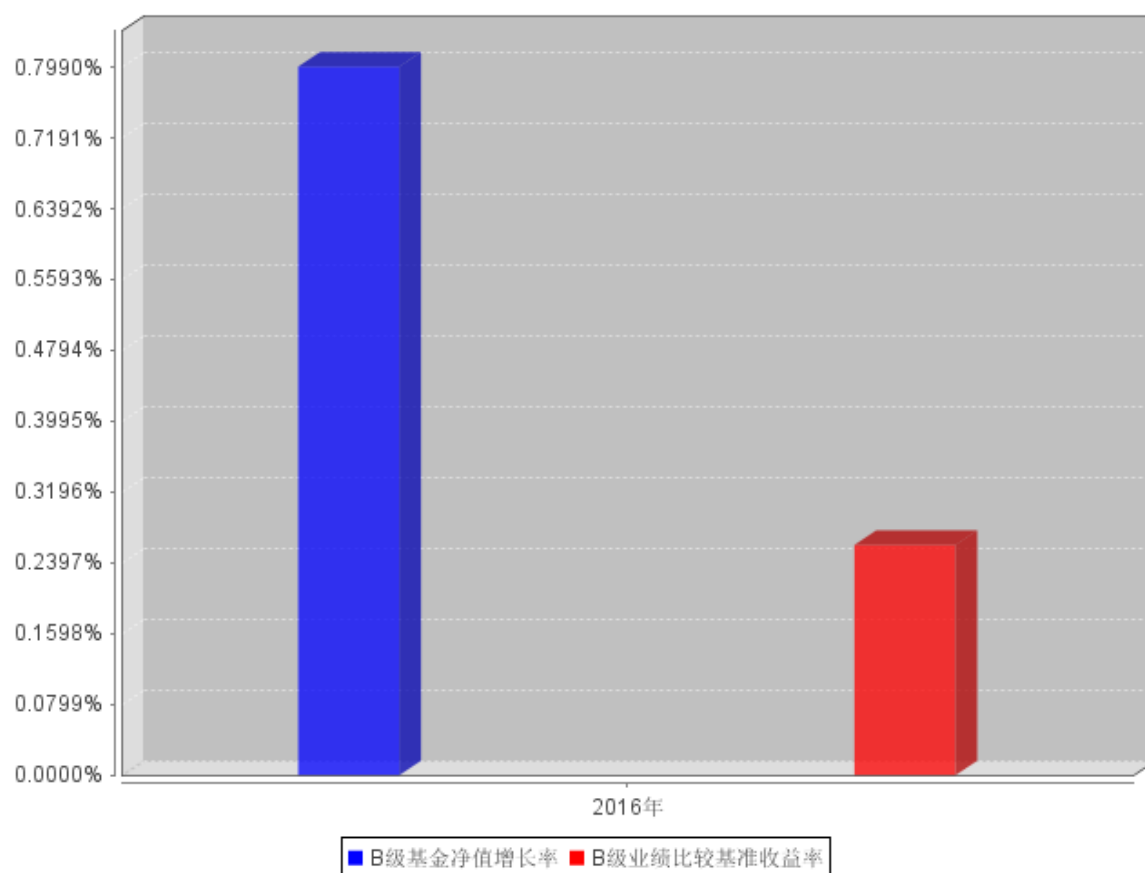
注：根据《华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票资产占基金资产的 0%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2016 年 8 月 26 日到 2017 年 2 月 26 日。本报告期内，本基金仍在建仓期。

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

A级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



B级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



注：1) 上述比较期间为 2016 年 8 月 26 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

华富元鑫灵活配置混合 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 年度	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

华富元鑫灵活配置混合 C					
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 年度	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

注：本基金合同生效未满一年，未进行利润分配。

§ 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

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、华富恒财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、华富华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		
张惠	华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富益鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富安享保本混合	2016 年 8 月 26 日	-	九年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历，2007 年 6 月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员，2012 年 5 月 21 日至 2014 年 3 月 19 日任华富策略精选混合型基金基金经理助理，2014 年 3 月 20

	型基金基金经理、华富恒利债券型基金基金经理、华富旺财保本混合型基金基金经理、华富保本混合型基金基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理				日至 2014 年 11 月 18 日任华富保本混合型基金基金经理助理。
--	---	--	--	--	--------------------------------------

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合规守信情况的说明

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，同时包括授权、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，制定客观、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内、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 年中国经济成功实现了“稳增长”的目标，全年来看，经过大半年的刺激政策，经济

基本面运行平稳，经济增长动力逐季强劲，工业生产增速稳定，固定资产投资增速与消费增速平稳；CPI 维持高位，PPI 快速上行，M2 增速有所回升。但代价是各种价格飞涨，房价大幅飙升，通胀显著反弹，因此年末的政治局会议把“抑制资产泡沫、防范金融风险”作为未来的首要目标，从而引发了年末债市和股市的双重回落。

债券市场方面，2016 年债券市场大幅震荡。在资金面整体宽松，稳定的负债预期下，银行委外和表外理财的爆发式增长，倒逼了资产荒现象的加剧。而在 4 季度，央行以降杠杆，抑制资产泡沫为主要目标的中性偏紧货币政策，打破了市场对于流动性持续宽松的预期。在流动性、基本面和海外环境等多方面因素使得延续了将近三年的大牛市最终于年末引来大幅调整。

2016 年 1 季度，宏观经济增长继续呈现放缓态势，货币政策整体偏宽松，1 季度社融数据呈现井喷状态，债券市场供给明显增加，市场整体呈现震荡格局。3 月份开始，债市违约明显增加，对债券市场形成明显冲击，这一期间，债市风险偏好明显下降，信用债收益率上升，也间接带动利率债收益率上升。5 月以后债市新增违约明显减少，市场情绪得到快速修复，加之 2 季度宏观经济继续呈现探底态势，CPI 环比连续负增长，债市收益率在资产荒逻辑的主导下呈现震荡下行的态势。3 季度，债市收益率继续呈现震荡下行局面，并于 8 月 15 日达到全年低点，彼时债市牛市氛围极为浓厚，主流观点认为零利率是长期趋势，债市仍有明显上涨空间。这一阶段债市信用利差、期限利差都被压缩至历史低位。4 季度，宏观经济开始出现积极变化，同时，央行悄然改变货币政策态度，拉长资金投放期限，抬升资金成本。10 月下旬，市场传闻央行欲将表外理财纳入 MPA 考核，正式引发本轮债市调整。加之海外市场的影响，美联储加息落地，人民币贬值压力，和国内“代持风波”，促使债券市场收益率快速上升，直至 2016 年年底仍延续跌势。这期间货币基金的全面赎回潮也备受市场关注。

权益市场方面，2016 年全年市场震荡加剧，股指年初即出现熔断为代表的断崖下跌，后续出现以银行、建筑等为代表的低估值大市值股票的反弹，而估值相对较高的中小盘成长股全年基本呈现下跌趋势，市场分化明显。年末随着资金面的紧张以及监管的加剧，市场整体回落调整。

2016 年四季度，本基金成立，根据市场情况，主要买入一年左右久期的公司债和企业债，并且买入估值低的大盘股票作为股票底仓，积极参与网下打新获取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 8 月 26 日正式成立。截止到 2016 年 12 月 31 日，华富元鑫 A 类基金份额净值为 1.009 元，累计份额净值为 1.009 元，本报告期的份额累计净值增长率为 0.90%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%；华富元鑫 C 基金份额净值为 1.008 元，累计份额净值为 1.008 元，

本报告期的份额累计净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%。

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，全球经济基本面都面临着较大的不确定性。国内经济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。因此在整体资产配置上本基金将继续适度杠杆和久期，严控信用风险，弱化资本利得，权益资产及时做好波段操作和结构调整。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位，在较低风险程度下，认真研究各个潜在投资领域的机会，发挥管理人的综合优势，积极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》；为更好地规范投资决策流程、有效控制交易风险，制定了《国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、监察稽核部负责人以及基金核算、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投资基金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《华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内未进行利润分配，符合基金合同相关约定。本期利润为 1,478,815.93 元，期末可供分配利润共 4,013,126.68 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 11 月 17 日起至本报告期末（2016 年 12 月 31 日），本基金份额持有人数量存在

连续二十个工作日不满二百人的情形，至本报告期末（2016 年 12 月 31 日）基金份额持有人数量仍不满二百人。

§ 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”）在对华富元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，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，对华富元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）6-70 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	华富元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元鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华富元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 8 月 26 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元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元鑫灵活配置混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 8 月 26 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	林晶
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：华富元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	上年度末
-----	-----	-----	------

		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款		13,669,714.55	-
结算备付金		961,292.95	-
存出保证金		33,061.39	-
交易性金融资产		462,958,649.61	-
其中: 股票投资		87,225,677.11	-
基金投资		-	-
债券投资		375,732,972.50	-
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		-	-
应收利息		5,513,965.83	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		483,136,684.33	-
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		-	-
应付赎回款		2,014.02	-
应付管理人报酬		245,759.04	-
应付托管费		61,439.76	-
应付销售服务费		61,366.34	-
应付交易费用		106,614.20	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		192,000.00	-
负债合计		669,193.36	-
所有者权益:			
实收基金		478,454,364.29	-
未分配利润		4,013,126.68	-
所有者权益合计		482,467,490.97	-

负债和所有者权益总计		483,136,684.33	-
------------	--	----------------	---

注：本基金合同于 2016 年 8 月 26 日生效，报告期为 2016 年 8 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日，无上年度可比期间。报告截止日 2016 年 12 月 31 日，华富元鑫 A 类基金份额净值为 1.009 元，华富元鑫 C 基金份额净值为 1.008 元，基金份额总额 478,454,364.29 份，A 类基金份额总额 120,017,966.67 份、C 类基金份额总额 358,436,397.62 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：华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 8 月 26 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 8 月 26 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		2,886,957.75	-
1.利息收入		3,596,042.29	-
其中：存款利息收入		202,454.86	-
债券利息收入		3,068,801.22	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		324,786.21	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,329,818.51	-
其中：股票投资收益		3,409,578.52	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-79,760.01	-
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）		-4,039,985.19	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,082.14	-
减：二、费用		1,408,141.82	-
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	701,959.22	-
2. 托管费	7.4.8.2.2	175,489.83	-

3. 销售服务费	7.4.8.2.3	150,149.59	-
4. 交易费用		161,725.53	-
5. 利息支出		20,410.63	-
其中：卖出回购金融资产支出		20,410.63	-
6. 其他费用		198,407.02	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,478,815.93	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,478,815.93	-

注：本基金合同于 2016 年 8 月 26 日生效，报告期为 2016 年 8 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日，无上年度可比期间。后附报表附注为本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：华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 8 月 26 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 8 月 26 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）	201,344,416.39	-	201,344,416.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,478,815.93	1,478,815.93
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）	277,109,947.90	2,534,310.75	279,644,258.65
其中：1. 基金申购款	277,600,654.35	2,537,401.55	280,138,055.90
2. 基金赎回款	-490,706.45	-3,090.80	-493,797.25
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）	478,454,364.29	4,013,126.68	482,467,490.97
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 8 月 26 日生效，报告期为 2016 年 8 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日，无上年度可比期间。

报表附注为本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：

<u>章宏韬</u>	<u>余海春</u>	<u>陈大毅</u>
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

华富元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]1083 号）核准，基金合同于 2016 年 9 月 7 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）6-128 号）。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《华富元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

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 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)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(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、代销机构
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 8 月 26 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	98,354,577.38	74.71%	-	-

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 8 月 26 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
华安证券	13,090,373.46	36.33%	-	-

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 8 月 26 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	
	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
华安证券	590,700,000.00	62.47%	-	-

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 8 月 26 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：本基金本报告期内无通过关联方交易单元发生的权证交易。

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8月26日(基金合同生效日)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
华安证券	91,597.68	75.12%	72,558.10	70.52%
关联方名称	上年度可比期间 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
--	----------	----------------	----------	----------------------

注：上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的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 8 月 26 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
当期发生的基金应支付的管理费	701,959.22	-
其中：支付销售机构的客户维护费	28,215.44	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 8 月 26 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
当期发生的基金应支付的托管费	175,489.83	-

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 8 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C	合计
华安证券	-	64.16	64.16
华富基金管理有限公司	-	149,367.51	149,367.51
上海浦东发展银行股份	-	477.76	477.76

有限公司			
合计	-	149,909.43	149,909.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C	合计

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式 $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值）。

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 8 月 26 日(基金合同生效日)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 1 月 1 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

份额单位：份

项目	本期 2016 年 8 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 8 月 26 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
-----------------------	---	---

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 8 月 26 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有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

华富元鑫灵活配置混合 A				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

份额单位：份

华富元鑫灵活配置混合 C				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

注：本基金本报告期和上年度可比期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

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 2016 年 8 月 26 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	13,669,714.55	196,033.65	-	-

股份有限公司				
--------	--	--	--	--

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2016 年 8 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数 量 （ 单 位 ： 份）	总金额
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 份）	总金额

注：本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

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
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-

300586	美 联 新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新 股 流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万 里 马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新 股 流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

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)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
----------	----------	-----------	----------	------------	----------	------------	--------------	------------	------------	----

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（股）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
----------	----------	----------	----------	------------	----------	------------	-------	------------	------------	----

注：本基金本期末未持有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

-

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期 日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
合计				-	-

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据“财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好 2010 年年报工作的通知（财会〔2010〕25 号）”（以下简称“通知”）要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产

或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

类别 2016 年 12 月 31 日公允价值 2015 年 12 月 31 日公允价值

第一层次	86,987,982.10	-
第二层次	375,970,667.51	-
第三层次	-	-
合计	462,958,649.61	

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号）的要求，本基金自 2015 年 3 月 30 日起，对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值（估值标准另有规定的除外），本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

§ 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	87,225,677.11	18.05
	其中：股票	87,225,677.11	18.05
2	固定收益投资	375,732,972.50	77.77
	其中：债券	375,732,972.50	77.77
	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	-	-
	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	14,631,007.50	3.03
7	其他各项资产	5,547,027.22	1.15
8	合计	483,136,684.33	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 期末其他各项资产构成。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,642,241.00	0.34
C	制造业	25,600,595.82	5.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	939,199.00	0.19
E	建筑业	4,102,500.71	0.85
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,169,016.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,218,703.00	0.25
J	金融业	51,705,244.58	10.72
K	房地产业	848,177.00	0.18
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	-	-
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	87,225,677.11	18.08

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	601398	工商银行	1,791,600	7,900,956.00	1.64
2	000800	一汽轿车	527,900	5,738,273.00	1.19
3	000568	泸州老窖	173,452	5,723,916.00	1.19
4	601318	中国平安	143,600	5,087,748.00	1.05
5	000001	平安银行	549,400	4,999,540.00	1.04
6	002142	宁波银行	295,300	4,913,792.00	1.02
7	000423	东阿阿胶	88,900	4,789,043.00	0.99
8	000776	广发证券	248,618	4,191,699.48	0.87
9	600016	民生银行	314,900	2,859,292.00	0.59
10	601166	兴业银行	175,700	2,835,798.00	0.59

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	601398	工商银行	10,981,262.00	2.28
2	000800	一汽轿车	5,998,933.00	1.24
3	000568	泸州老窖	5,998,519.02	1.24
4	000776	广发证券	5,298,583.00	1.10
5	601318	中国平安	5,028,935.00	1.04
6	000001	平安银行	4,999,540.00	1.04
7	002142	宁波银行	4,998,614.00	1.04
8	000423	东阿阿胶	4,996,781.82	1.04
9	601186	中国铁建	4,563,126.00	0.95
10	601988	中国银行	3,990,775.00	0.83
11	601668	中国建筑	3,989,697.00	0.83
12	601328	交通银行	3,980,275.50	0.82
13	601688	华泰证券	2,998,630.00	0.62
14	601818	光大银行	2,998,472.00	0.62
15	601166	兴业银行	2,997,458.00	0.62
16	600016	民生银行	2,959,133.00	0.61
17	600036	招商银行	2,539,667.00	0.53
18	600519	贵州茅台	2,169,822.67	0.45

19	600030	中信证券	1,843,760.00	0.38
20	600837	海通证券	1,814,712.00	0.38

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	601186	中国铁建	4,569,438.90	0.95
2	601668	中国建筑	4,350,651.22	0.90
3	601398	工商银行	3,151,416.00	0.65
4	601988	中国银行	3,146,715.00	0.65
5	601818	光大银行	2,346,570.00	0.49
6	601328	交通银行	2,045,140.00	0.42
7	601688	华泰证券	2,007,451.00	0.42
8	000776	广发证券	999,999.00	0.21
9	601166	兴业银行	216,064.00	0.04
10	603660	苏州科达	91,807.63	0.02
11	603928	兴业股份	91,594.00	0.02
12	603060	国检集团	77,269.72	0.02
13	603203	快克股份	75,920.60	0.02
14	601882	海天精工	73,654.92	0.02
15	603819	神力股份	72,998.08	0.02
16	603585	苏利股份	72,599.34	0.02
17	603033	三维股份	69,601.00	0.01
18	603036	如通股份	59,297.70	0.01
19	603559	中通国脉	50,775.52	0.01
20	603319	湘油泵	43,252.79	0.01

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

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	108,684,148.44
卖出股票收入（成交）总额	23,612,216.42

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权

等获得的股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,960,000.00	6.21
	其中：政策性金融债	29,960,000.00	6.21
4	企业债券	56,920,972.50	11.80
5	企业短期融资券	149,849,000.00	31.06
6	中期票据	50,785,000.00	10.53
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	88,218,000.00	18.28
9	其他	-	-
10	合计	375,732,972.50	77.88

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1382227	13 黄旅游 MTN1	200,000	20,458,000.00	4.24
2	041652008	16 农垦 CP001	200,000	20,038,000.00	4.15
3	041662012	16 昆山创业 CP001	200,000	20,032,000.00	4.15
4	011699909	16 闽能源 SCP007	200,000	20,026,000.00	4.15
5	041663002	16 连城投 CP001	200,000	20,024,000.00	4.15

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	------	---------------

注：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

注：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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

注：本基金本报告期末未持有权证。

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

注：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

—

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

—

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					—
国债期货投资本期收益（元）					—
国债期货投资本期公允价值变动（元）					—

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

—

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	33,061.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,513,965.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,547,027.22

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	------	---------------

注：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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告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

份额级别	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
华富元鑫灵活	6	20,002,994.45	119,998,000.00	99.98%	19,966.67	0.02%

配 置 混 合 A						
华 富 元 鑫 灵 活 配 置 混 合 C	157	2,283,034.38	357,464,735.12	99.73%	971,662.50	0.27%
合计	163	2,935,302.85	477,462,735.12	99.79%	991,629.17	0.21%

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华富元鑫灵活配置混合 A	0.00	0.0000%
	华富元鑫灵活配置混合 C	8,000.38	0.0022%
	合计	8,000.38	0.0017%

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

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	份额级别	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	华富元鑫灵活配置混合 A	0
	华富元鑫灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华富元鑫灵活配置混合 A	0
	华富元鑫灵活配置混合 C	0
	合计	0

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富元鑫灵活配置混合 A	华富元鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 8 月 26 日）基金份额总额	120,022,950.07	81,321,466.32
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	34,601.56	277,566,052.79
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	39,584.96	451,121.49
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	120,017,966.67	358,436,397.62

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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

1、2016 年 1 月 7 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，高靖瑜女士不再担任华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

2、2016 年 2 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任翁海波先生为华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

3、2016 年 6 月 23 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，孔庆卿先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

4、2016 年 6 月 23 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

5、2016 年 6 月 23 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任胡伟先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、2016 年 6 月 23 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任张惠女士为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、2016 年 8 月 23 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王夏儒先

生为华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

8、2016 年 9 月 2 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王翔先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

9、2016 年 9 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任王翔先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

10、2016 年 9 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

11、2016 年 11 月 10 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，聘任张惠女士为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

12、2016 年 11 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

13、2016 年 11 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富安福保本混合型证券投资基金的基金经理职务。

14、2016 年 11 月 29 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王夏儒先生不再担任华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理职务。

15、自 2016 年 1 月起，浦发银行进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 4.2 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

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

本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

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	
民生证券	2	33,290,969.84	25.29%	30,338.10	24.88%	-
华安证券	2	98,354,577.38	74.71%	91,597.68	75.12%	-

注：1）根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。

2）本报告期本基金新增民生证券、华安证券各 2 个席位。

3）此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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
民生证券	22,944,653.57	63.67%	354,800,000.00	37.53%	-	-
华安证券	13,090,373.46	36.33%	590,700,000.00	62.47%	-	-

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华富基金管理有限公司
2017 年 3 月 29 日