

新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金

2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月三十一日

§1 重要提示及目录

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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 29 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§6 审计报告	16
6.1 管理层对财务报表的责任	16
6.2 注册会计师的责任	16
6.3 审计意见	17
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
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	55
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	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	56
§9 基金份额持有人信息	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
9.3 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	58
§10 开放式基金份额变动	58
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	65
§13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华鑫利灵活配置混合
基金主代码	519165
交易代码	519165
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2014 年 4 月 23 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
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	77,187,945.82 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极的选股和资产配置策略，在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续增长，并力争为投资者提供稳定的绝对回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将以大类资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率 +50%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险中等预期收益品种，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露	姓名	齐岩	林葛
负责人	联系电话	010-68779688	010-66060069

	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		400010	100031
法定代表人		陈重	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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	2014 年 4 月 23 日(基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-14,029,827.57	52,843,986.61	5,439,023.70

本期利润	-27,970,057.75	81,095,846.79	-14,516,371.06
加权平均基金份额本期利润	-0.1889	0.4100	-0.0556
本期加权平均净值利润率	-15.71%	27.50%	-5.53%
本期基金份额净值增长率	-16.66%	58.48%	-6.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	17,850,993.07	51,495,033.81	-15,188,746.48
期末可供分配基金份额利润	0.2313	0.3435	-0.0685
期末基金资产净值	95,038,938.89	221,433,683.47	206,703,714.76
期末基金份额净值	1.231	1.477	0.932
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	23.10%	47.70%	-6.80%

注：1、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；

2、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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金于 2014 年 4 月 23 日基金合同生效，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。

3.2 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	-0.32%	0.90%	0.92%	0.36%	-1.24%	0.54%
过去六个月	-0.81%	0.88%	3.22%	0.38%	-4.03%	0.50%
过去一年	-16.66%	2.07%	-3.64%	0.70%	-13.02%	1.37%
自基金合同生效起至今	23.10%	2.13%	34.56%	0.92%	-11.46%	1.21%

注：1、本基金于 2014 年 4 月 23 日成立。

2、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用 50%×沪深 300 指数收益率 +50%×上证国债指数收

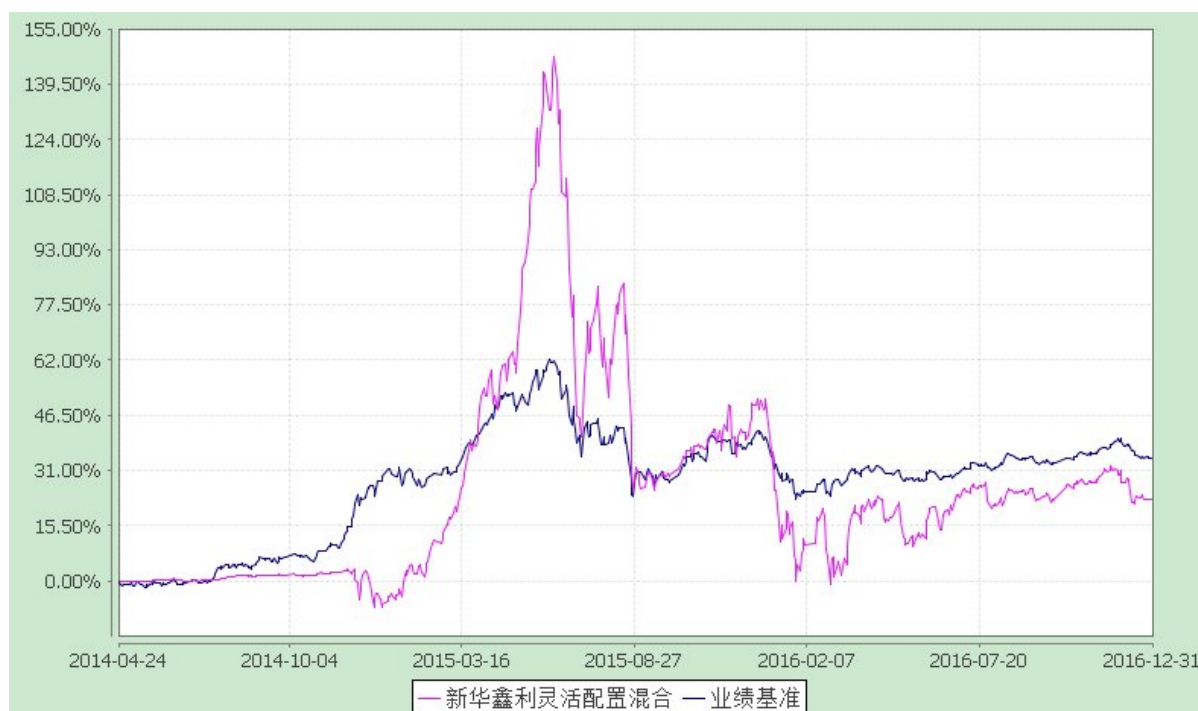
益率。

3、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金

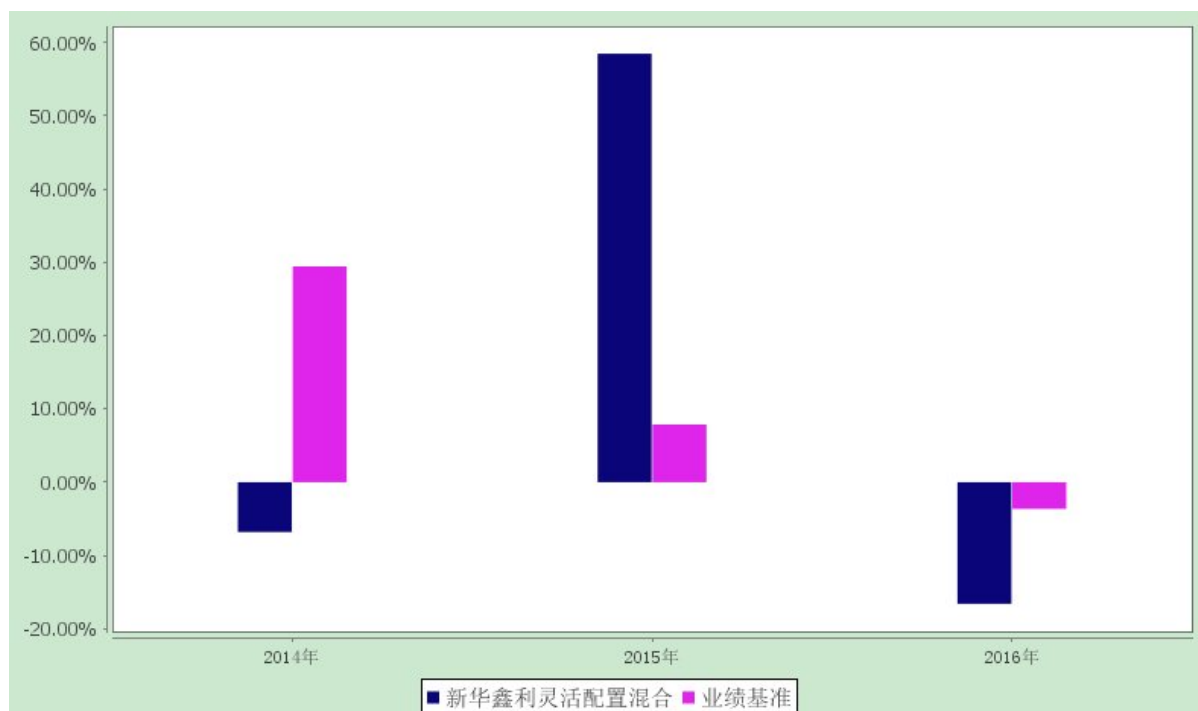
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014 年 4 月 23 日至 2016 年 12 月 31 日)



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

新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2014 年 4 月 23 日基金合同生效，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

本基金于 2014 年 4 月 23 日成立，截止 2016 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2016 年 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十一只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华惠鑫分级债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本混合

型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华信用增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金和新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金。

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		
李会忠	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资	2014-12-26	-	9	经济学硕士，9 年证券从业经验。2007 年 9 月加入新华基金管理股份有限公司，历任新华基金管理股份有限公司行业研究员、策略分析师、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫锐混合型证券投资基金基金经理。

	基金基金经 理、新华鑫动 力灵活配置混 合型证券投资 基金基金经 理、新华鑫锐 混合型证券投 资基金基金经 理。				
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

2、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，新华基金管理股份有限公司作为新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度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、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。场内交易，投资指令统一由交易部下达，并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度，严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。基金管理人对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的内向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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，市场先快速普跌然后慢慢反弹，整体上呈现宽幅震荡的格局。二季度反弹以创业板为主，主板也有一定程度的反弹，从三季度初开始，市场风格明显转变，周期股、价值蓝筹开始持续反弹，推动上证综指不断突破，而以 TMT 为代表的创业板却不断下跌。本基金在维持较高仓位的基础上适度仓位调整、波段操作、优选个股，争取来年取得较好投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.231 元，本报告期份额净值增长率为-16.60%，同期比较基准的增长率为-3.64%。

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，我们认为市场将以震荡格局为主，业绩和估值的安全性仍然是市场最关心的投资逻辑。我们将优选那些质地好、有业绩、估值低、安全边际较高的股票进行配置。

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，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督

促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步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，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；

③ 批准证券估值的步骤和方法；

④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

4.7.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

① 获得独立、完整的证券价格信息；

② 每日证券估值；

③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；

④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；

⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；

⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；

⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

4.7.1.3 投资管理部的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；

② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；

④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.7.1.4 交易部的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；

② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.7.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2014 年 4 月 23 日成立，截止 2016 年 12 月 31 日未进行利润分配。

4.9 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

本基金本报告期内无持有人少于 200 人和连续 20 个工作日资产净值小于伍仟万的情况。

§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—新华基金管理股份有限公司 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，新华基金管理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，新华基金管理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

瑞华审字[2017]01360095

新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“新华鑫利灵活配置基金”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是新华鑫利灵活配置基金的基金管理人新华基金管理股份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（以下简称“中国证监会”）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。

6.2 注册会计师的责任

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。

6.3 审计意见

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和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了新华鑫利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 年度的经营成果和基金净值变动情况。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

张伟 胡慰

北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

2017 年 3 月 30 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华鑫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	7.4.7.1	11,029,473.96	18,816,190.28
结算备付金		9,323.00	4,493,176.68
存出保证金		67,289.25	948,163.96
交易性金融资产	7.4.7.2	83,889,908.65	187,423,566.03
其中：股票投资		83,889,908.65	187,423,566.03
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		-	-

应收证券清算款		947,270.06	24,860,618.73
应收利息	7.4.7.3	2,325.51	4,675.32
应收股利		-	-
应收申购款		1,190.95	80,011,667.11
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		95,946,781.38	316,558,058.11
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		10,219.82	91,871,193.08
应付管理人报酬		125,556.21	300,974.38
应付托管费		20,926.01	50,162.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.4	491,119.13	2,258,883.27
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	260,021.32	643,161.53
负债合计		907,842.49	95,124,374.64
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.6	77,187,945.82	149,898,945.53
未分配利润	7.4.7.7	17,850,993.07	71,534,737.94

所有者权益合计		95,038,938.89	221,433,683.47
负债和所有者权益总计		95,946,781.38	316,558,058.11

注：本报告期末基金份额净值 1.231 元，基金份额总额 77,187,945.82 份。

7.2 利润表

会计主体：新华鑫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	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-23,506,498.98	92,512,825.19
1.利息收入		219,825.24	463,357.07
其中：存款利息收入	7.4.7.8	182,436.20	463,357.07
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		37,389.04	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,028,654.78	62,174,165.85
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-10,633,959.86	61,292,478.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.10	-	-
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	7.4.7.11	605,305.08	881,686.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	-13,940,230.18	28,251,860.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	242,560.74	1,623,442.09

减：二、费用		4,463,558.77	11,416,978.40
1. 管理人报酬		2,673,448.23	4,393,287.46
2. 托管费		445,574.65	732,214.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.14	859,948.16	5,803,959.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		484,587.73	487,516.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7.4.7.15	-27,970,057.75	81,095,846.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-27,970,057.75	81,095,846.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫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）	149,898,945.53	71,534,737.94	221,433,683.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,970,057.75	-27,970,057.75
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）	-72,710,999.71	-25,713,687.12	-98,424,686.83
其中：1.基金申购款	62,056,550.17	11,097,441.36	73,153,991.53

2.基金赎回款	-134,767,549.88	-36,811,128.48	-171,578,678.36
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）	77,187,945.82	17,850,993.07	95,038,938.89
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）	221,892,461.24	-15,188,746.48	206,703,714.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,095,846.79	81,095,846.79
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）	-71,993,515.71	5,627,637.63	-66,365,878.08
其中：1.基金申购款	292,170,732.54	193,095,850.08	485,266,582.62
2.基金赎回款	-364,164,248.25	-187,468,212.45	-551,632,460.70
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）	149,898,945.53	71,534,737.94	221,433,683.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）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：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华鑫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[2014]302号文件《关于核准新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2014年4月8日至4月18日向社会公开募集,首次募集资金总额295,580,861.07元,其中募集资金产生利息52,389.93元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]37100015号验资报告予以验证。2014年4月23日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、回购、银行存款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:股票投资占基金资产的比例为0-95%,单只中小企业私募债券市值不超过基金资产净值的10%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,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%。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:50%×沪深300指数收益率+50%×上证国债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于2017年3月30日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制,根据实际发生的交易和事项,按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的41项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”),中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

(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和其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债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。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

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

(1) 金融资产和金融负债的初始确认和终止确认（证券投资基金成本计价方法）

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

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、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。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。

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

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息（作为应收利息单独核算）。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含

报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 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认为权证投资成本，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。

(5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。

买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

(6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。

卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 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。

存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。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。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，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，采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，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，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，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，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，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，确定投资品种的公允价值。

（2）主要资产的估值方法

① 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内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。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：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。

②债券投资

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种（含上交所可交换债），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价作为公允价值。

对在交易所市场上市交易的可转换债券（含深交所可交换债券），采用交易所每日收盘价（估值全价）扣减上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、私募债券和未上市债券，采用成本估值。

对于银行间市场上的固定收益品种，选取中国债券登记结算有限公司提供的相应品种当日的估值净价加上上一起息日至估值日每百元债券的税前应计利息（算头算尾）减去上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

③如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于月末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(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 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额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，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，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) 每一基金份额享受同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的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

本基金报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税征收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定：对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、财税 [2015] 101 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》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股 1 年以内（含 1 年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	11,029,473.96	18,816,190.28
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	11,029,473.96	18,816,190.28

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		89,533,673.41	83,889,908.65	-5,643,764.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		89,533,673.41	83,889,908.65	-5,643,764.76
项目	上年度末			
	2015 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		179,127,100.61	187,423,566.03	8,296,465.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		179,127,100.61	187,423,566.03	8,296,465.42

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期无衍生金融资产投资。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,291.01	2,226.62
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	34.50	2,448.70
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	0.00	0.00
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	2,325.51	4,675.32

注：1、应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

7.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	491,119.13	2,258,883.27
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	491,119.13	2,258,883.27

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	21.32	183,161.32
其他应付款	-	-
预提费用	260,000.00	460,000.21

合计	260,021.32	643,161.53
----	------------	------------

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,898,945.53	149,898,945.53
本期申购	62,056,550.17	62,056,550.17
本期赎回（以“-”号填列）	-134,767,549.88	-134,767,549.88
本期末	77,187,945.82	77,187,945.82

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	51,495,033.81	20,039,704.13	71,534,737.94
本期利润	-14,029,827.57	-13,940,230.18	-27,970,057.75
本期基金份额交易产生的变动数	-17,710,785.61	-8,002,901.51	-25,713,687.12
其中：基金申购款	14,832,856.73	-3,735,415.37	11,097,441.36
基金赎回款	-32,543,642.34	-4,267,486.14	-36,811,128.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,754,420.63	-1,903,427.56	17,850,993.07

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	169,312.05	431,565.17

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	13,124.15	31,791.90
其他	-	-
合计	182,436.20	463,357.07

注：结算备付金利息收入包含保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	321,757,344.46	1,950,238,418.60
减：卖出股票成本总额	332,391,304.32	1,888,945,939.67
买卖股票差价收入	-10,633,959.86	61,292,478.93

7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	0.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	-
减：应收利息总额	-	-
买卖债券差价收入	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	605,305.08	881,686.92
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	605,305.08	881,686.92

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-13,940,230.18	28,251,860.18
——股票投资	-13,940,230.18	28,251,860.18
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-13,940,230.18	28,251,860.18

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	235,210.21	1,486,077.06
转换费收入	7,350.53	137,365.03
合计	242,560.74	1,623,442.09

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	859,948.16	5,803,959.70
银行间市场交易费用	-	-

合计	859,948.16	5,803,959.70
----	------------	--------------

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	379,999.79	380,000.00
债券账户维护费	13,500.00	7,500.00
汇划手续费	10,817.94	19,246.67
其他	270.00	770.00
合计	484,587.73	487,516.67

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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
恒泰证券股份有限公司	131,254,820.63	23.32%	920,332,294.35	24.17%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券交易。

7.4.10.1.4 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1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无关联方债券回购交易。

7.4.10.1.5 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

恒泰证券	107,694.16	22.06%	0.00	0.00%
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
恒泰证券股份有限公司	846,540.58	24.28%	627,926.00	27.80%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	2,673,448.23	4,393,287.46
其中：支付销售机构的客户维护费	193,479.98	270,291.70

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5%年费率计提。管理费的计算方法为：每日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

2、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

7.4.10.2.2 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	445,574.65	732,214.57

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如：每日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		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
中国农业银行北京万寿支行	11,029,473.96	169,312.05	18,816,190.28	431,565.17

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内与上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金于 2014 年 4 月 23 日成立，至 2016 年 12 月 31 日止无收益分配事项。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	网下中签	15.28	15.28	681.00	10,405.68	10,405.68	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	网下中签	4.00	4.00	12,204.00	48,816.00	48,816.00	-
30058	赛托	2016-1	2017-0	网下	40.29	40.29	1,582.	63,738	63,738	-

3	生物	2-29	1-10	中签			00	.78	.78	
300586	美联新材	2016-1-26	2017-01-04	网下中签	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-1-28	2017-01-05	网下中签	14.11	14.11	863.00	12,176.93	12,176.93	-
300591	万里马	2016-1-30	2017-01-10	网下中签	3.07	3.07	2,316.00	7,110.12	7,110.12	-

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300213	佳讯飞鸿	2016-11-03	重大资产重组	28.00	2017-02-17	25.48	48,900.00	1,491,096.73	1,369,200.00	-
000584	友利控股	2016-09-30	重大资产重组	11.85	2017-03-30	13.04	28,000.00	252,878.65	331,800.00	-
000697	炼石有色	2016-11-16	重大资产重组	23.51	-	-	12,133.00	281,496.11	285,246.83	-
300184	力源信息	2016-12-27	拟披露重大事项	14.42	2017-01-06	15.91	41,300.00	697,067.94	595,546.00	-
300123	太阳鸟	2016-09-27	重大资产重组	16.04	2017-02-16	18.25	33,700.00	472,906.40	540,548.00	-
300243	瑞丰高材	2016-09-19	重大资产重组	15.18	2017-01-04	16.70	51,592.00	853,498.19	783,166.56	-
300212	易华录	2016-11-29	重大资产重组	34.00	-	-	24,000.00	807,699.73	816,000.00	-
300496	中科创达	2016-10-10	重大资产重组	47.08	2017-01-06	47.49	14,115.00	795,361.84	664,534.20	-
600242	中昌海运	2016-10-10	重大资产重组	16.97	2017-03-13	17.90	66,405.00	991,724.05	1,126,892.85	-
300537	广信材料	2016-10-11	重大资产重组	48.79	2017-03-13	-	1,024.00	9,410.56	49,960.96	-
600090	同济堂	2016-12-23	重要事项未公告	11.75	2017-01-10	12.93	22,087.00	344,530.64	259,522.25	-
603986	兆易创新	2016-09-14	重大资产重组	177.97	2017-03-14	215.35	483.00	11,234.58	85,959.51	-
60015	航天机	2016-11	重大资	10.97	-	-	12,500.00	135,799.82	137,125.00	-

1	电	-10	产重组							
000558	莱茵体育	2016-10-14	重大资产重组	14.75	-	-	32,368.00	717,208.17	477,428.00	-
002165	红宝丽	2016-09-30	重大资产重组	8.57	2017-01-05	9.43	49,500.00	421,787.76	424,215.00	-
300367	东方网力	2016-12-14	重大资产重组	20.04	-	-	24,098.00	639,913.97	482,923.92	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期无银行间债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖

出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,029,473.96	-	-	-	11,029,473.96
结算备付金	9,323.00	-	-	-	9,323.00
存出保证金	67,289.25	-	-	-	67,289.25
交易性金融资产	-	-	-	83,889,908.65	83,889,908.65
应收证券清算款	-	-	-	947,270.06	947,270.06
应收利息	-	-	-	2,325.51	2,325.51
应收申购款	-	-	-	1,190.95	1,190.95
资产总计	11,106,086.21	-	-	84,840,695.17	95,946,781.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,219.82	10,219.82

应付管理人报酬	-	-	-	125,556.21	125,556.21
应付托管费	-	-	-	20,926.01	20,926.01
应付交易费用	-	-	-	491,119.13	491,119.13
其他负债	-	-	-	260,021.32	260,021.32
负债总计	-	-	-	907,842.49	907,842.49
利率敏感度缺口	11,106,086.21	-	-	83,932,852.68	95,038,938.89
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,816,190.28	-	-	-	18,816,190.28
结算备付金	4,493,176.68	-	-	-	4,493,176.68
存出保证金	948,163.96	-	-	-	948,163.96
交易性金融资产	-	-	-	187,423,566.03	187,423,566.03
应收利息	-	-	-	4,675.32	4,675.32
应收申购款	-	-	-	80,011,667.11	80,011,667.11
应收证券清算款	-	-	-	24,860,618.73	24,860,618.73
资产总计	24,257,530.92	-	-	292,300,527.19	316,558,058.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	91,871,193.08	91,871,193.08
应付管理人报酬	-	-	-	300,974.38	300,974.38
应付托管费	-	-	-	50,162.38	50,162.38
应付交易费用	-	-	-	2,258,883.27	2,258,883.27
其他负债	-	-	-	643,161.53	643,161.53
负债总计	-	-	-	95,124,374.64	95,124,374.64
利率敏感度缺口	24,257,530.92	-	-	197,176,152.55	221,433,683.47

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点		
	其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	增加约 27,765.22	增加约 60,643.83
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 27,765.22	减少约 60,643.83

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	83,889,908.65	88.27	187,423,566.03	84.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	83,889,908.65	88.27	187,423,566.03	84.64

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,本基金业绩比较基准上升 1%	
	其他市场变量不变,本基金业绩比较基准下降 1%	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	本基金业绩比较基准上升 1%	增加约 919,040.60	增加约 2,053,284.71
	本基金业绩比较基准下降 1%	减少约 919,040.60	减少约 2,053,284.71

注：1. 本基金的整体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%；

2. 本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

§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	83,889,908.65	87.43
	其中：股票	83,889,908.65	87.43
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	-	-
	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	11,038,796.96	11.51
7	其他各项资产	1,018,075.77	1.06
8	合计	95,946,781.38	100.00

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	451,930.90	0.48
B	采矿业	1,437,444.02	1.51
C	制造业	39,321,963.68	41.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,374,154.13	1.45
E	建筑业	343,105.56	0.36
F	批发和零售业	4,287,418.95	4.51
G	交通运输、仓储和邮政业	1,559,940.85	1.64
H	住宿和餐饮业	323,598.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,039,352.52	23.19
J	金融业	697,000.16	0.73
K	房地产业	3,377,132.62	3.55
L	租赁和商务服务业	576,198.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	427,038.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	609,948.36	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	400,660.00	0.42
R	文化、体育和娱乐业	4,100,638.41	4.31
S	综合	2,562,384.49	2.70
	合计	83,889,908.65	88.27

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002654	万润科技	222,762	2,459,292.48	2.59
2	600306	*ST 商城	108,055	1,889,881.95	1.99
3	300339	润和软件	49,700	1,520,820.00	1.60
4	600520	*ST 中发	52,300	1,411,577.00	1.49
5	300466	赛摩电气	45,000	1,385,550.00	1.46
6	300213	佳讯飞鸿	48,900	1,369,200.00	1.44
7	300188	美亚柏科	57,691	1,234,010.49	1.30
8	600242	中昌海运	66,405	1,126,892.85	1.19
9	002368	太极股份	32,305	988,856.05	1.04
10	600455	博通股份	16,475	969,224.25	1.02
11	300166	东方国信	45,500	945,945.00	1.00
12	300377	赢时胜	24,502	914,659.66	0.96
13	000997	新大陆	42,500	825,775.00	0.87
14	300212	易华录	24,000	816,000.00	0.86
15	300036	超图软件	46,300	805,620.00	0.85
16	300243	瑞丰高材	51,592	783,166.56	0.82
17	600701	*ST 工新	55,653	760,219.98	0.80
18	002439	启明星辰	36,000	748,440.00	0.79
19	002624	完美世界	25,095	747,580.05	0.79
20	002450	康得新	38,900	743,379.00	0.78
21	002251	步步高	43,971	723,322.95	0.76
22	300159	新研股份	52,800	717,024.00	0.75
23	300054	鼎龙股份	32,482	709,731.70	0.75
24	600850	华东电脑	28,613	691,862.34	0.73
25	300496	中科创达	14,115	664,534.20	0.70
26	002119	康强电子	31,200	645,840.00	0.68
27	300287	飞利信	54,200	644,980.00	0.68
28	300075	数字政通	34,600	644,944.00	0.68
29	000502	绿景控股	29,300	621,160.00	0.65
30	300285	国瓷材料	15,623	611,015.53	0.64
31	600498	烽火通信	24,207	610,258.47	0.64
32	300184	力源信息	41,300	595,546.00	0.63
33	600817	*ST 宏盛	28,294	588,232.26	0.62
34	300178	腾邦国际	35,700	576,198.00	0.61
35	000810	创维数字	40,901	575,477.07	0.61
36	002354	天神娱乐	8,097	559,988.52	0.59
37	002319	乐通股份	26,100	556,974.00	0.59
38	600760	*ST 黑豹	28,300	545,624.00	0.57
39	000722	湖南发展	38,200	542,822.00	0.57
40	300123	太阳鸟	33,700	540,548.00	0.57
41	600978	宜华生活	47,800	509,070.00	0.54
42	600571	信雅达	26,100	500,598.00	0.53
43	300253	卫宁健康	25,400	497,586.00	0.52
44	300364	中文在线	12,413	490,561.76	0.52

45	000858	五 粮 液	14,200	489,616.00	0.52
46	300367	东方网力	24,098	482,923.92	0.51
47	603901	永创智能	34,010	482,601.90	0.51
48	300137	先河环保	33,000	481,800.00	0.51
49	300426	唐德影视	16,752	477,432.00	0.50
50	000558	莱茵体育	32,368	477,428.00	0.50
51	300033	同花顺	6,800	467,704.00	0.49
52	600806	*ST 昆机	58,424	465,639.28	0.49
53	600570	恒生电子	9,800	461,972.00	0.49
54	000005	世纪星源	67,936	459,247.36	0.48
55	002701	奥瑞金	52,920	457,228.80	0.48
56	300113	顺网科技	16,695	448,928.55	0.47
57	300097	智云股份	8,116	444,837.96	0.47
58	300291	华录百纳	19,900	443,372.00	0.47
59	000606	*ST 易桥	38,900	442,682.00	0.47
60	002153	石基信息	17,800	433,786.00	0.46
61	600751	天海投资	51,800	433,048.00	0.46
62	000797	中国武夷	24,600	429,762.00	0.45
63	600476	湘邮科技	13,532	427,340.56	0.45
64	300384	三联虹普	10,300	427,038.00	0.45
65	300251	光线传媒	43,600	425,536.00	0.45
66	002165	红 宝 丽	49,500	424,215.00	0.45
67	600207	安彩高科	46,391	417,982.91	0.44
68	600240	华业资本	38,613	414,703.62	0.44
69	300170	汉得信息	35,000	413,350.00	0.43
70	002339	积成电子	21,600	411,264.00	0.43
71	002609	捷顺科技	25,471	407,536.00	0.43
72	002171	楚江新材	25,390	402,431.50	0.42
73	300015	爱尔眼科	13,400	400,660.00	0.42
74	000673	当代东方	28,900	400,554.00	0.42
75	300379	东方通	5,700	395,523.00	0.42
76	002131	利欧股份	24,508	390,902.60	0.41
77	000150	宜华健康	12,500	385,875.00	0.41
78	002668	奥马电器	5,325	377,808.75	0.40
79	002284	亚太股份	26,800	377,076.00	0.40
80	600339	*ST 天利	50,000	376,500.00	0.40
81	300488	恒锋工具	5,000	372,500.00	0.39
82	300369	绿盟科技	10,800	366,876.00	0.39
83	600165	新日恒力	30,000	366,000.00	0.39
84	600302	标准股份	33,800	365,716.00	0.38
85	002699	美盛文化	10,632	359,361.60	0.38
86	600348	阳泉煤业	52,850	355,680.50	0.37
87	300077	国民技术	21,729	353,096.25	0.37
88	300133	华策影视	30,920	350,942.00	0.37

89	300348	长亮科技	14,100	350,244.00	0.37
90	600883	博闻科技	21,000	337,680.00	0.36
91	000584	友利控股	28,000	331,800.00	0.35
92	600446	金证股份	13,200	331,716.00	0.35
93	000632	三木集团	39,000	330,720.00	0.35
94	002304	洋河股份	4,615	325,819.00	0.34
95	000651	格力电器	13,200	324,984.00	0.34
96	002292	奥飞娱乐	14,289	324,360.30	0.34
97	000971	高升控股	13,600	321,640.00	0.34
98	000983	西山煤电	37,567	317,816.82	0.33
99	600992	贵绳股份	18,358	311,718.84	0.33
100	600158	中体产业	13,100	308,767.00	0.32
101	002612	朗姿股份	17,000	308,040.00	0.32
102	300078	思创医惠	11,856	307,188.96	0.32
103	002241	歌尔股份	11,100	294,372.00	0.31
104	603019	中科曙光	10,500	292,110.00	0.31
105	000697	炼石有色	12,133	285,246.83	0.30
106	600503	华丽家族	34,200	283,518.00	0.30
107	300468	四方精创	5,100	283,407.00	0.30
108	603636	南威软件	3,101	279,710.20	0.29
109	002217	合力泰	15,614	279,490.60	0.29
110	601699	潞安环能	34,600	278,530.00	0.29
111	002078	太阳纸业	40,800	272,544.00	0.29
112	600330	天通股份	25,900	270,655.00	0.28
113	000616	海航投资	51,500	268,830.00	0.28
114	300168	万达信息	13,100	264,882.00	0.28
115	300046	台基股份	10,500	262,290.00	0.28
116	002649	博彦科技	6,700	260,630.00	0.27
117	600090	同济堂	22,087	259,522.25	0.27
118	000920	南方汇通	17,904	259,070.88	0.27
119	000985	大庆华科	8,400	257,880.00	0.27
120	300363	博腾股份	12,700	254,635.00	0.27
121	002670	国盛金控	7,560	254,016.00	0.27
122	600373	中文传媒	12,500	252,500.00	0.27
123	300231	银信科技	13,600	251,736.00	0.26
124	000815	美利云	12,100	248,655.00	0.26
125	600990	四创电子	3,400	247,180.00	0.26
126	002325	洪涛股份	30,800	246,708.00	0.26
127	002055	得润电子	10,400	246,584.00	0.26
128	601901	方正证券	32,400	246,240.00	0.26
129	000617	*ST 济柴	13,100	245,625.00	0.26
130	000532	力合股份	13,100	244,708.00	0.26
131	000488	晨鸣纸业	23,600	244,496.00	0.26
132	600962	国投中鲁	11,900	243,355.00	0.26

133	300072	三聚环保	5,219	241,587.51	0.25
134	002235	安妮股份	14,850	236,412.00	0.25
135	002643	万润股份	6,500	235,950.00	0.25
136	601233	桐昆股份	16,400	235,504.00	0.25
137	002777	久远银海	2,600	234,520.00	0.25
138	600634	中技控股	13,200	234,168.00	0.25
139	002405	四维图新	12,000	232,200.00	0.24
140	002821	凯莱英	1,593	228,579.57	0.24
141	603939	益丰药房	7,700	228,228.00	0.24
142	000530	大冷股份	20,950	227,517.00	0.24
143	600909	华安证券	17,770	223,013.50	0.23
144	300059	东方财富	13,100	221,783.00	0.23
145	000524	岭南控股	14,300	220,506.00	0.23
146	300295	三六五网	7,612	219,910.68	0.23
147	600756	浪潮软件	9,501	219,283.08	0.23
148	000938	紫光股份	3,800	218,082.00	0.23
149	002667	鞍重股份	7,700	216,832.00	0.23
150	000692	惠天热电	32,834	211,122.62	0.22
151	002373	千方科技	15,234	210,229.20	0.22
152	002229	鸿博股份	8,900	209,506.00	0.22
153	600750	江中药业	6,700	206,494.00	0.22
154	002326	永太科技	12,500	203,875.00	0.21
155	600969	郴电国际	10,610	202,226.60	0.21
156	300467	迅游科技	4,600	201,480.00	0.21
157	002690	美亚光电	9,398	198,861.68	0.21
158	300451	创业软件	5,380	198,522.00	0.21
159	000782	美达股份	19,500	197,730.00	0.21
160	300249	依米康	14,444	196,149.52	0.21
161	300119	瑞普生物	11,400	195,966.00	0.21
162	002004	华邦健康	21,400	194,098.00	0.20
163	000703	恒逸石化	12,836	192,925.08	0.20
164	600730	中国高科	15,100	187,089.00	0.20
165	000678	襄阳轴承	14,100	185,556.00	0.20
166	002249	大洋电机	21,500	185,545.00	0.20
167	002070	众和股份	13,300	184,604.00	0.19
168	002696	百洋股份	8,053	184,413.70	0.19
169	600615	丰华股份	8,700	183,048.00	0.19
170	002221	东华能源	14,500	179,655.00	0.19
171	002053	云南能投	9,300	178,467.00	0.19
172	600055	万东医疗	9,770	177,032.40	0.19
173	000892	星美联合	12,500	174,750.00	0.18
174	601933	永辉超市	35,502	174,314.82	0.18
175	000702	正虹科技	12,800	174,080.00	0.18
176	002410	广联达	11,900	173,740.00	0.18

177	601965	中国汽研	16,200	172,530.00	0.18
178	300192	科斯伍德	11,400	172,140.00	0.18
179	002686	亿利达	11,200	165,984.00	0.17
180	300433	蓝思科技	6,010	165,936.10	0.17
181	000779	三毛派神	8,500	163,710.00	0.17
182	000066	长城电脑	13,100	162,964.00	0.17
183	000687	华讯方舟	10,600	162,816.00	0.17
184	002019	亿帆医药	10,550	161,309.50	0.17
185	600705	中航资本	25,900	158,508.00	0.17
186	002086	东方海洋	13,500	154,710.00	0.16
187	600136	当代明诚	9,300	152,799.00	0.16
188	300422	博世科	3,700	150,701.00	0.16
189	603858	步长制药	1,572	149,811.60	0.16
190	300311	任子行	8,956	149,296.52	0.16
191	600562	国睿科技	4,900	149,058.00	0.16
192	600395	盘江股份	18,300	147,681.00	0.16
193	600887	伊利股份	8,200	144,320.00	0.15
194	300434	金石东方	4,100	143,090.00	0.15
195	002467	二六三	13,420	141,178.40	0.15
196	002338	奥普光电	2,900	140,360.00	0.15
197	600151	航天机电	12,500	137,125.00	0.14
198	300114	中航电测	5,900	134,402.00	0.14
199	002443	金洲管道	12,000	131,280.00	0.14
200	002104	恒宝股份	11,000	129,690.00	0.14
201	300267	尔康制药	9,800	127,890.00	0.13
202	600060	海信电器	7,400	126,688.00	0.13
203	600360	华微电子	14,200	125,812.00	0.13
204	600560	金自天正	7,600	124,412.00	0.13
205	300304	云意电气	2,600	119,340.00	0.13
206	600176	中国巨石	11,935	117,440.40	0.12
207	600313	农发种业	17,092	112,807.20	0.12
208	002487	大金重工	12,400	111,972.00	0.12
209	300286	安科瑞	4,000	110,600.00	0.12
210	000428	华天酒店	14,200	103,092.00	0.11
211	600287	江苏舜天	8,600	91,934.00	0.10
212	300398	飞凯材料	1,574	91,669.76	0.10
213	300569	天能重工	914	91,436.56	0.10
214	002519	银河电子	3,900	87,360.00	0.09
215	603986	兆易创新	483	85,959.51	0.09
216	002822	中装建设	2,797	80,805.33	0.09
217	300568	星源材质	910	74,510.80	0.08
218	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.08
219	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.07
220	002823	凯中精密	1,447	66,851.40	0.07

221	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.07
222	002831	裕同科技	910	62,972.00	0.07
223	300565	科信技术	1,582	62,773.76	0.07
224	002820	桂发祥	1,272	62,404.32	0.07
225	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.06
226	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.06
227	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.06
228	300556	丝路视觉	826	51,509.36	0.05
229	603298	杭叉集团	2,089	50,720.92	0.05
230	300570	太辰光	905	50,046.50	0.05
231	300537	广信材料	1,024	49,960.96	0.05
232	601375	中原证券	12,204	48,816.00	0.05
233	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.05
234	002819	东方中科	893	42,515.73	0.04
235	002825	纳尔股份	839	39,424.61	0.04
236	603218	日月股份	940	39,151.00	0.04
237	601882	海天精工	1,548	39,071.52	0.04
238	603336	宏辉果蔬	828	38,973.96	0.04
239	603036	如通股份	1,589	38,914.61	0.04
240	603819	神力股份	975	38,805.00	0.04
241	603660	苏州科达	1,168	37,632.96	0.04
242	603033	三维股份	696	35,892.72	0.04
243	603977	国泰集团	1,306	35,849.70	0.04
244	603633	徕木股份	858	35,186.58	0.04
245	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.04
246	603319	湘油泵	621	35,086.50	0.04
247	603900	通灵珠宝	813	31,300.50	0.03
248	002828	贝肯能源	770	29,722.00	0.03
249	603389	亚振家居	1,133	27,316.63	0.03
250	603585	苏利股份	388	27,051.36	0.03
251	603878	武进不锈	660	26,400.00	0.03
252	603987	康德莱	774	24,992.46	0.03
253	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.03
254	603727	博迈科	479	22,766.87	0.02
255	603323	吴江银行	1,321	20,422.66	0.02
256	002833	弘亚数控	1,092	19,241.04	0.02
257	603239	浙江仙通	496	15,599.20	0.02
258	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.02
259	300587	天铁股份	863	12,176.93	0.01
260	603886	元祖股份	610	10,797.00	0.01
261	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.01
262	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.01
263	300591	万里马	2,316	7,110.12	0.01

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300077	国民技术	3,775,729.00	1.71
2	600048	保利地产	3,348,689.64	1.51
3	300075	数字政通	3,061,190.80	1.38
4	600570	恒生电子	2,849,886.90	1.29
5	300496	中科创达	2,729,401.46	1.23
6	300287	飞利信	2,575,401.00	1.16
7	000558	莱茵体育	2,486,291.00	1.12
8	600978	宜华生活	2,395,390.00	1.08
9	002654	万润科技	2,366,859.00	1.07
10	000530	大冷股份	2,330,622.20	1.05
11	002221	东华能源	2,234,506.66	1.01
12	603901	永创智能	2,129,708.50	0.96
13	300159	新研股份	2,112,314.00	0.95
14	300348	长亮科技	2,028,509.08	0.92
15	000810	创维数字	1,999,830.00	0.90
16	300339	润和软件	1,978,981.00	0.89
17	002251	步步高	1,881,264.50	0.85
18	600735	新华锦	1,851,006.70	0.84
19	000997	新大陆	1,835,230.00	0.83
20	300377	赢时胜	1,834,452.00	0.83

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002709	天赐材料	8,284,336.19	3.74
2	300075	数字政通	5,460,141.88	2.47
3	002112	三变科技	5,434,405.60	2.45
4	300038	梅泰诺	4,984,691.39	2.25
5	600645	中源协和	4,123,980.00	1.86
6	600570	恒生电子	4,026,137.35	1.82

7	002171	楚江新材	3,864,314.85	1.75
8	002387	黑牛食品	3,481,556.00	1.57
9	600735	新华锦	3,364,846.10	1.52
10	600048	保利地产	3,316,882.50	1.50
11	002298	中电鑫龙	3,177,892.25	1.44
12	300077	国民技术	2,911,529.44	1.31
13	600992	贵绳股份	2,783,201.82	1.26
14	300144	宋城演艺	2,705,625.39	1.22
15	000799	酒鬼酒	2,683,004.50	1.21
16	300352	北信源	2,654,369.30	1.20
17	300377	赢时胜	2,593,442.00	1.17
18	600715	文投控股	2,447,843.00	1.11
19	300466	赛摩电气	2,421,131.00	1.09
20	300159	新研股份	2,384,979.00	1.08

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

买入股票的成本（成交）总额	242,797,877.12
卖出股票的收入（成交）总额	321,757,344.46

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期无债券投资。

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

本基金本报告期无债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期无资产支持证券投资。

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。

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

本基金本报告期无权证投资。

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

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期末本基金投资的前十名证券没有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 本报告期，本基金投资的前十名股票没有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	67,289.25
2	应收证券清算款	947,270.06
3	应收股利	-
4	应收利息	2,325.51
5	应收申购款	1,190.95
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,018,075.77

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无债券持仓。

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
1	300213	佳讯飞鸿	1,369,200.00	1.44	重大资产重组
2	600242	中昌海运	1,126,892.85	1.19	重大资产重组

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
2,194	35,181.38	52,979,470.20	68.64%	24,208,475.62	31.36%

9.2 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	178,131.25	0.23%

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为178,131.25份。

9.3 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年4月23日)基金份额总额	295,580,861.07
本报告期期初基金份额总额	149,898,945.53
本报告期基金总申购份额	62,056,550.17
减：本报告期基金总赎回份额	134,767,549.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	77,187,945.82

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

2016年3月24日，崔建波先生担任本基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2015 年至 2016 年，瑞华会计师事务所为本基金连续提供 2 年审计服务。

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，本基金无管理人、托管人及其高级管理人员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	
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	131,254,820.63	23.32%	107,694.16	22.06%	-
国泰君安	1	58,790,689.43	10.45%	54,751.60	11.21%	-
兴业证券	1	54,917,832.41	9.76%	51,145.11	10.48%	-
招商证券	1	46,694,175.97	8.30%	43,486.19	8.91%	-
光大证券	1	40,767,124.48	7.24%	37,966.47	7.78%	-
中信建投	1	35,292,373.23	6.27%	29,435.31	6.03%	-
银河证券	2	23,824,668.45	4.23%	17,502.60	3.58%	-
国金证券	1	21,525,332.10	3.82%	20,046.22	4.11%	-
华泰证券	1	20,510,194.18	3.64%	14,999.20	3.07%	-
齐鲁证券	1	20,452,414.61	3.63%	19,047.36	3.90%	-
浙商证券	1	14,567,630.30	2.59%	10,653.23	2.18%	-
民生证券	2	13,967,481.40	2.48%	11,091.81	2.27%	-
中金公司	1	13,115,843.28	2.33%	12,214.26	2.50%	-
渤海证券	1	12,409,616.58	2.20%	9,075.10	1.86%	-
平安证券	1	11,679,288.71	2.08%	10,877.06	2.23%	-
中信证券	1	11,531,942.26	2.05%	10,739.71	2.20%	-
新时代证券	2	10,756,349.67	1.91%	10,017.44	2.05%	-
申银万国	1	9,301,427.13	1.65%	8,662.50	1.77%	-
川财证券	1	5,048,785.13	0.90%	3,692.21	0.76%	-
东方证券	1	3,373,703.00	0.60%	2,951.46	0.60%	-
信达证券	1	1,628,895.85	0.29%	1,191.23	0.24%	-
东兴证券	1	1,132,052.40	0.20%	827.88	0.17%	-

安信证券	1	258,392.50	0.05%	188.96	0.04%	-
民族证券	1	-	-	188.96	0.04%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《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）的有关规定，本基金报告期内共租用32个交易席位，其中报告期内新增2个交易席位。新增席位为：信达证券上海交易所席位、浙商证券上海交易所席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经济商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		额的比例		额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	179,000,000.00	37.45%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	46,000,000.00	9.62%	-	-
齐鲁证券	-	-	107,000,000.00	22.38%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	45,000,000.00	9.41%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	73,000,000.00	15.27%	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	28,000,000.00	5.86%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2015 年年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-04

2	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金 2016 年 1 月 4 日开放时间的公告	公司网站	2016-01-04
3	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-06
4	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金 2016 年 1 月 7 日开放时间的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-07
5	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-08
6	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-12
7	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-14
8	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-22
9	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-27
10	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-28
11	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-29
12	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-02-17
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-02-18
14	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-01
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-01
16	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加金观诚为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-15

17	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-25
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加新兰德开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-26
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加众禄基金开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-28
20	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-29
21	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰为销售机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-16
22	新华基金管理股份有限公司关于“银联通”渠道开通部分银行借记卡网上直销业务功能的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-20
23	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-21
24	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-25
25	新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销系统招商银行网银支付费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-29
26	新华基金管理股份有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-05-05
27	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-04
28	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站	2016-06-06
29	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-06
30	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-06
31	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-13

32	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-13
33	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年半年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-07-01
34	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金通过上海浦东发展银行股份有限公司申购基金费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-07-02
35	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-07-18
36	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-08-24
37	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大泰金石为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-10-15
38	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-10-26
39	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加和讯开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-11-09
40	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加汇付金融为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-11-29
41	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加钱景财富开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-11-29
42	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-12-01
43	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-12-06
44	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)全文	公司网站	2016-12-06
45	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-12-14
46	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-12-30

47	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年年度最后一个交易日资产净值揭示公 告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-12-31
----	---	------------------------------------	------------

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (四)新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (五)新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金登记结算服务协议
- (六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (七)更新的《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (八)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程
- (九)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十一)中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇一七年三月三十一日