

华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 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：2019 年 8 月 29 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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 15 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 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.....	47
7.8 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.....	47
7.9 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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	53

§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华融新利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华融新利灵活配置混合
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	10,138,191.00 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，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的优质标的，运用多样化的投资策略实行组合管理。
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	梅思佳	贺倩
	联系电话	010-85556481	010-66060069
	电子邮箱	meisijia@hrsec.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-898-9999	95599
传真		010-85556592	010-68121816
注册地址		北京市西城区金融大街 8 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号	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		100033	100031
法定代表人		祝献忠	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	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund.hrsec.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华融证券股份有限公司	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-100,199.45
本期利润	2,118,516.40
加权平均基金份额本期利润	0.1973
本期加权平均净值利润率	22.91%
本期基金份额净值增长率	26.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-757,146.51
期末可供分配基金份额利润	-0.0747
期末基金资产净值	9,381,044.49
期末基金份额净值	0.925
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-7.50%

注：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。

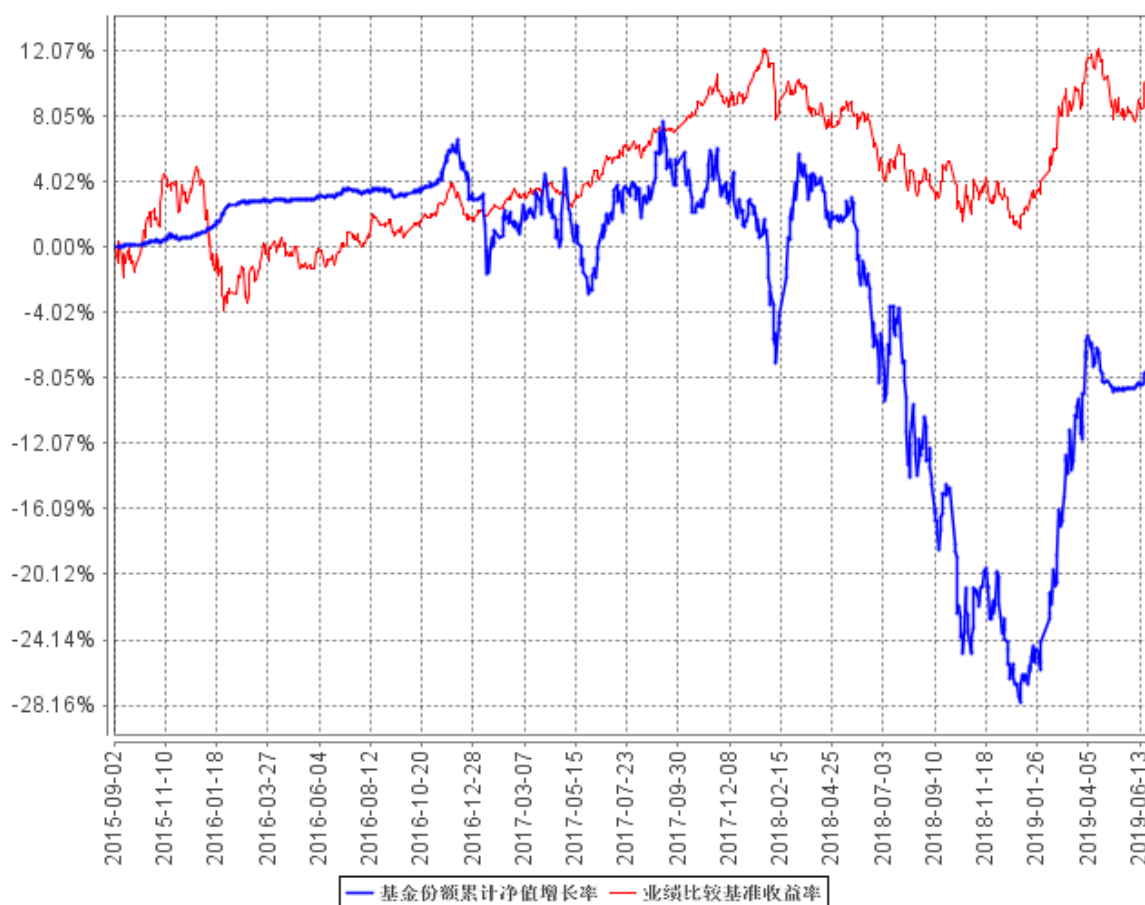
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	1.31%	0.12%	1.71%	0.35%	-0.40%	-0.23%
过去三个月	1.65%	0.51%	0.05%	0.46%	1.60%	0.05%
过去六个月	26.54%	0.92%	8.35%	0.47%	18.19%	0.45%
过去一年	-2.32%	1.14%	4.33%	0.46%	-6.65%	0.68%
过去三年	-10.45%	0.84%	10.45%	0.33%	-20.90%	0.51%
自基金合同 生效起至今	-7.50%	0.74%	10.12%	0.39%	-17.62%	0.35%

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。

3.3 其他指标

本基金本报告期末无其他指标。

§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是经中国证监会批准，由中国华融资产管理股份有限公司作为主发起人设立的全国性综合证券公司。2007 年 9 月在北京正式挂牌成立。目前，公司注册资本 58.41 亿元，总部设在北京，下设 16 家分公司、65 家营业部，旗下拥有华融期货有限责任公司、华融瑞泽投资管理有限公司，在雄安注册首家公募基金子公司（筹）。

公司坚持以服务实体经济为使命，回归主责主业，持续加强“投行、投资、交易、风控和财富管理”五大核心能力建设，目前已经初步形成了以全品种、全链条的资本中介型服务为引领的轻资产运营模式，以提升投资能力为核心竞争力的重资产运营模式，构建了包括“投行、资管、财富管理、自营投资、公募基金和私募股权基金”在内的较为全面的业务布局，同时拥有股票质押、代销金融产品、新三板、股票期权等多项重要业务资格，形成了较为健全的牌照体系，主动管理资产规模始终保持在行业前列。2018 年公司荣获中国区十大创新项目君鼎奖、中国理财服务先锋、银行间本币市场交易 300 强等荣誉。

华融证券将贯彻落实党的十九大精神，聚焦金融工作“三大任务”，积极参与供给侧结构性改革等国家战略部署，助力实体经济发展，用专业为客户创造价值。

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	2019 年 4 月 24 日	-	10	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 12 年金融行业工作经验。2006 年就职于中国建设银行, 2009 年 6 月加入华融证券, 历任市场研究部、资产管理二部、基金业务部。2015 年 9 月-2017 年 6 月任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月至今任华融新锐灵活

					配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 4 月至今任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：(1) 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

(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

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 公平交易制度的执行情况

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《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。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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

报告期内，不存在基金管理人管理的所有基金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

上半年，市场冲高回落，上证综指创下 3288 点的高点后震荡下行，但仍运行在 2800 点上方，市场风格快速切换，先是绩优白马龙头股领涨，随后创业板出现明显的反弹，但是季末白马龙头再度领涨，多只个股创出历史新高。上半年金融地产、TMT、大消费等三大类别都出现了一波行情，但总体来看，消费板块表现较好。

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。本基金在报告期内根据市场变化积极调整仓位和配置结构，积极参与新股申购增厚基金收益，并在二季度增加了债券资产的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.925 元；本报告期基金份额净值增长率为 26.54%，业绩比较基准收益率为 8.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年，国内经济稳中趋缓，先行指标制造业 PMI 多数时间运行在收缩区域。从需求端看，投资增速一季度小幅回升后，二季度继续延续近年来的下滑态势；出口面临贸易战的影响，增速波动下行；消费增速在汽车行业的拖累下在多年低位水平下徘徊。从供给端和企业经营效益看，工业增加值增速持续走低，工业企业利润增速低位震荡。物价方面，受猪肉价格上涨等因素影响 CPI 增速逐月扩大，上半年大部分时间 CPI 维持在 2%以上。

上半年，利率呈现冲高回落、趋势回升的态势，季末流动性较为宽松。上半年社融数据波动较大、货币供给增速低位波动。二季度中美经济下行压力增加，美联储降息预期强烈，美国 10 年期国债收益率创下 16 年 11 月以来的新低，带动国内利率下行。同时，受包商银行事件影响，信用分层较为明显，为降低包商银行事件的冲击，央行 6 月下旬通过增加再贴现、开展常备借贷便利（SLF）以及民营企业债券融资支持工具（CRMW）增信等方式，加强对中小银行的支持。总体上看，上半年收益率曲线变得更加平坦、信用利差走阔。

展望 2019 年三季度，我们认为，中国经济可能延续放缓走势，三大攻坚战以及中美贸易战仍是宏观政策的焦点。在猪肉价格上涨压力较大的情况下，物价存在一定的不确定性，对货币政策宽松力度形成一定制约，三季度货币政策可能维持中性略宽松。

综合来看，三季度市场面临经济下行、资金中性略宽松的宏观环境。从市场本身来看，上证 50 市盈率 11 倍左右，与标普 500 市盈率 20.5 倍、富时 100 为 15.3 倍、日经 225 为 12.2 倍、孟买 SENSEX 为 28.7 倍比较，具备一定的估值优势。在 A 股加速开放的背景下，境外配置资金有

望继续流入国内市场。历史对比看，全部 A 股、沪深 300、上证 50 估值处在历史后 25%分位水平，中证 500 处在 5%分位水平，但是部分白马蓝筹股的估值处于相对偏高的历史分位水平。因此，股票市场可能延续结构性分化的行情，自下而上选择优质股票仍是较好的选择。

4.6 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，负责研究、指导基金估值业务。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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的情形。

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。公司已向监管部门报告，正在拟定相关应对方案。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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—华融证券股份有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，华融证券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 托管人对本半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，华融证券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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	257,491.68	464,534.32
结算备付金		155,963.80	284,804.09
存出保证金		5,920.66	2,935.12
交易性金融资产	6.4.7.2	8,437,546.50	4,672,154.60
其中：股票投资		1,392,033.00	4,672,154.60
基金投资		-	-
债券投资		7,045,513.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	500,000.00	3,000,000.00
应收证券清算款		14,898.70	3,563.01
应收利息	6.4.7.5	132,934.76	-490.25
应收股利		-	-
应收申购款		928.43	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,505,684.53	8,427,500.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,673.76	-
应付赎回款		11,209.64	665.04
应付管理人报酬		4,870.34	4,381.82
应付托管费		1,217.59	1,095.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	20,002.56	709.62

应交税费		8.90	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	78,657.25	140,000.00
负债合计		124,640.04	146,851.93
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	10,138,191.00	11,331,607.27
未分配利润	6.4.7.10	-757,146.51	-3,050,958.31
所有者权益合计		9,381,044.49	8,280,648.96
负债和所有者权益总计		9,505,684.53	8,427,500.89

6.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,240,777.19	-488,124.78
1.利息收入		71,618.76	206,275.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,303.67	15,408.27
债券利息收入		30,917.30	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		36,397.79	190,867.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-59,055.82	-451,621.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-75,577.42	-468,460.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	199.10	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	16,322.50	16,839.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,218,715.85	-267,955.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	9,498.40	25,176.66
减：二、费用		122,260.79	303,152.09

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	27,400.90	58,446.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,850.24	14,611.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	38,578.01	148,691.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.96	-
7. 其他费用	6.4.7.20	49,430.68	81,402.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,118,516.40	-791,276.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,118,516.40	-791,276.87

6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	11,331,607.27	-3,050,958.31	8,280,648.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,118,516.40	2,118,516.40
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）	-1,193,416.27	175,295.40	-1,018,120.87
其中：1.基金申购款	3,897,196.18	-340,027.13	3,557,169.05
2.基金赎回款	-5,090,612.45	515,322.53	-4,575,289.92
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）	10,138,191.00	-757,146.51	9,381,044.49

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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)	33,900,442.17	546,808.16	34,447,250.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-791,276.87	-791,276.87
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)	-21,720,422.14	-396,351.36	-22,116,773.50
其中: 1.基金申购款	97,765.94	39.42	97,805.36
2.基金赎回款	-21,818,188.08	-396,390.78	-22,214,578.86
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)	12,180,020.03	-640,820.07	11,539,199.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表的编制所遵循的会计政策与上年度会计报表相一致未发生变动。

6.4.4.1 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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；
- 6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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首次发行成本，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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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收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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	257,491.68
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	257,491.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,337,551.63	1,392,033.00	54,481.37
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	7,026,965.22	7,045,513.50
	银行间市场	—	—
	合计	7,026,965.22	7,045,513.50
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	8,364,516.85	8,437,546.50	73,029.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	500,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	500,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	60.51
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	63.18
应收债券利息	131,939.46
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	869.27
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	2.34
合计	132,934.76

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	20,002.56
银行间市场应付交易费用	—
合计	20,002.56

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	78,657.25
—	—
合计	78,657.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,331,607.27	11,331,607.27
本期申购	3,897,196.18	3,897,196.18
本期赎回(以“-”号填列)	-5,090,612.45	-5,090,612.45
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	10,138,191.00	10,138,191.00

6.4.7.10 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	-622,670.85	-2,428,287.46	-3,050,958.31
本期利润	-100,199.45	2,218,715.85	2,118,516.40

本期基金份额交易产生的变动数	42,139.46	133,155.94	175,295.40
其中：基金申购款	-219,924.05	-120,103.08	-340,027.13
基金赎回款	262,063.51	253,259.02	515,322.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-680,730.84	-76,415.67	-757,146.51

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,001.61
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	2,276.23
其他	25.83
合计	4,303.67

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	16,150,123.75
减：卖出股票成本总额	16,225,701.17
买卖股票差价收入	-75,577.42

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	199.10
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	199.10
----	--------

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	201,626.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	199,560.90
减：应收利息总额	1,866.99
买卖债券差价收入	199.10

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未产生债权投资收益一赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未产生债权投资收益申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未产生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未产生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末产生衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末产生衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	16,322.50
基金投资产生的股利收益	—
合计	16,322.50

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,218,715.85
——股票投资	2,200,167.57
——债券投资	18,548.28
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	—
合计	2,218,715.85

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,498.40
合计	9,498.40

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	38,578.01
银行间市场交易费用	-
合计	38,578.01

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	9,890.40
信息披露费	28,766.85
帐户维护费	9,000.00
银行费用	1,773.43
-	-
合计	49,430.68

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
华融瑞泽投资有限公司	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	26,887,045.75	100.00%	110,902,248.75	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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
华融证券	7,427,345.68	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	253,500,000.00	100.00%	1,134,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	19,998.04	100.00%	20,002.56	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	81,995.97	100.00%	15,887.25	100.00%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	27,400.90	58,446.58
其中：支付销售机构的 客户维护费	1,837.12	

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,850.24	14,611.63

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未产生销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金于本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	257,491.68	2,001.61	584,654.43	4,403.92

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
601698	N 卫通	-	-	新股流通受限	-	3.92	1,000	2,720.00	3,920.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由董事会-经营层-业务部门-相关风险管理职能部门等构成的四个层次风险管理架构体系。其中，董事会是公司风险管理的最高决策机构；经营层负责对业务开展及其风险进行决策，并设立了首席·风险官，牵头公司全面风险管理工作；业务部门负责本业务风险的识别、评估、管理、应对及报告工作，并对本业务风险管理有效性承担直接责任；风险管理部门在首席风险官的领导下，负责牵头和推动公司全面风险管理工作；公司还指定了专门部门负责流动性风险以及声誉风险的管理工作，同时，监察稽核部门负责对公司风险管理工作进行审查、评价和整改。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	746,661.90	—
A-1 以下		—
未评级	6,298,851.60	—
合计	7,045,513.50	—

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末，本基金无资产支持证券持仓。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

截至本报告期末，本基金无同业存单持仓。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	687,723.90	-
AAA 以下	58,938.00	-
未评级	6,298,851.60	-
合计	7,045,513.50	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末，本基金无资产支持证券持仓。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

截至本报告期末，本基金无同业存单持仓。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持的全部证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，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投资的公允价值。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理岗位对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理办法：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；在开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	257,491.68	-	-	-	-	-	257,491.68
结算备付金	155,963.80	-	-	-	-	-	155,963.80
存出保证金	5,920.66	-	-	-	-	-	5,920.66
交易性金融资产	-	-1,705,634.40	5,100,653.80	239,225.30	1,392,033.00	-	8,437,546.50
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	-	-	-	500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,898.70	14,898.70
应收利息	-	-	-	-	-	132,934.76	132,934.76
应收申购款	-	-	-	-	-	928.43	928.43
资产总计	919,376.14	-1,705,634.40	5,100,653.80	239,225.30	1,540,794.89	-	9,505,684.53
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	8,673.76	8,673.76
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,209.64	11,209.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,870.34	4,870.34
应付托管费	-	-	-	-	-	1,217.59	1,217.59
应付交易费用	-	-	-	-	-	20,002.56	20,002.56
应交税费	-	-	-	-	-	8.90	8.90
其他负债	-	-	-	-	-	78,657.25	78,657.25
负债总计	-	-	-	-	-	124,640.04	124,640.04
利率敏感度缺口	919,376.14	-1,705,634.40	5,100,653.80	239,225.30	1,416,154.85	-	9,381,044.49
上年度末 2018 年 12 月	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

31 日							
资产							
银行存款	464,534.32	-	-	-	-	-	464,534.32
结算备付金	284,804.09	-	-	-	-	-	284,804.09
存出保证金	2,935.12	-	-	-	-	-	2,935.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-4,672,154.60	4,672,154.60
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	-	-	3,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,563.01	3,563.01
应收利息	-	-	-	-	-	-490.25	-490.25
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,752,273.53	-	-	-	-	-4,675,227.36	8,427,500.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	665.04	665.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,381.82	4,381.82
应付托管费	-	-	-	-	-	1,095.45	1,095.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	709.62	709.62
其他负债	-	-	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	146,851.93	146,851.93
利率敏感度缺口	3,752,273.53	-	-	-	-	-4,528,375.43	8,280,648.96

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	219,976.32	-
	利率上升 25 个基点	-219,976.32	-

注：本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	1,392,033.00	14.84	4,672,154.60	56.42
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	7,045,513.50	75.10	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	8,437,546.50	89.94	4,672,154.60	56.42

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	29,928.71	294,345.74
	沪深 300 指数下降 5%	-29,928.71	-294,345.74

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法管理风险。

6.4.14 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。

§7 投资组合报告

7.1 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	1,392,033.00	14.64
	其中：股票	1,392,033.00	14.64
2	固定收益投资	7,045,513.50	74.12
	其中：债券	7,045,513.50	74.12
	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	500,000.00	5.26
	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	413,455.48	4.35
7	其他各项资产	154,682.55	1.63
8	合计	9,505,684.53	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	492,014.00	5.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	78,760.00	0.84
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	72,001.00	0.77
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,920.00	0.04
J	金融业	621,819.00	6.63
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	97,515.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	26,004.00	0.28
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	1,392,033.00	14.84

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 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	601939	建设银行	30,000	223,200.00	2.38
2	601398	工商银行	30,000	176,700.00	1.88
3	601888	中国国旅	1,100	97,515.00	1.04
4	601318	中国平安	1,100	97,471.00	1.04
5	600309	万华化学	2,200	94,138.00	1.00
6	600660	福耀玻璃	3,900	88,647.00	0.94
7	601688	华泰证券	3,900	87,048.00	0.93
8	000338	潍柴动力	6,700	82,343.00	0.88
9	600900	长江电力	4,400	78,760.00	0.84
10	601006	大秦铁路	8,900	72,001.00	0.77
11	600104	上汽集团	2,500	63,750.00	0.68
12	600600	青岛啤酒	1,200	59,916.00	0.64
13	600176	中国巨石	6,000	57,180.00	0.61
14	300003	乐普医疗	2,000	46,040.00	0.49
15	601988	中国银行	10,000	37,400.00	0.40
16	603259	药明康德	300	26,004.00	0.28
17	601698	N 卫通	1,000	3,920.00	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000338	潍柴动力	609,123.00	7.36
2	603707	健友股份	505,832.00	6.11
3	603659	璞泰来	462,582.00	5.59
4	002635	安洁科技	431,101.00	5.21
5	002050	三花股份	420,865.00	5.08
6	002368	太极股份	408,752.00	4.94
7	601166	兴业银行	379,222.00	4.58
8	601888	中国国旅	377,671.00	4.56
9	600038	中直股份	351,016.00	4.24
10	601988	中国银行	344,430.00	4.16
11	300188	美亚柏科	342,422.00	4.14
12	601939	建设银行	333,900.00	4.03
13	600050	中国联通	318,050.00	3.84
14	601818	光大银行	316,850.00	3.83
15	601398	工商银行	315,250.00	3.81
16	300347	泰格医药	312,594.00	3.77
17	300009	安科生物	308,902.00	3.73
18	002643	万润股份	293,969.00	3.55
19	001979	招商蛇口	282,350.00	3.41
20	300122	智飞生物	280,290.00	3.38
21	601225	陕西煤业	275,400.00	3.33
22	601668	中国建筑	260,800.00	3.15
23	600850	华东电脑	207,630.00	2.51
24	600498	烽火通信	206,810.00	2.50
25	600837	海通证券	192,220.00	2.32
26	002139	拓邦股份	186,900.00	2.26
27	002157	正邦科技	172,300.00	2.08

7.4.2 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	000338	潍柴动力	644,075.80	7.78
2	002371	北方华创	534,250.00	6.45
3	000066	中国长城	527,139.00	6.37
4	603707	健友股份	500,000.00	6.04
5	603659	璞泰来	486,829.00	5.88
6	002050	三花股份	462,859.00	5.59
7	603019	中科曙光	455,702.00	5.50
8	002635	安洁科技	433,640.00	5.24
9	000938	紫光股份	412,156.80	4.98
10	002368	太极股份	402,284.00	4.86
11	601166	兴业银行	395,370.00	4.77
12	600487	亨通光电	372,794.00	4.50
13	600038	中直股份	362,628.00	4.38
14	300188	美亚柏科	357,127.00	4.31
15	300003	乐普医疗	343,590.00	4.15
16	000786	北新建材	338,176.00	4.08
17	601888	中国国旅	334,939.00	4.04
18	300009	安科生物	334,758.00	4.04
19	600050	中国联通	329,200.00	3.98
20	300347	泰格医药	327,057.00	3.95
21	002422	科伦药业	325,892.00	3.94
22	601818	光大银行	313,350.00	3.78
23	002643	万润股份	309,691.00	3.74
24	603103	横店影视	304,830.00	3.68
25	601607	上海医药	303,926.00	3.67
26	601988	中国银行	303,470.00	3.66
27	002511	中顺洁柔	288,802.43	3.49
28	600754	锦江股份	285,630.00	3.45
29	300122	智飞生物	272,800.00	3.29
30	601225	陕西煤业	272,740.00	3.29
31	001979	招商蛇口	260,782.00	3.15
32	002281	光迅科技	255,730.00	3.09
33	000001	平安银行	254,530.00	3.07

34	002294	信立泰	254,416.00	3.07
35	601668	中国建筑	248,370.00	3.00
36	002142	宁波银行	234,270.00	2.83
37	600498	烽火通信	230,312.68	2.78
38	002157	正邦科技	226,490.00	2.74
39	600850	华东电脑	209,700.00	2.53
40	600837	海通证券	204,644.04	2.47
41	600763	通策医疗	197,319.00	2.38
42	300618	寒锐钴业	191,056.00	2.31
43	002139	拓邦股份	180,300.00	2.18
44	300353	东土科技	170,360.00	2.06

7.4.3 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	10,745,412.00
卖出股票收入（成交）总额	16,150,123.75

7.5 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	3,329,080.80	35.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,969,770.80	31.66
	其中：政策性金融债	2,969,770.80	31.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	746,661.90	7.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,045,513.50	75.10

7.6 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	019611	19 国债 01	17,070	1,705,634.40	18.18
2	010107	21 国债(7)	15,780	1,623,446.40	17.31
3	018007	国开 1801	12,380	1,248,770.60	13.31
4	108604	国开 1805	9,060	916,600.20	9.77
5	108902	农发 1802	8,000	804,400.00	8.57

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券中其余的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制期日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.12.3 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	5,920.66
2	应收证券清算款	14,898.70
3	应收股利	-
4	应收利息	132,934.76
5	应收申购款	928.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,682.55

7.12.4 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（%）
1	132013	17 宝武 EB	132,920.20	1.42
2	132015	18 中油 EB	131,172.60	1.40
3	113013	国君转债	126,828.80	1.35
4	113021	中信转债	123,688.60	1.32
5	127010	平银转债	115,536.70	1.23
6	110031	航信转债	58,938.00	0.63
7	128024	宁行转债	57,577.00	0.61

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
645	15,718.12	0.00	0.00%	10,138,191.00	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金属于未上市基金。

8.3 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	1,020,980.11	10.0700%

8.4 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	—
本基金基金经理持有本开放式基金	—

§9 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	11,331,607.27
本报告期基金总申购份额	3,897,196.18
减：本报告期基金总赎回份额	5,090,612.45
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	10,138,191.00

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

基金管理人的重大人事变动：

2019 年 1 月 26 日，华融证券 2019 年第 1 次临时股东大会审议通过了《关于提名林锋女士、高东旺先生为公司第四届董事会董事候选人的议案》，2019 年 2 月 1 日，北京证监局下发了《关于核准高东旺证券公司董事资格的批复》。自 2019 年 2 月 1 日起，高东旺先生担任公司董事职务，司颖女士不再担任公司董事职务。

2019 年 1 月 26 日，华融证券 2019 年第 1 次临时股东大会审议通过了《关于提名林锋女士、高东旺先生为公司第四届董事会董事候选人的议案》，2019 年 3 月 5 日，北京证监局下发了《关于核准林锋证券公司董事资格的批复》。自 2019 年 3 月 5 日起，林锋女士担任公司董事职务，裴云华女士不再担任公司董事职务。

经公司第三届监事会第十五次会议审议通过，自 2019 年 3 月 15 日起，王水洋先生不再担任公司监事会主席职务，选举李卫女士担任公司第三届监事会主席职务；会议同时通报了经公司职工代表大会推举，由王云峰先生担任公司职工监事职务。

基金托管人的重大人事变动：

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

10.3 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事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金管理人未改聘为其审计的会计师事务所，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）。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	26,887,045.75	100.00%	19,998.04	100.00%	-

10.7.2 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	7,427,345.68	100.00%	253,500,000.00	100.00%	-	-

10.8 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	华融证券股份有限公司关于旗下开放式证券投资基金 2018 年最后一个市场交易日基金资产净值	本基金管理人网站	2019 年 1 月 2 日
2	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报、本基金管理人网站	2019 年 1 月 18 日
3	系统升级公告	本基金管理人网站	2019 年 1 月 25 日
4	华融基金管理有限公司关于完成工商注册登记的公告	中国证券报、本基金管理人网站	2019 年 3 月 9 日
5	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告	中国证券报、本基金、管理人网站	2019 年 3 月 29 日
6	华融证券股份有限公司关于开展华融新利灵活配置混合型证券投资基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、本基金、管理人网站	2019 年 4 月 10 日
7	华融新利灵活配置混合型证券投资	中国证券报、本基	2019 年 4 月 16 日

	资基金招募说明书（更新）	金管理人网站	
8	华融新利灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、本基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日
9	华融新利灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理公告	中国证券报、本基金管理人网站	2019 年 4 月 24 日
10	华融新利灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理公告	中国证券报、本基金管理人网站	2019 年 4 月 26 日
11	华融证券股份有限公司关于新增奕丰基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、本基金管理人网站	2019 年 4 月 30 日
12	华融证券股份有限公司关于调整旗下基金单笔最低定投金额的公告	证券时报、本基金管理人网站	2019 年 5 月 27 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会核准华融新利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

《华融新利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《华融新利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

本基金管理人业务资格批件和营业执照

本基金托管人业务资格批件和营业执照

报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.hrsec.com.cn）查阅。

华融证券股份有限公司

2019 年 8 月 29 日