华融新利灵活配置混合型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华融新利灵活配置混合
场内简称	–
基金主代码	001797
前端交易代码	–
后端交易代码	–
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	–
基金份额上市的证券交易所	–
上市日期	–

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

2.4信息披露方式

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

§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

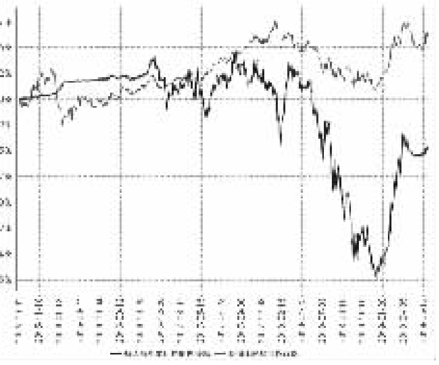
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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%	1.70%	0.35%	-0.39%	-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%	10.44%	0.33%	-20.89%	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



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。

§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遵规守信情况的说明

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,通过交易系统中的公平交易程序,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—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遵规守信、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		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		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		–	–
买入返售金融资产		500,000.00	3,000,000.00
应收证券清算款		14,898.70	3,563.01
应收利息		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		–	–
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		–	–
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		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		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		10,138,191.00	11,331,607.27
未分配利润		-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

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.925元,基金份额总额10138191份。

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		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		-75,577.42	-468,460.94
基金投资收益		–	–
债券投资收益		199.10	–
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		16,322.50	16,839.50
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		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)		9,498.40	25,176.66
减:二、费用		122,260.79	303,152.09
1.管理人报酬		27,400.90	58,446.58
2.托管费		6,850.24	14,611.63
3.销售服务费	6.4.8.2.3	–	–
4.交易费用		38,578.01	148,691.26
5.利息支出		–	–
其中:卖出回购金融资产支出		–	–
6.其他费用		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(本期净利润)	–	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(本期净利润)	–	-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。

6.4.5 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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

–

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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%

6.4.8.1.2 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%	–	–

6.4.8.1.3 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%

6.4.8.1.4 权证交易

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	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	–	–

6.4.8.2.2 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

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

注:本基金本报告期内未产生销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注:本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 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
基金合同生效日(2015年9月2日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

注:本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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
本期 2019年1月1日至2019年6月30日					
				数量(单位:份)	总金额
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

注:本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内未有其他关联交易事项的说明。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 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	–	2019年7月15日	新股流通受限	–	3.92	1,000	2,720.00	3,920.00	–

6.4.9.1.2 受限证券类别:债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.9.1.3 受限证券类别:权证

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

–

金额单位:人民币元

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

截至本报告期末,本基金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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	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

注: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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	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

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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

注:本基金本期末无债券投资持仓。

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

注:本基金本期末无债券投资持仓。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注: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

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

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

注: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

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

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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

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

注: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

§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%	–	–

§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

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

华融证券股份有限公司
2019年8月29日