华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月25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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24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2018年1月1日起至2018年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	华富永鑫灵活配置混合	
基金主代码	001466	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月15日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,965,923.32份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富永鑫灵活配置混合A	华富永鑫灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码:	001466	001467
报告期末下属分级基金的份额总额	648,274.47份	4,317,648.85份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略的基本思想是在充分控制风险的前提下实现高收益。依据风险-收益-投资策略关系原理,本基金采用自拟投资产配置策略,行业配置策略和个股精选策略六约束自拟投资策略进行实际投资,高层策略作用是规避风险,低层策略用于提高收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中等收益风险特征的基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金,弥补市场基金。

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		华富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘志弘	郭明
	联系电话	021-68898996	(010)66106798
	电子邮箱	manzh@hfund.com	csastody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95588
传真		021-68887997	(010)66106799

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	http://www.hfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	华富永鑫灵活配置混合A	华富永鑫灵活配置混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	98,625.04	479,876.16
本期利润	-2,168.61	-100,721.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0024	-0.0233
本期基金份额净值增长率	-2.08%	-2.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0624	0.0403
期末基金资产净值	688,744.31	4,491,599.51
期末基金份额净值	1.0624	1.0403

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,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3)期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日,即6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富永鑫灵活配置混合A

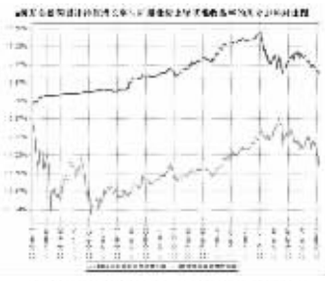
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.16%	0.19%	-3.68%	0.64%	2.49%	-0.45%
过去三个月	-3.59%	0.32%	-4.28%	0.57%	0.69%	-0.25%
过去六个月	-2.08%	0.40%	-5.15%	0.58%	3.07%	-0.18%
过去一年	-5.23%	0.34%	-0.34%	0.48%	-4.89%	-0.14%
过去三年	6.45%	0.22%	-4.89%	0.74%	11.34%	-0.52%
自基金合同生效起至今	6.24%	0.22%	-12.56%	0.79%	18.79%	-0.57%

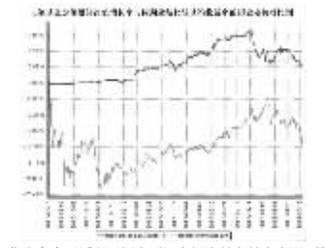
华富永鑫灵活配置混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.18%	0.20%	-3.68%	0.64%	2.47%	-0.44%
过去三个月	-3.68%	0.32%	-4.28%	0.57%	0.60%	-0.25%
过去六个月	-2.14%	0.40%	-5.15%	0.58%	3.01%	-0.18%
过去一年	-5.34%	0.34%	-0.34%	0.48%	-5.00%	-0.14%
过去三年	4.24%	0.22%	-4.89%	0.74%	9.13%	-0.52%
自基金合同生效起至今	4.03%	0.22%	-12.56%	0.79%	16.58%	-0.57%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:根据《华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票资产占基金资产的0%-95%;债券、货币市场工具、资产支持证券等固定收益类资产占基金资产的5%-100%;基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。其中,基金保留的现金或投资于到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为2015年6月15日到2015年12月15日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业,4月19日在上海正式注册成立。注册资本2.5亿元,公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股(集团)有限公司。截止2018年6月30日,本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富18个月定期开放债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富保福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金、华富富瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒悦定期开放债券型证券投资基金共三十七只基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张嵘	华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理,华富挂鑫灵活配置混合型基金基金经理,华富安享债券型基金基金经理,华富恒利债券型基金基金经理,华富保本混合型基金基金经理	2016年11月17日	2018年6月19日	十一年	合肥工业大学产业经济学硕士,研究生学历,2007年6月加入华富基金管理有限公司,先后担任研究发展部助理行业研究员,行业研究员,固收研究员,2012年6月21日至2014年3月19日任华富策略精选混合型基金基金经理助理,2014年3月20日至2014年11月18日任华富保本混合型基金基金经理助理,2016年6月20日至2017年7月5日任华富灵活配置混合型基金基金经理,2016年3月16日至2018年5月31日任华富恒财分级债券型证券投资基金基金经理,2016年11月17日至2018年6月19日任华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理。
张娓	华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理,公司公募投资决策委员会委员,公司总经理助理,创新业务部总监	2018年1月23日	-	十三年	美国肯特州立大学金融工程硕士,研究生学历,曾先后担任华泰证券资产管理有限公司衍生品投资主管基金经理,上海阳光投资管理有限公司副总经理兼芝麻量化中心总经理。2017年4月加入华富基金管理有限公司。
邵哲	华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理,华富中证100指数基金基金经理,华富中小板指数增强型基金基金经理	2018年2月23日	-	四年	北京大学理学博士,研究生学历,先后担任万正证券股份有限公司博士后研究员,上海同业投资管理有限公司高级研究员,2017年4月加入华富基金管理有限公司。

注:这里的任职日期、离任日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规,对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年上半年,国内宏观环境复杂多变,2月份风格切换至创业板反弹,自3月份起,中美贸易争端开始对市场产生脉冲式影响。从货币政策来看,年初的普惠金融提前实施等信号开始,至4月份和6月份两次定向降准,确立了宽货币的大环境。在今年上半年,一直延续紧信用的大环境,国家维持去杠杆政策的总体导向不变。从几个月的PMI数据来看,经济仍有韧性,我们的宏观经济周期模型切换至扩张期。从2018年1季报盈利增速来看,创业板相对主板形成了盈利上的相对优势。

但我们认为:1、自3月底贸易争端开始以来,不断对市场形成冲击,未来若贸易占升级整体对于科创股不利。2、外延并购对创业板影响仍在,权重行业的内生增速提升不明显。 3、去杠杆过程中最早受到损害的非金融地产行业的公司主要还是民企为主。因此我们对创业板的相对盈利优势的持续性尚且存疑,目前并不认为创业板具有相对盈利持续的潜力。

永鑫未来拟转型为华富人工智能指数基金,鉴于该指数发布期可能较迟,同时宏观环境变化较快,指数的结构牛市行情远未形成,此时并不适合运用权重个股进行投资操作。

综合以上环境,永鑫自2018年4月起,投资操作原则为基于宏观配置模型的配置并辅以可能的指数日线行情择时交易,追求绝对收益为主,同时从总体仓位上兼顾考虑相对业绩基准和同类混合主动基金的排名。

具体来看:我们结合宏观经济周期、宏观因子、技术面分析,对不同的组合场景均设立了相应的仓位操作范围,并根据实际情况持续优化。

从2季度的宏观环境和市场表现来看:

整体宏观周期虽然显示已经进入扩张期,但对于政府的经济政策导向的预期尚不稳定,从市场自身反映来看,市场目前认知的阶段仍然是基于去杠杆共识的收缩期,换言之市场认为实体去杠杆的趋势会延续(6/29日央行会议后债市反应仍然良好稳健、股市在应该技术反弹的区域表现趋弱受CDR影响较大都从市场自身反应印证了这个观察):该阶段总体来说利于债市、不利于股市。这也启示我们,感知并判断市场真实认知的宏观配置周期阶段十分重要。

中小创目前处于相对50的业绩优势确认的早期阶段,我们认为任何中长期良好的预期即使实现都有一个曲折的过程,市场是短视的。即使中长期乐观,也需要对当前状态进一步客观确认。

中美贸易战往复波动,从4月份到现在,政府已表露出两次宽信用的托底意向。对前期去杠杆政策或有一定程度的调整。其中,第一次4月底政治局会议政府的托底意向,股市反弹,债市调整,表现了市场对于托底意向的共识。但是之后随着各项实体去杠杆信号的持续显现,市场显然回到了原来去杠杆的共识,第二次6月底央行会议信息出来后,债券市场继续表现强劲显示市场并不认为扩内需会立刻上线。

自7月起,央行、人民日报、国常会纷纷释放明确的宽财政宽信用的信号,国常会强调积极的财政政策要更加积极,稳健的货币政策松紧适度。明确了宽信用宽货币的大环境。结合前期股市跌幅较大,相对利好股市反弹。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2015年6月15日正式成立。截止到2018年6月30日,华富永鑫A类基金份额净值为1.0624元,累计份额净值为1.0624元,本报告期的份额累计净值增长率为-2.08%,同期业绩比较基准收益率为-5.15%;华富永鑫C基金份额净值为1.0403元,累计份额净值为1.0403元,本报告期的份额累计净值增长率为-2.14%,同期业绩比较基准收益率为-5.15%。

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2018年下半年,我们对于股票和债券的操作思路如下:

股票:当前市场认知的宏观配置周期类似于收缩期末期,货币政策宽松,信用刺激信号开始出现,需关注宽财政的具体落地方式,以确定股市的阶段性反弹可以走多远。同时,中美贸易战的正式开打后具有不断互动升级的可能性,重点关注8月的投资限制和2000亿关税是否真实落地的时间节点。在次之前,仓位保持在谨慎参与反弹的20-25%的仓位附近;观察市场对贸易冲突以及三季度几个月的金融和经济数据是否能充分反映宽财政效果。如市场出现正面反应(对贸易冲突反应较小,数据显示宽财政取得成效),预计更长时间的反弹行情将出现,届时首先加仓至业绩基准50%的仓位水平,再观察市场的风险偏好提升程度。

债券:紧密观察跟踪贸易冲突和去杠杆政策的转向,最理想的状态是保持对两个基本方向的紧密感知:如果贸易冲突升级,则债券持仓到扩内需成为共识后减仓;反之亦然。减仓后的资金将以进行回购操作为主。当前的情况是,宽信用以及下半年地方债加速发行对利率债带来阶段性冲击,因此仓位减至20%以下的较低水平,宽货币也决定了利率债的风险暂时也不会太大。三季度主要在低仓位观望宽信用的实际落地情况,如重回基建地产刺激,维持当前低仓位不变,反之则择机进行加仓操作。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程,按照相关法律法规的规定,成立了估值委员会,并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理,成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本期利润为-102,890.57元,期末可供分配利润为214,420.50元。本报告期内未进行利润分配。

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

1. 从2016年3月16日起至本报告期末(2018年6月30日),本基金持有人数存在连续六十个工作日不满二百人的情形,至本报告期期末(2018年6月30日)本基金持有人数仍不满二百人。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》,积极采取相关措施,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

2. 从2017年7月31日起至本报告期末(2018年6月30日),本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于5000万元的情形,至本报告期期末(2018年6月30日)基金资产净值仍低于5000万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》,积极采取相关措施,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华富基金管理有限公司在华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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

本托管人依法对华富基金管理有限公司编制和披露的华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		2,048,784.35	4,740,698.78
结算备付金		167,836.04	-
存出保证金		1,835.36	35,435.72
交易性金融资产		1,421,203.40	2,418,871.59
其中:股票投资		206,317.30	2,418,871.59
基金投资		-	-
债券投资		1,214,886.10	-
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		1,500,000.00	-
应收证券清算款		73,612.29	-
应收利息		14,704.28	1,064.25
应收股利		-	-
应收申购款		199.70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		5,228,175.42	7,196,070.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		-	-
应付管理人报酬		2,623.34	3,536.28
应付托管费		655.81	884.05
应付销售服务费		372.77	380.09
应付交易费用		4,509.91	1,441.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		39,669.77	310,000.00
负债合计		47,831.60	316,242.28
所有者权益:			
实收基金		4,965,923.32	6,427,296.60
未分配利润		214,420.50	452,522.46
所有者权益合计		5,180,343.82	6,879,818.06
负债和所有者权益总计		5,228,175.42	7,196,070.34

注:报告截止日2018年6月30日,华富永鑫灵活配置混合A基金份额净值1.0624元,基金份额总额648274.47份;华富永鑫灵活配置混合C基金份额净值1.0403元,基金份额总额4317648.85份。华富永鑫灵活配置混合份额总额合计为4965923.32份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-2,897.75	29,686,885.73
1.利息收入		41,603.20	8,741,415.61
其中:存款利息收入		12,051.41	59,980.02
债券利息收入		11,048.45	8,585,090.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,503.34	96,344.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		635,856.53	11,809,660.89
其中:股票投资收益		639,428.21	22,103,494.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-6,333.91	-11,199,852.60
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		2,762.23	906,018.51
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-681,391.77	9,133,843.72
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		1,034.29	1,965.51
减:二、费用		99,992.52	2,666,082.39
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	16,627.41	1,401,782.46
2. 托管费	6.4.8.2.2	4,156.80	350,445.60
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	2,280.40	232,320.89
4. 交易费用		12,083.22	464,703.32
5. 利息支出		-	52,042.20
其中:卖出回购金融资产支出		-	52,042.20
6. 其他费用		64,844.69	174,787.92
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-102,890.57	27,020,803.34
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-102,890.57	27,020,803.34

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	6,427,296.60	452,522.46	6,879,818.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-102,890.57	-102,890.57
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)	-1,461,372.28	-135,211.39	-1,596,583.67
其中:1.基金申购款	292,036.96	23,263.97	315,300.93
2.基金赎回款	-1,753,409.14	-158,565.36	-1,911,974.50
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)	4,965,923.32	214,420.50	5,180,343.82
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	477,022,387.28	17,291,354.39	494,313,741.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	27,020,803.34	27,020,803.34
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)	-285,690,051.18	-23,434,446.41	-289,124,497.59
其中:1.基金申购款	132,315,871.91	8,946,501.06	141,262,372.97
2.基金赎回款	-398,005,923.09	-32,380,947.47	-430,386,870.56
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)	211,332,336.10	20,877,711.32	232,210,047.42

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____章宏韬_____ _____余海春_____ _____陈大毅_____

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

华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称:本基金或基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称:中国证监会)(证监许可[2015]1101号)核准,基金合同于2015年06月15日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并出具《验资报告》(天健验(2015)6-86号)。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华富永鑫灵活混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券、中期票据、短期融资券、债券回购、中小企业私募债等)、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作,真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(二) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(三) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(四) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司(“华安证券”)	基金管理人的股东、代销机构

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
华安证券股份有限公司	1,556,180.36	21.31%	57,608,982.66	22.03%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
华安证券股份有限公司	-	-	3,043,935.00	5.51%

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
华安证券股份有限公司	-	-	16,300,000.00	3.43%

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间内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 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
华安证券股份有限公司	1,448.27	21.62%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
华安证券股份有限公司	52,961.43	22.06%	9,297.28	4.96%

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,627.41	1,401,782.46
其中:支付销售机构的客户维护费	-	115,167.61

注:基金管理费按前一日基金资产净值0.6%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×年管理费率÷当年天数(H为每日应计提的基金管理费,E为前一日基金资产净值)。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,156.80	350,445.60

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

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	华富永鑫灵活配置混合A	华富永鑫灵活配置混合C	合计
华富基金管理有限公司(管理人)	-	2,114.76	2,114.76
华安证券(管理人股东)	-	-	-
合计	-	2,114.76	2,114.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富永鑫