华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富弘鑫灵活配置混合	
基金主代码	003182	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月28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	69,265,436.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富弘鑫灵活配置混合A	华富弘鑫灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码:	003182	003183
报告期末下属分级基金的份额总额	4,793,654.69份	64,471,781.50份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金通过合理灵活的资产配置策略、同时结合行业配置策略、个股精选策略、债券投资策略等投资策略,积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇,在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中等收益风险特征的基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。	
	华富弘鑫灵活配置混合A	华富弘鑫灵活配置混合C

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	满志弘	郭明
	联系电话	021-68886996	(010)66105798
	电子邮箱	manzh@hffund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95588
传真		021-68887997	(010)66105799

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年				2017年				2016年11月28日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	华富弘鑫灵活配置混合A	华富弘鑫灵活配置混合C	华富弘鑫灵活配置混合A	华富弘鑫灵活配置混合C	华富弘鑫灵活配置混合A	华富弘鑫灵活配置混合C				
本期已实现收益	86,544.06	6,907,399.35	2,015,383.05	22,322,231.24	-	-				
本期利润	119,635.95	8,173,616.37	1,704,287.35	21,245,004.82	-	-				
加权平均基金份额本期利润	0.0179	0.0251	0.0324	0.0314	-	-				
本期基金份额净值增长率	2.55%	2.34%	2.74%	2.39%	-	-				
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末					
期末可供分配基金份额利润	0.0569	0.0509	0.0306	0.0269	-	-				
期末基金资产净值	5,066,252.07	67,755,725.57	12,605,600.63	413,560,880.27	-	-				
期末基金份额净值	1.0569	1.0509	1.0306	1.0269	-	-				

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12月31日。

3.2 基金净值表现

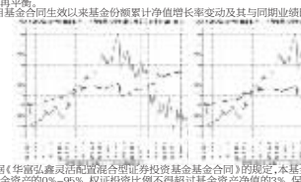
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富弘鑫灵活配置混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.53%	0.02%	-5.41%	0.82%	5.94%	-0.80%
过去六个月	2.57%	0.06%	-5.83%	0.75%	8.40%	-0.69%
过去一年	2.55%	0.09%	-10.68%	0.67%	13.23%	-0.58%
自基金合同生效起至今	5.69%	0.07%	-4.24%	0.52%	9.93%	-0.45%

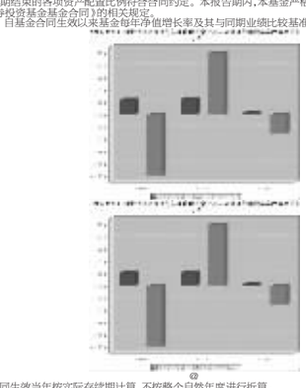
注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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《华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资资产配置比例为:股票资产占基金资产的0%-95%,权证投资比例不得超过基金资产净值的3%,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为2016年11月28日到2017年5月28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《华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

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



注: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

注:本基金过往三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业,4月19日在上海正式注册成立,注册资本2.5亿元,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12月31日,本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势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、华富合适配置混合型证券投资基金、华富恒康18个月定期开放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、华富安富保本混合型证券投资基金、华富鑫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、华富恒欣3个月定期开放债券型证券投资基金、华富鑫瑞3个月定期开放债券型证券投资基金、华富可转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、华富恒享定期开放债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金共三十六只基金。

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		
倪莉莎	华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富恒欣3个月定期开放债券型基金基金经理、华富天盈货币市场基金基金经理、华富恒财定期开放债券型基金基金经理、华富鑫瑞3个月定期开放债券型发起式基金基金经理、华富恒悦定期开放债券型基金基金经理、华富恒盛纯债债券型基金基金经理	2018年8月28日	-	四年	英国曼彻斯特大学管理学硕士,研究生学历。2014年2月加入华富基金管理有限公司,先后担任集中交易室助理交易员、交易员,固定收益部华富货币市场基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富鑫瑞3个月定期开放债券型发起式基金基金经理、华富恒悦定期开放债券型基金基金经理。
胡伟	-	2016年11月28日	2018年9月7日	十四年	中南财经政法大学经济学学士,本科学历,曾任珠海市商业银行资金营运部交易员,从事债券研究及债券交易工作,2006年11月加入华富基金管理有限公司,曾任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监,2009年10月19日至2014年11月17日任华富货币市场基金基金经理,2013年12月18日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金(原为华富恒鑫)基金经理,2016年6月28日至2017年7月4日任华富灵活配置混合型基金基金经理,2015年3月16日至2018年5月31日任华富旺财保本混合型基金基金经理,2013年4月24日至2018年9月14日任华富保本混合型基金基金经理,2014年5月7日至2018年9月26日任华富恒财定期开放债券型基金基金经理,2017年11月22日至2018年9月26日任华富恒富18个月定期开放债券型基金基金经理,2014年12月17日至2018年9月7日任华富恒稳纯债债券型基金基金经理,2011年10月10日至2018年9月14日任华富收益增强债券型基金基金经理,2015年8月31日至2018年9月14日任华富恒利债券型基金基金经理,2016年3月23日至2018年9月14日任华富安福保本混合型基金基金经理,2016年11月28日至2018年9月7日任华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理,2017年1月25日至2018年9月7日任华富天益货币市场基金基金经理,2017年3月3日至2018年9月7日任华富天盈货币市场基金基金经理,2017年12月13日至2018年9月26日任华富星玉衡一年定期开放混合型基金基金经理,2018年5月21日至2018年9月26日任华富可转债券型基金基金经理。

注:胡伟的任职日期指该基金成立之日,既有涉的任职日期及胡伟的离任日期指公司决定之日。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、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下:

在研究分析和投资决策环节,公司通过建立规范、完善的研究管理平台,为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合,在保证其决策相对独立的同时,在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略,制定客观、完整的交易决策规则,并按照这些规则进行投资决策,保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节,公司设立独立的集中交易部门,通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则:"价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施",保证交易在各投资组合间的公正实施,保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度,确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节,公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容,加强对投资交易行为的监察稽核力度,公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后,集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记,逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果,由具体执行的交易员签字确认留档,并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差进行分析。本报告期内,根据纳入样本内的数据分析结果,未发现明显异常情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年国内经济,首先固定资产投资增速较上年明显回落,主要是基础设施投资增速大幅放缓。房地产行业的投资与销售情况出现分化。销售面积逐步回落,房地产投资仍保持稳定。工业生产得益于供给侧改革,产业结构继续优化,多数行业保持增长态势,汽车、电子、化工行业增速有所减缓,消费仍是我国经济增长的主要动力,但增速较上年回落。一方面是当前经济下行压力加大;另一方面目前居民杠杆水平升高,房贷压力上升致支付能力与意愿下降,受贸易摩擦等外部因素影响,今年我国出口增速回落,贸易顺差收窄,新一轮碳商正在加紧进行,下半年抢出口效应叠加人民币回落贬值支撑,出口增速阶段性超预期增长。全球经济增长由同步复苏逐渐走向美国一枝独秀,欧元区、中国等新兴经济体增速放缓的分化局面。国内在当前国际环境错中复杂的背景下,中国央行年内累计四次降准,货币政策边际宽松。在2018年世界经济增速放缓的大环境下,中国经济运行保持在合理区间。

大类资产上,债券市场走出一波震荡下行的行子。十年国债全年下行超过60bp。无风险利率波动下行,利率期限结构形态陡峭化。2018上半年货币市场利率波动较大,下半年资金面充裕,短端无风险利率快速下行并向长端传导,叠加经济预期趋于悲观,长端利率波动下行。但在经济下行压力及去杠杆双重影响下,中高等级与低等级债券走出分化行情,信用利差易扩大难收窄。中证转债指数微跌,权益市场主要指数一路下跌,根据申万一级行业指数,全市场平均跌幅为30%左右。

华富弘鑫灵活配置基金,在市场风险偏好急剧下行的环境中,加大债券等避险资产的配置比例,降低风险资产的配置,利用流动性转为宽松的契机,适当利用杠杆策略,增强组合票息收益。通过自下而上地通过个券深耕与调研,选择资质良好,盈利优势明显的信用债券等品种进行配置。同时利用对资金面的预判,合理使用不同期限的融资品种,降低融资成本,增强组合收益。根据本基金策略,通过对宏观与债券市场趋势的判断,自上而下地通过择时配置,灵活选择杠杆,为持有人获取稳定适当收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2016年11月28日正式成立。截止到2018年12月31日,华富弘鑫A类基金份额净值为1.0569元,累计份额净值为1.0569元,本报告期的份额累计净值增长率为2.55%,同期业绩比较基准收益率为-10.68%;华富弘鑫C基金份额净值为1.0509元,累计份额净值为1.0509元,本报告期的份额累计净值增长率为2.34%,同期业绩比较基准收益率为-10.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年一季度,经济受内外部多因素影响,下行压力仍较大。但同时悲观的预期和过低的风险偏好有可能得到一定的修复机会。政策的逆周期调控的动力逐渐加强,更多的政策工具可能使用以加大对实体经济的托底作用。财政政策也将向更积极的方向转变,包括减税降费、提前地方债的发行等刺激政策也在推进。因此明年一季度,受流动性和基本面双重支持,债券市场在一级预期较强的市场情况下,社会融资是否有所好转,宏观政策是否超预期,是债券市场甚至整个资本市场波动加大的基础。风险偏好的回升,可能带来风险资产的一定机会。但考虑经济的趋势惯性,预计明年一季度我国经济增速将是温和下行的总体态势,对债市中长期利好,但由于短期债券行情发展较快,预期过于一致,后续政策力度或形式可能超预期,短期波动幅度也将增大,震荡波动行情的时间可能增加。

预计金融监管政策坚持大方向不变,但也会控制好节奏,执行尺度边际放宽,在化解旧风险的同时警惕新风险的聚集,金融监管环境整体较为温和。央行货币政策仍将继续适度呵护流动性,同时引导资金流向实体经济。但大水漫灌或将不再出现,短端特别是货币市场利率是否再有下行空间或将存疑。受经济基本面走弱以及资金面充裕的双重支持,债券市场对后市下行的一致预期颇高。但同时值得注意的是,一致性预期越高,边际变化对于预期的影响就越大。因此我们认为上半年,债券市场震荡波动的幅度将扩大,趋势性机会较难以很快形成。同时受信用环境收紧影响,中小微企业、民企等债券市场融资愈发困难,推出了较多纾困金融创新工具,信用事件会否陆着即将修复的风险偏好减少,低评级信用利差能否收敛,都值得观察。

2019年,我们预计对外依存度较低,效率高资质好的企业在融资方面可能受惠,盈利较好、行业优势突出,之前由于风险偏好的急速下跌而被错杀的信用债券更可能获得趋势上的机会。但行业景气度低、优势不明显和盲目扩张的企业,在去杠杆的后续影响下信用风险可能点状发生,仍需管理人谨慎挖掘与调研。华富弘鑫灵活配置基金将继续利于其在大类资产配置上灵活性强的特点,精选资质良好、行业优势明显的主体,结合市场行情与资金面预判,主动选择风险偏好,适当利用杠杆策略,通过精细化操作,同时灵活选择久期,在震荡市中减少波动对组合的影响,为持有人合理增加收益。

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。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所(特殊普通合伙)进行审核并出具报告,由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司总经理,成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券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,可向估值委员会提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《证券投资基金运作管理办法》和《华富弘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8,293,252.32元,期末可供分配利润为3,556,541.45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. 本报告期内,从2017年12月4日起至2018年9月30日,本基金份额持有人数量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12月31日)本基金已不存在基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2. 本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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弘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,华富弘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弘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、利润分配等方面,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。

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

本托管人依法对华富基金管理有限公司编制和披露的华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金2018年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审(2019)6-91号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称华富弘鑫灵活配置混合基金)财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表、持有人权益(基金净值)变动表,以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华富弘鑫灵活配置混合基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和持有人权益(基金净值)变动。
形成审计意见的基础	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。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华富弘鑫灵活配置混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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。
其他信息	华富弘鑫灵活配置混合基金管理人(以下简称管理人)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。 在编制财务报表时,管理层负责评估华富弘鑫灵活配置混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华富弘鑫灵活配置混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,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。 (三)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对华富弘鑫灵活配置混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华富弘鑫灵活配置混合基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	曹小勤 林晶
会计师事务所的地址	浙江省杭州市钱江路1366号华润大厦B座31层
审计报告日期	2019年3月22日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		353,524.85	973,069.92
结算备付金		45,454.55	463,719.06
存出保证金		30,263.42	82,329.24
交易性金融资产		62,121,350.00	410,191,400.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		62,121,350.00	400,230,400.00
资产支持证券投资		-	9,961,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		10,080,135.12	8,000,000.00
应收证券清算款		-	14,027.40
应收利息		635,312.85	7,555,559.25
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		73,266,040.79	427,280,104.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31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		-	325,566.48
应付管理人报酬		37,113.58	218,081.40
应付托管费		9,278.40	54,520.36
应付销售服务费		11,493.64	70,293.84
应付交易费用		6,177.53	5,039.75
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		380,000.00	440,122.14
负债合计		444,063.15	1,113,623.97
所有者权益:			
实收基金		69,265,436.19	414,945,862.30
未分配利润		3,556,541.45	11,220,618.60
所有者权益合计		72,821,977.64	426,166,480.90
负债和所有者权益总计		73,266,040.79	427,280,104.87

注:报告截止日2018年12月31日,华富弘鑫灵活配置混合A基金份额净值1.0569元,基金份额总额4,793,654.69份;华富弘鑫灵活配置混合C基金份额净值1.0509元,基金份额总额64,471,781.50份。华富弘鑫灵活配置混合份额总额合计为69,265,436.19份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.2 利润表

会计主体:华富弘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12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		14,368,995.69	37,577,019.23
1.利息收入		14,406,188.38	29,632,922.85
其中:存款利息收入		126,756.71	752,985.43
债券利息收入		13,677,403.48	26,941,100.53
资产支持证券利息收入		170,714.43	1,370,940.43
买入返售金融资产收入		431,313.76	567,896.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,337,446.55	9,262,164.57
其中:股票投资收益		-8,150,805.02	7,056,665.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益		6,813,358.47	1,759,485.83
资产支持证券投资收益		-	-125,448.19
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	571,460.99
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		1,299,308.91	-1,388,322.12
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		944.95	70,253.93
减:二、费用		6,075,743.37	14,627,727.06
1. 管理人报酬		2,057,554.32	4,528,708.95
2. 托管费		514,388.54	1,132,177.22
3. 销售服务费		671,978.20	1,400,989.91
4. 交易费用		126,640.48	921,761.00
5. 利息支出		2,245,859.73	6,192,337.94
其中:卖出回购金融资产支出		2,245,859.73	6,192,337.94
6. 税金及附加		32,585.91	-
7. 其他费用		426,736.19	451,752.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		8,293,252.32	22,949,292.17
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		8,293,252.32	22,949,292.17

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富弘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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	414,945,862.30	11,220,618.60	426,166,480.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,293,252.32	8,293,252.32
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)	-345,680,426.11	-15,957,329.47	-361,637,755.58
其中:1.基金申购款	66,059.47	2,951.38	69,010.85
2.基金赎回款	-345,746,485.58	-15,960,280.85	-361,706,766.43
四、期末所有者权益(基金净值)	69,265,436.19	3,556,541.45	72,821,977.64

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	176,667,606.26	527,609.95	177,195,216.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,949,292.17	22,949,292.17
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)	238,278,256.04	-12,256,283.52	226,021,972.52
其中:1.基金申购款	1,122,704,956.07	5,474,166.22	1,128,179,122.29
2.基金赎回款	-884,426,700.03	-17,730,449.74	-902,157,149.77
四、期末所有者权益(基金净值)	414,945,862.30	11,220,618.60	426,166,480.90

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____章宏韬_____ _____余海春_____ _____潘伟_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称本基金或基金)经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)《证监许可[2016]1112号》核准,基金合同于2016年11月28日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并出具《验资报告》(天健验〔2016〕6-148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《华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(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、债券回购等)、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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