华融新利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3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。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3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。

本报告中的财务资料经审计、德勤会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华融新利
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	11,331,607.27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	徐乾山	贺倩
	联系电话	010-85556728	010-66060069
	电子邮箱	xuqianshan@hrsec.com.cn	tgcxpl@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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund.hrsec.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、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

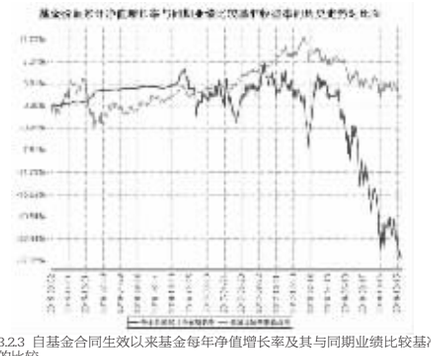
3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-1,431,141.82	-967,654.58	9,079,254.57
本期利润	-3,283,073.71	-1,159,901.34	5,563,926.01
加权平均基金份额本期利润	-0.2133	-0.0255	0.0567
本期基金份额净值增长率	-28.05%	-1.26%	1.98%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2692	0.0161	0.0292
期末基金资产净值	8,280,648.96	34,447,250.33	81,180,658.77
期末基金份额净值	0.731	1.016	1.029

3.2 基金净值表现

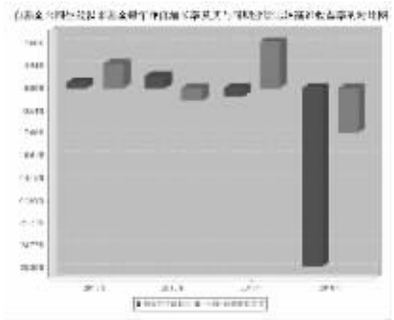
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-14.20%	1.36%	-3.49%	0.49%	-10.71%	0.87%
过去六个月	-22.81%	1.29%	-3.71%	0.45%	-19.10%	0.84%
过去一年	-28.05%	1.11%	-6.97%	0.40%	-21.08%	0.71%
过去三年	-27.55%	0.75%	-2.14%	0.35%	-25.41%	0.40%
自基金合同生效起至今	-26.90%	0.71%	1.63%	0.38%	-28.53%	0.33%

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



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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立至今未进行利润分配活动。

§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(以下简称"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(以下简称"中国华融")作为主发起人,联合中国葛洲坝集团有限公司共同发起设立的全国性证券公司。2007年9月,公司在北京正式挂牌成立。目前,公司注册资本58.41亿元。

公司总部设在北京,下设深圳、上海业务总部,北京、上海、深圳、湖南、新疆、湖北、陕西、贵州、四川、江西、海南、浙江、山东、福建、辽宁、广东共16家分公司,66家营业部,控股华融期货有限责任公司与华融瑞泽投资管理有限公司。公司紧紧依托中国华融在资产管理、银行、信托和金融租赁等方面的综合优势,可为客户提供证券经纪、融资融券、证券承销与保荐、与证券交易及证券投资活动有关的财务顾问、证券投资咨询、证券自营、证券资产管理、投资顾问等综合化的财富管理服务。公司先后荣获2014年度最佳资产管理券商、2015年度中国新三板最具投资眼光券商、2015-2016年度中国最佳资管创新产品、2016年度中国最佳财富管理品牌、2016年度金牛券商集合资产管理人、2017年度中国区突破债券投行君鼎奖、2017年度中国最佳券商资管、2018中国区十大创新项目君鼎奖、2018中国理财服务先锋等荣誉。

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		
靳冰馨	本基金的基金经理	2017年5月5日	-	22	2011-2015年,任职中国民族证券有限责任公司,从事证券投资研究及交易工作;2016年任职方正证券股份有限公司,从事证券投资研究工作;2017年1月进入华融证券股份有限公司从事证券投资研究工作。2017年5月至今,任华融新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
胡爽	本基金的基金经理助理	2016年8月1日	-	3	胡爽,美国波士顿大学金融数学硕士学历。2011年7月于野村证券(香港)总部担任研究员,2013年9月就职于新华社下属中国证券报研究中心,2015年7月就职于华融证券基金业务部任研究员,担任基金业务部研究员。2016年8月担任华融新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,公司制定了《异常交易管理办法》,对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度,未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

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

2018年证券市场波动率大,受国内降低宏观杠杆率、经济与企业盈利下行及中美贸易摩擦影响,A股投资收益率在全球股票市场中居末位;2018年下半年管理层不断推出投资、消费、流动性等方面的维稳政策,沪深市场在2440-2800点之间震荡运行,但重心下移。

报告期内,积极参与新股申购,现金流动性管理,积累安全收益;上半年以优质绩优蓝筹股为核心,以优选成长股及主题投资个股为卫星,辐射市场热点,增加产品弹性。结合实体经济利润改善和市场主题投资多维度审慎选取高价值低估值股票。下半年加大产品的持仓比例,选取景气行业,龙头配置,降低换手率。配置行业主要有医药、TMT、金融、消费等。

2018年下半年产品仓位提高,叠加市场下跌,净值损失大;预计19年市场在各项政策托底稳定的基础上,维持底部运行,结构性、主题性投资机会加大,等待经济数据的企稳、市场转机出现。

本基金继续秉承持有人利益优先原则,依据经济环境和市场表现,优选行业个股,争取在风险可控的基础上获取超额收益。

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0.731元;本报告期基金份额净值增长率为-28.05%,业绩比较基准收益率为-6.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

IMF最新将19年的全球经济增速由3.9%下调至3.7%,油价下跌之后,石油出口国经济对冲落空,19年的全球经济增速大概率还会继续超预期下滑。美联储19年加息次数调整为1-2次,也表现出对经济下滑的担忧。国内四季度已公布的各项数据显示经济下滑进程中,12月PMI跌破临界值,但财政、资金等逆周期调节政策的实施,有望降低下滑的速度。预计18年GDP6.5%,19年大概率在6.3-6.5%左右。

证券市场受全球经济增速下行影响,短期难有趋势性行情,在美联储调整缩表进程及国内流动性宽松预期下,辅以逆周期调节、稳定内需,预计经济下滑不会失速。当前时点是19年开局,需要政策与流动性的支持,期待有更大力度的改革措施;1月份年报业绩风险释放后,经济数据真空期,叠加春节后两会的维稳,预计市场将会有结构性行情,关注主题机会。二、三季度关注经济数据的变化,期待有经济企稳的信号出现。

2019年中国经济将是从高速度发展向高质量发展的关键时期,重点关注受产业政策倾斜的基础设施建设、信息产业、必需消费等行业。预计2019年市场结构性、主题性机会多,关注政策的实施,把握市场的热点,在增加收益的同时控制风险,等待市场更明确的趋势性机会到来。关注的行业TMT、券商、医药、电子等,主题投资有5G、高端制造、新能源汽车链等 。

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,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

内部监察稽核的重点是:国家法律法规及行业监管规则的执行情况;基金合同的遵守情况;内部规章制度的执行情况;网络与信息系统安全情况;资讯监管与员工职业操守规范情况等。

(1)进一步完善制度建设,构建适时、全面、严谨的内部控制体系。本基金管理人根据最新的法律法规等规范性文件,及时拟定了相关管理制度,并对原有制度体系进行了持续的更新和完善,对现有的制度体系进行了进一步梳理,同时,根据公司实际业务情况不断细化制度流程,进一步强化内部控制。

(2)全面加强风险监控,不断提高风险管理水平。本基金管理人在原有基础上进一步提升内控管理水平,确保内部控制的独立性和权威性,事前、事中、事后风险控制有效结合,通过多种形式提高内控管理质量、优化风险管理水平。

(3)有计划地开展监察稽核工作,确保工作的及时性、深入性和有效性。(4)强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规,并及时更新相关管理制度,并将上述规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中,同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式,提高全体员工的合规守法意识。

4.7 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。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本基金本报告期编制的财务报表经德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)审计并出具标准无保留意见报告。

4.10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,本基金存在资产净值低于五千万元的情况。公司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一华融证券股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018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, 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

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	德师报(审)字(19)第P00991

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	华融新利灵活配置混合型证券投资基金全体持有人。
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的规定编制,公允反映了华融新利灵活配置混合型证券投资基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。
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,我们独立于华融新利灵活配置混合型证券投资基金,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。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	华融证券股份有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括华融新利灵活配置混合型证券投资基金2018年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。
管理层和治理层对财务报表的责任	编制和公允列报财务报表是贵基金管理人华融证券股份有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,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。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	郭新华 / 娄金玲
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号30楼
审计报告日期	2019年3月29日

§7 年度财务报表

7.1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: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		464,534.32	1,770,211.61
结算备付金		284,804.09	1,840,814.15
存出保证金		2,935.12	56,835.70
交易性金融资产		4,672,154.60	11,198,600.00
其中:股票投资		4,672,154.60	11,198,600.00
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		3,000,000.00	19,800,000.00
应收证券清算款		3,563.01	400,485.09
应收利息		-490.25	-8,099.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	3,495.81
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		8,427,500.89	35,062,342.73
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		-	288,739.48
应付赎回款		665.04	129,204.63
应付管理人报酬		4,381.82	16,631.63
应付托管费		1,095.45	4,157.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		709.62	76,197.51
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		140,000.00	100,161.21
负债合计		146,851.93	615,092.40
所有者权益:			
实收基金		11,331,607.27	33,900,442.17
未分配利润		-3,050,958.31	546,808.16
所有者权益合计		8,280,648.96	34,447,250.33
负债和所有者权益总计		8,427,500.89	35,062,342.73

7.2 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: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		-2,855,144.59	67,003.19
1.利息收入		254,084.55	867,420.81
其中:存款利息收入		20,230.96	74,097.50
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		233,853.59	793,323.31
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,282,592.80	-1,015,348.85
其中:股票投资收益		-1,327,220.36	-1,049,554.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		44,627.56	34,206.10
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-1,851,931.89	-192,246.76
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		25,295.55	407,177.99
减:二、费用		427,929.12	1,226,904.53
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	87,686.42	282,038.09
2.托管费	7.4.8.2.2	21,921.56	70,509.57
3.销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		156,242.88	843,425.48
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		162,078.26	30,931.39
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-3,283,073.71	-1,159,901.34
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-3,283,073.71	-1,159,901.34

7.3 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: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)	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)	-	-3,283,073.71	-3,283,073.71
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)	-22,568,834.90	-314,692.76	-22,883,527.66
其中:1.基金申购款	169,947.01	-12,664.27	157,282.74
2.基金赎回款	-22,738,781.91	-302,028.49	-23,040,810.40
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)	11,331,607.27	-3,050,958.31	8,280,648.96
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)	78,880,896.64	2,299,762.13	81,180,658.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,159,901.34	-1,159,901.34
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)	-44,980,454.47	-593,052.63	-45,573,507.10
其中:1.基金申购款	72,821,979.80	2,550,494.68	75,372,474.48
2.基金赎回款	-117,802,434.27	-3,143,547.31	-120,945,981.58
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)	33,900,442.17	546,808.16	34,447,250.33

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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

7.4.2 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。

7.4.3 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2018年12月31日的财务状况以及2018年1月1日至2018年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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》、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》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。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、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税:a) 同业存款;b) 买入返售金融资产(质押式、买断式);c) 国债、地方政府债;d) 金融债券。

(2) 对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) 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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(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。

7.4.7 关联方关系

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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内无与上年度可比期间的关联方交易。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
华融证券	116,273,914.13	100.00%	631,777,884.55	100.00%

7.4.8.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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

7.4.8.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	1,491,300,000.00	100.00%	4,900,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内无权证交易。

7.4.8.1.5 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
华融证券	86,103.30	100.00%	709.62	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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(%)
华融证券	467,433.84	100.00%	76,197.51	100.00%

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	87,686.42	282,038.09
其中:支付销售机构的客户维护费	22,588.75	17,609.53

注:支付基金管理人华融证券股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.6% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,921.56	70,509.57

注:支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未产生销售服务费。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.8.4.2 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

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。

7.4.8.5 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 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	
	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	464,534.32	6,421.58	1,770,211.61	31,250.35

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于