华安新机遇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:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:二〇一九年三月三十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月26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。

原华安新机遇保本混合型证券投资基金本报告期自2018年1月1日起至2018年6月4日止,华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2018年6月5日(基金合同生效日)起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	华安新机遇灵活配置混合
基金主代码	001282
交易代码	001282
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月5日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	151,211,827.73份
基金合同存续期	不定期

2.1.2 华安新机遇保本混合型证券投资基金

基金简称	华安新机遇保本混合
基金主代码	001282
交易代码	001282
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月27日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	347,789,348.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

2.2.1 华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

投资目标	通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的绝对收益机会,在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下,力求持续高效地获取稳健回报。
投资策略	本基金为混合型基金,在投资中将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具,确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例;当市场环境发生变化时,本基金将依托合位弹性优势并借助投指期货等金融工具快速灵活地作出反应,对大类资产配置比例进行及时调整。 此外,本基金还将广泛运用各种定量和定性分析模型研究和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征,积极寻找各种可能的获利和价值增长的机会,以确定基金资产在各类具体券种间的配置比例。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。

2.2.2 华安新机遇保本混合型证券投资基金

投资目标	通过运用投资组合保险技术,有效控制本金损失的风险,在本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用基于VaR的风险乘数全程可变的CPPI策略(恒定比例组合保险策略),基金管理人主要通过数量分析,根据市场的波动来调整和维持正安全垫放大倍数(固风险乘数),动态调整保本资产与风险资产的投资比例,以确保基金在一段时间以其价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现投资组合的保本增值目标。同时,本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定具体的投资券种选择,积极寻找各种可能的获利和价值增长机会。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆霞	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	huying@huaanfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400888xxxx99	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层,32层

§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

3.1.1 华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

金额单位:人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期 2018年6月5日至2018年12月31日
本期已实现收益	-3,047,915.03
本期利润	-1,726,134.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0093
本期加权平均净值利润率	-0.88%
本期基金份额净值增长率	-1.06%
3.1.1.2 期末数据和指标	2018年末
期末可供分配利润	3,443,353.87
期末可供分配基金份额利润	0.0228
期末基金资产净值	157,251,022.47
期末基金份额净值	1.0399

注:1、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:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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、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(为期末余额,不是当期发生数)。

3.1.2 华安新机遇保本混合型证券投资基金

金额单位:人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	报告期 2018年1月1日至2018年6月4日	2017年	2016年
本期已实现收益	12,003,271.55	25,009,168.99	-12,805,808.99
本期利润	20,612,265.60	39,218,892.71	-54,607,839.38
加权平均基金份额本期利润	0.0176	0.0212	-0.0194
本期加权平均净值利润率	1.69%	2.08%	-1.93%
本期基金份额净值增长率	1.64%	2.27%	-1.65%
3.1.2.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月4日)	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	18,738,315.35	40,132,701.23	26,899,731.70
期末可供分配基金份额利润	0.0539	0.0310	0.0112
期末基金资产净值	365,393,936.91	1,336,540,532.84	2,432,835,283.38
期末基金份额净值	1.051	1.034	1.011

注:1、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:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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、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(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金值表现

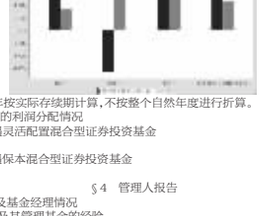
3.2.1 华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

3.2.1.1 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	-0.91%	0.21%	-6.10%	0.97%	5.19%	-0.76%
过去六个月	-0.77%	0.18%	-6.76%	0.89%	5.99%	-0.71%
自基金合同生效起至今	-1.06%	0.17%	-10.30%	0.88%	9.24%	-0.71%

3.2.1.2 自基金转型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

华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年6月5日至2018年12月31日)



注:1. 原华安新机遇保本混合型证券投资基金于2018年6月5日转型为华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金,截止本报告期末,华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金成立未满一年。

2.根据《华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为6个月。基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.1.3自基金转型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

华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金
自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

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。

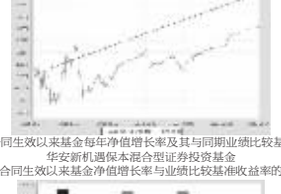
3.2.2 华安新机遇保本混合型证券投资基金

3.2.2.1 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	0.67%	0.03%	0.71%	0.01%	-0.04%	0.02%
过去六个月	2.04%	0.05%	1.37%	0.01%	0.67%	0.04%
过去一年	4.27%	0.07%	2.77%	0.01%	1.50%	0.06%
过去三年	4.89%	0.25%	8.42%	0.01%	-3.53%	0.24%
自基金合同生效起至今	5.10%	0.24%	8.51%	0.01%	-3.41%	0.23%

3.2.2.2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

华安新机遇保本混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年5月27日至2018年6月4日)



3.2.2.3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

华安新机遇保本混合型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

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

3.3.1 华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

无。

3.3.2 华安新机遇保本混合型证券投资基金

无。

§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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本15亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资(集团)有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司,在香港和上海设有子公司——华安(香港)资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至2018年12月31日,公司旗下共管理华安创新混合、华安MSCI中国A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等108只开放式基金,管理资产规模达到2756.06亿元人民币。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
郑可成	本基金的基金经理,固定收益部助理总监	2015-05-27	-	17年	硕士研究生,17年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在阳发证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,2005年1月至2005年9月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员,2006年10月至2009年7月在益民基金管理有限公司任基金经理,2009年8月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010年12月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月至2017年7月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014年8月至2015年1月,同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理,2014年8月起,同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起,同时担任华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2018年6月,同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月起,同时担任本基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理;2015年11月至2018年5月,同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年5月起,同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年12月至2018年1月,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2017年7月,同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月至2017年7月,同时担任华安安福保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年10月至2018年1月,同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安安金宝货币市场基金的基金经理。
吴丰树	本基金的基金经理	2015-05-27	2018-07-06	15年	硕士研究生,15年证券、基金行业从业经历,曾在中金公司担任研究员、华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理。2011年3月份加入华安基金管理有限公司。2011年7月至2012年5月担任华安核心优选混合型证券投资基金基金的基金经理。2012年10月至2018年7月同时担任华安行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2013年2月至2018年7月同时担任华安中小盘成长混合型证券投资基金的基金经理。2013年5月至2018年7月担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2018年7月同时担任本基金的基金经理。
王嘉	本基金的基金经理	2018-06-11	2018-11-12	15年	硕士,15年金融、证券行业从业经验。曾任上海市思也企业咨询有限公司研究员、上海市新辉基投资管理有限公司研究员、莫尼塔投资咨询有限公司研究员、元大京华证券上海代表处研究员、兴业证券研究发展中心研究员。2010年5月加入华安基金,现任基金投资部基金经理。2015年7月至2018年11月,担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2018年1月,担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2018年8月,担任华安安瑞保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年8月至2018年11月,同时担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年2月至2018年11月,同时担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。2018年6月至2018年11月,同时担任本基金的基金经理。
舒徽	本基金的基金经理	2018-11-12	-	10年	硕士研究生,10年证券、基金行业从业经验。曾任海通证券股份有限公司研究员。2011年6月加入华安基金,历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018年7月起担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年11月起,同时担任本基金的基金经理。2018年12月起,同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。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 管理人对投告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对投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《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共享的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风险管理部投资监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3异常交易行为的专项说明

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》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内,因组合流动性管理或投资策略调整需要,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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%的次数为4次,未出现异常交易。

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年美国经济持续复苏的背景下,美联储加息四次,美元成为强势货币。全球新兴市场国家出现不同程度的流动性外流。中国宏观经济在供给侧改革的背景下,上下游产业出现较明显分化。叠加中美贸易战的影响,民营经济出现经营困难的局面。央行货币政策前紧后松,资管新规等监管举措温和落地,体现了在内外部压力增加的背景下,宏观经济政策开始有所调整。

中国资本市场在2018年同样面临着其他新兴市场国家一样的困难局面。权益市场全年下跌近25%%,信用债市场出现连续的风险事件。幸而央行政策转向及时,确保货币流动性充裕并引导市场利率下行,中国在金融层面没有出现全局性和结构性的风险。市场风险偏好下降明显,无风险利率出现100BP以上的下行,收益率曲线呈现牛平的格局,信用利差在新一轮资产荒的冲击下,整体上也出现了明显的收窄。

报告期内,本基金投资以中短久期的信用债券投资为主,对长久期利率债进行波段操作,对权益市场保持灵活的仓位,取得了稳健收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金份额净值为1.0399元,本报告期(2018年6月5日-2018年12月31日)份额净值增长率为-1.06%,同期业绩比较基准增长率为-10.30%,本报告期(2018年1月1日-2018年6月4日)份额净值增长率为1.64%,同期业绩比较基准增长率为1.17%。

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2019年,美国经济复苏有见顶的迹象,市场对美联储的加息预期开始出现分歧。全球其他经济体经济增长开始放缓,各主要货币当局也开始减缓回收货币的政策。国内经济下行在市场上已经形成共识,但鉴于18年底政治局会议和中央经济工作会议的指导精神,我们倾向于认为19年逆周期政策调控的力度会显著加大,无论是货币政策还是财政政策,边际宽松的趋势非常明确,以确保“稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期”的目标得以顺利实现。从长期来看,风险偏好的提升是一个渐进而且反复的过程。短期中美贸易战缓和和稳增长政策的发力,使得风险偏好有较快回升,市场利率也将出现一定程度的回升。中期来看各类资产的趋势将会有所反复。在人民币汇率基本稳定的格局下,央行将综合运用数量政策和价格政策,维持不发生金融风险的底线。我们预期全年各类资产均将取得正收益,而市场利率仍然有下行的空间,信用风险事件仍然会有局部爆发的可能但不会大量出现。权益市场结构性特征较为明显,小微企业和高科技制造业将成为本轮信贷宽松的最大赢家,我们预计上半年价值成长各领风骚,下半年成长优势愈发明显。

本基金将维持债券组合适度杠杆水平,动态调整组合久期,以中高评级信用债为主要的配置对象。将保持一定权益仓位,积极参与权益一二级市场的投资。积极挖掘趋势性和结构性投资机会。具体操作以自下而上优选高科技制造领域的低估值真成长品种作为核心配置,结合自上而下的仓位调整和主题筛选,力争取得超额收益。在科创板上市以后,本基金也将凭借公司的投研资源,积极参与科创板一二级市场的投资机会。本基金将秉承稳健、专业的投资理念,勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值;同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成,具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

6.1 华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师蒋燕华沈熙苑签字出具了安永华明(2019)审字第60971571_B18号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

6.2 华安新机遇保本混合型证券投资基金

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师蒋燕华沈熙苑签字出具了安永华明(2019)审字第60971571_B17号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

7.1.1资产负债表

会计主体:华安新机遇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	本期末 2018年12月31日
资产:	-
银行存款	19,787,931.81
结算备付金	395,297.93
存出保证金	47,894.57
交易性金融资产	133,048,793.67
其中:股票投资	22,645,254.07
基金投资	-
债券投资	110,403,539.60
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	-
应收证券清算款	3,054,723.42
应收利息	2,031,079.08
应收股利	-
应收申购款	3,302.82
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	158,369,023.30
负债和所有者权益	**本期末 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	-
应付赎回款	279,467.61
应付管理人报酬	203,146.74
应付托管费	33,857.80
应付销售服务费	-
应付交易费用	212,736.58
应交税费	8,792.10
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	380,000.00
负债合计	1,118,000.83
所有者权益:	-
实收基金	151,211,827.73
未分配利润	6,039,194.74
所有者权益合计	157,251,022.47
负债和所有者权益总计	158,369,023.30

注:(1)报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0399元,基金份额总额151,211,827.73份。

(2)本基金由华安新机遇保本混合型证券投资基金转型而成,转型日为2018年6月5日。

7.1.2 利润表

会计主体:华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年6月5日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年6月5日至2018年12月31日
一、收入	845,248.30
1.利息收入	2,596,565.78
其中:存款利息收入	298,731.28
债券利息收入	2,154,751.61
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	143,072.89
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-3,074,845.02
其中:股票投资收益	-4,232,719.48
基金投资收益	-
债券投资收益	1,138,823.26
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	19,051.20
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,321,780.73
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,756.81
减:二、费用	2,571,382.60
1. 管理人报酬	1,661,408.60
2. 托管费	276,901.47
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	350,761.26
5. 利息支出	41,899.24
其中:卖出回购金融资产支出	41,899.24
6. 税金及附加	6,463.25
7. 其他费用	233,948.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-1,726,134.30
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-1,726,134.30

7.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年6月5日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年6月5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)	347,789,348.41	17,604,588.50	365,393,936.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,726,134.30	-1,726,134.30
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)	-196,577,520.68	-9,839,259.46	-206,416,780.14
其中:1.基金申购款	356,391.09	17,580.89	373,971.98
2.基金赎回款	-196,933,911.77	-9,856,840.35	-206,790,752.12
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)	151,211,827.73	6,039,194.74	157,251,022.47

报表附注为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:

基金管理人负责人:朱学华,主管会计工作负责人:赵敏,会计机构负责人:陈林

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 基金基本情况

华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安新机遇保本混合型证券投资基金转型而成,华安新机遇保本混合型证券投资基金系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]741号《关于准予华安新机遇保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2015年5月27日生效,首次设立募集规模为3,583,397,121.18份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安新机遇保本混合型证券投资基金基金合同》以及《华安新机遇保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为华安新机遇灵活配置混合基金相关业务规则的公告》的约定,本基金自2018年6月5日起转型为非保本的混合型证券投资基金并更名为华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金。

本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)以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。

基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金整体业绩比较基准:60%×沪深300指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。

7.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.1.4.3 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,真实、完整地反映了本基金于2018年12月31日的财务状况以及自2018年6月5日(基金合同转型日)起至2018年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.1.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2018年6月5日(基金合同转型日)起至2018年12月31日止。

7.1.4.4.2 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。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类: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;

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入