新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十四日

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23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。

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。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	新华鑫动力灵活配置混合	
基金主代码	002083	
交易代码	002083	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月8日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
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	22,475,829.82份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华鑫动力灵活配置混合A	新华鑫动力灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	002083	002084
报告期末下属分级基金的份额总额	17,424,537.21份	5,051,292.61份

2.2 基金产品说明

投资目标	综合运用多种投资策略,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	投资策略方面,本基金将以资产配置策略为基础,采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险、中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

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		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	贺婧
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

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日至2019年6月30日)	
	新华鑫动力灵活配置混合A	新华鑫动力灵活配置混合C
本期已实现收益	2,375,238.86	652,404.99
本期利润	2,861,701.60	788,969.56
加权平均基金份额本期利润	0.1587	0.1543
本期基金份额净值增长率	22.37%	22.46%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	新华鑫动力灵活配置混合A	新华鑫动力灵活配置混合C
期末可供分配基金份额利润	-0.1520	-0.1550
期末基金资产净值	14,776,173.67	4,268,230.94
期末基金份额净值	0.848	0.845

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(例如基金申购费赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.对期末可供分配利润,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

新华鑫动力灵活配置混合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	-0.59%	0.85%	3.43%	0.68%	-4.02%	0.17%
过去三个月	-7.12%	1.32%	-0.76%	0.90%	-6.36%	0.42%
过去六个月	22.37%	1.47%	15.71%	0.92%	6.66%	0.55%
过去一年	-2.53%	1.29%	7.18%	0.91%	-9.71%	0.38%
自基金合同生效起至今	-15.20%	1.01%	13.22%	0.66%	-28.42%	0.35%

注:1.本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用中国债券总指数,复合业绩比较标准为60%×沪深300指数+40%×中国债券总指数。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

新华鑫动力灵活配置混合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	-0.59%	0.83%	3.43%	0.68%	-4.02%	0.15%
过去三个月	-7.14%	1.31%	-0.76%	0.90%	-6.38%	0.41%
过去六个月	22.46%	1.46%	15.71%	0.92%	6.75%	0.54%
过去一年	-2.87%	1.28%	7.18%	0.91%	-10.05%	0.37%
自基金合同生效起至今	-15.50%	1.00%	13.22%	0.66%	-28.72%	0.34%

注:1.本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用中国债券总指数,复合业绩比较标准为60%×沪深300指数+40%×中国债券总指数。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

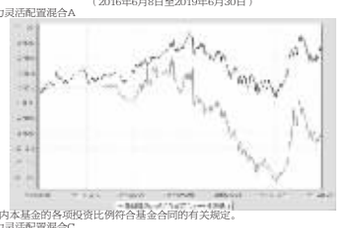
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华鑫动力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历史走势对比图

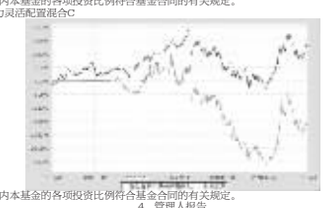
(2016年6月8日至2019年6月30日)

新华鑫动力灵活配置混合A



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

新华鑫动力灵活配置混合C



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复,于2004年12月9日注册成立。注册地为丽庆市,是我国西部首家基金管理公司。

截至2019年6月30日,新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十四只开放式基金,即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华鑫诚宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华家盈双利混合型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金和新华鼎利债券型证券投资基金。

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		
王永明	本基金基金经理。	2017-02-17	-	21	经济学博士,历任西南证券资产管理部研究员、恒泰证券研发中心经理、上海名禹资产管理有限公司研究总监、上海尚阳投资管理有限公司投资总监。
李会忠	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监,新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理,新华多策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016-06-08	2019-03-21	12	经济学硕士,历任新华基金管理股份有限公司行业研究员、策略分析师、基金经理助理。

注:1.首任基金经理,任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司作出决定之日。

2.非首任基金经理,任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券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,新华基金管理股份有限公司作为新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》,制度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、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由交易部下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由交易部投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会会议,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易,固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令,交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

2019年上半年A股市场走出冲高回落、震荡整理的走势。国内方面,4月上旬冲高后,投资者担忧流动性宽松程度的收缩,加之部分上市公司业绩和估值匹配度的问题随着市场上涨而凸显。国外方面,美国突然宣布对中国2500亿美元出口商品征收关税,对市场情绪造成较大冲击。国内外因素的双重叠加对市场造成了较大的影响。

与外部因素的影响相比,市场内部结构性分化更为显著。在不利的外部环境下,上证50指数二季度仍上涨了3.24%,涨幅在各主要指数中名列第一。与此同时,创业板、中小板指数同期跌幅超过10%。本基金本着守正出奇、机动灵活的策略,在守住"核心资产"主线的同时,适度把握市场的阶段性机会,在消费、金融和TMT类板块的进行了适度的灵活配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金成立于2016年6月8日,截至2019年6月30日,本基金A类份额净值为0.848元,本报告期份额净值增长率为22.37%,同期比较基准的增长率为15.71%;本基金C类份额净值为0.845元,本报告期份额净值增长率为22.46%,同期比较基准的增长率为15.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场的结构性分化,折射了中国经济基本特征的变化,是中国经济进入新常态的反映,也是投资者结构出现趋势性变化的必然结果,以"核心资产"为主要配置方向的投资逻辑仍将会被较多机构投资者认同。对于投资人来说,在好行业、好公司中选好股票将是未来较长时间的重要命题。本基金看好未来中国消费大市场的潜力和消费升级的前景,在食品饮料、医药、家用电器、电子、社会服务等消费领域继续投资和持有潜力品种,同时也将进点在科技创新类为主的逆周期和弱周期的其它行业中筛选投资标的,力争获得行业配置和选股的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工:

一、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责,估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部门、交易部,监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责:

① 制定估值制度并在必要时修改;

② 确保估值方法符合现行法规;

③ 批准证券估值的步骤和力法;

④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长,运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下,可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

二、基金会计负责的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值,基金会计和公司投资管理部门相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后,基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告,至少每月一次。

基金会计职责:

① 获得独立、完整的证券价格信息;

② 每日证券估值;

③ 检查价格波动并进行一般准确性评估;

④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;

⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;

⑥ 对估值调整和入工估值进行记录;

⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部门的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯;

② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告;

④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应;

② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

① 监督证券的整个估值过程;

② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;

④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险;

⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资管理部门问讯;

⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

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

本报告期本基金自2019年1月2日至2019年6月28日连续一百一十八个工作日基金资产净值低于五千万元。

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—新华基金管理股份有限公司 2019年1月1日至 2019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

托管人认为,新华基金管理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

托管人认为,新华基金管理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》及其他有关法律法规的规定,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:新华鑫动力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	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	2,296,594.13	6,433,286.90
结算备付金	198,054.30	230,897.24
存出保证金	53,264.34	57,484.80
交易性金融资产	17,004,707.98	4,379,243.00
其中:股票投资	17,004,707.98	4,379,243.00
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	-	-
应收证券清算款	-	6,108,202.30
应收利息	1,177.04	654.85
应收股利	-	-
应收申购款	4,995.00	99.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	19,558,792.79	17,209,868.10

负债和所有者权益	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	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	23,283.20	21,629.10
应付托管费	3,880.54	3,604.86
应付销售服务费	345.13	322.62
应付交易费用	447,207.73	277,706.27
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	39,671.58	460,000.38
负债合计	514,388.18	763,263.23
所有者权益:	-	-
实收基金	22,475,829.82	23,764,828.62
未分配利润	-3,431,425.21	-7,318,223.75
所有者权益合计	19,044,404.61	16,446,604.87
负债和所有者权益总计	19,558,792.79	17,209,868.10

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值(A类)0.848元,基金份额总额(A类)17,424,537.21份;基金份额净值(C类)0.845元,基金份额总额(C类)5,051,292.61份。

6.2 利润表

会计主体:新华鑫动力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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	4,286,618.50	-2,168,197.61
1.利息收入	22,277.65	26,966.42
其中:存款利息收入	20,817.96	24,342.03
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	1,459.69	2,624.39
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,639,872.69	-1,733,967.99
其中:股票投资收益	3,487,853.47	-1,883,409.80
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	152,019.22	149,441.81
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	623,027.31	-464,145.20
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,440.85	2,949.16
减:二、费用	635,947.34	941,340.58
1. 管理人报酬	141,780.50	181,351.01
2. 托管费	23,630.07	30,225.16
3. 销售服务费	2,082.29	2,554.98
4. 交易费用	416,505.53	486,695.18
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	51,948.95	240,514.25
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	3,650,671.16	-3,109,538.19
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	3,650,671.16	-3,109,538.19

注:报告截止日2019年6月30日,新华鑫动力A:基金份额净值0.848元,基金份额总额17,424,537.21份;新华鑫动力C:基金份额净值0.845元,基金份额总额5,051,292.61份。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华鑫动力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)	23,764,828.62	-7,318,223.75	16,446,604.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,650,671.16	3,650,671.16
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)	-1,288,998.80	236,127.38	-1,052,871.42
其中:1.基金申购款	871,434.03	-93,658.91	777,775.12
2.基金赎回款	-2,160,432.83	329,786.29	-1,830,646.54
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)	22,475,829.82	-3,431,425.21	19,044,404.61

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)	30,065,824.88	105,797.32	30,171,622.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,109,538.19	-3,109,538.19
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)	-5,577,894.28	-138,158.12	-5,716,052.40
其中:1.基金申购款	876,340.32	-24,271.85	852,068.47
2.基金赎回款	-6,454,234.60	-113,886.27	-6,568,120.87
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)	24,487,930.60	-3,141,898.99	21,346,031.61

报表附注为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:

基金管理人负责人:陈琨,主管会计工作负责人:刘全胜,会计机构负责人:徐端蓉

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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]2104 号文核准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2016年5月31日至2016年6月3日向社会公开募集,设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计619,212,900.64份,有效认购户数为6474户,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2016]01360032号验资报告予以验证。2016年6月8日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定,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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等、现金及到期日在一年以内的政府债券,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:股票投资占基金资产的比例为0-95%,中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于20%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,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%。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于2019年8月23日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制,根据实际发生的交易和事项,按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第33号发布,财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的41项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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的财务状况、经营成果和基金净值变动的情况等相关信息。

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估计与上年度一致,会计政策与上年度一致。

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

本基金报告期未发生差错更正。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从2008年9月19日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据按0.1%的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税,调整为单边征税,即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据的出让按0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

2.营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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有关政策的通知》的规定: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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定:对证券投资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。

根据《关于金融机构同业往来有关增值税问题的通知》(财税[2016]36 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补充通知》(财税[2017]2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)的规定,自2018年1月1日起,证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法,按照规行规定缴纳增值税及附加税费。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、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》的规定: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,持股期限在一个月以内(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,暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时,对个人持股1年以内(含1年)的,上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

本报告期内,本基金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
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

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
恒泰证券股份有限公司	26,397,068.32	8.74%	20,279,365.27	5.93%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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
恒泰证券股份有限公司	20,551.58	8.46%	20,551.58	4.60%

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
恒泰证券股份有限公司	18,595.48	6.57%	8,821.48	2.81%

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	141,780.50	181,351.01
其中:支付销售机构的客户维护费	70,378.48	90,099.60

注:1.基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提确认。计算公式为:每日基金管理费=前一日基金资产净值×(1.5%÷当年天数)

2.本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

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	23,630.07	30,225.16

注:基金托管费按前一日的基金资产净值0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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 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		
	新华鑫动力灵活配置混合A	新华鑫动力灵活配置混合C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	2,044.77	2,044.77
合计	-	2,044.77	2,044.77

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫动力灵活配置混合A	新华鑫动力灵活配置混合C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	2,504.29	2,504.29
合计	-	2,504.29	2,504.29

注:基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.10%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.10%/当年天数。

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

本基金本报告期及上年度可比期间,均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

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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