华富弘鑫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: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8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。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2019年8月28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2019年1月1日起至2019年6月30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	290,546,305.38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	192,912,131.64份	97,634,173.74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	潘志弘	郭明
	联系电话	021-68889996	(010)66105799
	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)66105798

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.hffund.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	华富弘鑫灵活配置混合A	华富弘鑫灵活配置混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	581,410.20	366,019.85
本期利润	930,889.98	649,141.44
加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0193
本期基金份额净值增长率	-0.44%	-0.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0523	0.0443
期末基金资产净值	202,992,517.06	101,956,696.48
期末基金份额净值	1.0523	1.0443

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

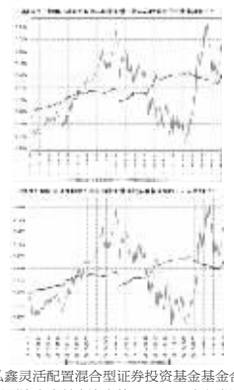
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.80%	0.18%	2.92%	0.59%	-2.12%	-0.41%
过去三个月	0.32%	0.12%	-0.06%	0.77%	0.38%	-0.65%
过去六个月	-0.44%	0.09%	14.27%	0.78%	-14.71%	-0.69%
过去一年	2.13%	0.08%	7.61%	0.76%	-5.48%	-0.68%
自基金合同生效起至今	5.23%	0.07%	9.43%	0.58%	-4.20%	-0.51%

华富弘鑫灵活配置混合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	0.79%	0.18%	2.92%	0.59%	-2.13%	-0.41%
过去三个月	0.28%	0.12%	-0.06%	0.77%	0.34%	-0.65%
过去六个月	-0.63%	0.09%	14.27%	0.78%	-14.90%	-0.69%
过去一年	1.82%	0.08%	7.61%	0.76%	-5.79%	-0.68%
自基金合同生效起至今	4.43%	0.07%	9.43%	0.58%	-5.00%	-0.51%

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,本基金的资产配置范围为: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%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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。

§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2019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、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富稳健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、华富安福债券型证券投资基金、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、华富恒富18个月定期开放债券型证券投资基金、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、华富恒财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、华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债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		
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、华富富瑞3个月定期开放债券型发起式基金基金经理、华富恒盛纯债债券型基金基金经理、华富货币市场基金基金经理	2018年8月28日	-	五年	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,先后担任偏中交易部投资交易员、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、华富益鑫灵活配置混合型基金、华富恒财分级债券型基金的基金经理助理,2018年6月26日至2019年3月28日任华富恒悦定期开放债券型基金基金经理。
张惠	华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富益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、华富安鑫债券型基金基金经理、华富安福债券型基金基金经理、华富恒享一年定期开放混合型基金基金经理	2019年4月15日	-	十二年	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5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28日至2017年7月5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3月22日任华富旺财保本混合型基金基金经理,2016年11月17日至2018年6月19日任华富永鑫灵活配置型基金基金经理,2016年8月26日至2018年8月1日任华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理。

注:这里的任职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,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

2019年上半年,国内经济在寻底的过程中低位徘徊。1月社融数据见底回升,2-3月一线城市地产销售复苏、基建投资增速回升,一系列减税降费后消费出现反弹,3月PMI重新回到50以上,但4-5月制造业PMI和工业增速再度下滑,经济走势再度趋弱。总体来看,一季度关于经济基本面复苏的预期在二季度被证伪。年初以来,央行通过降准等一系列宽松的货币政策继续引导资金流入实体经济,宽货币向宽信用的转换在路上。虽然在1季度货币政策例会上,央行表示下一步稳健的货币政策要松紧适度,把好货币供给总闸门,但是在二季度经济数据再次走弱、包商银行事件爆发后,央行对银行间市场流动性加大呵护,货币政策宽松周期依然延续。国际方面,一季度经济韧性超预期的美国在二季度末开始频繁出现经济数据低于预期的情况,6月美联储FOMC会议明确释放出鸽派信号,美联储进入降息周期的脚步渐行渐近,全球宽松环境预计可以持续。中美贸易战方面,5月中美贸易谈判突然出现明显恶化,而在6月底G20峰会上则再次出现边际缓和迹象。资本市场改革政策方面,6月科创板企业陆续开始招股询价,科创板注册制拉开序幕。

2019年上半年,债券市场跟随经济波动也出现了先抑后扬的行情。一季度,超预期的经济数据叠加市场风险偏好的提升,债券收益率曲线持续陡峭化,短端利率下行,长端利率震荡向上。受益于风险偏好的提升,可转债市场成为一季度债券市场里最亮眼的收益来源,转债整体估值大幅提升,多数个券收益明显。二季度,由于经济数据短期被证伪,经济下行压力凸显,同时叠加中美贸易摩擦阶段性升温市场风险偏好急剧下行,债券市场整体表现较好。虽然4月份专项债供给压力加大,6月初包商银行事情冲击等不利因素影响,长端利率阶段性出现回调,但是全季度来看,长短端均出现不同程度下行,相比而言利率债和中高等级信用债走势更为平稳,低等级信用债仍然面临利差走阔的压力。受到权益市场向下波动的影响,可转债市场二季度出现较大调整,大部分个券出现了一波快速的估值下行,跌幅较大。

2019年上半年,权益市场在去年以来市场担心的经济失速、改革停滞、中美贸易战持续升级等因素被逐一证伪后,开启了一轮估值修复行情,市场出现普涨,1-3月沪深300指数累计上涨28.62%,创业板指累计上涨35.43%。随后二季度,由于经济数据再次下行,叠加货币政策边际收紧和中美贸易摩擦升温,风险偏好出现大幅下行,市场大幅波动,开始震荡,在下跌的过程中,受到内外资青睐的各行业龙头公司表现较好,所谓"核心资产"大幅跑赢其他资产。

2019年上半年,本基金规模大幅增长,主要配置一年左右的高等级债券和存单,同时小幅加仓了高分红的稳定收益类股票仓位,以获取超额收益。

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2019年6月30日,华富弘鑫A类基金份额净值为1.0523元,累计份额净值为1.0523元,本报告期的份额累计净值增长率为-0.44%,同期业绩比较基准收益率为14.27%;华富弘鑫C基金份额净值为1.0443元,累计份额净值为1.0443元,本报告期的份额累计净值增长率为-0.63%,同期业绩比较基准收益率为14.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济数据显示基本面仍处底部区域,经济企稳动能较为薄弱;通胀虽仍在上升趋势,但对货币政策的制约可控;包商事件后央行呵护流动性,货币环境较为宽松;中美贸易摩擦难以短期解决,全球贸易体系不断受到冲击,主要经济体增长预期较差。去年以来的减税降费会在微观层面逐渐体现效果,上市公司的季度业绩变化值得期待与跟踪。我们倾向于认为基本面仍会在低位徘徊,但在政策托底的情况下经济失速的风险在显著下降。在货币政策仍然偏松,且在各种打破刚兑的预期和"房住不炒"的政策基调下,长端利率仍有进一步下行的空间,无风险利率有望继续下行。权益资产在基本面改善不明显的情况下,更关注风险偏好以及政策扰动,三季度业绩表现持续良好以及在各种政策刺激下业绩转好明显的行业和板块将有望得到市场认可,精选个股更为重要。

从资产配置角度,我们认为短期基本面和货币政策仍对债券市场形成支撑,但由于绝对收益率水平仍处在较低位置,性价比继续下降。经过二季度下跌后的可转债市场和权益资产更值得关注。本基金将继续保持债券偏中短久期的组合,以获取票息收入为主的策略,风险资产仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念进行配置。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位,在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,发挥管理人的综合优势,积极稳健地做好配置策略,均衡投资,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

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。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1,580,031.42元,期末可供分配利润为14,402,908.16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

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者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,本基金的管理人——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、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,本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弘鑫灵活配置混合型证券投资基金2019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:华富弘鑫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

姓名	附注号	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	6.4.7.1	320,447.49	353,524.85
结算备付金		274,835.85	45,454.55
存出保证金		11,073.56	30,263.42
交易性金融资产	6.4.7.2	305,063,244.88	62,121,350.00
其中:股票投资		61,930,644.88	-
基金投资		-	-
债券投资		243,132,600.00	62,121,350.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	10,080,135.12
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,461,225.98	635,312.85
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		308,130,827.76	73,266,040.79
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,600,000.00	-
应付证券清算款		177,604.41	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		149,818.27	37,113.58
应付托管费		37,454.59	9,278.40
应付销售服务费		16,617.77	11,493.64
应付交易费用	6.4.7.7	115,916.91	6,177.53
应交税费		15,835.17	-
应付利息		568.44	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	67,798.66	380,000.00
负债合计		3,181,614.22	444,063.15
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	290,546,305.38	69,265,436.19
未分配利润	6.4.7.10	14,402,908.16	3,556,541.45
所有者权益合计		304,949,213.54	72,821,977.64
负债和所有者权益总计		308,130,827.76	73,266,040.79

注:报告截止日2019年6月30日,华富弘鑫灵活配置混合A基金份额净值1.0523元,基金份额总额192,912,131.64份;华富弘鑫灵活配置混合C基金份额净值1.0443元,基金份额总额97,634,173.74份。华富弘鑫灵活配置混合份额总额合计为290,546,305.38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:华富弘鑫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	附注号	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		2,318,530.45	3,299,690.47
1.利息收入		1,459,810.71	8,259,430.52
其中:存款利息收入	6.4.7.11	33,621.06	46,217.30
债券利息收入		1,287,778.69	8,030,580.88
资产支持证券利息收入		-	163,289.68
买入返售金融资产收入		138,410.96	19,342.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		226,116.70	-7,875,369.39
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-948,660.13	-8,150,805.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	125,738.81	275,435.63
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,049,038.02	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	632,601.37	2,914,806.79
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	1.67	822.55
减:二、费用		738,499.03	3,879,342.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	344,950.23	1,245,981.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,237.53	311,495.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	34,824.90	406,990.58
4. 交易费用	6.4.7.19	158,572.68	111,800.08
5. 利息支出		22,533.41	1,574,458.67
其中:卖出回购金融资产支出		22,533.41	1,574,458.67
6. 税金及附加		3,530.62	19,159.27
7. 其他费用	6.4.7.20	87,849.66	209,457.44
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,580,031.42	-579,652.07
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,580,031.42	-579,652.07

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:华富弘鑫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)	69,265,436.19	3,556,541.45	72,821,977.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,580,031.42	1,580,031.42
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)	221,280,869.19	9,266,335.29	230,547,204.48
其中:1.基金申购款	288,263,180.30	12,766,793.12	301,029,973.42
2.基金赎回款	-66,982,311.11	-3,500,457.83	-70,482,768.94
五、期末所有者权益(基金净值)	290,546,305.38	14,402,908.16	304,949,213.54
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)	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)	-	-579,652.07	-579,652.07
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)	-7,512,414.17	-199,168.71	-7,711,582.88
2.基金赎回款	-7,512,414.17	-199,168.71	-7,711,582.88
五、期末所有者权益(基金净值)	407,433,448.13	10,441,797.82	417,875,245.95

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_____ _____曹华玮_____ _____邵恒____

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)。

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%的征税率缴纳增值税。

(二)对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(三)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。

主要税种及税率列示如下:

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	金融服务销售额	3%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加[注]	应缴流转税税额	2%、1%

[注]:接地方税务局通知,自2018年7月1日起下调地方教育附加税税率,由原来的2%下调为1%。

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 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
华安证券	61,619,885.34	50.12%	21,113,151.60	28.11%

6.4.8.1.2 债券交易

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	2,996,100.00	2.65%	36,283,960.61	15.82%

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 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	
	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	26,000,000.00	6.04%	1,444,700,000.00	28.51%

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 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
华安证券	57,369.43	50.12%	57,369.43	50.12%
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
华安证券	19,662.75	28.34%	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括

佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	344,950.23	1,245,981.27
其中:支付销售机构的客户维护费	3,885.72	8,940.43

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 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	86,237.53	311,495.23

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 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		
	华富弘鑫灵活配置混合A	华富弘鑫灵活配置混合C	合计
华富基金管理有限公司	-	34,380.79	34,380.79
华安证券股份有限公司	-	143.99	143.99
上海浦东发展银行股份有限公司	-	289.73	289.73
合计	-	34,814.51	34,814.51
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		
	华富弘鑫灵活配置混合A	华富弘鑫灵活配置