华融现金增利货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:华融证券股份有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年1月1 日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华融现金增利货币		
交易代码	000785		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年9月16日		
报告期末基金份额总额	366,046,453.07份		
投资目标	在充分控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的稳定增值。		
投资策略	本基金的投资将以资产的安全性和流动性控制为基本原则, 力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上,科学预计未来利率走势,择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具,进行积极的投资组合管理。		
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	华融证券股份有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C
下属分级基金的交易代码	000785	000786	000787
报告期末下属分级基金的份额总额	7,928,119.54份	348,868,091.47份	9,250,242.06份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)		
	华融现金增利A	华融现金增利B	华融现金增利C
1. 本期已实现收益	63,264.60	2,972,553.22	43,431.86
2. 本期利润	63,264.60	2,972,553.22	43,431.86
3. 期末基金资产净值	7,928,119.54	348,868,091.47	9,250,242.06

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华融现金增利A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.75%	0.00%	0.33%	0.00%	0.42%	0.00%

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、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、本基金利润分配是按日结转份额。

华融现金增利B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.81%	0.00%	0.33%	0.00%	0.48%	0.00%

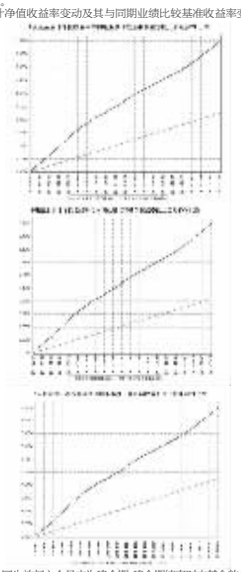
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、本基金利润分配是按日结转份额。

华融现金增利C

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.75%	0.00%	0.33%	0.00%	0.42%	0.00%

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、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、本基金利润分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桑劲乔	本基金的基金经理	2016年12月6日	-	4	桑劲乔,男,硕士研究生。2012年11月进入华融证券股份有限公司以来先后从事证券研究分析、证券交易的工作,曾先后担任固定收益投资部交易员、投资经理。

注:1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
2、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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,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。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金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5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,除跨春节时点受居民提现影响、跨季度时点受MPA考核影响外,资金面整体维持宽松态势。受到美联储加息以及国内金融同业去杠杆的影响,央行当局逐步提高了公开市场操作、中期借贷便利等一系列工具的利率,导致回购、存单及短期融资券等资产收益率中枢不断攀升。本基金在一季度维持杠杆+信用+久期+骑乘的组合投资策略,且根据时间节点资金面松紧状态做妥善安排。由于商业银行资产端与负债端久期错配严重,同时受到同业存单纳入同业负债监管预期的影响,1季度同业存单发行量价齐升,本基金也加大了同业存单的配置力度。截至1季度末,本基金银行存款投资占比为3%左右,信用债投资占比为22%左右,同业存单投资占比65%左右,政策性金融债投资占比为10%左右。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内A类基金份额净值收益率为0.75%;B类基金份额净值收益率为0.81%;C类基金份额净值收益率为0.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	408,911,325.42	95.91
	其中:债券	408,911,325.42	95.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	15,673,299.94	3.68
4	其他资产	1,777,144.93	0.42
5	合计	426,361,770.29	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	11.11	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	59,799,590.30	16.34
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未有超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	58.83	16.34
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	13.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	5.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	19.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		115.99	16.34

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
本基金本报告期内未发生平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,946,012.71	10.91
	其中:政策性金融债	39,946,012.71	10.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	89,963,315.74	24.58
6	中期票据	19,917,183.50	5.44
7	同业存单	259,084,813.47	70.78
8	其他	-	-
9	合计	408,911,325.42	111.71
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170301	17进出01	300,000	29,887,373.37	8.16
2	011698599	16鲁晨鸣SCP011	200,000	19,990,007.77	5.46
3	1282214	12本钢MTN1	200,000	19,917,183.50	5.44
4	140347	14进出47	100,000	10,058,639.34	2.75
5	111792713	17成都银行CD014	100,000	10,000,000.00	2.73
6	071721002	17渤海证券CP002	100,000	9,999,385.95	2.73
7	011759004	17杭金投SCP002	100,000	9,998,769.57	2.73
8	071721003	17渤海证券CP003	100,000	9,998,495.55	2.73
9	011698593	16新希望SCP002	100,000	9,998,477.41	2.73
10	011752003	17日照港SCP001	100,000	9,995,717.46	2.73

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.07%
报告期内偏离度的最低值	-0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.04%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1本基金目前投资工具的估值方法如下:
(1)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;
(2)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。
如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。
如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,777,144.93
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,777,144.93

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	12,257,847.86
报告期期间基金总申购份额	4,278,440.53
报告期期间基金总赎回份额	8,608,168.85
报告期期末基金份额总额	7,928,119.54
报告期期初基金份额总额	349,316,673.18
报告期期间基金总申购份额	252,980,294.52
报告期期间基金总赎回份额	253,428,876.23
报告期期末基金份额总额	348,868,091.47
报告期期初基金份额总额	4,567,894.80
报告期期间基金总申购份额	16,272,230.66
报告期期间基金总赎回份额	11,589,883.40
报告期期末基金份额总额	9,250,242.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金,截至本报告期末,基金管理人运用固有资金投资本基金的资产余额为41,258,830.72元。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年3月21日-2017年3月21日	0.00	150,125,240.02	-	150,125,240.02	41.01
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人,在持有人大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,存在流动性风险,且在特定市场条件下,若基金管理人及时变现基金资产,存在基金净值波动风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
华融现金增利货币市场基金向中国证监会注册的募集文件;
《华融现金增利货币市场基金基金合同》;
《华融现金增利货币市场基金托管协议》;
法律意见书;
基金管理人业务资格批件、营业执照;
基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式
投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华融证券股份有限公司
2017年4月25日

华融新利灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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
报告送出日期:2017年4月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华融新利灵活配置混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	60,666,056.97份
投资目标	通过灵活运用多种投资策略,把握市场机会,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,能够为股东持续创造价值的优质标的,运用多样化的投资策略实行组合管理,实现基金资产的长期增值。 1、资产配置策略 从全球经济格局和中国经济发展方式的变化,分析经济的驱动力和阶段性特征,结合宏观政策,产业政策,结构变迁,市场情绪等对比分析大类资产风险收益比,合理分配各大类资产配置比例,以实现基金资产的稳健增值。 2、股票投资策略 本基金的股票投资秉承价值投资理念,采取定量和定性相结合的方法,深挖符合经济升级转型,发展潜力巨大的行业与公司,通过上下游产业链的实地调研对研究逻辑和结论进行验证,灵活运用多种低风险投资策略,把握市场投资机会。 3、债券投资策略 本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上,灵活采用类属配置、个券选择、套利等投资策略。 4、股指期货投资策略 本基金认为在符合一定条件的市场环境中, 有必要审慎灵活地综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险,降低投资组合波动性并提高资金管理效率。本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。 5、套利策略 利用市场的弱有效性,以较低成本、较高效率、承担较低风险情况下把握市场定价偏差带来的机会,主要包括新可转换债券套利、增发套利、转债转股套利等。
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,461,788.74
2.本期利润	-314,253.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0045
4.期末基金资产净值	62,323,106.58
5.期末基金份额净值	1.027

注: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。

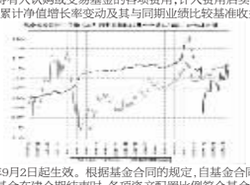
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-0.19%	0.64%	1.59%	0.15%	-1.78%	0.49%

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、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的基金合同自2015年9月2日起生效。根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时,各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

3.3 其他指标
注:本基金本报告期未未有其他指标备注。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
范贵龙	本基金的基金经理	2015年9月2日	-	10	范贵龙,男,汉族,1981年生,武汉大学金融学硕士, 特许金融分析师(CFA),金融风险管理师(FRM),具备10年金融行业工作经验。2006年就职于中国建设银行,2009年6月就职于华融证券市场研究部,2013年8月就职于华融证券资产管理二部、基金业务部。2015年4月起任华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年9月起任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:2、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
2、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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节,本基金管理人构建了统一的研究平台,为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时,在投资决策过程中,各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度,保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节,本基金管理人实行集中交易制度,按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节,本基金管理人定期对股票交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金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5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度经济稳中向好,先行指标制造业PMI连续8个月维持温和扩张。受食品价格持续走弱影响,CPI同比涨幅出现较明显的回落,非食品CPI以及PPI依然处于高位,但是PPI环比涨幅已经开始回落,整体物价压力有所缓解。在美联储加息、国内货币政策稳健中性以及去杠杆防风险等政策的引导下,利率出现缓慢走高态势。

一季度,市场震荡回升,上证综指最低下探至3044点,随后缓慢上行,月末出现小幅回调,整体维持在3000-3300之间整理。周期、消费、成长以及局部主题性机会频繁切换。

本基金始终坚持持有人利益优先的原则,坚持价值投资的理念。本基金在报告期内根据市场变化积极调整仓位和配置结构,积极参与新股和新债申购增厚基金收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.932元,本报告期份额净值增长率为4.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	98,037,875.38	47.49
	其中:股票	98,037,875.38	47.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,139,000.00	4.91
	其中:债券	10,139,000.00	4.91
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	79,000,000.00	38.27
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,387,126.50	8.91
8	其他资产	881,767.95	0.43
9	合计	206,445,769.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	622,500.00	0.31
B	采矿业	3,794,411.64	1.88
C	制造业	48,585,762.93	24.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	865,500.00	0.43
E	建筑业	3,335,421.25	1.65
F	批发和零售业	5,552,316.56	2.75
G	交通运输、仓储和邮政业	3,518,490.00	1.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,636,900.00	1.30
J	金融业	24,526,473.00	12.14
K	房地产业	2,806,500.00	1.39
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	925,600.00	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	868,000.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	98,037,875.38	48.51

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	2,690,000	13,019,600.00	6.44
2	000858	五粮液	112,300	4,828,900.00	2.39
3	000401	冀东水泥	308,000	4,305,840.00	2.13
4	600276	恒瑞医药	78,440	4,261,645.20	2.11
5	600030	中信证券	209,100	3,368,601.00	1.67
6	002087	新野纺织	486,269	3,243,414.23	1.60
7	002450	康得新	150,000	2,868,000.00	1.42
8	601229	上海银行	110,000	2,637,800.00	1.31
9	000538	云南白药	30,000	2,553,600.00	1.26
10	600718	东软集团	120,000	2,316,000.00	1.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,994,000.00	4.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	145,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,139,000.00	5.02

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160011	16附息国债11	100,000	9,994,000.00	4.94
2	113012	骆驼转债	1,000	100,000.00	0.05
3	113011	光大转债	450	45,000.00	0.02

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
根据本基金的基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	140,573.19
2	应收证券清算款	1,929,715.94
3	应收股利	-
4	应收利息	2,404.22
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,073,187.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期内未持有转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300309	吉艾科技	1,730,093.64	2.78	临时停牌
2	002652	扬子新材	1,720,450.00	2.76	临时停牌
3	603010	万盛股份	1,509,948.00	2.42	临时停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	78,880,896.64
报告期期间基金总申购份额	1,535,661.48
减:报告期期间基金总赎回份额	19,750,501.15
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	60,666,056.97

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	-	19,266,859.34	-	-	19,266,859.34	31.75
	2	-	14,519,845.11	-	-	14,519,845.11	23.93
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人,在持有人大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,存在流动性风险,且在特定市场条件下,若基金管理人及时变现基金资产,存在基金净值波动风险。持有人赎回后,可能出现基金资产净值低于5000万元的情形,若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人可能提前终止基金合同。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会核准华融新利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
《华融新利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
《华融新利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
《华融证券股份有限公司开放式基金业务规则》
本基金管理人业务资格批件和营业执照
本基金托管人业务资格批件和营业执照
报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 存放地点
上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在