

华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------|--------------|
| 基金简称 | 华富元鑫灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 002853 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 8 月 26 日 | |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 7,698,831.41 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 华富元鑫灵活配置混合 A | 华富元鑫灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 002853 | 002854 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,362,598.04 份 | 336,233.37 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。 |

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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 满志弘 |
| | 联系电话 | 021-68886996 |
| | 电子邮箱 | manzh@hffund.com |
| 客户服务电话 | 400-700-8001 | 95528 |
| 传真 | 021-68887997 | 021-63602540 |

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 | 华富元鑫灵活配置混合 A | 华富元鑫灵活配置混合 C |
|---------------|-------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日) | 报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 589,777.05 | 16,014.97 |
| 本期利润 | 159,952.03 | 5,242.52 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0185 | 0.0098 |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.86% | 0.36% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.0049 | 0.1138 |
| 期末基金资产净值 | 14,761,637.60 | 374,484.20 |
| 期末基金份额净值 | 2.005 | 1.114 |

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

华富元鑫灵活配置混合 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 | -0.15% | 0.13% | -3.65% | 0.64% | 3.50% | -0.51% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.00% | 0.12% | -4.28% | 0.57% | 4.28% | -0.45% |
| 过去六个月 | 0.86% | 0.19% | -5.15% | 0.58% | 6.01% | -0.39% |
| 过去一年 | 4.16% | 0.19% | -0.34% | 0.48% | 4.50% | -0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 100.50% | 3.58% | 5.41% | 0.41% | 95.09% | 3.17% |

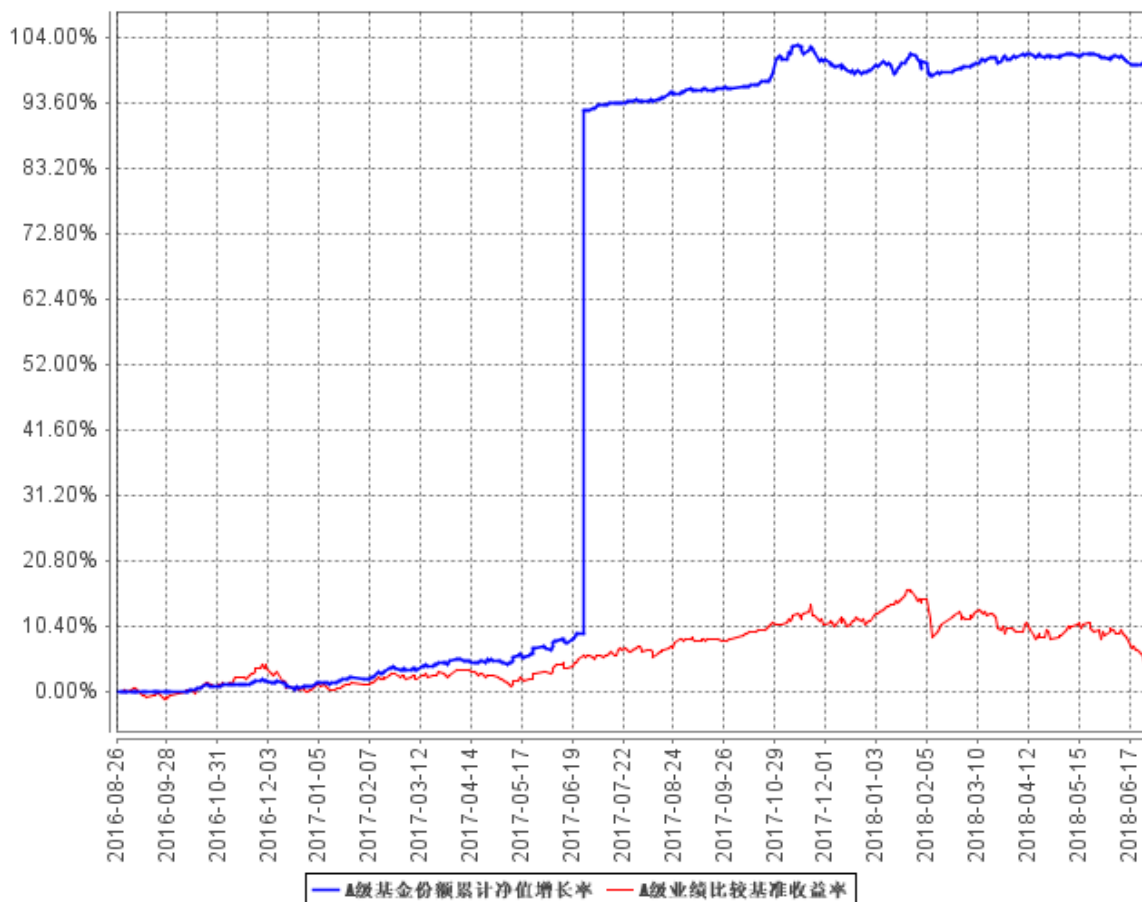
华富元鑫灵活配置混合 C

| 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 | -0.18% | 0.12% | -3.65% | 0.64% | 3.47% | -0.52% |
| 过去三个月 | -0.09% | 0.13% | -4.28% | 0.57% | 4.19% | -0.44% |
| 过去六个月 | 0.36% | 0.19% | -5.15% | 0.58% | 5.51% | -0.39% |
| 过去一年 | 1.83% | 0.19% | -0.34% | 0.48% | 2.17% | -0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.40% | 0.19% | 5.41% | 0.41% | 5.99% | -0.22% |

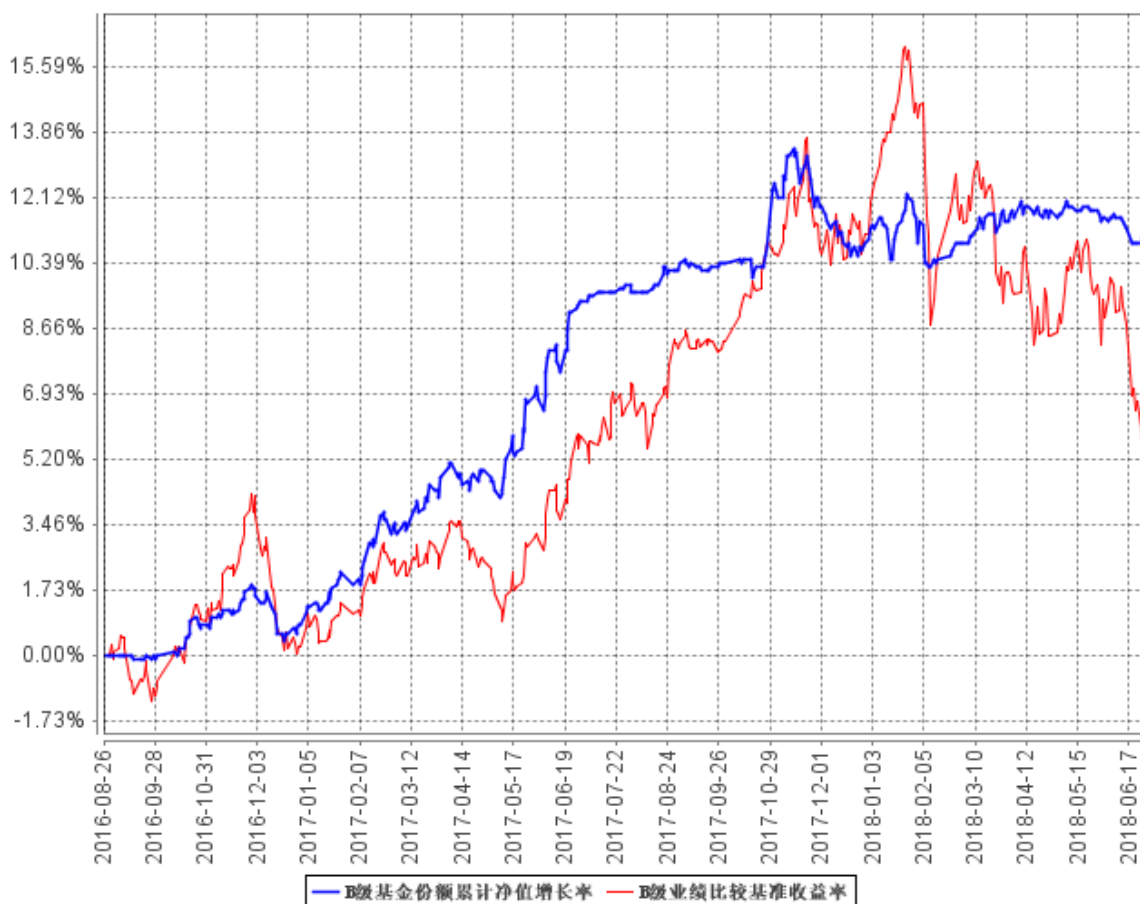
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富元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。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2016 年 8 月 26 日到 2017 年 2 月 26 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《华富元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 2018 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、华富保本混合型证券投资基金、华富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、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债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、华富安福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、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、华富恒悦定期开放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 | | |
| 张惠 | 华富元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 | 2016 年 8 月 26 日 | - | 十一年 | 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经理，2015 年 3 月 16 日至 2018 年 5 月 31 日任华富旺 |

| | | | | | |
|--|------------------------------------------------------------|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------|
| | 富恒利 债券型 基金基 金经理、 华富保 本混合 型基金 基金经 理 | | | | 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。 |
|--|------------------------------------------------------------|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------|

注：任职日期指该基金成立之日。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

2018 年上半年，国内经济依然延续了较好的韧性，但是需求开始出现放缓。一季度，固定资产投资增速回升，出口保持强势，在金融去杠杆的过程中，新增贷款和社融数据环比继续回落。二季度，制造业 PMI 出现小幅回落，但在历年同期中仍处较高水平，指向制造业景气稳中略降。固定资产投资方面，6 月以来地产销量增速较 5 月出现回落，未来资金问题将制约地产投资扩张，在基建投资未有明显反弹之时，整个固定资产投资增速将有可能进一步下滑。消费方面，高房价对消费的挤出效应日渐明显，5 月份开始社零增速出现环比下滑。金融数据方面，在降杠杆过程中，金融严监管效应持续增强，非标融资规模出现负增长，同时违约事件频发也导致债券融资规模出现下滑，社会融资额持续下行。3 月份开始，美国总统签署备忘录将对对中国大规模增加关税，在随后的一个季度里，中美贸易摩擦不断升温愈演愈烈，贸易争端对出口的抑制作用开始显现。海外方面，二季度美国经济持续向好，美元进一步走强，美联储进一步加息，美债出现上行。

2018 年上半年，面对错综复杂的国内外环境，债券市场走势出人意料，从年初最不被市场看好的一类资产到季度末，成为了最赚钱的资产。1 月份，市场普遍预期经济超预期，悲观情绪达到顶峰，当时股票市场金融地产相继大涨，债券利率纷纷创出新高。进入 2 月份后，春节临近，央行呵护市场释放了流动性，年后公布的前两月经济数据差于预期，利率出现下行。4 月份后，伴随着社融和新增贷款环比进一步下行，资金需求继续回落，再叠加中美贸易摩擦升温后避险情绪加大，央行开启降准，市场悲观预期被彻底扭转，十年期国债和国开大幅下行。随后市场开始出现调整，特别是 5 月份开始集中爆发了多起信用风险，多家上市公司或母公司接连爆发信用风险，城投也爆兑付危机，信用违约潮再次到来，债市出现震荡整理，高等级受到追捧，中低等级成交惨淡，等级利差进一步走阔。

2018 年上半年，权益市场走势也超出大多数主流观点的预期。年初，在乐观的经济预期下，金融地产出现大幅上涨继而带动指数大涨，随后在中美贸易摩擦升温、信用风险集中爆发以及对去杠杆的经济担忧笼罩下，各主要股指均出现了明显的下跌。其中，年初大幅上涨的金融地产和代表新经济的中小成长股均出现大幅杀跌，在市场悲观情绪下，A 股整体估值跌回 2016 年年初水平。

上半年，根据本基金的规模特点，以追求绝对收益为目标，我们减仓了组合中的权益资产，加入了低价转债的投资策略，在追求稳定债券收益的基础上获取潜在的股价上涨收益，产品净值小幅上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 8 月 26 日正式成立。截止到 2018 年 6 月 30 日，华富元鑫 A 类基金份额净

值为 2.005 元，累计份额净值为 2.005 元，本报告期的份额累计净值增长率为 0.86%，同期业绩比较基准收益率为-5.15%；华富元鑫 C 基金份额净值为 1.114 元，累计份额净值为 1.114 元，本报告期的份额累计净值增长率为 0.36%，同期业绩比较基准收益率为-5.15%。

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，在严监管大势下，紧信用环境总体仍将延续，以投资驱动的工业经济增速势必回落，且从高频数据看，需求萎缩已经影响到生产端，未来工业经济景气度将逐步下行。6 月 24 日央行再次降准，27 日央行二季度例会确认货币宽松，我们认为下半年资金面应无忧，政策面宽松，但不会是大水漫灌，去杠杆和货币宽松本身不矛盾，后续可能会有更多结构性政策出台。7 月中旬，央行和监管机构也印发了资管新规的细则和理财新规，本次理财新规和央行细则，体现了决策层在面对国内外一系列新形势、新情况，并且预期其将对宏观经济造成负面冲击时，主动调整金融监管节奏和力度，相对放松的政策口径可以有效缓解资管新规为实体融资带来的冲击、保证宏观经济增速稳定在合适区间，并努力规避信用违约扩散所导致的系统性风险。因此从中长期看，资金面、基本面、政策面对利率债市场的影响都偏正面，我们认为利率债仍然面临趋势向下的投资机会。产业债方面，资管新规落地以及网传央行对低等级主体的 MLF 支持对近期信用债收益率的大幅下行起到了直接的促进作用，短期信用风险的担忧有所缓解。但考虑去杠杆的大环境下，中低等级信用风险依然较高，我们仍然以中高等级配置为主，可以适当拉长组合久期。城投债方面，非标收缩、平台流动性压力显著增加，负面事件时有传出，城投估值风险不容小觑，城投债配置应以无负面信息地区的高等级、短久期债券为主，持续监测平台各类违约事件信息。

权益资产方面，经历过上半年的大幅杀跌后，在目前时刻，A 股整体估值水平大幅回落，部分行业估值在历史地位水平，但是考虑这两年的经济增长和企业盈利，部分个股短期超跌，因此展望下半年，我们不过度悲观，将择机挑选错杀的个股进行配置，等待市场回暖。

从本基金配置角度看，我们将进一步采取低价转债策略，做到“退可守进可攻”，同时尽可能的对长久期债券进行波动操作，力争获取超额收益。

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投资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《华富元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 165,194.55 元，期末可供分配利润为 7,437,290.39 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

从 2016 年 11 月 17 日起至本报告期末（2018 年 6 月 30 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日不满二百人的情形，至本报告期期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有人数仍不满二百人。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§ 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基

金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 7,735,185.33 | 19,285,139.03 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 2,152.79 | 68,271.30 |
| 交易性金融资产 | | 7,607,481.30 | 3,889,102.36 |
| 其中：股票投资 | | - | 3,868,537.56 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 7,607,481.30 | 20,564.80 |
| 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 | | - | - |
| 应收利息 | | 60,903.77 | 9,639.86 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 20,640.78 | 219,000.98 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 15,426,363.97 | 23,471,153.53 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 205,424.41 | 448,856.09 |
| 应付管理人报酬 | | 7,739.95 | 12,049.48 |
| 应付托管费 | | 1,935.00 | 3,012.36 |
| 应付销售服务费 | | 69.40 | 200.27 |
| 应付交易费用 | | 847.70 | - |
| 应交税费 | | 465.50 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 73,760.21 | 310,589.40 |
| 负债合计 | | 290,242.17 | 774,707.60 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 7,698,831.41 | 11,844,365.54 |
| 未分配利润 | | 7,437,290.39 | 10,852,080.39 |
| 所有者权益合计 | | 15,136,121.80 | 22,696,445.93 |
| 负债和所有者权益总计 | | 15,426,363.97 | 23,471,153.53 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.005 元、B 类基金份额净值 1.114 元，基金份额总额 7,698,831.41 份，A 类基金份额总额 7,362,598.04 份、B 类基金份额总额 336,233.37 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：华富元鑫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 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------------|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入 | | 333,852.37 | 31,695,540.63 |
| 1.利息收入 | | 167,934.79 | 5,655,054.01 |
| 其中：存款利息收入 | | 102,316.68 | 205,940.82 |
| 债券利息收入 | | 57,212.63 | 5,332,889.81 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 8,405.48 | 116,223.38 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 541,037.07 | 22,120,847.47 |

| | | | |
|----------------------------|-----------|-------------|---------------|
| 其中：股票投资收益 | | 533,582.10 | 24,145,610.41 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 4,994.85 | -2,786,856.21 |
| 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 | | 2,460.12 | 762,093.27 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -440,597.47 | 3,847,198.50 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 65,477.98 | 72,440.65 |
| 减：二、费用 | | 168,657.82 | 2,560,629.77 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.8.2.1 | 53,366.86 | 1,114,084.93 |
| 2. 托管费 | 6.4.8.2.2 | 13,341.71 | 278,521.19 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.8.2.3 | 590.64 | 298,658.96 |
| 4. 交易费用 | | 8,109.20 | 459,067.19 |
| 5. 利息支出 | | - | 232,672.03 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | 232,672.03 |
| 6. 其他费用 | | 93,126.77 | 177,625.47 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 165,194.55 | 29,134,910.86 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 165,194.55 | 29,134,910.86 |

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：华富元鑫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 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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） | 11,844,365.54 | 10,852,080.39 | 22,696,445.93 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本 | - | 165,194.55 | 165,194.55 |

| | | | |
|----------------------------------------|---------------------------------|----------------|-----------------|
| 期净利润) | | | |
| 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) | -4,145,534.13 | -3,579,984.55 | -7,725,518.68 |
| 其中:1.基金申购款 | 4,705,055.84 | 4,706,791.94 | 9,411,847.78 |
| 2.基金赎回款 | -8,850,589.97 | -8,286,776.49 | -17,137,366.46 |
| 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) | 7,698,831.41 | 7,437,290.39 | 15,136,121.80 |
| | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | |
| 项目 | 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) | 478,454,364.29 | 4,013,126.68 | 482,467,490.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 29,134,910.86 | 29,134,910.86 |
| 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) | -331,826,835.79 | -18,919,010.78 | -350,745,846.57 |
| 其中:1.基金申购款 | 126,636,240.77 | 6,289,740.78 | 132,925,981.55 |
| 2.基金赎回款 | -458,463,076.56 | -25,208,751.56 | -483,671,828.12 |
| 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) | 146,627,528.50 | 14,229,026.76 | 160,856,555.26 |

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
基金管理人负责人

余海春
主管会计工作负责人

陈大毅
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富元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]1083号）核准，基金合同于2016年9月7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）6-128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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票（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、中小企业私募债等）、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% 的征收率缴纳增值税。

（二）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。

（三）对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

（四）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。

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 | 基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 391,564.70 | 9.84% | 250,633,004.28 | 95.16% |

6.4.8.1.2 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6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 2,943,130.17 | 38.56% | 16,561,190.89 | 35.18% |

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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | - | - | 467,200,000.00 | 93.25% |

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 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 | 356.82 | 9.67% | 356.82 | 42.09% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 230,246.55 | 95.15% | 184,541.78 | 100.00% |

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 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 53,366.86 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 18,950.16 | 136,057.26 |

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 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （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 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----|----------------------------|---------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的托管费 | 13,341.71 |

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 $H =$

$E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ (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 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 | | |
| | 华富元鑫灵活配置 混合 A | 华富元鑫灵活配置 混合 C | 合计 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | - | 27.38 | 27.38 |
| 华富基金管理有限公司 | - | - | - |
| 华安证券股份有限公司 | - | 14.55 | 14.55 |
| 合计 | - | 41.93 | 41.93 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华富元鑫灵活配置 混合 A | 华富元鑫灵活配置 混合 C | 合计 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | - | 30.24 | 30.24 |
| 华富基金管理有限公司 | - | 231,743.50 | 231,743.50 |
| 合计 | - | 231,773.74 | 231,773.74 |

注: 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费; C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率每日计提, 逐日累计至每个月月末, 按月支付。计算公式 $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ (H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费, E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值)。

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

注: 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。

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

注: 本基金本报告期和上年度可比期间内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金本报告期和上年度可比期间内基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

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

| 关联方名称 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | |
|----------------|---------------------------------------|------------|--------------------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 7,735,185.33 | 102,175.54 | 44,233,418.11 | 201,848.19 |

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 7,607,481.30 | 49.31 |
| | 其中：债券 | 7,607,481.30 | 49.31 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 7,735,185.33 | 50.14 |
| 7 | 其他各项资产 | 83,697.34 | 0.54 |
| 8 | 合计 | 15,426,363.97 | 100.00 |

注：本表列示的其他各项资产详见 7.12.3 期末其他各项资产构成。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|
| 1 | 601828 | 美凯龙 | 10,230.00 | 0.05 |

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|
| 1 | 600050 | 中国联通 | 892,110.00 | 3.93 |
| 2 | 601989 | 中国重工 | 853,417.76 | 3.76 |
| 3 | 601088 | 中国神华 | 803,158.00 | 3.54 |
| 4 | 002859 | 洁美科技 | 580,721.40 | 2.56 |
| 5 | 600795 | 国电电力 | 476,771.00 | 2.10 |
| 6 | 002860 | 星帅尔 | 292,702.94 | 1.29 |
| 7 | 600100 | 同方股份 | 55,590.00 | 0.24 |
| 8 | 601828 | 美凯龙 | 20,030.00 | 0.09 |
| 9 | 600025 | 华能水电 | 4,960.00 | 0.02 |

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|--------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 10,230.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,979,461.10 |

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|--------------|
|----|------|------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|--------------|-------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,259,177.50 | 14.93 |
| | 其中：政策性金融债 | 2,259,177.50 | 14.93 |
| 4 | 企业债券 | 2,763,889.60 | 18.26 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,584,414.20 | 17.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 7,607,481.30 | 50.26 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 112352 | 16TCL01 | 15,000 | 1,481,250.00 | 9.79 |
| 2 | 018005 | 国开 1701 | 10,000 | 1,003,800.00 | 6.63 |
| 3 | 128032 | 双环转债 | 9,810 | 965,107.80 | 6.38 |
| 4 | 132015 | 18 中油 EB | 10,000 | 963,600.00 | 6.37 |
| 5 | 136161 | 16 渝交投 | 10,000 | 957,700.00 | 6.33 |

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 2,152.79 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 60,903.77 |
| 5 | 应收申购款 | 20,640.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 83,697.34 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|------------|---------------|
| 1 | 128032 | 双环转债 | 965,107.80 | 6.38 |
| 2 | 132006 | 16 皖新 EB | 496,950.00 | 3.28 |
| 3 | 123006 | 东财转债 | 158,756.40 | 1.05 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|----------|-----------|-------|--------|--------------|---------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 华富元鑫灵活配置混合 A | 1,288 | 5,716.30 | 0.00 | 0.00% | 7,362,598.04 | 100.00% |
| 华富元鑫灵活配置混合 C | 53 | 6,344.03 | 0.00 | 0.00% | 336,233.37 | 100.00% |
| 合计 | 1,341 | 5,741.11 | 0.00 | 0.00% | 7,698,831.41 | 100.00% |

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华富元鑫灵活配置混合 A | - | - |
| | 华富元鑫灵活配置混合 C | 1,000.10 | 0.2974% |
| | 合计 | 1,000.10 | 0.2974% |

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华富元鑫灵活配置混合 A | 华富元鑫灵活配置混合 C |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2016 年 8 月 26 日）基金份额总额 | 120,022,950.07 | 81,321,466.32 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 10,872,798.91 | 971,566.63 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,704,696.62 | 359.22 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 8,214,897.49 | 635,692.48 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7,362,598.04 | 336,233.37 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘张娅女士为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理。

8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。

9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，张惠女士不再担任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

10、本报告期，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|--------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 海通证券 | 1 | 3,050,446.76 | 76.65% | 2,840.92 | 77.02% | - |
| 国盛证券 | 2 | 537,449.64 | 13.51% | 490.88 | 13.31% | - |
| 华安证券 | 2 | 391,564.70 | 9.84% | 356.82 | 9.67% | - |
| 民生证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2)本报告期本基金新增国盛证券 2 个交易单元、浙商证券 1 个交易单元。

3)此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|-------|--------|------|------|-------|
| | 成交金额 | 占当期债券 | 成交金额 | 占当期债 | 成交金额 | 占当期权证 |

| | | 成交总额的比 例 | | 券回购 成交总额 的比例 | | 成交总额的 比例 |
|------|--------------|-------------|--------------|--------------------|---|-------------|
| 海通证券 | 4,689,043.25 | 61.44% | 6,500,000.00 | 100.00% | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 2,943,130.17 | 38.56% | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无