

华富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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	华富灵活配置混合
基金主代码	000398
交易代码	000398
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 7 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	22,683,279.90 份
基金合同存续期	不定期

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	本基金投资策略的基本思想是在充分控制风险的前提下实现高收益。依据风险-收益-投资策略关系原理，本基金采用包括资产配置策略、行业配置策略和个股精选策略在内的多层次复合投资策略进行实际投资，高层策略作用是规避风险，低层策略用于提高收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均预期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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	郭明
	联系电话	021-68886996	(010) 66105798
	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) 66105799

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

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)
本期已实现收益	-1,257,517.10
本期利润	-1,764,158.14
加权平均基金份额本期利润	-0.0769
本期基金份额净值增长率	-7.54%
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	-0.0774
期末基金资产净值	21,406,585.17
期末基金份额净值	0.944

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

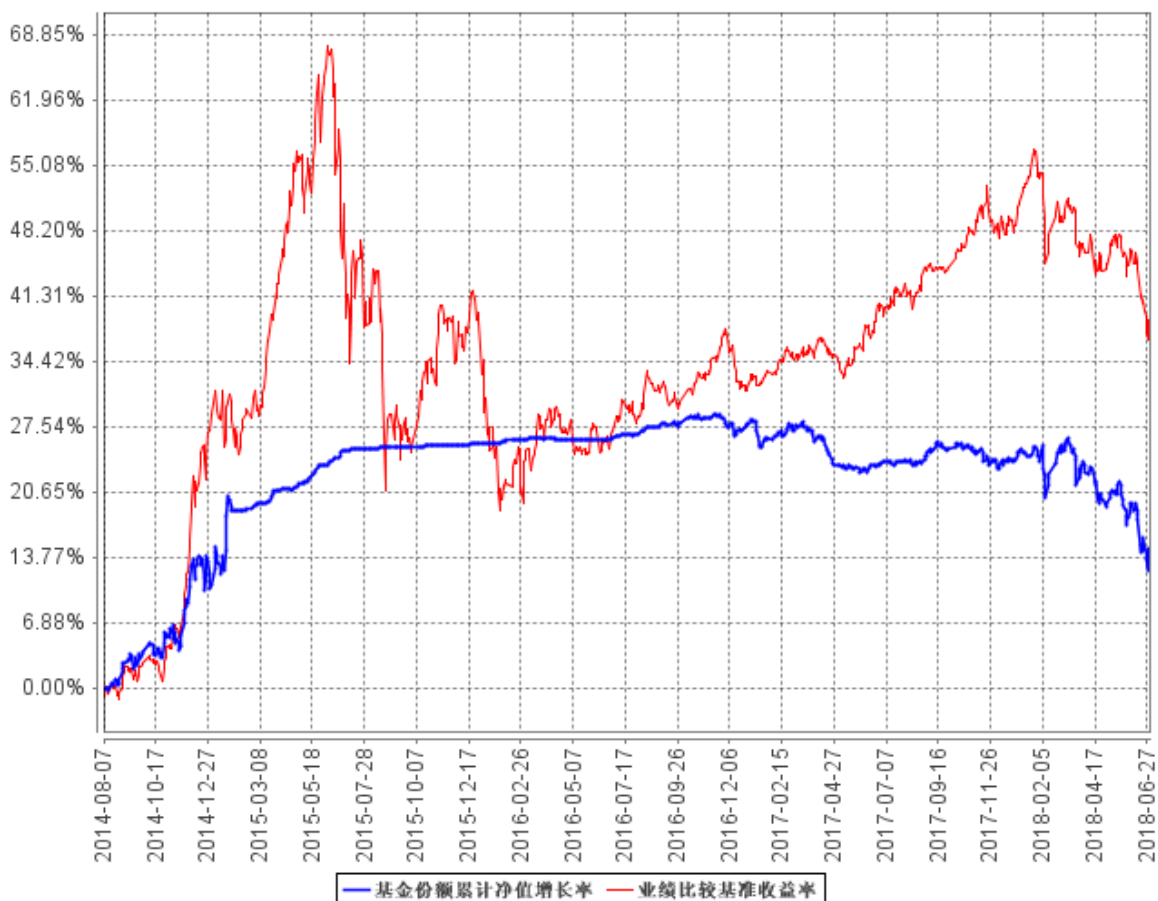
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.98%	0.95%	-4.46%	0.77%	1.48%	0.18%
过去三个月	-7.18%	0.70%	-5.43%	0.68%	-1.75%	0.02%
过去六个月	-7.54%	0.67%	-6.72%	0.69%	-0.82%	-0.02%
过去一年	-7.27%	0.48%	-1.09%	0.57%	-6.18%	-0.09%

过去三年	-8.27%	0.42%	-8.16%	0.89%	-0.11%	-0.47%
自基金合同生效起至今	14.64%	0.46%	38.73%	0.96%	-24.09%	-0.50%

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%，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

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：1、本基金从 2014 年 8 月 7 日起正式转型为华富灵活配置混合型证券投资基金。截止报告期末，本基金转型不满一年。

2、根据《华富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%；债券、货币市场工具、资产支持证券等固定收益类资产占基金资产的 5%-100%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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。本基金合同生效未满一年。本基金投资转型期为 2014 年 8 月 7 日到 2015 年 2 月 7 日，投资转型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《华富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

§ 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 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		
龚炜	华富灵活配置混合型基金基金经理、	2017 年 5 月 9 日	-	十四年	安徽财经大学金融学硕士，研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、

	<p>华富竞争力优选混合型基金经理、华富成长趋势混合型基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金经理、华富国泰民安灵活配置混合型基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金经理、华富物联世界灵活配置混合型基金经理、华富量子生命力混合型基金经理、公司公募投资决策委</p>			<p>天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监，2012 年 9 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理，2014 年 8 月 7 日至 2015 年 2 月 11 日任华富灵活配置混合型基金经理。</p>
--	--	--	--	--

	员会主席、公司副总经理				
翁海波	华富灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富物联世界灵活配置混合型基金基金经理	2017 年 7 月 5 日	-	九年	清华大学工程学硕士，研究生学历，曾任华安证券股份有限公司证券投资部研究员。2012 年 2 月加入华富基金管理有限公司，先后担任助理行业研究员、行业研究员、2014 年 8 月 1 日至 2015 年 12 月 24 日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理助理、2015 年 12 月 25 日至 2017 年 5 月 9 日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理、2016 年 2 月 24 日至 2017 年 5 月 9 日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理。
王翔	-	2016 年 9 月 2 日	2018 年 1 月 25 日	七年	墨尔本大学工程管理学硕士、研究生学历。2010 年 3 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、2014 年 5 月 12 日至 2014 年 11 月 18 日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理助理，2015 年 5 月 11 日至 2017 年 3 月 14 日任华富成长趋势混合型基金基金经理，2016 年 9 月 2 日至 2018 年 1 月 25 日任华富灵活配置混合型基金基金经理，2014 年 11 月 19 日至 2018 年 1 月 25 日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理，2016 年 1 月 21 日至 2018 年 1 月 25 日任华富物联世界灵活配置混合基

					金基金经理，2016 年 12 月 29 日至 2018 年 1 月 25 日任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：这里的任职日期、离任日期是指公司作出决定之日，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

2018 年上半年，宏观经济继续受益上一年供给侧改革、基建地产投资、净出口改善等因素延续了一定韧性，但是在二季度开始出现放缓迹象。货币市场利率中枢下行，且波动率加大。两次降准为经济释放了一定流动性，但对冲作用更为明显。美国通胀预期抬升和中美贸易摩擦的加

剧导致市场出现的几次明显调整，同时一季报白马业绩不及预期、信用债违约增多，人民币贬值等多重负面因素环境下，市场表现弱势格局，股指持续震荡下行。市场在防御性思维模式下，医药、消费表现抢眼，其他板块行情轮动加快，且不持续。

本基金上半年操作延续稳健风格，增加对市场的容忍度，在震荡过程中逐步提升仓位；行业配置方面相对均衡，标的选择上乘承自下而上精选个股的投资策略，综合考虑成长与估值的匹配，侧重配置细分行业龙头；策略上由于热点变幻频繁，适当增强了主题轮动的配置方式。大类行业配置上全面减持了地产、零售、周期，加强了对 TMT、高端制造、食品饮料的配置。综合的策略目标期望能够匹配市场节奏，在有效控制风险的基础上争取回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同 2014 年 8 月 7 日生效，截止 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.944 元，累计份额净值为 1.169 元。本报告期，本基金份额净值增长率为-7.54%，同期业绩比较基准收益率为-6.72%。

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 2018 年下半年，全球复苏延续，但势头有所放缓。主要经济体经济增长和货币政策分化：美国经济增长强劲，加息节奏加快，欧、日复苏稳健，退出宽松步伐放缓。全球贸易冲突升温是下半年最大不确定性；此外，美国无风险收益率的提升速度已经接近超过盈利增速，如美股调整会再次冲击全球权益市场。

下半年国内经济下行压力依然存在，投资、出口、消费走弱趋势显现。近期政策出现转向信号，更加积极的财政政策、松紧适度的货币政策，以及资管新规细则降低过渡期处置压力。在监管放松，信用紧缩压力缓解，和下半年财政政策发力的预期下，经济中的风险以及下行压力有望缓解。但政策具体实施的途径、力度仍需要进一步的落实，同时刺激政策对经济、对股市的边际效应往往也是边际递减的。流动性虽较为乐观，但在强监管背景下，资金脱虚向实仍是方向。总体上政策因素对于市场的扰动持续存在，但是大扰动的风险在下降。总体判断下半年市场环境改善的空间有限，如继续出现超预期的风险事件，在熊市环境下会加大投资者的忧虑，导致风险厌恶情绪增加，仍需要耐心观察与等待时机，下半年大概率维持震荡行情，但是结构性机会依然层出不穷。本基金未来投资策略将淡化风格，强化基本面，重点在于自下而上筛选盈利与估值匹配的个股，期望以此能够持续为持有人获得低风险的绝对回报。未来将重点布局 TMT、高端智能制造、消费、生物医药等行业。

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-1,764,158.14元，期末可供分配利润为-1,755,595.38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 2017 年 5 月 25 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低于五千万元的情形，至本报告期期末（2018 年 6 月 30 日）基金资产净值仍低于 5000 万元。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，本基金托管人在对华富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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华富灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华富基金管理有限公司在华富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，华富灵活配置混合型证券投资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灵活配置混合型证券投资基金 2018 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		5,321,371.72	4,409,164.72
结算备付金		93,698.99	197,961.10
存出保证金		15,622.78	13,941.92
交易性金融资产		15,446,117.58	12,210,419.50
其中：股票投资		9,493,196.78	4,148,594.00
基金投资		-	-
债券投资		5,952,920.80	8,061,825.50
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		-	7,100,000.00
应收证券清算款		586,665.18	-

应收利息		112,417.79	215,924.40
应收股利		-	-
应收申购款		98.52	296.15
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		21,575,992.56	24,147,707.79
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		47,502.01	-
应付赎回款		-	524.93
应付管理人报酬		26,952.35	30,299.90
应付托管费		4,492.07	5,049.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		35,469.94	34,805.41
应交税费		444.86	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		54,546.16	290,000.07
负债合计		169,407.39	360,680.28
所有者权益:			
实收基金		22,683,279.90	23,291,897.60
未分配利润		-1,276,694.73	495,129.91
所有者权益合计		21,406,585.17	23,787,027.51
负债和所有者权益总计		21,575,992.56	24,147,707.79

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.944 元，基金份额总额 22,683,279.90 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		-1,353,302.64	-3,164,689.71

1.利息收入		207,429.48	1,555,170.36
其中：存款利息收入		25,327.86	211,875.30
债券利息收入		166,229.79	769,026.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		15,871.83	574,268.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,054,343.68	-4,340,127.04
其中：股票投资收益		-1,178,283.72	-3,773,977.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-16,392.03	-593,749.56
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		140,332.07	27,600.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-506,641.04	-409,620.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		252.60	29,887.24
减：二、费用		410,855.50	1,810,299.77
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	171,232.07	1,039,991.40
2. 托管费	6.4.8.2.2	28,538.68	173,331.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		136,770.07	432,640.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		73,789.16	164,335.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,764,158.14	-4,974,989.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,764,158.14	-4,974,989.48

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)	23,291,897.60	495,129.91	23,787,027.51
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	-1,764,158.14	-1,764,158.14
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)	-608,617.70	-7,666.50	-616,284.20
其中: 1.基金申购款	140,171.86	1,289.25	141,461.11
2.基金赎回款	-748,789.56	-8,955.75	-757,745.31
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)	22,683,279.90	-1,276,694.73	21,406,585.17
	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)	179,075,009.66	9,155,606.08	188,230,615.74
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期净利润)	-	-4,974,989.48	-4,974,989.48
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)	-133,515,870.26	-3,348,200.19	-136,864,070.45
其中: 1.基金申购款	167,166.65	5,977.92	173,144.57
2.基金赎回款	-133,683,036.91	-3,354,178.11	-137,037,215.02
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)	45,559,139.40	832,416.41	46,391,555.81

注: 后附报表附注为本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：

_____ 章宏韬	_____ 余海春	_____ 陈大毅
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

华富灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）系由华富恒鑫债券型证券投资基金转型，经中国证监会中国证监会证券投资基金机构监管部《关于华富恒鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（证券投资基金机构监管部部函（2014）922 号）的确认，基金合同于 2014 年 8 月 7 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。基金管理人为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。

根据《华富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资范围为：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
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 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	16,828,745.29	18.12%	159,105,952.76	57.67%

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

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	6,900,000.00	26.74%	2,042,000,000.00	48.30%

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	15,672.55	18.31%	-	-
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	146,693.01	56.92%	22,874.72	57.59%

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	171,232.07	1,039,991.40
其中：支付销售机构的 客户维护费	17,823.31	31,259.74

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 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	28,538.68	173,331.91

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 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）。

6.4.8.3 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（ 2014 年 8 月 7 日）持有的 基金份额	-	-

期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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自有资金投资本基金。

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
	中国工商银行 股份有限公司	5,321,371.72	24,172.84	34,475,473.26

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	9,493,196.78	44.00
	其中：股票	9,493,196.78	44.00
2	固定收益投资	5,952,920.80	27.59
	其中：债券	5,952,920.80	27.59
	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	5,415,070.71	25.10
7	其他各项资产	714,804.27	3.31
8	合计	21,575,992.56	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	416,700.00	1.95
C	制造业	7,071,507.78	33.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	525,654.00	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,048,047.00	4.90
J	金融业	431,288.00	2.01
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,493,196.78	44.35

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	25,800	719,820.00	3.36
2	600031	三一重工	77,000	690,690.00	3.23
3	600498	烽火通信	27,700	688,345.00	3.22
4	300014	亿纬锂能	36,700	645,920.00	3.02
5	300377	赢时胜	42,800	581,652.00	2.72
6	002078	太阳纸业	59,200	573,648.00	2.68
7	603900	莱绅通灵	26,100	525,654.00	2.46

8	300037	新宙邦	18,300	490,257.00	2.29
9	600845	宝信软件	17,700	466,395.00	2.18
10	002384	东山精密	18,700	448,800.00	2.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	000672	上峰水泥	1,160,076.00	4.88
2	603005	晶方科技	1,066,805.00	4.48
3	002241	歌尔股份	1,060,758.00	4.46
4	002146	荣盛发展	955,609.00	4.02
5	601318	中国平安	941,586.00	3.96
6	000725	京东方 A	937,176.00	3.94
7	600703	三安光电	930,412.00	3.91
8	300604	长川科技	917,367.00	3.86
9	601699	潞安环能	914,850.00	3.85
10	002384	东山精密	863,316.00	3.63
11	002340	格林美	807,202.00	3.39
12	600029	南方航空	802,953.00	3.38
13	600352	浙江龙盛	715,937.00	3.01
14	600566	济川药业	715,621.00	3.01
15	601166	兴业银行	714,539.00	3.00
16	601009	南京银行	713,691.00	3.00
17	600581	八一钢铁	712,154.00	2.99
18	600585	海螺水泥	711,239.00	2.99
19	000970	中科三环	711,113.00	2.99
20	000063	中兴通讯	710,066.00	2.99
21	002108	沧州明珠	706,956.00	2.97
22	600030	中信证券	704,959.00	2.96
23	000910	大亚圣象	703,114.00	2.96
24	000998	隆平高科	696,067.00	2.93

25	300288	朗玛信息	690,112.00	2.90
26	300377	赢时胜	674,025.00	2.83
27	600887	伊利股份	671,699.00	2.82
28	002078	太阳纸业	667,388.00	2.81
29	603986	兆易创新	667,200.00	2.80
30	603900	莱绅通灵	664,838.00	2.79
31	300014	亿纬锂能	664,078.00	2.79
32	600031	三一重工	651,896.43	2.74
33	600498	烽火通信	637,032.00	2.68
34	601100	恒立液压	627,737.00	2.64
35	300545	联得装备	480,221.00	2.02
36	600452	涪陵电力	480,190.00	2.02
37	300415	伊之密	478,770.00	2.01
38	002368	太极股份	478,525.00	2.01
39	600018	上港集团	477,620.00	2.01
40	603757	大元泵业	477,597.00	2.01
41	601336	新华保险	477,081.00	2.01

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	000672	上峰水泥	1,141,836.00	4.80
2	002241	歌尔股份	1,131,061.76	4.75
3	600859	王府井	1,071,548.12	4.50
4	300604	长川科技	1,017,116.00	4.28
5	603005	晶方科技	968,130.00	4.07
6	600028	中国石化	934,139.45	3.93
7	600703	三安光电	924,688.00	3.89
8	002146	荣盛发展	914,460.00	3.84
9	601318	中国平安	896,214.00	3.77
10	002385	大北农	797,229.00	3.35
11	600581	八一钢铁	797,112.08	3.35
12	600029	南方航空	766,920.00	3.22
13	600566	济川药业	763,190.00	3.21

14	600030	中信证券	742,840.00	3.12
15	000063	中兴通讯	739,989.00	3.11
16	000725	京东方 A	735,588.00	3.09
17	601009	南京银行	724,715.00	3.05
18	600352	浙江龙盛	724,272.00	3.04
19	601166	兴业银行	697,296.00	2.93
20	603986	兆易创新	688,396.00	2.89
21	000970	中科三环	687,015.56	2.89
22	600585	海螺水泥	663,893.76	2.79
23	000910	大亚圣象	662,043.00	2.78
24	002108	沧州明珠	638,172.00	2.68
25	601100	恒立液压	618,181.00	2.60
26	000998	隆平高科	609,400.00	2.56
27	300288	朗玛信息	578,396.00	2.43
28	601088	中国神华	563,252.00	2.37
29	002419	天虹股份	558,544.00	2.35
30	603223	恒通股份	546,321.57	2.30
31	300188	美亚柏科	513,206.00	2.16
32	300097	智云股份	507,292.00	2.13
33	601919	中远海控	496,405.00	2.09
34	600018	上港集团	488,976.00	2.06
35	601336	新华保险	488,834.00	2.06
36	002709	天赐材料	488,477.49	2.05
37	000717	韶钢松山	484,116.00	2.04
38	603757	大元泵业	481,484.00	2.02

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	49,951,728.01
卖出股票收入（成交）总额	42,932,529.30

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,002,800.00	18.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,950,120.80	9.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,952,920.80	27.81

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	122124	11 中化 02	20,000	2,003,800.00	9.36
2	122366	14 武钢债	20,000	1,999,000.00	9.34
3	132009	17 中油 EB	20,030	1,950,120.80	9.11

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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	15,622.78
2	应收证券清算款	586,665.18
3	应收股利	-
4	应收利息	112,417.79
5	应收申购款	98.52
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	714,804.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

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
275	82,484.65	17,996,685.86	79.34%	4,686,594.04	20.66%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	13,974.42	0.0616%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年8月7日）基金份额总额	41,515,113.95
本报告期期初基金份额总额	23,291,897.60
本报告期基金总申购份额	140,171.86
减：本报告期基金总赎回份额	748,789.56
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	22,683,279.90

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、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
东方证券	1	27,253,685.05	29.34%	24,836.36	29.02%	-

太平洋证券	2	24,348,254.10	26.21%	22,498.76	26.28%	-
华安证券	2	16,828,745.29	18.12%	15,672.55	18.31%	-
西南证券	1	9,983,727.38	10.75%	9,297.90	10.86%	-
长江证券	1	6,204,450.06	6.68%	5,654.17	6.61%	-
招商证券	2	5,226,287.43	5.63%	4,867.21	5.69%	-
浙商证券	1	1,645,166.00	1.77%	1,499.26	1.75%	-
中泰证券	1	1,393,942.00	1.50%	1,270.28	1.48%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

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），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，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几家券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金交易单元新增浙商证券一个交易单元, 退租浙商证券一个交易单元。

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	18,900,000.00	73.26%	-	-
华安证券	-	-	6,900,000.00	26.74%	-	-
西南证券	2,002,816.16	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

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

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	1.1-6.30	17,996,685.86	0.00	0.00	17,996,685.86	79.34%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
