

华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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 27 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 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54

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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华润元大安鑫灵活配置混合
基金主代码	000273
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 18 日
基金管理人	华润元大基金管理有限公司
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	67,916,476.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金根据对宏观经济形势的研究，判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势，积极把握股票、债券等市场发展趋势，注重大类资产配置轮换特征、重点挖掘价值低洼，在适度控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人对大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。 2、股票投资策略 本基金将运用“价值和成长并重”的投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。 3、债券投资策略 本基金将采用“自上而下”的投资策略，对债券类资产进行合理有效的配置，并在配置框架下进行具有针对性的券种选择。 4、权证投资策略 本基金以被动投资权证为主要策略，包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益。同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，主动进行部分权证投资。

	5、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+中债综合指数收益率×65%
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与货币市场基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

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		华润元大基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘豫皓	贺倩
	联系电话	0755-88399015	010-66060069
	电子邮箱	lyh@cryuantafund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4000-1000-89	95599
传真		0755-88399045	010-68121816
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座 7 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		518048	100031
法定代表人		邹新	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cryuantafund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座 7 层

§ 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 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,435,554.07
本期利润	4,167,950.98
加权平均基金份额本期利润	0.2086
本期加权平均净值利润率	17.50%
本期基金份额净值增长率	15.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,648,344.22
期末可供分配基金份额利润	0.0537
期末基金资产净值	83,088,155.87
期末基金份额净值	1.223
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	86.38%

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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

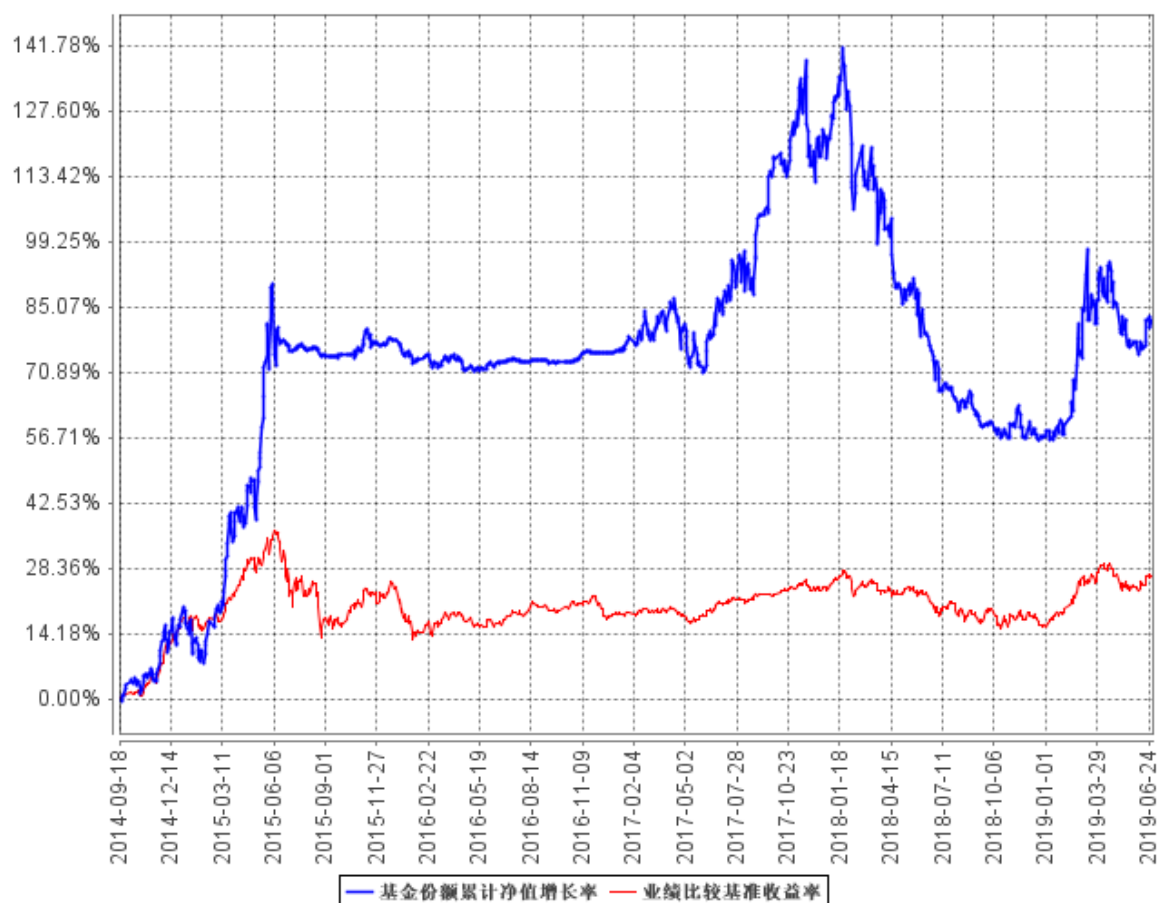
3.2 基金净值表现

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	2.43%	0.81%	2.07%	0.40%	0.36%	0.41%
过去三个月	-2.39%	1.21%	-0.41%	0.52%	-1.98%	0.69%
过去六个月	15.70%	1.53%	9.28%	0.53%	6.42%	1.00%
过去一年	5.16%	1.14%	5.63%	0.52%	-0.47%	0.62%
过去三年	4.94%	1.07%	8.14%	0.39%	-3.20%	0.68%
自基金合同 生效起至今	86.38%	1.07%	30.75%	0.51%	55.63%	0.56%

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



§ 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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 3 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司和台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51% 和 49%。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理十一只开放式基金：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金，华润元大现金收益货币市场基金，华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金，华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金，华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金，华润元大稳健收益债券型证券投资基金，华润元大中创 100 指数型证券投资基金，华润元大现金货币市场基金，华润元大润鑫债券型证券投资基金，华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金，华润元大润泽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		
刘宏毅	本基金基金经理、研究部副总经理	2018 年 1 月 18 日	—	9 年	中国，复旦大学发展经济学硕士，具有基金从业资格。曾任湘财证券有限责任公司研究员、信诚基金管理有限公司宏观分析师。2017 年 7 月 17 日加入公司，现任研究部副总经理；2018 年 1 月 18 日担任华润元大安鑫灵活配置混合型投资基金基金经理；2018 年 6 月 14 日担任华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金经理；2019 年 2 月 14 日担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理。
袁华涛	本基金基金经理、权益投资部副经理	2015 年 9 月 16 日	—	9 年	中国，西南财经大学金融学博士，具有基金从业资格。曾任华泰证券股份有限公司研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司

	理				司量化投资经理。2015 年 7 月 20 日加入公司，现任权益投资部副总经理；2015 年 9 月 16 日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理；2016 年 8 月 5 日起担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有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

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

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。基金管理人管理的所有投资组合未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，A 股市场波动增大，年初反映复苏预期后再因贸易战而剧烈波动。截至 6 月底，上证 50 涨幅 27.80%（振幅 34.86%），上证综指涨幅 19.45%（振幅 33.98%），沪深 300 涨幅 27.07%（振幅 39.53%），创业板指涨幅 20.87%（振幅 47.20%），中证 1000 涨幅 21.06%（振幅 43%）。中信一级行业，食品饮料上涨 60.9%、非银金融上涨 44.69%、农林牧渔上涨 43.28%，涨幅靠前；而建筑涨幅 6.58%，传媒上涨 7.97%，汽车涨幅 9.85% 涨幅靠后。申万风格指数方面，2019 年 6 月月月底高市净率指数上涨 37.05%，绩优股指数上涨 37.63%，而微利股指数上涨 19.32%，亏损股指数上涨 23.05%。2019 年上半年，在市场剧烈波动中，本基金在控制回撤的基础上，适时增配股

票投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.223 元，报告期内的份额净值增长率 15.70%，同期业绩比较基准收益率为 9.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年下半年，海外形势仍存不确定性，但国内经济不乏亮点：贸易摩擦或有缓解但难以彻底消除，压制全球经济增长预期；产业转移和科创政策导向，在加速改变国内经济结构。整体来看，内部宏观政策保持定力，控制杠杆风险同时避免因控制风险而产生的风险，整体环境趋于平稳，好于预期；产业升级从原本的政策推动，变成在压力下企业自发的行为，产业升级加快。A 股市场韧性增强，虽有波动，更多结构机会将带来活力。A 股蓝筹估值稳定，而成长股的 5G 产业链、新能源以及新消费相关的领域有较大投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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，符合相关法规及基金合同的规定。

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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2019 年 1 月 2 日至 6 月 18 日。经过基金管理人积极地持续营销，截至本报告期末，本基金资产净值已超过五千万元。本报告期内，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的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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—华润元大基金管理有限公司 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，华润元大基金管理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

本托管人认为，华润元大基金管理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》及其他相关法律法规的规定，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，未发现有关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：华润元大安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

资 产	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	10,056,911.05	8,026,524.30
结算备付金		243,334.68	350,726.26
存出保证金		83,720.74	46,272.42
交易性金融资产	6.4.7.2	73,931,759.96	2,838,852.00
其中：股票投资		73,931,759.96	2,838,852.00
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	1,500,000.00
应收证券清算款		-	5,308,135.14
应收利息	6.4.7.5	2,199.83	2,573.25
应收股利		-	-
应收申购款		12,180.13	99.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		84,330,106.39	18,073,183.25
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		-	-
应付证券清算款		798,966.88	-
应付赎回款		98,539.18	4,914.70
应付管理人报酬		50,043.60	21,230.38
应付托管费		7,149.10	3,032.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	212,187.71	85,907.95
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	75,064.05	100,000.00
负债合计		1,241,950.52	215,085.91
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	67,916,476.93	16,889,615.05
未分配利润	6.4.7.10	15,171,678.94	968,482.29
所有者权益合计		83,088,155.87	17,858,097.34
负债和所有者权益总计		84,330,106.39	18,073,183.25

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.223 元，基金份额总额 67,916,476.93 份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大安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		5,094,190.82	-4,919,284.16
1.利息收入		43,766.01	55,072.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	28,718.52	23,471.55
债券利息收入		4,619.32	13,656.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,428.17	17,944.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,224,223.83	-4,536,783.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,010,274.33	-4,608,144.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-28,479.80	2,721.00
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	242,429.30	68,640.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,732,396.91	-535,743.12
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	93,804.07	98,169.60
减：二、费用		926,239.84	874,945.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	163,020.20	187,960.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	23,288.63	26,851.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	693,242.48	569,691.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	46,688.53	90,441.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,167,950.98	-5,794,229.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,167,950.98	-5,794,229.23

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华润元大安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）	16,889,615.05	968,482.29	17,858,097.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,167,950.98	4,167,950.98
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）	51,026,861.88	10,035,245.67	61,062,107.55
其中：1.基金申购款	58,751,815.84	11,778,609.08	70,530,424.92
2.基金赎回款	-7,724,953.96	-1,743,363.41	-9,468,317.37
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）	67,916,476.93	15,171,678.94	83,088,155.87
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)	24,966,306.14	12,200,332.61	37,166,638.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,794,229.23	-5,794,229.23
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)	-6,918,460.37	-3,455,437.71	-10,373,898.08
其中：1.基金申购款	10,055,973.87	4,095,986.27	14,151,960.14
2.基金赎回款	-16,974,434.24	-7,551,423.98	-24,525,858.22
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)	18,047,845.77	2,950,665.67	20,998,511.44

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：

<u>李仆</u>	<u>黄晓芳</u>	<u>黄晓芳</u>
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

华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。华润元大保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2013]872 号文予以募集注册,自 2013 年 8 月 19 日至 2013 年 9 月 6 日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为 6,465 户,募集资金及其产生的利息共计 630,303,516.04 元,折合基金份额 630,303,516.04 份,于 2013 年 9 月 11 日基金合同正式生效。根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,2014 年 9 月 11 日,华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后,未能符合保本基金存续条件,自 2014 年 9 月 18 日起变更为本基金。同时,基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改为《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。上述变更无须经基金份额持有人大会决议,在报中国证监会备案后,提前在临时公告或《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中予以说明。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大安鑫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，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、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、银行存款等固定收益类资产、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投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本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%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×35%+中债综合指数收益率×65%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

—

6.4.5.2 会计估计变更的说明

—

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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。

(3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	10,056,911.05
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	10,056,911.05

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	72,046,887.43	73,931,759.96	1,884,872.53
贵金属投资-金交所	—	—	—

黄金合约				
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		72,046,887.43	73,931,759.96	1,884,872.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,067.35
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	98.55
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	33.93
合计	2,199.83

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	212,187.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	212,187.71

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	268.86
预提审计费	74,795.19
合计	75,064.05

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,889,615.05	16,889,615.05
本期申购	58,751,815.84	58,751,815.84
本期赎回 (以“-”号填列)	-7,724,953.96	-7,724,953.96
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	67,916,476.93	67,916,476.93

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,359,121.90	2,327,604.19	968,482.29
本期利润	2,435,554.07	1,732,396.91	4,167,950.98
本期基金份额交易产生的变动数	2,571,912.05	7,463,333.62	10,035,245.67
其中：基金申购款	3,129,065.71	8,649,543.37	11,778,609.08
基金赎回款	-557,153.66	-1,186,209.75	-1,743,363.41

本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,648,344.22	11,523,334.72	15,171,678.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	24,979.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,221.22
其他	518.29
合计	28,718.52

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	205,769,485.07
减：卖出股票成本总额	202,759,210.74
买卖股票差价收入	3,010,274.33

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-28,479.80
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-28,479.80

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	9,875,013.31

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,886,281.20
减：应收利息总额	17,211.91
买卖债券差价收入	-28,479.80

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

—

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

—

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

—

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

—

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

—

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	242,429.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	242,429.30

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,732,396.91
——股票投资	1,732,396.91
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,732,396.91

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	43,792.44
其他收入_转换费	11.63
其他收入_其他	50,000.00
合计	93,804.07

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	693,242.48
银行间市场交易费用	-
合计	693,242.48

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	—
银行汇划费	3,293.34
账户维护费	18,000.00
其他费用_其他	600.00
合计	46,688.53

6.4.7.21 分部报告

—

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	163,020.20	187,960.46
其中：支付销售机构的客户维护费	43,191.10	56,139.42

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.40% 的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.40%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 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	23,288.63	26,851.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

—

6.4.10.3 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债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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持有本基金。

6.4.10.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	10,056,911.05	24,979.01	5,477,709.95	19,227.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.14 金融工具风险及管理

—

6.4.14.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，监察合规部和各业务部门构成的四级风

险管理架构体系。

6.4.14.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2018 年 12 月 31 日：无）。

6.4.14.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

—

6.4.14.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

—

6.4.14.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

—

6.4.14.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

—

6.4.14.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

—

6.4.14.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

—

6.4.14.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风

险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所投资证券均在证券交易所或银行间市场交易，能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.14.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

—

6.4.14.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所投资证券均在证券交易所或银行间市场交易，能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.14.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.14.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.14.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	10,056,911.05	-	-	-	-	10,056,911.05
结算备付金	243,334.68	-	-	-	-	243,334.68
存出保证金	83,720.74	-	-	-	-	83,720.74
交易性金融资产	-	-	-	-	73,931,759.96	73,931,759.96
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	2,199.83	2,199.83
应收申购款	-	-	-	-	12,180.13	12,180.13
资产总计	10,383,966.47	-	-	-	73,946,139.92	84,330,106.39
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	798,966.88	798,966.88
应付赎回款	-	-	-	-	98,539.18	98,539.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	50,043.60	50,043.60
应付托管费	-	-	-	-	7,149.10	7,149.10
应付交易费用	-	-	-	-	212,187.71	212,187.71
其他负债	-	-	-	-	75,064.05	75,064.05
负债总计	-	-	-	-	1,241,950.52	1,241,950.52
利率敏感度缺口	10,383,966.47	-	-	-	-	-
上年度末 2018 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	8,026,524.30	-	-	-	-	8,026,524.30
结算备付金	350,726.26	-	-	-	-	350,726.26
存出保证金	46,272.42	-	-	-	-	46,272.42
交易性金融资产	-	-	-	-	2,838,852.00	2,838,852.00
买入返售金融资产	1,500,000.00	-	-	-	-	1,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	5,308,135.14	5,308,135.14
应收利息	-	-	-	-	2,573.25	2,573.25
应收申购款	-	-	-	-	99.88	99.88
资产总计	9,923,522.98	-	-	-	8,149,660.27	18,073,183.25
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	4,914.70	4,914.70

应付管理人报酬	-	-	-	-	21,230.38	21,230.38
应付托管费	-	-	-	-	3,032.88	3,032.88
应付交易费用	-	-	-	-	85,907.95	85,907.95
其他负债	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	215,085.91	215,085.91
利率敏感度缺口	9,923,522.98	-	-	-	-	-

6.4.14.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）	
	市场利率增加 25 个 基准点	-	-	-
	市场利率减少 25 个 基准点	-	-	-

注：本期末本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.14.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证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。

6.4.14.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	73,931,759.96	88.98	2,838,852.00	15.90
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	73,931,759.96	88.98	2,838,852.00	15.90

6.4.14.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5	3,559,349.77	58,619.06
	沪深 300 指数下降 5	-3,559,349.77	-58,619.06

6.4.14.4.4 采用风险价值法管理风险

-

6.4.15 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	73,931,759.96	87.67
	其中：股票	73,931,759.96	87.67
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	10,300,245.73	12.21
7	其他各项资产	98,100.70	0.12
8	合计	84,330,106.39	100.00

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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	2,769,110.00	3.33
C	制造业	23,464,468.00	28.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	3,296,621.00	3.97
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	644,620.00	0.78
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	813,120.00	0.98
J	金融业	39,727,292.36	47.81
K	房地产业	2,064,078.60	2.48
L	租赁和商务服务业	1,152,450.00	1.39
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	73,931,759.96	88.98

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	94,700	8,391,367.00	10.10
2	600519	贵州茅台	7,300	7,183,200.00	8.65
3	600036	招商银行	146,600	5,274,668.00	6.35
4	600887	伊利股份	105,000	3,508,050.00	4.22
5	601166	兴业银行	178,000	3,255,620.00	3.92
6	601628	中国人寿	113,300	3,208,656.00	3.86
7	600276	恒瑞医药	41,000	2,706,000.00	3.26
8	600030	中信证券	110,000	2,619,100.00	3.15
9	601601	中国太保	62,936	2,297,793.36	2.77
10	601328	交通银行	370,000	2,264,400.00	2.73
11	600016	民生银行	343,200	2,179,320.00	2.62
12	600703	三安光电	185,000	2,086,800.00	2.51
13	601988	中国银行	465,200	1,739,848.00	2.09
14	601668	中国建筑	300,000	1,725,000.00	2.08
15	600585	海螺水泥	39,600	1,643,400.00	1.98
16	600104	上汽集团	63,000	1,606,500.00	1.93
17	600000	浦发银行	136,200	1,590,816.00	1.91
18	601398	工商银行	214,900	1,265,761.00	1.52
19	600048	保利地产	98,000	1,250,480.00	1.51
20	601888	中国国旅	13,000	1,152,450.00	1.39
21	601766	中国中车	135,000	1,092,150.00	1.31
22	601211	国泰君安	58,300	1,069,805.00	1.29
23	600028	中国石化	185,000	1,011,950.00	1.22
24	601818	光大银行	240,000	914,400.00	1.10
25	601939	建设银行	122,600	912,144.00	1.10
26	601857	中国石油	132,000	908,160.00	1.09
27	601229	上海银行	74,400	881,640.00	1.06
28	600309	万华化学	20,000	855,800.00	1.03
29	601688	华泰证券	38,000	848,160.00	1.02
30	600690	青岛海尔	48,000	829,920.00	1.00

31	600340	华夏幸福	24,980	813,598.60	0.98
32	600050	中国联通	132,000	813,120.00	0.98
33	600019	宝钢股份	120,000	780,000.00	0.94
34	601390	中国中铁	106,800	696,336.00	0.84
35	600029	南方航空	83,500	644,620.00	0.78
36	601989	中国重工	110,800	616,048.00	0.74
37	601088	中国神华	30,000	611,400.00	0.74
38	600196	复星医药	22,000	556,600.00	0.67
39	601336	新华保险	9,800	539,294.00	0.65
40	601186	中国铁建	52,700	524,365.00	0.63
41	601319	中国人保	50,000	474,500.00	0.57
42	601800	中国交建	31,000	350,920.00	0.42
43	603993	洛阳钼业	60,000	237,600.00	0.29

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	601318	中国平安	9,288,106.57	52.01
2	600887	伊利股份	7,505,895.80	42.03
3	603986	兆易创新	7,401,848.60	41.45
4	600519	贵州茅台	6,992,445.00	39.16
5	603501	韦尔股份	6,686,801.00	37.44
6	603160	汇顶科技	5,445,358.00	30.49
7	600036	招商银行	5,420,394.00	30.35
8	002405	四维图新	4,731,741.00	26.50
9	300567	精测电子	4,319,688.00	24.19
10	002371	北方华创	4,313,107.00	24.15
11	300604	长川科技	4,197,205.30	23.50
12	601799	星宇股份	3,516,026.76	19.69
13	601628	中国人寿	3,350,113.80	18.76
14	603186	华正新材	3,256,235.00	18.23
15	601166	兴业银行	3,239,488.00	18.14
16	600088	中视传媒	3,213,076.00	17.99
17	603019	中科曙光	3,191,950.00	17.87
18	300014	亿纬锂能	2,954,963.10	16.55

19	000625	长安汽车	2,926,356.00	16.39
20	600872	中炬高新	2,738,191.00	15.33
21	002475	立讯精密	2,654,628.00	14.87
22	603197	保隆科技	2,648,994.60	14.83
23	002415	海康威视	2,644,660.00	14.81
24	002419	天虹股份	2,588,656.00	14.50
25	600276	恒瑞医药	2,506,919.00	14.04
26	600340	华夏幸福	2,495,229.40	13.97
27	600030	中信证券	2,322,300.00	13.00
28	601328	交通银行	2,286,600.00	12.80
29	601601	中国太保	2,244,727.20	12.57
30	600016	民生银行	2,185,646.00	12.24
31	600703	三安光电	2,133,050.00	11.94
32	000333	美的集团	2,087,698.00	11.69
33	601633	长城汽车	2,055,996.67	11.51
34	600104	上汽集团	2,026,461.00	11.35
35	300661	圣邦股份	1,936,074.00	10.84
36	002023	海特高新	1,892,052.00	10.59
37	600585	海螺水泥	1,889,470.00	10.58
38	601398	工商银行	1,864,649.00	10.44
39	600547	山东黄金	1,837,657.32	10.29
40	300498	温氏股份	1,779,296.00	9.96
41	600029	南方航空	1,764,300.00	9.88
42	601988	中国银行	1,750,012.00	9.80
43	000975	银泰资源	1,748,215.00	9.79
44	601668	中国建筑	1,740,727.00	9.75
45	300347	泰格医药	1,722,864.07	9.65
46	600584	长电科技	1,677,229.00	9.39
47	000961	中南建设	1,674,639.00	9.38
48	300450	先导智能	1,653,371.12	9.26
49	002920	德赛西威	1,649,646.00	9.24
50	300568	星源材质	1,636,970.00	9.17
51	002156	通富微电	1,628,200.00	9.12
52	603000	人民网	1,575,554.00	8.82
53	600000	浦发银行	1,572,178.00	8.80
54	603515	欧普照明	1,569,759.60	8.79

55	300373	扬杰科技	1,565,205.00	8.76
56	002311	海大集团	1,497,721.00	8.39
57	601336	新华保险	1,476,757.00	8.27
58	002886	沃特股份	1,476,594.00	8.27
59	000977	浪潮信息	1,448,216.00	8.11
60	300601	康泰生物	1,435,519.00	8.04
61	300691	联合光电	1,408,108.00	7.88
62	002705	新宝股份	1,392,944.00	7.80
63	300471	厚普股份	1,360,534.00	7.62
64	300630	普利制药	1,343,160.00	7.52
65	600640	号百控股	1,335,577.00	7.48
66	300308	中际旭创	1,335,545.00	7.48
67	600996	贵广网络	1,333,148.00	7.47
68	600418	江淮汽车	1,325,200.00	7.42
69	603517	绝味食品	1,319,557.00	7.39
70	600690	海尔智家	1,309,110.00	7.33
71	601818	光大银行	1,276,000.00	7.15
72	603658	安图生物	1,275,914.95	7.14
73	601766	中国中车	1,268,762.00	7.10
74	600163	中闽能源	1,265,181.00	7.08
75	300435	中泰股份	1,248,865.00	6.99
76	600048	保利地产	1,247,620.00	6.99
77	300496	中科创达	1,235,426.00	6.92
78	601229	上海银行	1,229,703.00	6.89
79	002733	雄韬股份	1,222,474.00	6.85
80	603939	益丰药房	1,214,441.00	6.80
81	300676	华大基因	1,208,350.00	6.77
82	300639	凯普生物	1,199,012.00	6.71
83	601857	中国石油	1,175,910.00	6.58
84	300400	劲拓股份	1,171,239.00	6.56
85	002773	康弘药业	1,166,882.00	6.53
86	600332	白云山	1,160,550.00	6.50
87	300685	艾德生物	1,147,000.00	6.42
88	600115	东方航空	1,144,700.00	6.41
89	600422	昆药集团	1,140,629.00	6.39
90	002938	鹏鼎控股	1,137,874.00	6.37

91	002241	歌尔股份	1,127,560.00	6.31
92	601688	华泰证券	1,124,620.00	6.30
93	601939	建设银行	1,108,470.00	6.21
94	002185	华天科技	1,071,000.00	6.00
95	300623	捷捷微电	1,069,928.00	5.99
96	002368	太极股份	1,051,480.00	5.89
97	601169	北京银行	1,051,200.00	5.89
98	601888	中国国旅	1,018,320.00	5.70
99	601100	恒立液压	994,000.00	5.57
100	601211	国泰君安	977,937.00	5.48
101	600028	中国石化	970,950.00	5.44
102	000921	海信家电	896,790.00	5.02
103	603288	海天味业	858,712.69	4.81
104	300750	宁德时代	844,397.00	4.73
105	600050	中国联通	825,540.00	4.62
106	600309	万华化学	798,388.00	4.47
107	600885	宏发股份	788,536.00	4.42
108	600019	宝钢股份	774,400.00	4.34
109	002407	多氟多	772,500.00	4.33
110	002032	苏泊尔	737,503.00	4.13
111	300454	深信服	736,281.00	4.12
112	601390	中国中铁	699,648.00	3.92
113	002557	洽洽食品	681,641.00	3.82
114	600073	上海梅林	679,014.00	3.80
115	603313	梦百合	677,253.00	3.79
116	300413	芒果超媒	677,154.00	3.79
117	002739	万达电影	668,130.00	3.74
118	000560	我爱我家	649,750.00	3.64
119	002332	仙琚制药	645,726.00	3.62
120	000568	泸州老窖	643,997.00	3.61
121	002714	牧原股份	632,000.00	3.54
122	002812	恩捷股份	626,415.00	3.51
123	002675	东诚药业	617,600.00	3.46
124	600779	水井坊	613,820.00	3.44
125	000063	中兴通讯	612,800.00	3.43
126	600977	中国电影	604,200.00	3.38

127	300702	天宇股份	598,890.00	3.35
128	300540	深冷股份	597,370.00	3.35
129	601989	中国重工	597,036.00	3.34
130	600732	ST 新梅	595,288.00	3.33
131	300747	锐科激光	595,270.00	3.33
132	300177	中海达	595,070.00	3.33
133	603214	爱婴室	593,649.00	3.32
134	601088	中国神华	592,262.72	3.32
135	300073	当升科技	584,226.00	3.27
136	300015	爱尔眼科	578,179.00	3.24
137	002049	紫光国微	576,872.00	3.23
138	603609	禾丰牧业	562,795.52	3.15
139	002690	美亚光电	558,083.00	3.13
140	000418	小天鹅 A	556,150.00	3.11
141	000043	中航善达	543,121.00	3.04
142	600859	王府井	537,600.00	3.01
143	600196	复星医药	532,360.00	2.98
144	601186	中国铁建	530,931.00	2.97
145	600831	广电网络	528,959.00	2.96
146	002439	启明星辰	522,670.00	2.93
147	600570	恒生电子	522,536.00	2.93
148	300047	天源迪科	521,128.00	2.92
149	002110	三钢闽光	520,087.00	2.91
150	600507	方大特钢	519,098.00	2.91
151	000426	兴业矿业	518,720.00	2.90
152	600850	华东电脑	517,809.00	2.90
153	002912	中新赛克	517,679.00	2.90
154	000066	中国长城	513,780.00	2.88
155	000401	冀东水泥	511,500.00	2.86
156	300463	迈克生物	508,868.00	2.85
157	002050	三花智控	505,720.00	2.83
158	002008	大族激光	502,740.00	2.82
159	603886	元祖股份	499,938.00	2.80
160	603881	数据港	498,470.00	2.79
161	002180	纳思达	498,300.00	2.79
162	300136	信维通信	493,380.00	2.76

163	002341	新纶科技	491,970.00	2.75
164	300383	光环新网	487,550.00	2.73
165	601319	中国人保	476,900.00	2.67
166	600845	宝信软件	476,360.00	2.67
167	600673	东阳光	473,500.00	2.65
168	603690	至纯科技	471,008.00	2.64
169	002456	欧菲光	465,664.00	2.61
170	600745	闻泰科技	459,632.00	2.57
171	600809	山西汾酒	458,942.00	2.57
172	603369	今世缘	457,500.00	2.56
173	002236	大华股份	448,900.00	2.51
174	600197	伊力特	442,800.00	2.48
175	300001	特锐德	436,911.00	2.45
176	600335	国机汽车	423,770.00	2.37
177	601877	正泰电器	388,150.00	2.17
178	000651	格力电器	373,710.00	2.09
179	300129	泰胜风能	370,792.00	2.08
180	600873	梅花生物	367,580.00	2.06
181	300679	电连技术	362,693.00	2.03
182	603103	横店影视	358,091.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	603986	兆易创新	7,350,871.40	41.16
2	603501	韦尔股份	6,773,382.84	37.93
3	603160	汇顶科技	5,605,442.00	31.39
4	002405	四维图新	4,541,383.00	25.43
5	002371	北方华创	4,393,790.00	24.60
6	300604	长川科技	4,327,842.00	24.23
7	300567	精测电子	4,299,955.00	24.08
8	600887	伊利股份	4,179,732.59	23.41
9	600088	中视传媒	3,719,283.00	20.83
10	601799	星宇股份	3,609,110.00	20.21
11	603186	华正新材	3,252,983.00	18.22

12	603019	中科曙光	3,244,283.93	18.17
13	600547	山东黄金	3,013,618.78	16.88
14	300014	亿纬锂能	2,978,011.81	16.68
15	600872	中炬高新	2,769,005.00	15.51
16	000625	长安汽车	2,732,082.00	15.30
17	002475	立讯精密	2,708,217.00	15.17
18	002419	天虹股份	2,617,305.82	14.66
19	603197	保隆科技	2,614,042.00	14.64
20	002415	海康威视	2,554,109.00	14.30
21	000975	银泰资源	2,306,742.00	12.92
22	300661	圣邦股份	1,996,914.34	11.18
23	601633	长城汽车	1,990,864.00	11.15
24	000333	美的集团	1,956,239.00	10.95
25	600584	长电科技	1,866,247.00	10.45
26	002023	海特高新	1,859,000.00	10.41
27	300498	温氏股份	1,798,050.00	10.07
28	002156	通富微电	1,777,058.00	9.95
29	002886	沃特股份	1,707,556.00	9.56
30	300347	泰格医药	1,686,891.00	9.45
31	002920	德赛西威	1,674,646.00	9.38
32	600418	江淮汽车	1,664,758.00	9.32
33	300450	先导智能	1,650,022.54	9.24
34	300373	扬杰科技	1,644,744.00	9.21
35	600340	华夏幸福	1,625,951.00	9.10
36	300471	厚普股份	1,568,801.00	8.78
37	603000	人民网	1,561,003.68	8.74
38	300568	星源材质	1,540,690.00	8.63
39	000961	中南建设	1,539,265.00	8.62
40	600640	号百控股	1,490,885.00	8.35
41	002311	海大集团	1,487,795.28	8.33
42	603515	欧普照明	1,481,961.90	8.30
43	300601	康泰生物	1,472,589.50	8.25
44	300308	中际旭创	1,452,377.00	8.13
45	300630	普利制药	1,438,446.00	8.05
46	300691	联合光电	1,415,984.00	7.93
47	002705	新宝股份	1,384,106.00	7.75
48	000977	浪潮信息	1,375,000.00	7.70
49	300400	劲拓股份	1,351,981.00	7.57

50	603517	绝味食品	1,350,158.40	7.56
51	600996	贵广网络	1,336,518.00	7.48
52	600029	南方航空	1,267,400.00	7.10
53	600115	东方航空	1,256,956.00	7.04
54	601318	中国平安	1,254,456.00	7.02
55	603658	安图生物	1,244,595.42	6.97
56	300496	中科创达	1,216,119.00	6.81
57	600163	中闽能源	1,211,834.00	6.79
58	002241	歌尔股份	1,202,777.00	6.74
59	002733	雄韬股份	1,194,900.00	6.69
60	603939	益丰药房	1,185,422.00	6.64
61	300435	中泰股份	1,184,400.00	6.63
62	002938	鹏鼎控股	1,179,265.00	6.60
63	300676	华大基因	1,160,675.00	6.50
64	300639	凯普生物	1,154,432.00	6.46
65	002773	康弘药业	1,152,570.00	6.45
66	300685	艾德生物	1,141,288.00	6.39
67	600332	白云山	1,137,972.00	6.37
68	600422	昆药集团	1,125,366.00	6.30
69	002185	华天科技	1,108,600.00	6.21
70	300623	捷捷微电	1,099,242.00	6.16
71	002368	太极股份	1,089,490.00	6.10
72	601169	北京银行	1,063,800.00	5.96
73	000921	海信家电	989,019.36	5.54
74	601336	新华保险	966,027.90	5.41
75	601100	恒立液压	918,840.00	5.15
76	603288	海天味业	852,761.00	4.78
77	300750	宁德时代	835,908.00	4.68
78	600885	宏发股份	778,700.00	4.36
79	002032	苏泊尔	772,738.00	4.33
80	600489	中金黄金	767,457.00	4.30
81	002407	多氟多	736,018.00	4.12
82	000560	我爱我家	731,003.00	4.09
83	002557	洽洽食品	698,060.00	3.91
84	002714	牧原股份	694,210.00	3.89
85	300540	深冷股份	687,343.00	3.85
86	000063	中兴通讯	684,200.00	3.83
87	600073	上海梅林	675,870.00	3.78

88	300747	锐科激光	673,205.00	3.77
89	000568	泸州老窖	664,267.00	3.72
90	300454	深信服	662,582.00	3.71
91	002332	仙琚制药	662,290.00	3.71
92	603313	梦百合	654,913.00	3.67
93	300413	芒果超媒	652,660.00	3.65
94	002739	万达电影	648,903.41	3.63
95	002675	东诚药业	645,560.00	3.61
96	603214	爱婴室	629,728.00	3.53
97	002812	恩捷股份	628,606.00	3.52
98	600779	水井坊	627,308.00	3.51
99	600977	中国电影	626,500.00	3.51
100	601398	工商银行	626,048.00	3.51
101	002155	湖南黄金	621,298.90	3.48
102	600732	ST 新梅	609,910.00	3.42
103	000418	小天鹅 A	605,786.00	3.39
104	300136	信维通信	600,830.00	3.36
105	600859	王府井	586,418.00	3.28
106	300177	中海达	582,227.00	3.26
107	300015	爱尔眼科	578,114.02	3.24
108	002456	欧菲光	577,616.00	3.23
109	000043	中航善达	574,863.00	3.22
110	000066	中国长城	573,600.00	3.21
111	600570	恒生电子	568,970.00	3.19
112	300073	当升科技	565,576.00	3.17
113	002110	三钢闽光	559,824.00	3.13
114	002049	紫光国微	550,182.00	3.08
115	002690	美亚光电	549,402.00	3.08
116	002912	中新赛克	546,347.00	3.06
117	603609	禾丰牧业	544,836.85	3.05
118	300702	天宇股份	543,800.00	3.05
119	600831	广电网络	540,650.00	3.03
120	603690	至纯科技	539,961.00	3.02
121	000426	兴业矿业	538,116.00	3.01
122	600690	海尔智家	536,700.00	3.01
123	002050	三花智控	536,530.00	3.00
124	002008	大族激光	533,000.00	2.98
125	600507	方大特钢	532,607.00	2.98

126	600850	华东电脑	532,142.00	2.98
127	000401	冀东水泥	525,300.00	2.94
128	603886	元祖股份	514,145.00	2.88
129	300383	光环新网	510,980.00	2.86
130	600845	宝信软件	508,855.00	2.85
131	300463	迈克生物	503,331.00	2.82
132	603369	今世缘	502,089.00	2.81
133	002439	启明星辰	498,831.80	2.79
134	300047	天源迪科	498,802.00	2.79
135	600673	东阳光	491,000.00	2.75
136	600809	山西汾酒	490,474.00	2.75
137	002180	纳思达	490,030.00	2.74
138	002341	新纶科技	488,400.00	2.73
139	002236	大华股份	486,216.00	2.72
140	603881	数据港	482,357.00	2.70
141	600104	上汽集团	470,720.00	2.64
142	600745	闻泰科技	466,094.00	2.61
143	600197	伊力特	441,408.00	2.47
144	300001	特锐德	415,800.00	2.33
145	600335	国机汽车	408,000.00	2.28
146	000651	格力电器	405,591.00	2.27
147	601688	华泰证券	397,772.00	2.23
148	600873	梅花生物	392,620.00	2.20
149	601877	正泰电器	390,893.00	2.19
150	300129	泰胜风能	360,800.00	2.02
151	002142	宁波银行	359,050.00	2.01

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	272,119,721.79
卖出股票收入（成交）总额	205,769,485.07

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

—

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	83,720.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,199.83
5	应收申购款	12,180.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,100.70

7.12.4 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

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

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字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
1,323	51,335.21	664,656.75	0.98%	67,251,820.18	99.02%

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	1,550.03	0.0023%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：截止本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2014 年 9 月 18 日 ）基金份额总额	65,878,168.77
本报告期期初基金份额总额	16,889,615.05
本报告期基金总申购份额	58,751,815.84
减：本报告期基金总赎回份额	7,724,953.96
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	67,916,476.93

注：本基金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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，因部分人员任期届满，本基金管理人发生重大人事变动如下：自 2019 年 3 月 8 日起，公司总经理由孙晔伟先生变更为李仆先生；公司董事成员由张天鹄、孙晔伟、厉放、刘宗圣、郭庆卫、林瑞源、孙茂竹、刘胤宏变更为：张天鹄、李仆、厉放、刘宗圣、郭庆卫、刘民、林育如、汪习根。

上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期内，本基金托管人发生重大人事变动如下：2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣女士托管业务部副总裁职务；2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光先生托管业务部总裁职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

—

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

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

本报告期内，本基金管理人，托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚。

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	
中信证券	2	148,282,546.24	31.03%	138,096.02	31.03%	—
国信证券	2	137,292,058.84	28.73%	127,859.64	28.73%	—
中山证券	1	108,754,320.65	22.76%	101,282.39	22.76%	—
银河证券	1	70,656,517.13	14.79%	65,802.45	14.79%	—

国融证券	1	12,903,764.00	2.70%	12,017.51	2.70%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- （1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- （3）经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- （6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司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，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本基金本报告期内新增一个广发证券的深市基金专用交易单元、退租了一个国融证券的沪市基金专用交易单元。

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
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	1,461,184.80	7.40%	-	-	-	-
中山证券	18,282,897.80	92.60%	1,700,000.00	14.05%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	10,400,000.00	85.95%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华润元大基金管理有限公司旗下开放式基金净值公告	证券时报	2019 年 1 月 2 日
2	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券时报	2019 年 1 月 21 日
3	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加海银基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2019 年 1 月 28 日
4	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加信达证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2019 年 1 月 29 日
5	华润元大基金管理有限公司关于暂停信达证券股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报	2019 年 2 月 2 日
6	华润元大基金管理有限公司关于恢复信达证券	证券时报	2019 年 3 月 4 日

	股份有限公司 办理旗下基金相关销售业务的公告		
7	华润元大基金管理有限公司关于总经理助理人员变更的公告	证券时报	2019 年 3 月 9 日
8	华润元大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报	2019 年 3 月 9 日
9	华润元大基金管理有限公司关于董事变更的公告	证券时报	2019 年 3 月 9 日
10	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳盈信基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2019 年 3 月 15 日
11	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加五矿证券有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2019 年 3 月 15 日
12	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	证券时报	2019 年 3 月 27 日
13	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加民商基金销售（上海）有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2019 年 3 月 27 日
14	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加西藏东方财富证券股份有限公司为代销机构、开通转换业务并参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2019 年 4 月 15 日
15	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报	2019 年 4 月 20 日
16	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019 年第 1 号）	证券时报	2019 年 4 月 30 日
17	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加联储证券有限责任公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2019 年 5 月 17 日
18	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2019 年 5 月 17 日
19	华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票及相关风险揭示的公告	证券时报	2019 年 6 月 24 日
20	华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报	2019 年 6 月 29 日

§ 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2019 年 6 月 13 日至 2019 年 6 月 28 日	0.00	15,163,437.24	0.00	15,163,437.24	22.33%
	2	2019 年 6 月 19 日至 2019 年 6 月 28 日	0.00	25,208,546.94	0.00	25,208,546.94	37.12%
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形,本基金管理人已经采取措施,审慎确认大额申购与大额赎回,防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019 年 3 月 9 日,本基金管理人发布了《华润元大基金管理有限公司关于总经理助理人员变更的公告》《华润元大基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》《华润元大基金管理有限公司关于董事变更的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日