

华富华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：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

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.....	6
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
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华富华鑫灵活配置混合	
基金主代码	002730	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 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	116,015,008.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码:	002730	002731
报告期末下属分级基金的份额总额	108,465,968.04 份	7,549,040.73 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×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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	021-68887997	(010) 66105798
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	章宏韬	陈四清

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.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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 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

基金级别	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,719,411.09	113,431.97
本期利润	19,257,601.32	1,468,227.39
加权平均基金份额本期利润	0.1714	0.1850
本期加权平均净值利润率	18.75%	20.34%
本期基金份额净值增长率	21.51%	21.34%
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	-11,428,777.83	-831,143.16
期末可供分配基金份额利润	-0.1054	-0.1101
期末基金资产净值	101,092,894.73	6,997,520.24
期末基金份额净值	0.9320	0.9270
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	-4.95%	-5.46%

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

华富华鑫灵活配置混合 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	1.41%	1.25%	2.92%	0.59%	-1.51%	0.66%
过去三个月	-7.26%	1.66%	-0.06%	0.77%	-7.20%	0.89%
过去六个月	21.51%	1.63%	14.27%	0.78%	7.24%	0.85%
过去一年	-0.64%	1.58%	7.61%	0.76%	-8.25%	0.82%
自基金合同	-4.95%	1.09%	11.47%	0.57%	-16.42%	0.52%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

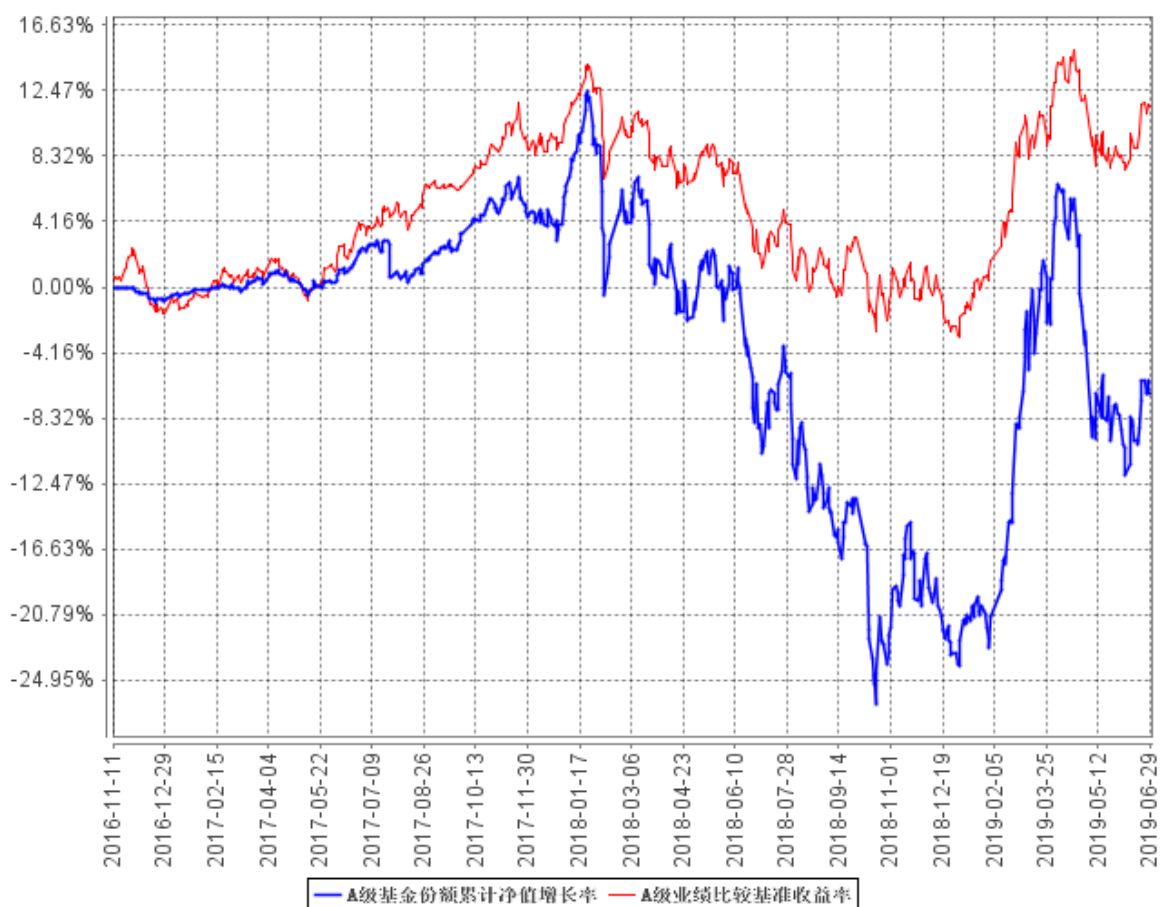
华富华鑫灵活配置混合 C

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	1.42%	1.26%	2.92%	0.59%	-1.50%	0.67%
过去三个月	-7.30%	1.67%	-0.06%	0.77%	-7.24%	0.90%
过去六个月	21.34%	1.64%	14.27%	0.78%	7.07%	0.86%
过去一年	-0.86%	1.58%	7.61%	0.76%	-8.47%	0.82%
自基金合同生效起至今	-5.46%	1.09%	11.47%	0.57%	-16.93%	0.52%

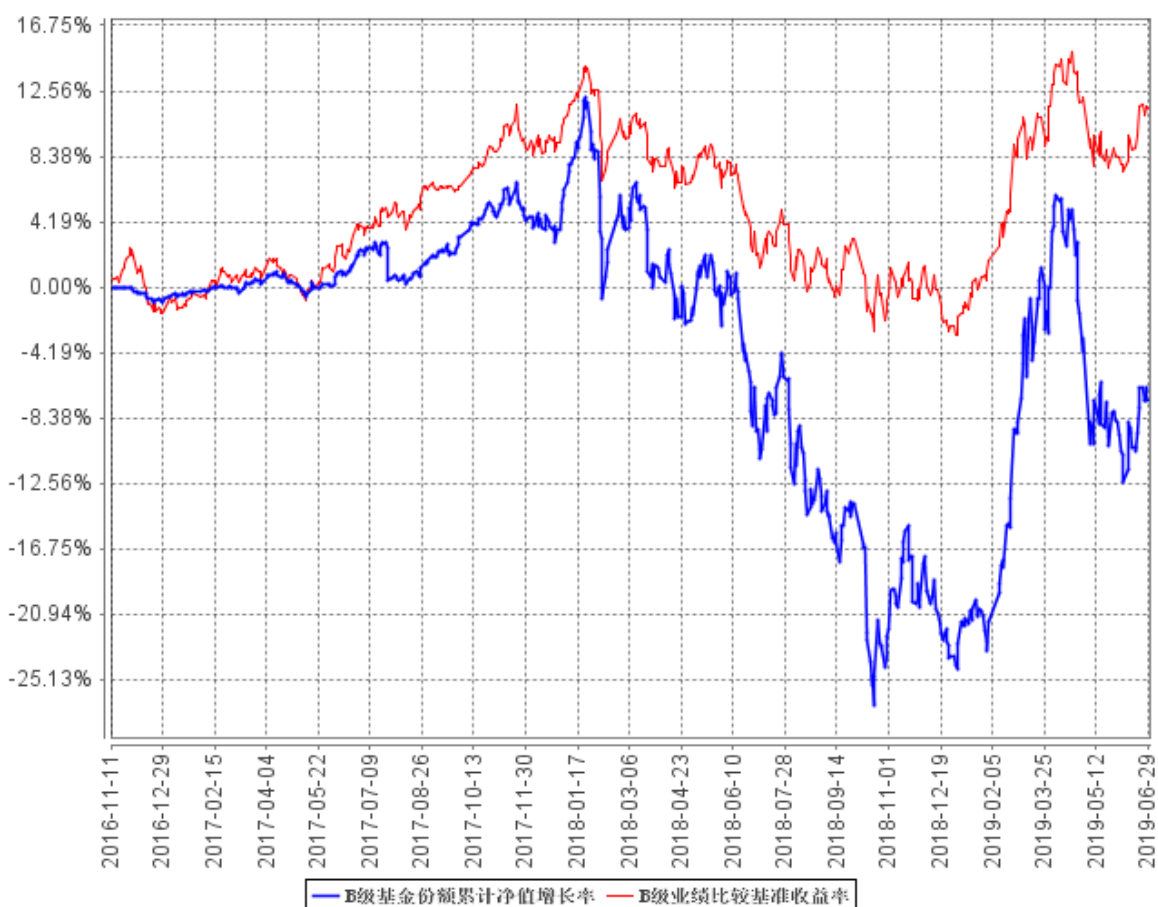
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票资产占基金资产的 0%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为 2016 年 11 月 11 日到 2017 年 5 月 11 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《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富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、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒财定期开放债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金共三十七只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹培俊	华富华鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富强化	2016 年 11 月 11 日	-	十三年	兰州大学工商管理硕士，研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析

	回报债券型基金基金经理、华富安享债券型基金基金经理、华富收益增强债券型基金基金经理、华富可转债债券型基金基金经理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会委员			师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012 年加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用研究员、固定收益部总监助理、固定收益部副总监，2016 年 5 月 5 日至 2018 年 9 月 4 日任华富诚鑫灵活配置混合型基金经理、2014 年 3 月 6 日至 2019 年 6 月 20 日任华富货币市场基金经理。
--	--	--	--	--

注：这里的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

从基本面来看，2019 年上半年以来宏观数据继续在低位徘徊，金融数据表现逐步趋于平淡，市场对于经济企稳复苏的预期逐步被证伪。政策层面货币宽松基调边际有所收紧，但包商事件引发市场短期冲击，信用分层趋势渐成，货币政策短期重回宽松。外部来看，中美贸易摩擦出现反复，从预期达成协议到暂停对话，再到日本 G20 峰会重启对话，对市场风险偏好产生持续干扰。从资本市场的表现来看，上半年市场风险偏好有较好的修复，但由于基本面复苏预期被证伪，叠加政策基调边际收紧和中美贸易摩擦，股票市场出现冲高回落的走势；而债券市场受益于基本面支撑，虽然有利率债供给压力、包商事件冲击等因素影响，但整体表现仍然较为平稳。相比而言利率债和中高等级信用债走势更为平稳，低等级信用债仍然面临利差走阔的压力。本基金以债券、新股申购等低风险资产投资为主，但权益底仓占比较高，上半年股票市场波动幅度较大，但产品净值受益于一季度的大幅上涨，录得较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 11 月 11 日正式成立。截止到 2019 年 6 月 30 日，华富华鑫 A 类基金份额净值为 0.932 元，累计份额净值为 0.952 元，本报告期的份额累计净值增长率为 21.51%，同期业绩比较基准收益率为 14.27%；华富华鑫 C 基金份额净值为 0.927 元，累计份额净值为 0.947 元，本报告期的份额累计净值增长率为 21.34%，同期业绩比较基准收益率为 14.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基本面难有大幅改观，无风险利率和风险偏好对市场影响的影响作用将更为显著。长期来看，市场所担心的中美关系问题、内部改革和债务杠杆问题、人口问题等仍将持续存在，仍然需要相当的时间和空间才可能得以解决。去年过度地把长期问题短期化的情绪得到了明显的纠偏，今年以来市场风险偏好和估值水平已经得到了较好的修复，“核心资产”表现突出。后续我们倾向于认为基本面仍会在低位徘徊，但在政策托底的情况下经济失速的风险在显著下降。在货币政策仍然偏松，且在各种打破刚兑的预期和“房住不炒”的政策基调下，长端利率仍有进一步下行的空间，无风险利率有望继续下行。从资产配置角度，基本面和货币政策仍对债券市场

形成支撑，但由于绝对收益率水平仍处在较低位置，性价比继续下降。风险资产仍面临基本面改善不足的掣肘，但中美贸易摩擦对市场的影响在逐步弱化，无风险利率和风险偏好可能是下半年影响市场的更为重要的变量。本基金权益仓位尽量控制大幅波动和回撤，并利用新股申购等手段增强收益，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《华富华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 20,725,828.71 元，期末可供分配利润为-12,259,920.99 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 2019 年 4 月 10 日起至本报告期末（2019 年 6 月 30 日），本基金连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，至本报告期期末（2019 年 6 月 30 日）本基金基金份额持有人数量仍不满二百人。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。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——华富基金管理有限公司在华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华富基金管理有限公司编制和披露的华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富华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	1,077,757.89	2,082,107.93
结算备付金		-	7,786.48
存出保证金		8,771.57	41,983.87
交易性金融资产	6.4.7.2	106,736,918.11	99,152,802.70
其中：股票投资		101,031,218.11	93,628,602.70
基金投资		-	-
债券投资		5,705,700.00	5,524,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		286,158.04	-
应收利息	6.4.7.5	103,839.25	154,211.52
应收股利		-	-
应收申购款		50,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		108,263,444.86	101,438,892.50
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		52,221.89	53,317.18
应付托管费		13,055.45	13,329.30
应付销售服务费		1,115.80	1,132.03
应付交易费用	6.4.7.7	4,348.47	33,189.55
应交税费		3.02	3.02

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	102,285.26	360,000.00
负债合计		173,029.89	460,971.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	116,015,008.77	131,618,444.36
未分配利润	6.4.7.10	-7,924,593.80	-30,640,522.94
所有者权益合计		108,090,414.97	100,977,921.42
负债和所有者权益总计		108,263,444.86	101,438,892.50

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华富华鑫灵活配置混合 A 基金份额净值 0.9320 元，基金份额总额 108,465,968.04 份；华富华鑫灵活配置混合 C 基金份额净值 0.9270 元，基金份额总额 7,549,040.73 份。华富华鑫灵活配置混合份额总额合计为 116,015,008.77 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：华富华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		21,292,811.91	-11,881,059.30
1.利息收入		97,236.65	387,362.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,553.44	20,539.33
债券利息收入		92,683.21	339,193.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	27,629.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,301,586.94	4,421,421.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,387,862.77	3,687,508.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,778.92	-417,700.02
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	911,945.25	1,151,613.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	18,892,985.65	-16,693,180.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,002.67	3,337.48
减：二、费用		566,983.20	769,327.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	325,529.24	426,992.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	81,382.23	106,748.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,123.97	9,599.23
4. 交易费用	6.4.7.19	31,027.02	26,376.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	601.58
7. 其他费用	6.4.7.20	121,920.74	199,010.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,725,828.71	-12,650,387.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,725,828.71	-12,650,387.21

注：后附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：华富华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）	131,618,444.36	-30,640,522.94	100,977,921.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,725,828.71	20,725,828.71
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）	-15,603,435.59	1,990,100.43	-13,613,335.16
其中：1.基金申购款	644,981.34	-7,361.93	637,619.41
2.基金赎回款	-16,248,416.93	1,997,462.36	-14,250,954.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华富华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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券、中期票据、短期融资券、债券回购等）、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85号）、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36号）、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税〔2016〕46号）、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕

56 号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90 号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。

主要税种及税率列示如下:

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

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

6.4.7 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	1,077,757.89
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:	1,077,757.89

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	96,126,288.55	101,031,218.11	4,904,929.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,716,081.42	5,705,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	5,716,081.42	5,705,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	101,842,369.97	106,736,918.11	4,894,548.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无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	204.57
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	-
应收债券利息	103,630.68
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	4.00
合计	103,839.25

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

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	4,348.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,348.47

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	-
应付审计费	24,795.19
应付信息披露费	68,490.07
中债账户维护费	4,500.00
上清账户维护费	4,500.00
合计	102,285.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 A		
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	123,193,148.55	123,193,148.55
本期申购	122,158.64	122,158.64
本期赎回(以“-”号填列)	-14,849,339.15	-14,849,339.15

- 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	108,465,968.04	108,465,968.04

金额单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 C		
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	8,425,295.81	8,425,295.81
本期申购	522,822.70	522,822.70
本期赎回(以“-”号填列)	-1,399,077.78	-1,399,077.78
- 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	7,549,040.73	7,549,040.73

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-14,924,236.39	-13,727,075.37	-28,651,311.76
本期利润	1,719,411.09	17,538,190.23	19,257,601.32
本期基金份额交易产生的变动数	1,776,047.47	244,589.66	2,020,637.13
其中：基金申购款	-14,325.23	8,109.19	-6,216.04
基金赎回款	1,790,372.70	236,480.47	2,026,853.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,428,777.83	4,055,704.52	-7,373,073.31

单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,053,310.41	-935,900.77	-1,989,211.18
本期利润	113,431.97	1,354,795.42	1,468,227.39
本期基金份额交易	108,735.28	-139,271.98	-30,536.70

产生的变动数			
其中：基金申购款	-60,876.05	59,730.16	-1,145.89
基金赎回款	169,611.33	-199,002.14	-29,390.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-831,143.16	279,622.67	-551,520.49

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	4,025.75
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	350.81
其他	176.88
合计	4,553.44

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	15,639,929.96
减：卖出股票成本总额	14,252,067.19
买卖股票差价收入	1,387,862.77

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	1,778.92
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	1,778.92

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）成交总额	7,514,010.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,263,560.18
减：应收利息总额	248,671.22
买卖债券差价收入	1,778.92

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	911,945.25
基金投资产生的股利收益	-
合计	911,945.25

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	18,892,985.65

——股票投资	18,913,817.07
——债券投资	-20,831.42
——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	18,892,985.65

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	1,002.67
合计	1,002.67

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	31,027.02
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	31,027.02

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	68,490.07

银行汇划费用	1,035.48
自营托管账户维护费	27,000.00
其他	600.00
合计	121,920.74

注：其他为上清所查询服务费。

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

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

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。

6.4.9.2 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
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司（华安证券）	基金管理人的股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华安证券	487,693.00	3.11%	1,496,760.13	7.71%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华安证券	100,250.00	0.69%	5,098,265.21	27.35%

6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华安证券	454.21	3.15%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华安证券	1,393.99	7.81%	-	-

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。

6.4.10.2 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	325,529.24	426,992.58
其中：支付销售机构的客户维护费	32,878.76	67,494.57

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%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）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	81,382.23	106,748.13

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）。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	-	-	-
工商银行银行股份有限公司	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	-	-	-
工商银行银行股份有限公司	-	100.12	100.12
华安证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	100.12	100.12

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)。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

注：本基金本报告期内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。

6.4.10.4.2 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

注：本基金本报告期内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。

6.4.10.5 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
中国工商银行股份有限公司	1,077,757.89	4,025.75	513,368.33	18,499.40

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

注：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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	

300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
--------	------	-----------------	----------------	--------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

注：实际可流通日以该证券公告为准。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，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。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

6.4.13.2 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券等债券基金可投资的短期信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。信用等级按期末评级结果列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、可转债、公募可交换债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,077,757.89	-	-	-	-	-	1,077,757.89
存出保证金	8,771.57	-	-	-	-	-	8,771.57
交易性金融资产	-	-	5,705,700.00	-	-	101,031,218.11	106,736,918.11
应收证券清算款	-	-	-	-	-	286,158.04	286,158.04

应收利息	-	-	-	-	-	103,839.25	103,839.25
应收申购款	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
资产总计	1,086,529.46	-	5,705,700.00	-	-	101,471,215.40	108,263,444.86
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	52,221.89	52,221.89
应付托管费	-	-	-	-	-	13,055.45	13,055.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,115.80	1,115.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,348.47	4,348.47
应交税费	-	-	-	-	-	3.02	3.02
其他负债	-	-	-	-	-	102,285.26	102,285.26
负债总计	-	-	-	-	-	173,029.89	173,029.89
利率敏感度缺口	1,086,529.46	-	5,705,700.00	-	-	101,298,185.51	108,090,414.97
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,082,107.93	-	-	-	-	-	2,082,107.93
结算备付金	7,786.48	-	-	-	-	-	7,786.48
存出保证金	41,983.87	-	-	-	-	-	41,983.87
交易性金融资产	-	-	5,524,200.00	-	-	93,628,602.70	99,152,802.70
应收利息	-	-	-	-	-	154,211.52	154,211.52
资产总计	2,131,878.28	-	5,524,200.00	-	-	93,782,814.22	101,438,892.50
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,317.18	53,317.18
应付托管费	-	-	-	-	-	13,329.30	13,329.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,132.03	1,132.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	33,189.55	33,189.55
应交税费	-	-	-	-	-	3.02	3.02
其他负债	-	-	-	-	-	360,000.00	360,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	460,971.08	460,971.08
利率敏感度缺口	2,131,878.28	-	5,524,200.00	-	-	93,321,843.14	100,977,921.42

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外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）
	市场利率下降 25 基点	4,996.59	3,593.15
市场利率上升 25 基点	-4,988.39	-3,588.31	

6.4.13.4.2 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其他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市场价格风险，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。

6.4.13.4.2.1 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 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	101,031,218.11	93.47	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	5,705,700.00	5.28	-	-
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	106,736,918.11	98.75	-	-

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外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 指数上升百分之五	4,695,217.34	4,605,469.27
沪深 300 指数下降百分之五	-4,695,217.34	-4,605,469.27	

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 95%		
	2. 观察期 1 年		
分析	风险价值	本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）

	(单位: 人民币元)	日)	31 日)
	合计	35,715,714.25	30,057,453.09

6.4.14 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	101,031,218.11	93.32
	其中：股票	101,031,218.11	93.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,705,700.00	5.27
	其中：债券	5,705,700.00	5.27
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,077,757.89	1.00
8	其他各项资产	448,768.86	0.41
9	合计	108,263,444.86	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	630,374.83	0.58
B	采矿业	3,793,943.44	3.51
C	制造业	56,441,001.37	52.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,254,142.16	3.01
E	建筑业	1,220,052.12	1.13
F	批发和零售业	6,039,850.89	5.59
G	交通运输、仓储和邮政业	4,849,308.18	4.49
H	住宿和餐饮业	631,283.88	0.58
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,645,998.73	7.07
J	金融业	3,660,377.32	3.39
K	房地产业	6,744,981.44	6.24
L	租赁和商务服务业	1,150,853.09	1.06
M	科学研究和技术服务业	261,052.11	0.24

N	水利、环境和公共设施管理业	699,401.29	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	132,706.80	0.12
Q	卫生和社会工作	87,939.42	0.08
R	文化、体育和娱乐业	1,778,105.92	1.65
S	综合	2,009,845.12	1.86
	合计	101,031,218.11	93.47

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	600872	中炬高新	27,585	1,181,465.55	1.09
2	600426	华鲁恒升	57,269	851,017.34	0.79
3	600201	生物股份	54,000	847,260.00	0.78
4	600183	生益科技	52,919	796,430.95	0.74
5	600298	安琪酵母	24,148	763,801.24	0.71
6	600600	青岛啤酒	14,985	748,201.05	0.69
7	600642	申能股份	120,000	721,200.00	0.67
8	603369	今世缘	25,000	697,250.00	0.65
9	600161	天坛生物	27,604	697,001.00	0.64
10	600460	士兰微	41,138	682,890.80	0.63
11	600801	华新水泥	33,600	680,400.00	0.63
12	600879	航天电子	108,000	665,280.00	0.62
13	600536	中国软件	12,272	658,638.24	0.61
14	600895	张江高科	32,000	656,640.00	0.61
15	600584	长电科技	50,000	642,500.00	0.59
16	600875	东方电气	58,738	623,797.56	0.58
17	600392	盛和资源	54,978	608,056.68	0.56
18	600256	广汇能源	170,000	605,200.00	0.56
19	600755	厦门国贸	70,050	604,531.50	0.56
20	600885	宏发股份	24,811	602,907.30	0.56
21	601168	西部矿业	94,494	602,871.72	0.56
22	600673	东阳光	76,358	599,410.30	0.55
23	600410	华胜天成	54,406	583,776.38	0.54

24	600528	中铁工业	50,110	579,772.70	0.54
25	600643	爱建集团	60,000	574,800.00	0.53
26	600079	人福医药	54,500	572,250.00	0.53
27	603899	晨光文具	12,980	570,730.60	0.53
28	600325	华发股份	73,000	570,130.00	0.53
29	600166	福田汽车	238,907	566,209.59	0.52
30	600967	内蒙一机	50,388	564,345.60	0.52
31	600022	山东钢铁	329,487	550,243.29	0.51
32	600718	东软集团	42,666	546,978.12	0.51
33	601872	招商轮船	125,419	546,826.84	0.51
34	600808	马钢股份	155,867	531,506.47	0.49
35	600839	四川长虹	180,000	531,000.00	0.49
36	603077	和邦生物	266,396	506,152.40	0.47
37	600380	健康元	58,105	502,608.25	0.46
38	600315	上海家化	15,690	488,743.50	0.45
39	600863	内蒙华电	154,795	486,056.30	0.45
40	600160	巨化股份	67,386	479,114.46	0.44
41	600143	金发科技	96,307	471,904.30	0.44
42	600655	豫园股份	57,269	469,033.11	0.43
43	600266	北京城建	57,957	467,133.42	0.43
44	600388	龙净环保	37,511	464,761.29	0.43
45	600026	中远海能	71,204	462,113.96	0.43
46	600525	长园集团	72,732	459,666.24	0.43
47	600094	大名城	73,000	459,170.00	0.42
48	000860	顺鑫农业	9,738	454,277.70	0.42
49	600064	南京高科	42,410	454,211.10	0.42
50	600260	凯乐科技	22,622	451,987.56	0.42
51	601128	常熟银行	58,319	450,222.68	0.42
52	600737	中粮糖业	51,828	449,867.04	0.42
53	600021	上海电力	50,983	442,532.44	0.41
54	600171	上海贝岭	27,108	440,505.00	0.41
55	002410	广联达	13,205	434,312.45	0.40
56	600258	首旅酒店	23,862	429,038.76	0.40
57	600848	上海临港	13,744	427,850.72	0.40
58	600435	北方导航	46,483	417,882.17	0.39
59	600572	康恩贝	65,000	416,000.00	0.38
60	601098	中南传媒	32,834	415,021.76	0.38
61	600649	城投控股	63,664	411,906.08	0.38
62	600155	华创阳安	30,394	408,191.42	0.38

63	600827	百联股份	41,234	404,505.54	0.37
64	601000	唐山港	147,086	404,486.50	0.37
65	600062	华润双鹤	31,956	402,965.16	0.37
66	600648	外高桥	19,185	402,501.30	0.37
67	600729	重庆百货	13,267	401,194.08	0.37
68	600511	国药股份	17,276	396,829.72	0.37
69	601966	玲珑轮胎	23,194	394,298.00	0.36
70	600037	歌华有线	38,466	394,276.50	0.36
71	600056	中国医药	29,016	391,425.84	0.36
72	603885	吉祥航空	29,780	390,118.00	0.36
73	601179	中国西电	103,466	382,824.20	0.35
74	600138	中青旅	30,161	382,743.09	0.35
75	600598	北大荒	35,411	379,960.03	0.35
76	601678	滨化股份	55,403	374,524.28	0.35
77	300146	汤臣倍健	19,275	373,935.00	0.35
78	600811	东方集团	100,000	372,000.00	0.34
79	601608	中信重工	85,903	371,100.96	0.34
80	600120	浙江东方	29,036	369,918.64	0.34
81	600282	南钢股份	105,566	369,481.00	0.34
82	600267	海正药业	36,843	368,430.00	0.34
83	600500	中化国际	48,965	365,768.55	0.34
84	002049	紫光国微	8,252	363,995.72	0.34
85	600418	江淮汽车	70,345	362,980.20	0.34
86	600348	阳泉煤业	62,328	362,125.68	0.34
87	600466	蓝光发展	58,128	361,556.16	0.33
88	600060	海信电器	41,329	356,255.98	0.33
89	600823	世茂股份	76,645	353,333.45	0.33
90	600291	西水股份	34,647	348,548.82	0.32
91	000066	中国长城	33,498	344,359.44	0.32
92	600366	宁波韵升	37,129	340,844.22	0.32
93	600597	光明乳业	31,689	340,656.75	0.32
94	601880	大连港	159,337	339,387.81	0.31
95	603658	安图生物	4,963	339,270.68	0.31
96	600557	康缘药业	22,813	339,001.18	0.31
97	600970	中材国际	52,401	336,938.43	0.31
98	600503	华丽家族	87,526	332,598.80	0.31
99	600158	中体产业	32,453	331,994.19	0.31
100	600884	杉杉股份	30,830	328,339.50	0.30
101	600787	中储股份	56,601	324,323.73	0.30

102	600835	上海机电	19,513	323,915.80	0.30
103	600717	天津港	50,283	322,816.86	0.30
104	002463	沪电股份	23,567	320,982.54	0.30
105	600307	酒钢宏兴	158,063	320,867.89	0.30
106	601200	上海环境	23,452	319,181.72	0.30
107	300383	光环新网	18,986	318,395.22	0.29
108	600633	浙数文化	33,979	317,703.65	0.29
109	600039	四川路桥	86,953	316,508.92	0.29
110	600575	皖江物流	107,856	316,018.08	0.29
111	600259	广晟有色	7,826	315,387.80	0.29
112	600312	平高电气	40,947	314,882.43	0.29
113	600316	洪都航空	21,858	312,787.98	0.29
114	600216	浙江医药	30,161	308,848.64	0.29
115	603883	老百姓	5,272	308,306.56	0.29
116	600277	亿利洁能	62,137	302,607.19	0.28
117	601928	凤凰传媒	36,939	298,097.73	0.28
118	300253	卫宁健康	20,989	297,624.02	0.28
119	600664	哈药股份	71,872	297,550.08	0.28
120	600125	铁龙物流	45,910	296,119.50	0.27
121	600499	科达洁能	67,577	295,987.26	0.27
122	002439	启明星辰	10,996	295,792.40	0.27
123	600409	三友化工	52,210	295,508.60	0.27
124	600017	日照港	93,348	294,046.20	0.27
125	600478	科力远	51,969	290,506.71	0.27
126	601598	中国外运	60,395	289,292.05	0.27
127	600580	卧龙电驱	34,170	287,369.70	0.27
128	603816	顾家家居	8,942	285,428.64	0.26
129	000656	金科股份	47,258	284,965.74	0.26
130	002223	鱼跃医疗	11,562	284,656.44	0.26
131	002465	海格通信	29,556	281,964.24	0.26
132	600563	法拉电子	6,804	280,120.68	0.26
133	600770	综艺股份	41,424	276,712.32	0.26
134	600073	上海梅林	30,066	276,607.20	0.26
135	600582	天地科技	79,509	274,306.05	0.25
136	002268	卫士通	11,195	273,717.75	0.25
137	600765	中航重机	29,589	273,106.47	0.25
138	002127	南极电商	24,219	272,221.56	0.25
139	601717	郑煤机	47,629	271,961.59	0.25
140	000401	冀东水泥	15,425	271,634.25	0.25

141	600151	航天机电	52,401	269,865.15	0.25
142	000686	东北证券	30,620	269,762.20	0.25
143	600195	中牧股份	19,471	269,673.35	0.25
144	002129	中环股份	27,621	269,580.96	0.25
145	600565	迪马股份	71,681	267,370.13	0.25
146	600759	洲际油气	68,723	265,270.78	0.25
147	600908	无锡银行	46,674	263,241.36	0.24
148	000750	国海证券	52,329	263,214.87	0.24
149	600645	中源协和	15,081	261,052.11	0.24
150	603444	吉比特	1,241	260,560.36	0.24
151	600611	大众交通	55,646	258,753.90	0.24
152	601009	南京银行	31,214	257,827.64	0.24
153	600993	马应龙	14,603	257,742.95	0.24
154	002340	格林美	54,299	255,748.29	0.24
155	000596	古井贡酒	2,149	254,677.99	0.24
156	600881	亚泰集团	78,268	254,371.00	0.24
157	002195	二三四五	64,493	250,877.77	0.23
158	002299	圣农发展	9,890	250,414.80	0.23
159	002506	协鑫集成	37,107	247,874.76	0.23
160	000333	美的集团	4,765	247,112.90	0.23
161	600777	新潮能源	118,642	246,775.36	0.23
162	600859	王府井	16,226	246,472.94	0.23
163	601311	骆驼股份	22,431	243,376.35	0.23
164	603515	欧普照明	7,517	242,423.25	0.22
165	603228	景旺电子	6,013	240,580.13	0.22
166	600098	广州发展	39,038	240,474.08	0.22
167	600989	宝丰能源	20,297	239,707.57	0.22
168	002371	北方华创	3,451	238,981.75	0.22
169	600169	太原重工	89,053	237,771.51	0.22
170	600978	宜华生活	62,614	235,428.64	0.22
171	600393	粤泰股份	50,301	233,899.65	0.22
172	600141	兴发集团	22,526	231,567.28	0.21
173	601016	节能风电	86,858	231,042.28	0.21
174	002373	千方科技	13,469	230,319.90	0.21
175	000009	中国宝安	40,334	230,307.14	0.21
176	000581	威孚高科	12,363	229,457.28	0.21
177	002013	中航机电	33,347	229,427.36	0.21
178	000999	华润三九	7,819	229,409.46	0.21
179	000997	新大陆	13,569	229,180.41	0.21

180	600338	西藏珠峰	12,961	226,558.28	0.21
181	600639	浦东金桥	13,744	222,240.48	0.21
182	600694	大商股份	7,922	221,103.02	0.20
183	603198	迎驾贡酒	12,313	220,525.83	0.20
184	002353	杰瑞股份	9,511	219,704.10	0.20
185	600623	华谊集团	28,729	219,489.56	0.20
186	603766	隆鑫通用	52,115	218,361.85	0.20
187	600006	东风汽车	40,374	215,193.42	0.20
188	600640	号百控股	15,844	211,992.72	0.20
189	600329	中新药业	14,794	211,406.26	0.20
190	000039	中集集团	19,789	211,346.52	0.20
191	000830	鲁西化工	19,398	211,050.24	0.20
192	600416	湘电股份	35,029	210,874.58	0.20
193	000513	丽珠集团	6,312	209,747.76	0.19
194	000975	银泰资源	15,741	207,623.79	0.19
195	000690	宝新能源	32,008	206,131.52	0.19
196	600750	江中药业	15,750	204,907.50	0.19
197	002384	东山精密	13,988	203,805.16	0.19
198	002038	双鹭药业	8,638	203,511.28	0.19
199	600757	长江传媒	29,875	203,448.75	0.19
200	603568	伟明环保	9,407	202,438.64	0.19
201	600754	锦江股份	8,208	202,245.12	0.19
202	600869	智慧能源	44,574	201,474.48	0.19
203	600862	中航高科	22,240	199,937.60	0.18
204	603888	新华网	10,000	199,600.00	0.18
205	600545	卓郎智能	28,062	199,520.82	0.18
206	601001	大同煤业	43,525	198,909.25	0.18
207	600748	上实发展	23,957	198,603.53	0.18
208	600458	时代新材	19,089	198,334.71	0.18
209	002078	太阳纸业	29,067	197,946.27	0.18
210	002690	美亚光电	6,021	196,284.60	0.18
211	000778	新兴铸管	43,807	194,503.08	0.18
212	002916	深南电路	1,883	191,915.36	0.18
213	002281	光迅科技	7,244	191,821.12	0.18
214	002191	劲嘉股份	15,196	188,582.36	0.17
215	300166	东方国信	15,151	186,205.79	0.17
216	603806	福斯特	5,059	185,817.07	0.17
217	000089	深圳机场	20,817	185,063.13	0.17
218	601801	皖新传媒	30,639	184,140.39	0.17

219	300315	掌趣科技	53,239	183,674.55	0.17
220	002670	国盛金控	14,560	183,456.00	0.17
221	600996	贵广网络	16,990	183,152.20	0.17
222	002092	中泰化学	22,977	182,896.92	0.17
223	000970	中科三环	16,091	182,632.85	0.17
224	600058	五矿发展	21,571	182,274.95	0.17
225	300088	长信科技	35,981	182,063.86	0.17
226	600594	益佰制药	34,361	180,395.25	0.17
227	600657	信达地产	43,525	179,323.00	0.17
228	600971	恒源煤电	30,582	178,904.70	0.17
229	000563	陕国投 A	39,543	175,570.92	0.16
230	600874	创业环保	20,999	174,081.71	0.16
231	000988	华工科技	10,959	173,371.38	0.16
232	601689	拓普集团	11,263	172,549.16	0.16
233	000547	航天发展	18,034	172,405.04	0.16
234	000960	锡业股份	15,144	169,158.48	0.16
235	600773	西藏城投	25,007	168,297.11	0.16
236	002110	三钢闽光	17,794	165,484.20	0.15
237	000729	燕京啤酒	24,847	164,984.08	0.15
238	000878	云南铜业	15,439	164,116.57	0.15
239	603659	璞泰来	3,476	163,441.52	0.15
240	000636	风华高科	13,486	163,180.60	0.15
241	600428	中远海特	44,097	163,158.90	0.15
242	002589	瑞康医药	21,472	162,972.48	0.15
243	002152	广电运通	23,769	162,817.65	0.15
244	603169	兰石重装	22,049	160,075.74	0.15
245	000732	泰禾集团	9,679	159,703.50	0.15
246	002221	东华能源	18,325	157,778.25	0.15
247	600350	山东高速	32,834	157,603.20	0.15
248	002440	闰土股份	12,594	156,921.24	0.15
249	300274	阳光电源	16,763	156,734.05	0.15
250	600167	联美控股	14,642	154,912.36	0.14
251	002019	亿帆医药	12,597	154,313.25	0.14
252	002273	水晶光电	13,323	154,280.34	0.14
253	002368	太极股份	5,050	153,015.00	0.14
254	000598	兴蓉环境	33,520	152,516.00	0.14
255	600335	国机汽车	22,011	152,316.12	0.14
256	002155	湖南黄金	14,950	150,546.50	0.14
257	000008	神州高铁	39,895	150,404.15	0.14

258	300001	特锐德	8,190	147,583.80	0.14
259	600122	宏图高科	45,433	145,839.93	0.13
260	601777	力帆股份	33,598	144,135.42	0.13
261	000758	中色股份	25,918	142,289.82	0.13
262	300418	昆仑万维	10,996	141,518.52	0.13
263	002583	海能达	16,842	141,304.38	0.13
264	002266	浙富控股	29,281	139,084.75	0.13
265	000807	云铝股份	29,643	139,025.67	0.13
266	002408	齐翔腾达	17,928	138,942.00	0.13
267	000877	天山股份	11,953	138,893.86	0.13
268	000887	中鼎股份	14,388	137,980.92	0.13
269	603328	依顿电子	13,362	137,227.74	0.13
270	002004	华邦健康	28,187	136,988.82	0.13
271	300324	旋极信息	23,652	136,945.08	0.13
272	000685	中山公用	15,916	135,922.64	0.13
273	600939	重庆建工	27,776	135,824.64	0.13
274	002183	怡亚通	28,433	135,625.41	0.13
275	300010	立思辰	14,341	134,661.99	0.12
276	000027	深圳能源	21,460	133,052.00	0.12
277	000488	晨鸣纸业	24,805	132,954.80	0.12
278	603377	东方时尚	8,685	132,706.80	0.12
279	000930	中粮生化	17,246	129,689.92	0.12
280	600053	九鼎投资	5,534	128,942.20	0.12
281	002174	游族网络	7,592	128,152.96	0.12
282	600184	光电股份	11,168	128,096.96	0.12
283	002399	海普瑞	6,095	127,934.05	0.12
284	002250	联化科技	11,524	127,801.16	0.12
285	000028	国药一致	3,045	127,372.35	0.12
286	000681	视觉中国	6,567	127,268.46	0.12
287	002603	以岭药业	10,966	126,986.28	0.12
288	603556	海兴电力	9,163	126,632.66	0.12
289	002002	鸿达兴业	20,418	126,387.42	0.12
290	000528	柳工	18,733	124,761.78	0.12
291	000156	华数传媒	11,328	124,721.28	0.12
292	002131	利欧股份	65,051	124,247.41	0.11
293	000667	美好置业	47,079	123,817.77	0.11
294	002563	森马服饰	11,190	123,761.40	0.11
295	002407	多氟多	10,450	123,728.00	0.11
296	000031	大悦城	19,223	123,411.66	0.11

297	300113	顺网科技	7,851	123,103.68	0.11
298	002056	横店东磁	15,991	121,531.60	0.11
299	002244	滨江集团	29,160	121,014.00	0.11
300	600126	杭钢股份	26,401	120,388.56	0.11
301	300026	红日药业	34,870	120,301.50	0.11
302	600743	华远地产	47,629	119,548.79	0.11
303	002426	胜利精密	45,398	116,218.88	0.11
304	601969	海南矿业	19,662	115,612.56	0.11
305	002051	中工国际	10,050	115,273.50	0.11
306	000021	深科技	14,162	115,137.06	0.11
307	002030	达安基因	10,728	115,111.44	0.11
308	601127	小康股份	8,781	115,031.10	0.11
309	000078	海王生物	32,101	111,711.48	0.10
310	601019	山东出版	14,317	111,386.26	0.10
311	000738	航发控制	8,307	111,313.80	0.10
312	300182	捷成股份	25,076	110,585.16	0.10
313	300134	大富科技	7,109	110,402.77	0.10
314	000712	锦龙股份	8,570	110,038.80	0.10
315	002491	通鼎互联	13,575	109,821.75	0.10
316	600280	中央商场	30,161	108,277.99	0.10
317	002128	露天煤业	12,486	108,003.90	0.10
318	002212	南洋股份	7,873	107,860.10	0.10
319	002233	塔牌集团	9,175	107,164.00	0.10
320	002242	九阳股份	5,119	106,526.39	0.10
321	300115	长盈精密	10,143	106,400.07	0.10
322	002414	高德红外	5,517	105,926.40	0.10
323	000969	安泰科技	12,454	105,111.76	0.10
324	000727	华东科技	50,263	105,049.67	0.10
325	002366	台海核电	11,201	104,841.36	0.10
326	000519	中兵红箭	13,558	104,803.34	0.10
327	002064	华峰氨纶	20,839	104,611.78	0.10
328	300058	蓝色光标	24,416	104,256.32	0.10
329	002249	大洋电机	24,004	104,177.36	0.10
330	002176	江特电机	21,184	103,166.08	0.10
331	002444	巨星科技	10,308	102,873.84	0.10
332	002701	奥瑞金	21,828	101,936.76	0.09
333	000926	福星股份	14,679	101,578.68	0.09
334	002640	跨境通	12,120	100,959.60	0.09
335	002573	清新环境	12,541	100,955.05	0.09

336	002672	东江环保	8,882	100,721.88	0.09
337	300002	神州泰岳	25,089	99,854.22	0.09
338	603056	德邦股份	7,044	99,179.52	0.09
339	002839	张家港行	17,509	98,575.67	0.09
340	002831	裕同科技	5,121	98,169.57	0.09
341	000400	许继电气	10,758	97,467.48	0.09
342	002028	思源电气	9,725	96,861.00	0.09
343	603225	新凤鸣	7,750	96,797.50	0.09
344	000012	南玻 A	23,199	96,507.84	0.09
345	601811	新华文轩	7,759	94,737.39	0.09
346	300159	新研股份	19,023	94,734.54	0.09
347	000718	苏宁环球	27,371	94,703.66	0.09
348	002505	大康农业	48,049	94,656.53	0.09
349	002807	江阴银行	20,110	94,114.80	0.09
350	603868	飞科电器	2,387	93,451.05	0.09
351	000848	承德露露	11,151	92,887.83	0.09
352	000612	焦作万方	17,388	92,851.92	0.09
353	000006	深振业 A	17,022	92,769.90	0.09
354	002332	仙琚制药	13,636	92,179.36	0.09
355	002400	省广集团	30,922	92,147.56	0.09
356	002317	众生药业	10,824	92,112.24	0.09
357	601020	华钰矿业	7,636	89,493.92	0.08
358	000543	皖能电力	18,933	89,174.43	0.08
359	002544	杰赛科技	6,848	89,024.00	0.08
360	002358	森源电气	8,734	88,650.10	0.08
361	002280	联络互动	24,135	88,334.10	0.08
362	603355	莱克电气	4,104	88,318.08	0.08
363	300308	中际旭创	2,597	88,272.03	0.08
364	300244	迪安诊断	5,179	87,939.42	0.08
365	600618	氯碱化工	11,168	87,780.48	0.08
366	300287	飞利信	22,088	87,689.36	0.08
367	000600	建投能源	12,992	87,046.40	0.08
368	600751	海航科技	27,203	86,505.54	0.08
369	002390	信邦制药	16,346	86,143.42	0.08
370	300133	华策影视	12,718	85,592.14	0.08
371	300376	易事特	17,324	85,407.32	0.08
372	000090	天健集团	17,094	84,444.36	0.08
373	002745	木林森	7,168	84,008.96	0.08
374	002285	世联行	18,592	83,849.92	0.08

375	000990	诚志股份	5,084	83,428.44	0.08
376	002254	泰和新材	7,811	82,640.38	0.08
377	002302	西部建设	7,323	81,578.22	0.08
378	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.07
379	002424	贵州百灵	8,034	79,375.92	0.07
380	002048	宁波华翔	7,262	78,574.84	0.07
381	002431	棕榈股份	19,864	78,462.80	0.07
382	300055	万邦达	11,004	78,458.52	0.07
383	000501	鄂武商 A	7,297	78,442.75	0.07
384	300199	翰宇药业	8,544	78,348.48	0.07
385	002093	国脉科技	8,430	78,314.70	0.07
386	000937	冀中能源	20,053	77,404.58	0.07
387	000426	兴业矿业	14,393	77,290.41	0.07
388	300266	兴源环境	16,922	76,825.88	0.07
389	000062	深圳华强	5,764	76,603.56	0.07
390	002709	天赐材料	3,163	76,544.60	0.07
391	000813	德展健康	10,000	76,200.00	0.07
392	000536	华映科技	29,498	74,334.96	0.07
393	002375	亚厦股份	12,545	74,140.95	0.07
394	300257	开山股份	6,497	71,986.76	0.07
395	002815	崇达技术	4,546	70,872.14	0.07
396	600968	海油发展	19,845	70,449.75	0.07
397	002635	安洁科技	5,202	70,174.98	0.06
398	002276	万马股份	12,642	68,898.90	0.06
399	002437	誉衡药业	17,324	68,429.80	0.06
400	002434	万里扬	9,952	67,574.08	0.06
401	002665	首航节能	19,864	67,338.96	0.06
402	002517	恺英网络	20,670	65,937.30	0.06
403	002955	鸿合科技	1,108	65,194.72	0.06
404	000061	农产品	11,678	63,294.76	0.06
405	002509	天广中茂	30,682	63,204.92	0.06
406	300297	蓝盾股份	10,474	63,158.22	0.06
407	000049	德赛电池	2,324	60,493.72	0.06
408	002707	众信旅游	9,096	55,212.72	0.05
409	002118	紫鑫药业	8,000	53,920.00	0.05
410	000766	通化金马	7,578	51,530.40	0.05
411	002920	德赛西威	2,111	47,286.40	0.04
412	603569	长久物流	3,913	45,351.67	0.04
413	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.04

414	603217	元利科技	584	39,268.16	0.04
415	603000	人民网	2,000	35,660.00	0.03
416	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.03
417	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.03
418	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
419	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.02

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	601598	中国外运	331,642.00	0.33
2	000333	美的集团	237,479.82	0.24
3	600989	宝丰能源	225,702.64	0.22
4	002948	青岛银行	94,522.24	0.09
5	601298	青岛港	76,641.25	0.08
6	002958	青农商行	70,092.00	0.07
7	600928	西安银行	63,474.84	0.06
8	002955	鸿合科技	58,070.28	0.06
9	600885	宏发股份	52,237.00	0.05
10	600835	上海机电	51,810.00	0.05
11	600875	东方电气	47,200.00	0.05
12	300770	新媒股份	41,161.46	0.04
13	600967	内蒙一机	40,680.00	0.04
14	600968	海油发展	40,483.80	0.04
15	000581	威孚高科	39,100.00	0.04
16	603967	中创物流	37,610.60	0.04
17	300765	新诺威	34,551.64	0.03
18	601236	红塔证券	33,869.94	0.03
19	601615	明阳智能	33,497.00	0.03
20	603267	鸿远电子	33,416.24	0.03

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	603000	人民网	615,045.64	0.61
2	600811	东方集团	240,376.90	0.24
3	600536	中国软件	205,906.85	0.20
4	600895	张江高科	204,849.07	0.20
5	600256	广汇能源	188,202.21	0.19
6	002958	青农商行	178,947.00	0.18
7	601298	青岛港	165,059.00	0.16
8	002948	青岛银行	157,049.12	0.16
9	600928	西安银行	155,025.09	0.15
10	600614	*ST 鹏起	148,546.57	0.15
11	600179	ST 安通	133,455.59	0.13
12	000813	德展健康	128,198.52	0.13
13	300762	上海瀚讯	120,747.69	0.12
14	600642	申能股份	118,921.97	0.12
15	300759	康龙化成	114,001.84	0.11
16	600094	大名城	106,283.72	0.11
17	601865	福莱特	102,954.06	0.10
18	600201	生物股份	93,367.38	0.09
19	000541	佛山照明	93,054.48	0.09
20	002489	浙江永强	92,149.61	0.09

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	2,740,865.53
卖出股票收入（成交）总额	15,639,929.96

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	5,705,700.00	5.28
	其中：政策性金融债	5,705,700.00	5.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,705,700.00	5.28

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	108901	农发 1801	57,000	5,705,700.00	5.28

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	8,771.57
2	应收证券清算款	286,158.04
3	应收股利	-
4	应收利息	103,839.25
5	应收申购款	50,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	448,768.86

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

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 华 鑫 灵 活 配 置 混 合 A	133	815,533.59	95,600,382.40	88.14%	12,865,585.64	11.86%
华 富 华 鑫 灵 活 配 置 混 合 C	53	142,434.73	0.00	0.00%	7,549,040.73	100.00%
合计	186	623,736.61	95,600,382.40	82.40%	20,414,626.37	17.60%

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

注：本期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）基金份额总额	408,167,084.54	179,267,613.14
本报告期期初基金份额总额	123,193,148.55	8,425,295.81
本报告期期间基金总申购份额	122,158.64	522,822.70
减：本报告期期间基金总赎回份额	14,849,339.15	1,399,077.78
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	108,465,968.04	7,549,040.73

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，增聘陈启明先生为华富天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，翁海波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，翁海波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，翁海波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，增聘张惠女士为华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、经华富基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，因工作需要，余海春先生不再担任公司总经理职务，聘任曹华玮先生担任公司总经理。

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，增聘张亮先生为华富灵活配置混合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，增聘倪莉莎女士为华富货币市场基金基金经理。

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，增聘郦彬先生为华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理。

10、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，尹培俊先生、姚姣姣女士不再担任华富货币市场基金基金经理的职务。

11、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，姚姣姣女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。

12、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	2	6,907,949.23	44.06%	6,305.82	43.71%	-
西南证券	1	4,908,557.39	31.31%	4,571.47	31.68%	-
华创证券	1	2,284,707.52	14.57%	2,082.05	14.43%	-
太平洋证券	2	1,089,182.00	6.95%	1,014.35	7.03%	-
华安证券	2	487,693.00	3.11%	454.21	3.15%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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) 本基金本报告期新增东方证券一个交易单元，退租广发证券一个交易单元。

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	7,030,948.32	48.21%	-	-	-	-
西南证券	701,950.00	4.81%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	6,751,302.10	46.29%	-	-	-	-
华安证券	100,250.00	0.69%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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。

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	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告》	证券时报及公司网站	2019 年 1 月 21 日
2	《华富基金管理有限公司关于旗下所有基金在直销渠道面向养老金客户开展费率优惠的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 3 月 15 日
3	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告》	公司网站	2019 年 3 月 26 日
4	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告及摘要》	证券时报及公司网站	2019 年 3 月 26 日
5	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 3 月 27 日
6	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南京	证券时报及公司网站	2019 年 4 月 11 日

	苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告》		
7	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰基金销售有限公司为代销机构的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 4 月 17 日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华安证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 4 月 18 日
10	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》	证券时报及公司网站	2019 年 4 月 20 日
11	《华富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销售有限公司为代销机构的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 4 月 23 日
12	《华富基金管理有限公司关于变更总经理的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 4 月 23 日
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 4 月 29 日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 5 月 7 日
15	《华富基金管理有限公司澄清公告》	证券时报及公司网站	2019 年 5 月 14 日
16	《华富基金管理有限公司关于系统暂停网上交易服务的通知》	证券时报及公司网站	2019 年 5 月 25 日
17	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告》	证券时报及公司网站	2019 年 6 月 21 日
18	《华富基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告》	证券时报及公司网站	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	1	1.1-6.30	95,600,382.40	0.00	0.00	95,600,382.40	82.40%
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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。