

# 华富智慧城市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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 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              | 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             | 14        |
| 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        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 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        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>16</b> |
| 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        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>35</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 35        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 35        |
| 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.....     | 36        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 37        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 38        |
| 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.....    | 39        |
| 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.....  | 39        |
| 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..... | 39        |
| 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.....    | 39        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 39        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 39        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 39        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>41</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 41        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 41        |
| 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.....     | 41        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>42</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 43        |
| 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.....      | 43        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 44        |
| 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.....         | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 44        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 45        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>47</b> |
| 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.....    | 47        |

|                           |           |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... | 47        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>    | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录.....          | 48        |
| 12.2 存放地点.....            | 48        |
| 12.3 查阅方式.....            | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 华富智慧城市灵活配置混合        |
| 基金主代码      | 000757              |
| 交易代码       | 000757              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2014 年 10 月 31 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 | 99,724,687.98 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金通过深入研究并积极投资与智慧城市相关的优质上市公司，分享其发展和成长的机会，力求获取超额收益与长期资本增值。                                                                |
| 投资策略   | 本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及智慧城市相关行业的发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%                                                                                           |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。                                                             |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                          | 基金托管人               |
|---------|------|--------------------------------|---------------------|
| 名称      |      | 华富基金管理有限公司                     | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 满志弘                            | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-68886996                   | (010) 66105799      |
|         | 电子邮箱 | manzh@hffund.com               | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-700-8001                   | 95588               |
| 传真      |      | 021-68887997                   | (010) 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       | 《中国证券报》                                                   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a> |
| 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<br>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

| 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       | 1,125,562.22                           |
| 本期利润          | 19,484,101.87                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1672                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 23.06%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 21.06%                                 |
| 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      | -24,616,154.97                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.2468                                |
| 期末基金资产净值      | 75,108,533.01                          |
| 期末基金份额净值      | 0.753                                  |
| 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   | -16.95%                                |

注：1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2) 以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

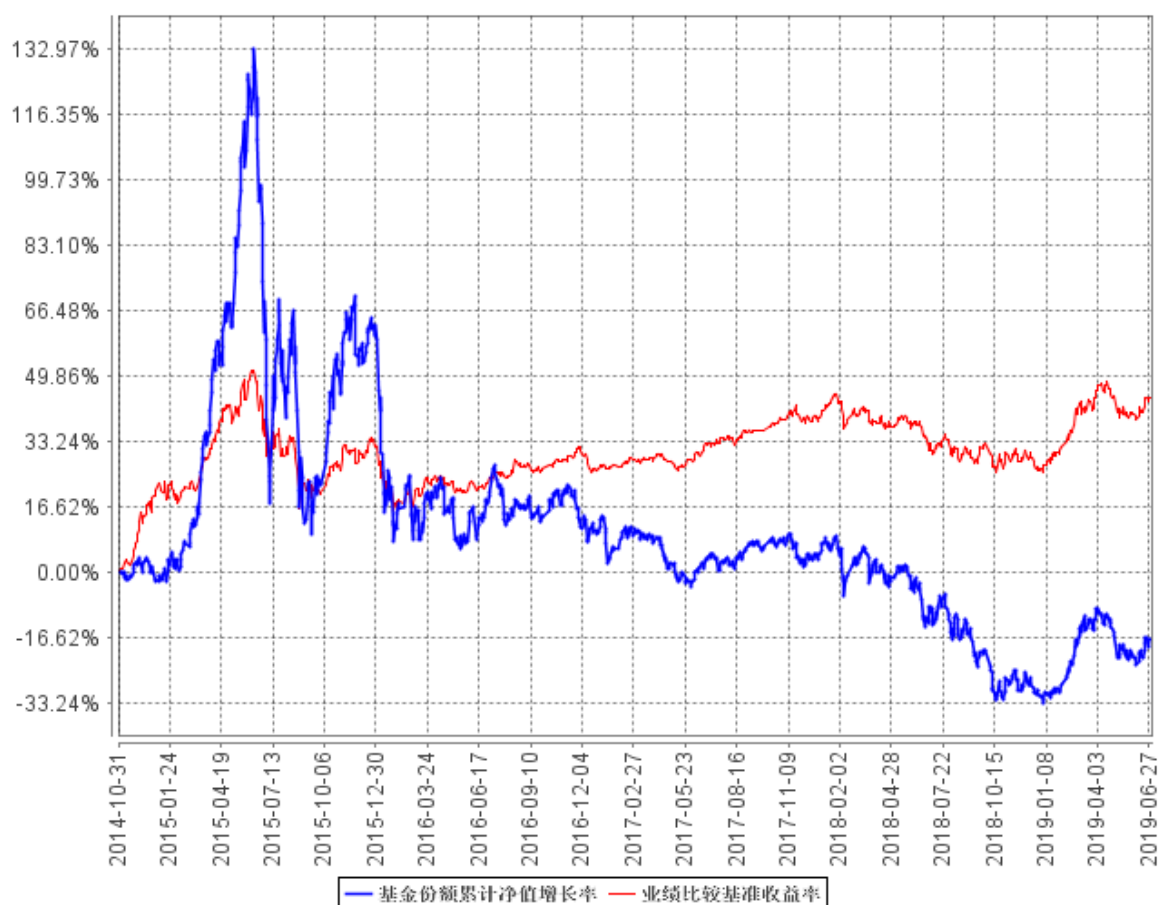
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | 4.87%    | 1.46%       | 2.99%      | 0.57%         | 1.88%   | 0.89% |
| 过去三个月      | -5.88%   | 1.72%       | -0.11%     | 0.75%         | -5.77%  | 0.97% |
| 过去六个月      | 21.06%   | 1.65%       | 14.31%     | 0.77%         | 6.75%   | 0.88% |
| 过去一年       | -9.06%   | 1.73%       | 8.50%      | 0.76%         | -17.56% | 0.97% |
| 过去三年       | -29.69%  | 1.39%       | 17.45%     | 0.55%         | -47.14% | 0.84% |
| 自基金合同生效起至今 | -16.95%  | 2.05%       | 44.42%     | 0.81%         | -61.37% | 1.24% |

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*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

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《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%，投资于本合同界定的智慧城市相关证券不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2014 年 10 月 31 日到 2015 年 4 月 31 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《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 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 |        |                                                                              |
| 龚炜 | 华富智慧城市灵活配置混合型基金经理、华富竞争力优选混 | 2014 年 10 月 31 日 | -    | 十五年    | 安徽财经大学金融学硕士，研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究 |

|     |                                                                                                                                                                                                                                                                              |                |   |     |                                                                                                                                                                                                                            |
|-----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 合型基金基金经<br>理、华富<br>成长趋势<br>混合型基金基金经<br>理、华富<br>国泰民安<br>灵活配置<br>混合型基金基金经<br>理、华富<br>灵活配置<br>混合型基金基金经<br>理、华富<br>天鑫灵活<br>配置混合<br>型基金基<br>金基金经<br>理、华富<br>物联<br>世界灵活<br>配置混合<br>型基金基<br>金基金经<br>理、华富<br>量子<br>生命力混<br>合型基金<br>基金经<br>理、公司<br>公募投资<br>决策委员<br>会主席、<br>公司副总<br>经理 |                |   |     | 员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监，2012 年 9 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理，2014 年 8 月 7 日至 2015 年 2 月 11 日任华富灵活配置混合型基金基金经理，2018 年 7 月 27 日至 2018 年 12 月 21 日任华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理。 |
| 高靖瑜 | 华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经<br>理、华富健康<br>文娱灵活<br>配置混合<br>型基金基<br>金基金基                                                                                                                                                                                                                 | 2017 年 5 月 9 日 | - | 十九年 | 复旦大学金融学硕士，本科学历。历任金鼎综合证券（维京）股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员，2007 年 7 月加入华富基金管理有限公司，任行业研究员，2013 年 3 月 1 日至 2014 年 12 月 14 日                                                                                                   |

|  |                                                                                                               |  |  |  |                                                                                             |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 金经理、<br>华富策略<br>精选灵活<br>配置混合<br>型基金基<br>金经理、<br>华富中小<br>板指数增<br>强型基金<br>基金经<br>理、华富<br>中证 100<br>指数基金<br>基金经理 |  |  |  | 任华富价值增长混合型基<br>金基金经理助理，2014 年<br>12 月 15 日至 2016 年 1 月<br>12 日任华富策略精选灵<br>活配置混合型基金基金经<br>理。 |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------|

注：龚炜的任职日期指该基金成立之日，高靖瑜的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2019 年上半年，国内实体经济总体仍在下行趋势中，国内政策基调也随着开工旺季以及之后景气回落而不断微调。海外方面，美联储降息预期渐进，中美贸易战方面则是一波三折。国内看，2019 年上半年社融余额规模增速回升至 10.9%，已经处于企稳回升区间；PMI 等领先景气度指标尚未显疲弱，在一季度回升之后，二季度制造业 PMI 连续处于荣枯线下方，工业增加值与企业利润增速也均处于放缓趋势中，实体企业库存也在继续去化；总体看，整体宏观经济仍处在信用环境缓和、但尚未传导到实体企业生产的状态。而在国际方面，全球重要经济体均出处在经济下行趋势中，一季度经济韧性超预期的美国在二季度末开始频繁出现经济数据低于预期的情况，6 月美联储 FOMC 会议明确释放出鸽派信号，美联储进入降息周期的脚步渐行渐近。中美贸易战方面，在一季度显著修复之后，二季度一波三折，5 月中美贸易谈判突然出现显著恶化，而在 6 月底 G20 峰会上则再次出现边际缓和，显示双方对于达成协议均有诉求，而两国贸易与产业摩擦会是长期的矛盾。我们预计国内政策方面，虽然 4 月中央政治局会议基调由宽变紧，但在二季度经济数据再次走弱、包商银行事件爆发后，央行维持银行间市场“流动性合理充裕”，预计下半年政策基调会略微宽松。

2019 年上半年，沪深 300 指数累计上涨 27.07%，创业板指累计上涨 20.87%。上半年市场总体表现较好，一季度市场普涨，二季度有所回调，但半年看总体市场涨幅较大。上半年所有行业均收红，表现最为抢眼的是食品饮料、非银、农林牧渔、家电、计算机等板块。

本基金半年度末重点配置行业包括计算机、电子、生物医药、机械、新能源车等，结构相对均衡。我国依旧处于城镇化率不断提高的过程中，且伴随着科技的飞跃发展，城市的科技化程度不断提升，本基金持续关注其中投资机会，对相关计算机、电子、通信、新能源车等行业做了相关投资。科技影响也在个人生活中不断体现，娱乐方式日益丰富，医疗服务多样化、出行不断便捷，个人需求的日益丰富多样化同时推动个人生活智能化以及城市智能化，我们也将对相关传媒、医药、社服等各个行业做深入研究并投资。从中美贸易战以及从我国经济运行阶段来看，公司将进入精致化发展的阶段，对增长的质量要求日益提高，各行各业中能够摆脱粗放型发展收获自身优势的公司都值得重视，提速的科创板也将在科技发展中引领市场方向，基金持仓的重点行业中都可能受益于这种变化，后期也将持续关注。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同 2014 年 10 月 31 日生效，截止 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.753 元，累计份额净值为 0.953 元。本报告期，本基金份额净值增长率为 21.06%，同期业绩比较基准

收益率为 14.31%。

#### 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：首先，经济数据显示国内经济依旧在筑底过程中，后期适当的财政政策支持以及货币政策适当宽松还是可以预期；其次，中美贸易摩擦不断演绎，后期在双方利益诉求下继续恶化的可能性边际减弱，对市场影响在逐渐钝化；再次，科创板 7 月开板，板内估值体系的形成会对主板有所影响，而国家对于高新技术产业的支持也将通过科创板影响到主板，A 股相关细分行业龙头也可能因此被市场追捧；另外，随着国家各种减税降费，以及推动经济结构优化的措施出台，会在微观层面逐渐体现效果，上市公司业绩表现变化值得期待与跟踪。在这样的背景下，我们预计市场仍将呈现结构性机会。我们会重点关注，科技创新龙头个股在科创板映射下的机会；中报业绩依然表现稳定和超预期的个股；在经济转向高质量发展的阶段，我们会更多地选择细分行业龙头进行研究和投资。

#### 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《华富智慧城市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 19,484,101.87 元，期末可供分配利润为 -24,616,154.97 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 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智慧城市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，华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华富基金管理有限公司在华富智慧城市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。本基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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智慧城市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：华富智慧城市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<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 8,693,741.03                   | 21,712,286.98                    |
| 结算备付金           |            | 67,630.79                      | -                                |
| 存出保证金           |            | 28,972.36                      | 16,346.60                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 66,966,113.90                  | 62,765,625.89                    |
| 其中：股票投资         |            | 66,966,113.90                  | 62,765,625.89                    |
| 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    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 1,603.11                       | 4,841.62                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 5,391.90                       | 2,396.40                         |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 75,763,453.09                  | 84,501,497.49                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 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         |            | 245,521.20                     | 1,468,967.80                     |
| 应付赎回款           |            | 186,741.58                     | 202,745.04                       |
| 应付管理人报酬         |            | 89,412.77                      | 105,254.27                       |
| 应付托管费           |            | 14,902.12                      | 17,542.36                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 54,177.42                      | 38,562.23                        |
| 应交税费            |            | 15.85                          | 0.84                             |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 64,149.14      | 230,000.00     |
| 负债合计          |          | 654,920.08     | 2,063,072.54   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 99,724,687.98  | 132,476,812.56 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -24,616,154.97 | -50,038,387.61 |
| 所有者权益合计       |          | 75,108,533.01  | 82,438,424.95  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 75,763,453.09  | 84,501,497.49  |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.753 元，基金份额总额 99,724,687.98 份。

后附表附注为本财务报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：华富智慧城市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<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 20,482,429.72                            | -11,683,944.20                                |
| 1.利息收入                |            | 44,966.36                                | 47,663.41                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 44,509.44                                | 47,637.86                                     |
| 债券利息收入                |            | 456.92                                   | 25.55                                         |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |            | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 2,010,928.28                             | 884,087.80                                    |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 1,442,169.51                             | 430,592.66                                    |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 244,966.57                               | 83,186.90                                     |
| 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   | 323,792.20                               | 370,308.24                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 18,358,539.65                            | -12,617,784.44                                |
| 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   | 67,995.43                                | 2,089.03                                      |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 998,327.85                               | 1,515,982.15                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 625,571.07                               | 756,288.78                                    |

|                     |            |               |                |
|---------------------|------------|---------------|----------------|
| 2. 托管费              | 6.4.10.2.2 | 104,261.84    | 126,048.10     |
| 3. 销售服务费            |            | -             | -              |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19   | 194,183.09    | 508,981.03     |
| 5. 利息支出             |            | -             | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -             | -              |
| 6. 税金及附加            |            | 1.48          | 0.09           |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20   | 74,310.37     | 124,664.15     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 19,484,101.87 | -13,199,926.35 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 19,484,101.87 | -13,199,926.35 |

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富智慧城市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<br>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）                        | 132,476,812.56                        | -50,038,387.61 | 82,438,424.95  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 19,484,101.87  | 19,484,101.87  |
| 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）      | -32,752,124.58                        | 5,938,130.77   | -26,813,993.81 |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,391,381.26                          | -618,420.56    | 1,772,960.70   |
| 2.基金赎回款                                | -35,143,505.84                        | 6,556,551.33   | -28,586,954.51 |
| 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）                        | 99,724,687.98                         | -24,616,154.97 | 75,108,533.01  |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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)                        | 116,091,681.38                             | -5,883,158.62  | 110,208,522.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | -13,199,926.35 | -13,199,926.35 |
| 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)      | -7,772,652.26                              | 454,845.78     | -7,317,806.48  |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,482,870.30                               | -149,087.59    | 1,333,782.71   |
| 2.基金赎回款                                | -9,255,522.56                              | 603,933.37     | -8,651,589.19  |
| 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)                        | 108,319,029.12                             | -18,628,239.19 | 89,690,789.93  |

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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：

|              |              |             |
|--------------|--------------|-------------|
| _____<br>章宏韬 | _____<br>曹华玮 | _____<br>邵恒 |
| 基金管理人负责人     | 主管会计工作负责人    | 会计机构负责人     |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2014]771 号）核准，基金合同于 2014 年 10 月 31 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2014）6-75 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监

会核准上市的股票)、债券、权证、资产支持证券、货币市场工具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的规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

#### 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%的征税率缴纳增值税。

(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。

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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 8,693,741.03           |
| 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：            | 8,693,741.03           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |               |              |
|----|------------------------|---------------|--------------|
|    | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票 | 62,487,679.01          | 66,966,113.90 | 4,478,434.89 |

|               |       |               |               |              |
|---------------|-------|---------------|---------------|--------------|
| 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            |       | 62,487,679.01 | 66,966,113.90 | 4,478,434.89 |

#### 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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,559.61               |
| 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  | 30.40                  |
| 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         | 13.10                  |
| 合计         | 1,603.11               |

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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 54,177.42              |
| 银行间市场应付交易费用 | —                      |
| 合计          | 54,177.42              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | 141.77                 |
| 预提费用        | —                      |
| 预提信息披露费     | 39,671.58              |
| 预提账户维护费     | 4,500.00               |
| 预提审计费       | 19,835.79              |
| 合计          | 64,149.14              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 132,476,812.56                        | 132,476,812.56 |
| 本期申购          | 2,391,381.26                          | 2,391,381.26   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -35,143,505.84                        | -35,143,505.84 |
| — 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           | 99,724,687.98                         | 99,724,687.98  |

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

| 项目   | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | -25,872,538.65 | -24,165,848.96 | -50,038,387.61 |
| 本期利润 | 1,125,562.22   | 18,358,539.65  | 19,484,101.87  |

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 7,201,216.28   | -1,263,085.51 | 5,938,130.77   |
| 其中：基金申购款       | -488,541.34    | -129,879.22   | -618,420.56    |
| 基金赎回款          | 7,689,757.62   | -1,133,206.29 | 6,556,551.33   |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | -17,545,760.15 | -7,070,394.82 | -24,616,154.97 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 43,502.88                             |
| 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 | 811.53                                |
| 其他        | 195.03                                |
| 合计        | 44,509.44                             |

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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 69,825,739.96                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 68,383,570.45                         |
| 买卖股票差价收入   | 1,442,169.51                          |

#### 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<br>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 | 244,966.57                 |
| 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                            | 244,966.57                 |

#### 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<br>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   | 4,246,095.89               |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,998,329.44               |
| 减：应收利息总额                | 2,799.88                   |
| 买卖债券差价收入                | 244,966.57                 |

#### 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 323,792.20                 |
| 基金投资产生的股利收益 | —                          |
| 合计          | 323,792.20                 |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 18,358,539.65              |
| ——股票投资     | 18,358,539.65              |
| ——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<br>增值税 | -             |
| 合计                         | 18,358,539.65 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 67,978.29                             |
| 转换费收入   | 17.14                                 |
| 合计      | 67,995.43                             |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 194,183.09                            |
| 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        | 194,183.09                            |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 19,835.79                             |
| 信息披露费   | 39,671.58                             |
| 债券帐户维护费 | 13,500.00                             |
| 银行汇划费用  | 1,303.00                              |
| 其他      | -                                     |
| 合计      | 74,310.37                             |

### 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 华安证券  | 2,287,034.48               | 1.86%            | 60,864,862.94                   | 17.78%           |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 华安证券  | 177,758.66                 | 2.21%            | -                               | -                |

##### 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债券回购交易。

##### 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<br>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  | 2,084.18                        | 1.84%      | 2,084.18 | 3.85%        |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>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  | 56,683.32                       | 18.03%     | -        | -            |

#### 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>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  | 625,571.07                 | 756,288.78                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 314,372.68                 | 383,838.80                      |

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 104,261.84                 | 126,048.10                      |

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%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）。

#### 6.4.10.3 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>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 | 8,693,741.03                          | 43,502.88 | 8,802,888.45                               | 44,453.30 |

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<br>(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 | -  |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：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風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金管理人已建立董事會領導下的架構清晰、控制有效、系統全面、切實可行的風險控制體系，並設定適當的風險限額及內部控制流程，通過可靠的管理及信息系統持續監控上述各類風險。

董事會下設風險管理委員會，負責對公司風險管理制度進行審查並提供諮詢和建議。總經理下設投資決策委員會和風險控制委員會，負責對公司经营及基金運作中的風險進行研究、評估和監控。公司設督察長，組織、指導公司監察稽核工作，監督檢查基金及公司運作的合法合規情況和公司的內部風險控制情況。公司設有獨立的監察稽核部門，監察稽核部有權對公司各部門內部風險控制制度的建立和落實情況進行檢查，對公司的內部風險控制制度的合理性、有效性進行分析，提出改進意見，上報總經理，通報督察長。

#### 6.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易過程中因交易對手未履行合約責任，或者基金所投資證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息，導致基金資產損失和收益變化的風險。本基金均投資於具有良好信用等級的證券，且通過分散化投資以分散信用風險。本基金投資於一家公司發行的證券市值不超過基金資產淨值的 10%，且本基金與由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的證券不得超過該證券的 10%。

本基金在交易所進行的交易均與中國證券登記結算有限責任公司完成證券交收和款項清算，因此違約風險發生的可能性很小；基金在進行銀行間同業市場交易前均對交易對手進行信用評估以控制相應的信用風險。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用評級列示的債券投資

單位：人民幣元

| 短期信用評級 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>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<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                   | 0.00                     |
| AAA 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约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<br>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                   | 8,693,741.03 | -      | -        | -     | -     | -             | 8,693,741.03  |
| 结算备付金                  | 67,630.79    | -      | -        | -     | -     | -             | 67,630.79     |
| 存出保证金                  | 28,972.36    | -      | -        | -     | -     | -             | 28,972.36     |
| 交易性金融资产                | -            | -      | -        | -     | -     | 66,966,113.90 | 66,966,113.90 |
| 应收利息                   | -            | -      | -        | -     | -     | 1,603.11      | 1,603.11      |
| 应收申购款                  | -            | -      | -        | -     | -     | 5,391.90      | 5,391.90      |
| 资产总计                   | 8,790,344.18 | -      | -        | -     | -     | 66,973,108.91 | 75,763,453.09 |
| 负债                     |              |        |          |       |       |               |               |
| 应付证券清算款                | -            | -      | -        | -     | -     | 245,521.20    | 245,521.20    |
| 应付赎回款                  | -            | -      | -        | -     | -     | 186,741.58    | 186,741.58    |
| 应付管理人报酬                | -            | -      | -        | -     | -     | 89,412.77     | 89,412.77     |
| 应付托管费                  | -            | -      | -        | -     | -     | 14,902.12     | 14,902.12     |
| 应付交易费用                 | -            | -      | -        | -     | -     | 54,177.42     | 54,177.42     |
| 应交税费                   | -            | -      | -        | -     | -     | 15.85         | 15.85         |

|                          |               |        |          |       |       |                |               |
|--------------------------|---------------|--------|----------|-------|-------|----------------|---------------|
| 其他负债                     | -             | -      | -        | -     | -     | 64,149.14      | 64,149.14     |
| 负债总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | 654,920.08     | 654,920.08    |
| 利率敏感度缺口                  | 8,790,344.18  | -      | -        | -     | -     | -66,318,188.83 | 75,108,533.01 |
| 上年度末<br>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                     | 21,712,286.98 | -      | -        | -     | -     | -              | 21,712,286.98 |
| 存出保证金                    | 16,346.60     | -      | -        | -     | -     | -              | 16,346.60     |
| 交易性金融资产                  | -             | -      | -        | -     | -     | -62,765,625.89 | 62,765,625.89 |
| 应收利息                     | -             | -      | -        | -     | -     | 4,841.62       | 4,841.62      |
| 应收申购款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 2,396.40       | 2,396.40      |
| 其他资产                     | -             | -      | -        | -     | -     | -              | -             |
| 资产总计                     | 21,728,633.58 | -      | -        | -     | -     | -62,772,863.91 | 84,501,497.49 |
| 负债                       |               |        |          |       |       |                |               |
| 应付证券清算款                  | -             | -      | -        | -     | -     | 1,468,967.80   | 1,468,967.80  |
| 应付赎回款                    | -             | -      | -        | -     | -     | 202,745.04     | 202,745.04    |
| 应付管理人报酬                  | -             | -      | -        | -     | -     | 105,254.27     | 105,254.27    |
| 应付托管费                    | -             | -      | -        | -     | -     | 17,542.36      | 17,542.36     |
| 应付交易费用                   | -             | -      | -        | -     | -     | 38,562.23      | 38,562.23     |
| 应交税费                     | -             | -      | -        | -     | -     | 0.84           | 0.84          |
| 其他负债                     | -             | -      | -        | -     | -     | 230,000.00     | 230,000.00    |
| 负债总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | 2,063,072.54   | 2,063,072.54  |
| 利率敏感度缺口                  | 21,728,633.58 | -      | -        | -     | -     | -60,709,791.37 | 82,438,424.95 |

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<br>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   | 0.00                            | 0.00                   |
|    | 市场利率上升 25 基点   | 0.00                            | 0.00                   |

#### 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<br>2019 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 66,966,113.90          | 89.16         | 62,765,625.89            | 76.14         |
| 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            | 66,966,113.90          | 89.16         | 62,765,625.89            | 76.14         |

#### 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       | 2,744,631.75                | 3,594,364.28           |
|    | 沪深 300 指数下降百分之五       | -2,744,631.75               | -3,594,364.28          |

#### 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<br>（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） |
|    | 合计                | 29,640,533.16        | 24,999,041.24          |

#### 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              | 66,966,113.90 | 88.39         |
|    | 其中：股票             | 66,966,113.90 | 88.39         |
| 2  | 基金投资              | —             | —             |
| 3  | 固定收益投资            | —             | —             |
|    | 其中：债券             | —             | —             |
|    | 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      | 8,761,371.82  | 11.56         |
| 8  | 其他各项资产            | 35,967.37     | 0.05          |
| 9  | 合计                | 75,763,453.09 | 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         | —             | —             |
| B  | 采矿业              | 28,652.05     | 0.04          |
| C  | 制造业              | 40,151,581.99 | 53.46         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —             | —             |
| E  | 建筑业              | —             | —             |
| F  | 批发和零售业           | 6,988,900.00  | 9.31          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —             | —             |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 11,909,509.92 | 15.86         |
| J  | 金融业              | 2,176,769.94  | 2.90          |
| K  | 房地产业             | 2,552,000.00  | 3.40          |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —             | —             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 695,700.00    | 0.93          |
| 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 | 2,463,000.00  | 3.28  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 66,966,113.90 | 89.16 |

### 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  | 603939 | 益丰药房 | 70,000  | 4,899,300.00 | 6.52         |
| 2  | 000977 | 浪潮信息 | 190,000 | 4,533,400.00 | 6.04         |
| 3  | 002821 | 凯莱英  | 35,000  | 3,432,800.00 | 4.57         |
| 4  | 000063 | 中兴通讯 | 105,000 | 3,415,650.00 | 4.55         |
| 5  | 002384 | 东山精密 | 214,857 | 3,130,466.49 | 4.17         |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 45,000  | 2,970,000.00 | 3.95         |
| 7  | 600588 | 用友网络 | 110,000 | 2,956,800.00 | 3.94         |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 110,000 | 2,726,900.00 | 3.63         |
| 9  | 300271 | 华宇软件 | 140,000 | 2,660,000.00 | 3.54         |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 200,000 | 2,552,000.00 | 3.40         |
| 11 | 603986 | 兆易创新 | 29,000  | 2,514,300.00 | 3.35         |
| 12 | 300413 | 芒果超媒 | 60,000  | 2,463,000.00 | 3.28         |
| 13 | 603019 | 中科曙光 | 70,000  | 2,457,000.00 | 3.27         |
| 14 | 002422 | 科伦药业 | 82,000  | 2,437,860.00 | 3.25         |
| 15 | 000157 | 中联重科 | 390,000 | 2,343,900.00 | 3.12         |
| 16 | 002439 | 启明星辰 | 85,000  | 2,286,500.00 | 3.04         |
| 17 | 300567 | 精测电子 | 42,950  | 2,255,734.00 | 3.00         |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 90,000  | 2,142,900.00 | 2.85         |
| 19 | 002419 | 天虹股份 | 160,000 | 2,089,600.00 | 2.78         |
| 20 | 600273 | 嘉化能源 | 170,000 | 1,965,200.00 | 2.62         |
| 21 | 002747 | 埃斯顿  | 220,000 | 1,933,800.00 | 2.57         |
| 22 | 002174 | 游族网络 | 107,000 | 1,806,160.00 | 2.40         |
| 23 | 002407 | 多氟多  | 140,000 | 1,657,600.00 | 2.21         |
| 24 | 603305 | 旭升股份 | 60,000  | 1,434,600.00 | 1.91         |
| 25 | 600536 | 中国软件 | 25,000  | 1,341,750.00 | 1.79         |
| 26 | 002202 | 金风科技 | 70,000  | 870,100.00   | 1.16         |
| 27 | 300383 | 光环新网 | 50,000  | 838,500.00   | 1.12         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 28 | 300190 | 维尔利  | 90,000 | 695,700.00 | 0.93 |
| 29 | 601236 | 红塔证券 | 9,789  | 33,869.94  | 0.05 |
| 30 | 300782 | 卓胜微  | 297    | 32,349.24  | 0.04 |
| 31 | 600968 | 海油发展 | 8,071  | 28,652.05  | 0.04 |
| 32 | 603867 | 新化股份 | 870    | 22,454.70  | 0.03 |
| 33 | 601698 | 中国卫通 | 5,051  | 19,799.92  | 0.03 |
| 34 | 300594 | 朗进科技 | 396    | 17,467.56  | 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  | 600030 | 中信证券 | 4,352,502.00 | 5.28           |
| 2  | 603305 | 旭升股份 | 3,001,045.00 | 3.64           |
| 3  | 600588 | 用友网络 | 2,748,940.00 | 3.33           |
| 4  | 300054 | 鼎龙股份 | 2,742,246.00 | 3.33           |
| 5  | 600273 | 嘉化能源 | 2,590,518.12 | 3.14           |
| 6  | 002281 | 光迅科技 | 2,582,093.00 | 3.13           |
| 7  | 300750 | 宁德时代 | 2,562,045.00 | 3.11           |
| 8  | 600547 | 山东黄金 | 2,560,175.00 | 3.11           |
| 9  | 002594 | 比亚迪  | 2,458,805.00 | 2.98           |
| 10 | 002444 | 巨星科技 | 2,399,082.00 | 2.91           |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 2,387,715.90 | 2.90           |
| 12 | 002407 | 多氟多  | 2,223,968.00 | 2.70           |
| 13 | 000157 | 中联重科 | 2,072,100.00 | 2.51           |
| 14 | 002419 | 天虹股份 | 2,069,193.00 | 2.51           |
| 15 | 300451 | 创业慧康 | 1,965,218.00 | 2.38           |
| 16 | 300567 | 精测电子 | 1,906,714.00 | 2.31           |
| 17 | 002709 | 天赐材料 | 1,852,987.00 | 2.25           |
| 18 | 002493 | 荣盛石化 | 1,763,106.00 | 2.14           |
| 19 | 600536 | 中国软件 | 1,391,135.00 | 1.69           |
| 20 | 603019 | 中科曙光 | 1,151,422.00 | 1.40           |

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  | 601888 | 中国国旅 | 3,636,387.87 | 4.41           |
| 2  | 601100 | 恒立液压 | 3,460,130.00 | 4.20           |
| 3  | 600845 | 宝信软件 | 3,280,409.10 | 3.98           |
| 4  | 300054 | 鼎龙股份 | 3,073,516.00 | 3.73           |
| 5  | 002281 | 光迅科技 | 3,029,873.00 | 3.68           |
| 6  | 002594 | 比亚迪  | 2,683,000.00 | 3.25           |
| 7  | 600547 | 山东黄金 | 2,653,948.00 | 3.22           |
| 8  | 002709 | 天赐材料 | 2,351,749.00 | 2.85           |
| 9  | 600030 | 中信证券 | 2,295,000.00 | 2.78           |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 2,278,460.00 | 2.76           |
| 11 | 300363 | 博腾股份 | 2,223,595.00 | 2.70           |
| 12 | 600588 | 用友网络 | 2,218,288.67 | 2.69           |
| 13 | 002563 | 森马服饰 | 2,180,217.00 | 2.64           |
| 14 | 601952 | 苏垦农发 | 2,123,500.00 | 2.58           |
| 15 | 002444 | 巨星科技 | 2,096,008.00 | 2.54           |
| 16 | 300451 | 创业慧康 | 2,054,757.00 | 2.49           |
| 17 | 600566 | 济川药业 | 2,037,831.00 | 2.47           |
| 18 | 300059 | 东方财富 | 2,021,315.00 | 2.45           |
| 19 | 300036 | 超图软件 | 1,823,348.70 | 2.21           |
| 20 | 002439 | 启明星辰 | 1,662,314.00 | 2.02           |

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

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 54,225,518.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 69,825,739.96 |

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

注：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

注：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   | 28,972.36 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 1,603.11  |
| 5  | 应收申购款   | 5,391.90  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 35,967.37 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 3,414        | 29,210.51     | 24,618.23 | 0.02%      | 99,700,069.75 | 99.98%     |

### 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 | 34,829.57 | 0.0349%  |

### 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

|                                   |                      |
|-----------------------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（ 2014 年 10 月 31 日 ）基金份额总额 | 1, 537, 351, 831. 89 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 132, 476, 812. 56    |
| 本报告期期间基金总申购份额                     | 2, 391, 381. 26      |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额                   | 35, 143, 505. 84     |
| 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                      | 99, 724, 687. 98     |

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      | 59,466,503.42 | 48.29%       | 54,333.04 | 48.00%     | -  |
| 太平洋证券 | 2      | 23,081,700.89 | 18.74%       | 21,495.91 | 18.99%     | -  |
| 西南证券  | 1      | 19,323,444.91 | 15.69%       | 17,995.99 | 15.90%     | -  |
| 华创证券  | 1      | 18,977,275.28 | 15.41%       | 17,294.07 | 15.28%     | -  |
| 华安证券  | 2      | 2,287,034.48  | 1.86%        | 2,084.18  | 1.84%      | -  |
| 华泰证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券  | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国海证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华信证券  | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券  | 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) 本报告期本基金新增东方证券 1 个交易单元。

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 债券交易         |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|-------|--------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|       | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 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  | 5,521,387.80 | 68.72%       | -      | -              | -    | -            |
| 太平洋证券 | 2,335,108.30 | 29.06%       | -      | -              | -    | -            |
| 西南证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华安证券  | 177,758.66   | 2.21%        | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国海证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 申万宏源  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 天风证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 安信证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中银国际  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华信证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长城证券  | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 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  | 《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告》 | 中证报及公司网站 | 2019 年 1 月 21 日 |
| 2  | 《华富智慧城市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 |
| 3  | 《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度报告摘要》    | 中证报及公司网站 | 2019 年 3 月 26 日 |

|    |                                                 |          |                 |
|----|-------------------------------------------------|----------|-----------------|
| 4  | 《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》     | 中证报及公司网站 | 2019 年 4 月 11 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》   | 中证报及公司网站 | 2019 年 4 月 11 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浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告》  | 中证报及公司网站 | 2019 年 4 月 17 日 |
| 7  | 《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》            | 中证报及公司网站 | 2019 年 4 月 20 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阳光人寿销售有限公司为代销机构的公告》     | 中证报及公司网站 | 2019 年 4 月 23 日 |
| 9  | 《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》   | 中证报及公司网站 | 2019 年 5 月 7 日  |
| 10 | 《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中投证券费率优惠的公告》            | 中证报及公司网站 | 2019 年 5 月 16 日 |
| 11 | 《华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2019 年第 1 号)》     | 公司网站     | 2019 年 6 月 15 日 |
| 12 | 《华富智慧城市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)》 | 中证报及公司网站 | 2019 年 6 月 15 日 |
| 13 | 《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加徽商银行股份有限公司基金费率优惠活动的公告》  | 中证报及公司网站 | 2019 年 6 月 20 日 |
| 14 | 《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》         | 中证报及公司网站 | 2019 年 6 月 21 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| 无 |
|---|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富智慧城市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。