

# 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华润元大安鑫灵活配置混合   |
| 交易代码       | 000273   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2014 年 9 月 18 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 96,449,242.82 份  |
| 投资目标       | 本基金根据对宏观经济形势的研究，判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势，积极把握股票、债券等市场发展趋势，注重大类资产配置轮换特征、重点挖掘价值低洼，在适度控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略       | <p>本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、投资标的的评估以及组合风险管理全过程中。本基金为灵活配置基金，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。首先根据宏观经济和政策预判，定性大类资产的边际变动方向。其次，参考全部 A 股整体估值（参照万得全 A 指数（除金融，石油石化）市盈率 TTM），每日追踪过去 20 年的历史情况，将 A 股历史估值区间划分成若干分位。如果估值在由低到高排列的 90 分位下方，股票仓位变动是 50%—95%；如果估值在由低到高排列的 90—100 分位，股票仓位在 0—50%。最后，根据短期上涨速度和获利水平，决定短期仓位变化。</p> <p>1、资产配置策略</p> |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人对于大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。</p> <p>(1) 战略资产配置策略</p> <p>在长期范围内，基金管理人将在对中长期大类资产收益预期的基础上获得战略资产配置的最优比例，并以此作为资产配置调整的可参照基准。主要考虑因素包括国内外宏观经济环境、财政及货币政策趋势、大类资产的历史回报、历史波动率、各类资产之间的相关性、行情驱动因素、类别风格轮动等，从其变动及趋势中得出未来资产回报、风险及相关性的可能变化。</p> <p>(2) 战术资产配置策略</p> <p>在短期范围内，基金管理人将对组合进行战术资产配置，即在战略资产配置长期维持均衡的基础上积极主动的实现对大类资产配置的动态优化调整。重点考虑的因素包括：经济基本面及中短期波动、资本市场资金面和流动性、大类资产的估值变化以及市场情绪等。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将运用“价值和成长并重”的投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。</p> <p>同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。</p> <p>本基金将通过基本面分析，结合定量分析和定性分析，进一步筛选出运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的上市公司股票进行投资。其中定量分析重点关注上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价值等方面；定性分析重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。</p> <p>对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：</p> <p>(1)A 股稀缺性行业个股，包括优质中资公司（如</p> |
|--|--|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等)、A 股缺乏投资标的行业(如博彩);</p> <p>(2) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业,这类企业应具有良好成长性或为市场龙头;</p> <p>(3) 符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股;</p> <p>(4) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。</p> <p><b>3、债券投资策略</b></p> <p>本基金将采用“自上而下”的投资策略,对债券类资产进行合理有效的配置,并在配置框架下进行具有针对性的券种选择。具体而言,基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策以及市场趋势调整因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期和市场信用偏好预期,判断债券市场的基本走势,制定久期控制下的资产类属配置策略,力争有效控制整体资产风险。在确定组合整体框架后,基金管理人将对收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行进一步预测,相机而动,积极调整。在债券投资组合构建和管理过程中,基金管理人将具体采用久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断、信用风险评估等管理手段。在债券投资策略制定与执行的过程中,基金管理人将持续对风险进行动态评估和管理,以确保系统性的控制持仓风险,并且在寻求风险结构优化的过程中不断提高组合的收益水平。</p> <p><b>4、权证投资策略</b></p> <p>本基金以被动投资权证为主要策略,包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证,以获取这部分权证带来的增量收益。同时,本基金将在严格控制风险的前提下,以价值分析为基础,主动进行部分权证投资。</p> <p><b>5、股指期货投资策略</b></p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。</p> <p><b>6、资产支持证券投资策略</b></p> <p>当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主(包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产),仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本</p> |
|--|--|

|                 |   |                 |
|-----------------|---|-----------------|
|                 | 基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。   |                 |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×25%+恒生指数收益率×15%。   |                 |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。<br>本基金将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。 |                 |
| 基金管理人           | 华润元大基金管理有限公司  |                 |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 华润元大安鑫灵活配置 A  | 华润元大安鑫灵活配置 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 000273  | 007632          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 9,303,132.74 份  | 87,146,110.08 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2020年4月1日—2020年6月30日） |                |
|-----------------|---------------------------|----------------|
|                 | 华润元大安鑫灵活配置 A              | 华润元大安鑫灵活配置 C   |
| 1. 本期已实现收益      | 441,559.04                | 3,320,859.90   |
| 2. 本期利润         | 1,323,550.82              | 8,814,700.04   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1323                    | 0.1284         |
| 4. 期末基金资产净值     | 13,247,414.88             | 123,661,588.89 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4240                    | 1.4190         |

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

华润元大安鑫灵活配置 A

| 阶段   | 净值增长率① | 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    |
|------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个 | 10.18% | 0.62%     | 7.96%      | 0.73%         | 2.22% | -0.11% |

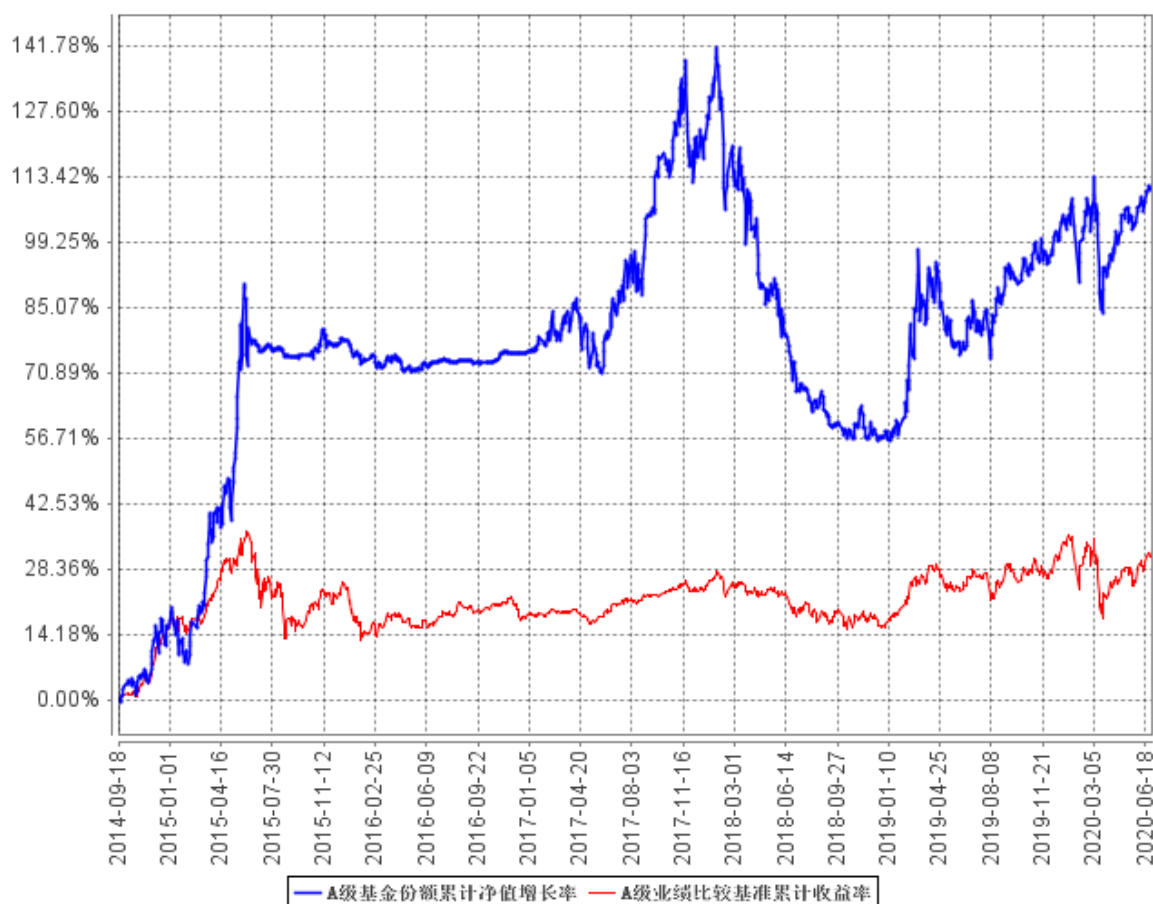
|            |         |       |        |       |        |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 月          |         |       |        |       |        |       |
| 过去六个月      | 4.14%   | 1.22% | -0.61% | 1.14% | 4.75%  | 0.08% |
| 过去一年       | 16.43%  | 1.03% | 4.26%  | 0.90% | 12.17% | 0.13% |
| 过去三年       | 13.98%  | 1.18% | 9.34%  | 0.63% | 4.64%  | 0.55% |
| 过去五年       | 19.63%  | 0.95% | 3.09%  | 0.62% | 16.54% | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 117.01% | 0.98% | 36.32% | 0.58% | 80.69% | 0.40% |

华润元大安鑫灵活配置 C

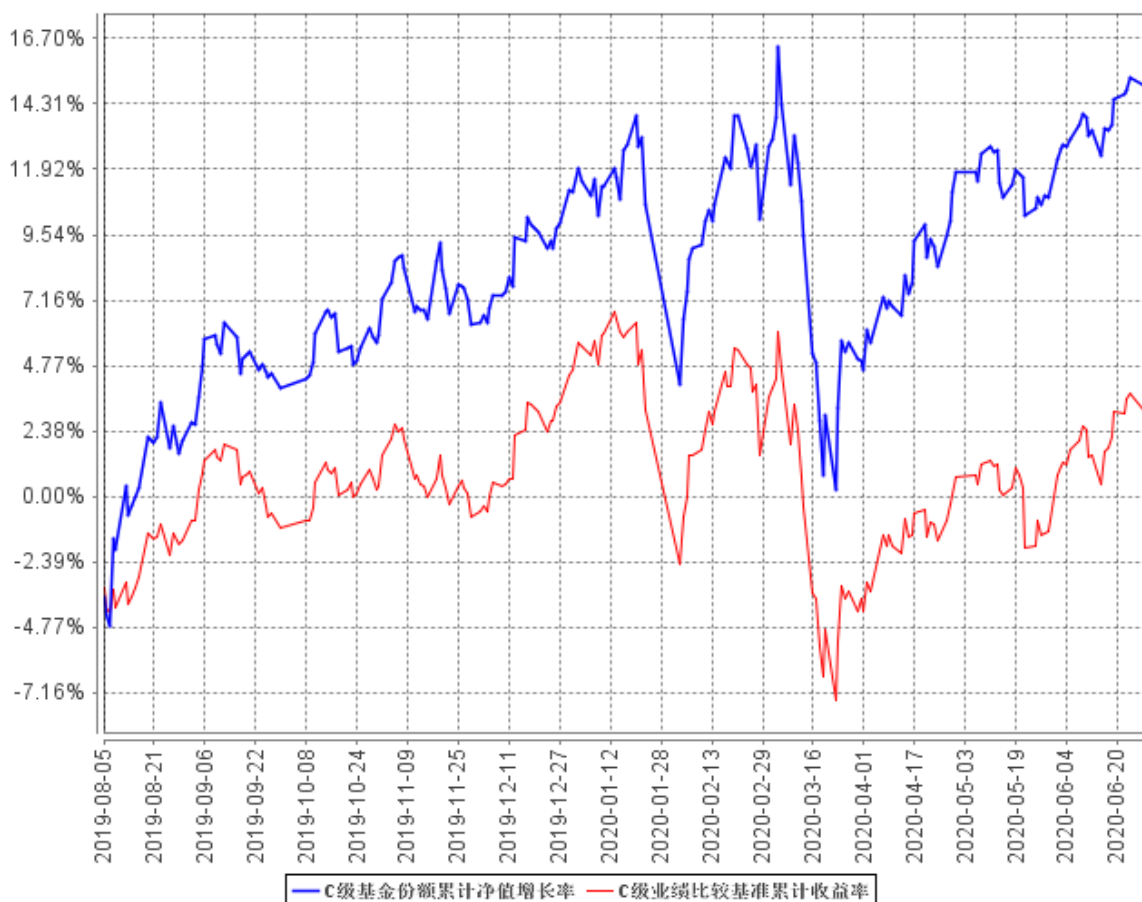
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 10.13% | 0.62%     | 7.96%      | 0.73%         | 2.17%  | -0.11% |
| 过去六个月      | 4.03%  | 1.22%     | -0.61%     | 1.14%         | 4.64%  | 0.08%  |
| 自基金合同生效起至今 | 15.55% | 1.04%     | 3.94%      | 0.92%         | 11.61% | 0.12%  |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



C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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务               | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------------|-------------|------|--------|---|
|     |                  | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 刘宏毅 | 本基金基金经理、投资管理部总经理 | 2018年1月18日  | -    | 11年    | 中国，复旦大学发展经济学硕士，具有基金从业资格。曾任湘财证券有限责任公司研究员、信诚基金管理有限公司宏观分析师。2017年7月17日加入公司，现任投资管理部总经理；2018年1月18日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型投资基金基金经理；2018年6月14日起担任华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金经理；2019年2月14 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 日起担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理；2019 年 11 月 8 日起担任华润元大景泰混合型证券投资基金基金经理；2020 年 3 月 18 日起担任华润元大成长精选股票型发起式证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

展望 2020 年，主要经济体在宏观经济层面处于不同阶段，但无经济体处于上行周期。在宏观经济进入周期后半段时，主要经济体央行会采用宽松政策应对；在主要央行利率近零，货币政策手段受限制情况下，财政政策和产业政策力度可能加大。

宽松的流动性和积极产业政策，可能是更有利于成长股的投资环境，我们看好：1) 稳健的消费升级趋势；2) 信息技术、新能源、医药生物等成长行业等。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大安鑫灵活配置 A 基金份额净值为 1.4240 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.18%；截至本报告期末华润元大安鑫灵活配置 C 基金份额净值为 1.4190 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.13%；同期业绩比较基准收益率为 7.96%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产



净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 71,947,257.02  | 40.52        |
|    | 其中：股票             | 71,947,257.02  | 40.52        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 50,075,000.00  | 28.20        |
|    | 其中：债券             | 50,075,000.00  | 28.20        |
|    | 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      | 53,476,182.58  | 30.12        |
| 8  | 其他资产              | 2,073,118.77   | 1.17         |
| 9  | 合计                | 177,571,558.37 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 2,298,478.00  | 1.68         |
| C  | 制造业              | 24,007,629.18 | 17.54        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32     | 0.01         |
| E  | 建筑业              | 2,036,913.00  | 1.49         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,598,342.12  | 4.82         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 558,830.40    | 0.41         |
| J  | 金融业              | 31,851,098.00 | 23.26        |
| K  | 房地产业             | 1,493,966.00  | 1.09         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,694,330.00  | 1.24         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,394,904.00  | 1.02         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |

|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| P | 教育        | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作   | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -             | -     |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 71,947,257.02 | 52.55 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 120,740 | 8,620,836.00 | 6.30         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 5,800   | 8,484,704.00 | 6.20         |
| 3  | 601816 | 京沪高铁 | 906,536 | 5,593,327.12 | 4.09         |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 43,860  | 4,048,278.00 | 2.96         |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 115,400 | 3,891,288.00 | 2.84         |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 163,900 | 2,586,342.00 | 1.89         |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 95,700  | 2,307,327.00 | 1.69         |
| 8  | 601988 | 中国银行 | 656,000 | 2,282,880.00 | 1.67         |
| 9  | 600887 | 伊利股份 | 68,100  | 2,119,953.00 | 1.55         |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 11,000  | 1,694,330.00 | 1.24         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 50,075,000.00 | 36.58        |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,075,000.00 | 36.58        |
| 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        | 50,075,000.00 | 36.58        |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 018007 | 国开 1801 | 500,000 | 50,075,000.00 | 36.58        |

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持仓股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持仓国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持仓国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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中没有出现发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 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

本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 36,847.28    |
| 2  | 应收证券清算款 | 392,122.85   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,604,197.85 |
| 5  | 应收申购款   | 39,950.79    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,073,118.77 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|---------------|----------|
| 1  | 601816 | 京沪高铁 | 5,593,327.12       | 4.09          | 新股流通受限   |

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 华润元大安鑫灵活配置 A  | 华润元大安鑫灵活配置 C  |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 10,147,090.22 | 50,509,073.54 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 633,052.97    | 59,514,417.16 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,477,010.45  | 22,877,380.62 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 9,303,132.74  | 87,146,110.08 |

注：本基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期期初基金管理人未持有本基金份额，且报告期内基金管理人持有基金份额未发生变动。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|---|----------------|------------|
|---|----------------|------------|

| 资<br>者<br>类<br>别 | 序<br>号 | 持有基金<br>份额比例<br>达到或者<br>超过 20%<br>的时间区<br>间   | 期初<br>份额      | 申购<br>份额      | 赎回<br>份额     | 持有份额          | 份额占<br>比 |
|------------------|--------|---|---------------|---------------|--------------|---------------|----------|
| 机<br>构           | 1      | 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 4 月 2 日, 2020 年 4 月 17 日至 2020 年 4 月 29 日, 2020 年 5 月 6 日至 2020 年 5 月 15 日 | 12,686,554.84 | 0.00          | 0.00         | 12,686,554.84 | 13.15%   |
|                  | 2      | 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 4 月 9 日, 2020 年 4 月 14 日至 2020 年 4 月 29 日, 2020 年 5 月 6 日至 2020 年 6 月 30 日 | 29,690,008.67 | 0.00          | 0.00         | 29,690,008.67 | 30.78%   |
|                  | 3      | 2020 年 5 月 18 日至 2020 年 6 月 12 日  | 0.00          | 25,328,536.82 | 7,500,000.00 | 17,828,536.82 | 18.48%   |
| 个<br>人           | -      | -   | -             | -             | -            | -             | -        |
| -                | -      | -   | -             | -             | -            | -             | -        |
| 产品特有风险           |        |   |               |               |              |               |          |

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020 年 4 月 2 日发布了《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金关于在代销机构、网上直销系统恢复大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告》，4 月 22 日发布了《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年度第 1 季度报告》，4 月 30 日发布了《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告》，5 月 15 日发布了《华润元大基金管理有限公司取消纸质对账单的公告》，5 月 17 日发布了《华润元大基金管理有限公司及子公司关于办公地址变更的公告》，6 月 20 日发布了《华润元大基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告》。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

### 9.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2020 年 7 月 21 日