

# 华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 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 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告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	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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情况 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华富益鑫灵活配置混合	
基金主代码	002728	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 7 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	463,740,901.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002728	002729
报告期末下属分级基金的份额总额	267,386,306.47 份	196,354,595.45 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）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	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	赵万利	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	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	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

## § 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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)		
	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C	
本期已实现收益	7,432,514.64	9,637,078.73	
本期利润	6,867,530.53	6,752,074.74	
加权平均基金份额本期利润	0.0523	0.0393	
本期加权平均净值利润率	4.27%	3.30%	
本期基金份额净值增长率	3.52%	3.45%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利润	58,474,035.29	35,907,099.56
	期末可供分配基金份额利润	0.2187	0.1829
	期末基金资产净值	326,932,458.09	233,024,458.39

期末基金份额净值	1.223	1.187
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	44.68%	41.02%

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

华富益鑫灵活配置混合 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	2.26%	0.22%	3.72%	0.45%	-1.46%	-0.23%
过去三个月	2.95%	0.21%	6.67%	0.45%	-3.72%	-0.24%
过去六个月	3.52%	0.31%	2.64%	0.75%	0.88%	-0.44%
过去一年	11.87%	0.31%	7.54%	0.60%	4.33%	-0.29%
过去三年	30.70%	0.24%	15.33%	0.63%	15.37%	-0.39%
自基金合同生效起至	44.68%	0.25%	21.34%	0.57%	23.34%	-0.32%

华富益鑫灵活配置混合 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	2.24%	0.22%	3.72%	0.45%	-1.48%	-0.23%
过去三个月	2.86%	0.20%	6.67%	0.45%	-3.81%	-0.25%
过去六个月	3.45%	0.31%	2.64%	0.75%	0.81%	-0.44%
过去一年	11.65%	0.31%	7.54%	0.60%	4.11%	-0.29%
过去三年	27.97%	0.24%	15.33%	0.63%	12.64%	-0.39%
自基金合同生效起至	41.02%	0.25%	21.34%	0.57%	19.68%	-0.32%

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

华富益鑫灵活配置混合A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



华富益鑫灵活配置混合C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《华富益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%。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 2016 年 9 月 7 日到 2017 年 3 月 7 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《华富益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 2020 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、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金共四十只基金。

#### 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		
张惠	华富益鑫灵活配置	2016 年 9 月 7 日	-	13 年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历，2007 年 6 月加入华富基金管理有限公

	混合型基 金基金经 理、华富 安享债券 型基金基 金经理、 华富恒利 债券型基 金基金经 理、华富 安鑫债券 型基金基 金经理、 华富安福 债券型基 金基金经 理、华富 星玉衡一 年定期开 放混合型 基金基金 经理、华 富弘鑫灵 活配置混 合型基金 基金经理				司,先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员,2012年5月21日至2014年3月19日任华富策略精选混合型基金基金经理助理,2014年3月20日至2014年11月18日任华富保本混合型基金基金经理助理,2016年6月28日至2017年7月5日任华富灵活配置混合型基金基金经理,2015年3月16日至2018年3月22日(原先写的5月31日为公告时间,根据诚鑫的口径,此处调整为最后运作时间)任华富旺财保本混合型基金基金经理,2016年11月17日至2018年6月19日任华富永鑫灵活配置型基金基金经理,2016年8月26日至2018年8月1日任华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：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

2020 年上半年，全球爆发了新冠疫情，先后在国内外出现大幅扩散蔓延，包括中国在内的全球经济出现阶段性停摆，随着疫情的缓解，国内开始复工复产，经济出现逐季改善的趋势。进入二季度，整个宏观经济呈现从疫情冲击中爬坡态势，4、5、6 月制造业 PMI 分别录得 50.8%、50.4% 以及 50.9%，基本完成疫情 v 型冲击的修复，二季度实际 GDP 同比录得+3.2%，回到正增长区间。外需方面，今年贸易顺差走阔、出口对于 GDP 正向拉动，主要原因在于“衰退式顺差”以及救灾物资。随着二季度末 PMI 数据显示出企业订单持续向好、库存有序去化、工业品原材料价格回升等积极迹象，经济逐渐进入弱复苏阶段。

货币信用环境方面，在信贷扩张、债券融资宽松和地方政府专项债下的共振作用下，社会融资余额增速持续高增，上半年新增社融融资规模逾 20 万亿，同时央行上半年累计下调公开市场操作利率 30BP，整体货币政策维持宽松。下半年预计政策面呈现“宽财政、稳货币”的导向。

海外方面，上半年疫情的加剧成为海外经济主线，二季度中后期各国陆续复工复产，但美国等地区仍有疫情反复迹象。此外，疫情对于经济造成压力的同时，民粹主义迹象也进一步显露，各国贸易摩擦也一直未平息。下半年美国临近大选，中美两国摩擦博弈预计难以平复。

从国内资本市场的表现来看，受到新冠疫情的冲击和影响，一季度 A 股和转债市场均出现了大幅波动，债券市场则受益于悲观的经济增长预期和宽松的货币政策，收益率曲线陡峭化下行。二季度随着国内疫情的控制得力，经济出现环比回升的良好态势，债券市场出现先扬后抑的大幅波动，标志性的 10Y 国债利率上行 24 BP。权益市场在两次疫情冲击后逐步回归基本面，受到疫情影响最小且盈利恢复最快的食品饮料、医药、电子计算机等行业持续上涨，而受到经济下行压力较大的传统行业则持续下跌，股票市场结构分化日益严重。可转债市场由于一季度整体上涨估值抬升明显，二季度也出现普跌的行情。

上半年，本基金主要配置一年左右的高等级债券和存单，权益资产方面继续加大了低估值高分红的稳定收益类股票，同时积极参与科创板新股以获取超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 9 月 7 日正式成立。截止到 2020 年 6 月 30 日，华富益鑫 A 类基金份额净值为 1.223 元，累计份额净值为 1.429 元，本报告期的份额累计净值增长率为 3.52%，同期业绩比较基准收益率为 2.64%；华富益鑫 C 基金份额净值为 1.187 元，累计份额净值为 1.393 元，本报告期的份额累计净值增长率为 3.45%，同期业绩比较基准收益率为 2.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去的半年无疑是历史性的，目前来看，国内疫情已经得到了有效控制，经济在有条不紊的复苏，上半年宽松的货币政策和积极的财政政策双管齐下，未来几个季度经济和企业盈利均有望环比改善。从资产配置角度，随着疫情因素的淡化，受益于复苏以及企业盈利改善，风险资产将优于债券资产。本基金将继续保持获取票息收入为主的债券配置，以及超配风险资产的策略，以低估值正股类转债、相对低价位转债为主要配置方向，及时动态调整，股票仓位仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念，充分考虑风险收益比，寻找具有估值优势或拥有优势赛道具备长期成长性的企业。本基金将继续坚持风格，积极地做好资产配置策略，均衡投资，适度降低业绩波动，力争为基金持有人获取持续较高的投资收益。

#### 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《华富益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 13,619,605.27 元，期末可供分配利润为 94,381,134.85 元。本报告期共实施一次利润分配，分配金额为 16,819,953.56 元。

#### 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益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，华富益鑫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益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，华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 16,819,953.56 元。

### 5.3 托管人对本中期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益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：华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,870,023.16	1,155,773.19
结算备付金		7,711,346.14	952.60
存出保证金		20,642.58	31,412.01
交易性金融资产	6.4.7.2	534,171,587.83	378,237,669.01
其中：股票投资		130,205,887.17	81,296,603.09
基金投资		-	-
债券投资		403,965,700.66	296,941,065.92
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	-	22,000,000.00
应收证券清算款		-	3,712.88
应收利息	6.4.7.5	5,392,239.73	5,082,087.20
应收股利		-	-
应收申购款		30,004,956.98	218,651.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		587,170,796.42	406,730,258.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019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		16,000,000.00	3,000,000.00
应付证券清算款		8,968,466.23	-
应付赎回款		1,591,808.91	17,222.52
应付管理人报酬		196,204.23	207,450.28
应付托管费		49,051.07	51,862.59
应付销售服务费		31,240.77	39,130.99
应付交易费用	6.4.7.7	256,467.88	9,687.37
应交税费		22,132.83	26,500.91
应付利息		-	1,516.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,508.02	129,000.00
负债合计		27,213,879.94	3,482,371.10
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	463,740,901.92	330,211,808.03
未分配利润	6.4.7.10	96,216,014.56	73,036,079.00
所有者权益合计		559,956,916.48	403,247,887.03
负债和所有者权益总计		587,170,796.42	406,730,258.13

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.223 元、C 类基金份额净值 1.187 元，基金份额总额 463,740,901.92 份，A 类基金份额总额 267,386,306.47 份、C 类基金份额总额 196,354,595.45 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：华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年1月1日至2020年	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年
-----	-----	-----------------------	----------------------------

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		15,989,039.73	4,033,434.24
1. 利息收入		5,638,911.33	1,620,951.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,782.33	35,169.09
债券利息收入		5,599,349.82	1,585,117.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,779.18	665.04
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,780,176.02	1,366,972.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,261,408.61	155,859.32
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-39,749.59	139,310.34
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	1,558,517.00	1,071,802.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,449,988.10	1,040,907.25
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	19,940.48	4,602.71
减：二、费用		2,369,434.46	841,562.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,099,740.30	378,713.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	274,935.08	94,678.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	205,023.39	72,717.09
4. 交易费用	6.4.7.19	462,153.55	157,071.19
5. 利息支出		197,629.71	40,259.05
其中：卖出回购金融资产支出		197,629.71	40,259.05
6. 税金及附加		16,542.92	3,057.82
7. 其他费用	6.4.7.20	113,409.51	95,064.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,619,605.27	3,191,872.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,619,605.27	3,191,872.24

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：华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	330,211,808.03	73,036,079.00	403,247,887.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,619,605.27	13,619,605.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	133,529,093.89	26,380,283.85	159,909,377.74
其中：1. 基金申购款	337,162,619.32	67,747,914.09	404,910,533.41
2. 基金赎回款	-203,633,525.43	-41,367,630.24	-245,001,155.67
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）	-	-16,819,953.56	-16,819,953.56
五、期末所有者权益（基金净值）	463,740,901.92	96,216,014.56	559,956,916.48
项目	上年度可比期间 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）	46,795,288.97	8,419,213.46	55,214,502.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,191,872.24	3,191,872.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	229,789,587.47	41,660,086.09	271,449,673.56



(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	232,852,981.99	42,278,722.56	275,131,704.55
2. 基金赎回款	-3,063,394.52	-618,636.47	-3,682,030.99
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)	-	-1,699,372.60	-1,699,372.60
五、期末所有者权益(基金净值)	276,584,876.44	51,571,799.19	328,156,675.63

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：

赵万里

曹华玮

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

华富益鑫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[2016]852号）核准，基金合同于2016年9月7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（2016）6-134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《华富益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，包括国内依法公开发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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、中小企业私募债等）、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 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。

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 1%、2%

[注]：接地方税务局通知，自 2019 年 7 月 1 日起调整地方教育附加税税率，由原来的 1%调整为 2%。

#### 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	9,870,023.16
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	9,870,023.16

注：其他存款所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	124,451,477.12	130,205,887.17	5,754,410.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	217,230,200.66	-1,318,204.11
	银行间市场	186,735,500.00	-212,010.22
	-	-	-
	合计	403,965,700.66	-1,530,214.33
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	529,947,392.11	534,171,587.83	4,224,195.72

##### 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 2020年6月30日
应收活期存款利息	691.76
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	3,470.10
应收债券利息	5,388,068.57
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	-
应收出借证券利息	-
其他	9.30
合计	5,392,239.73

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	254,442.88
银行间市场应付交易费用	2,025.00
-	-
合计	256,467.88

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	0.42
应付证券出借违约金	-
上清账户维护费	4,500.00
应付审计费	29,835.26
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	59,672.34
合计	98,508.02

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富益鑫灵活配置混合 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	137,158,885.76	137,158,885.76
本期申购	199,808,809.79	199,808,809.79
本期赎回（以“-”号填列）	-69,581,389.08	-69,581,389.08
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	267,386,306.47	267,386,306.47

华富益鑫灵活配置混合 C

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	193,052,922.27	193,052,922.27
本期申购	137,353,809.53	137,353,809.53
本期赎回（以“-”号填列）	-134,052,136.35	-134,052,136.35
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	196,354,595.45	196,354,595.45

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

华富益鑫灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,839,898.42	3,167,044.51	33,006,942.93
本期利润	7,432,514.64	-564,984.11	6,867,530.53
本期基金份额 交易产生的变	27,837,013.29	-1,529,944.07	26,307,069.22

动数			
其中：基金申购款	42,677,412.25	-1,104,561.44	41,572,850.81
基金赎回款	-14,840,398.96	-425,382.63	-15,265,781.59
本期已分配利润	-6,635,391.06	-	-6,635,391.06
本期末	58,474,035.29	1,072,116.33	59,546,151.62
华富益鑫灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,700,140.83	4,328,995.24	40,029,136.07
本期利润	9,637,078.73	-2,885,003.99	6,752,074.74
本期基金份额交易产生的变动数	754,442.50	-681,227.87	73,214.63
其中：基金申购款	25,732,577.64	442,485.64	26,175,063.28
基金赎回款	-24,978,135.14	-1,123,713.51	-26,101,848.65
本期已分配利润	-10,184,562.50	-	-10,184,562.50
本期末	35,907,099.56	762,763.38	36,669,862.94

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	21,381.48
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	14,305.40
其他	95.45
合计	35,782.33

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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,261,408.61
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	12,261,408.61

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	129,407,377.24
减：卖出股票成本总额	117,145,968.63
买卖股票差价收入	12,261,408.61

#### 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 2020年1月1日至2020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	-39,749.59
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	-39,749.59

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	353,668,845.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	345,537,132.99
减：应收利息总额	8,171,462.18
买卖债券差价收入	-39,749.59

##### 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衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,558,517.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,558,517.00

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,449,988.10
股票投资	-158,777.59
债券投资	-3,291,210.51
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-3,449,988.10

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	19,940.48
-	-
合计	19,940.48

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	458,478.55
银行间市场交易费用	3,675.00



	-
合计	462,153.55

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	5,301.91
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	113,409.51

注：其他所列金额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

根据本管理人于 2020 年 8 月 21 日发布的分红公告，本基金于 2020 年 8 月 24 日（除权日）进行本年度第二次分红，份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.4 元。

#### 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、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行股份有限公司”）	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	112,101,350.08	38.99	57,722,454.07	47.85

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	823,570.40	0.39	5,962,608.60	10.94

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华安证券	288,200,000.00	11.26	4,500,000.00	5.63

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均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 2020年1月1日至2020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	104,399.38	39.17	92,570.04	36.38
关联方名称	上年度可比期间 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	53,756.31	47.86	53,240.02	48.80

## 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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,099,740.30	378,713.54
其中：支付销售机构的客户维护费	14,190.57	3,761.10

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.6% 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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	274,935.08	94,678.39

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 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C	合计
华安证券		7.65	7.65
华富基金管理有限公司	0.00	199,199.26	199,199.26
合计	0.00	199,206.91	199,206.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C	合计

华安证券	-	19.75	19.75
华富基金管理有限公司	-	53,613.49	53,613.49
合计	-	53,633.24	53,633.24

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 7 日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00

期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016年9月7日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

注：本基金本报告期和上年度可比期间内本基金管理人没有运用自有资金投资本基金。

#### 6.4.10.5.2 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基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

#### 6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	9,870,023.16	21,381.48	6,686,656.42	34,048.78

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

华富益鑫灵活配置混合 A
--------------

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 3 月 26 日	-	2020 年 3 月 26 日	0.6000	6,620,22 7.88	15,163.18	6,635,39 1.06	-
合计	-	-	-	0.6000	6,620,22 7.88	15,163.18	6,635,39 1.06	-
华富益鑫灵活配置混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 3 月 26 日	-	2020 年 3 月 26 日	0.6000	8,435,16 3.89	1,749,398. 61	10,184,5 62.50	-
合计	-	-	-	0.6000	8,435,16 3.89	1,749,398. 61	10,184,5 62.50	-

#### 6.4.12 期末(2020 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
300840	酷特 智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股流 通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝 股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股流 通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安 高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股流 通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流 通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688106	金宏 气体	2020 年 6 月 9 日	2020 年 12 月 16 日	科创板 新股锁 定	15.48	41.36	16,986	262,943.28	702,540.96	-
688159	有方 科技	2020 年 1 月 16 日	2020 年 7 月 23 日	科创板 新股锁 定	20.35	52.73	3,341	67,989.35	176,170.93	-
688200	华峰 测控	2020 年 2 月 11 日	2020 年 8 月 18 日	科创板 新股锁 定	107.41	270.02	3,192	342,852.72	861,903.84	-

688377	迪威尔	2020年 6月29 日	2020年 7月8 日	新股流 通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
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：张)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
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：份)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

注：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

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 16,000,000.00 元，该 16,000,000.00 元于 2020 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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发行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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	49,994,000.00	10,060,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
-	-	-
未评级	29,953,000.00	170,566,000.00
合计	79,947,000.00	180,626,000.00

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：本基金本报告期末及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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
-	-	-
未评级	0.00	38,949,000.00
合计	0.00	38,949,000.00

#### 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	368,103,000.00	229,538,143.30
AAA 以下	2,873,955.90	7,070,614.62
-	-	-
未评级	-	-
合计	370,976,955.90	236,608,757.92

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：本基金本报告期末及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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	38,949,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
-	-	-
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	38,949,000.00

### 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 2020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	9,870,023.16	-	-	-	-	-	9,870,023.16
结算备付金	7,711,346.14	-	-	-	-	-	7,711,346.14
存出保证金	20,642.58	-	-	-	-	-	20,642.58
交易性金融资产	20,162,000.00	41,434,253.00	244,311,991.76	98,057,455.90	-	130,205,887.17	534,171,558.73
买入返售金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
应收利息	-	-	-	-	-	5,392,239.73	5,392,239.73
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	30,004,956.98	30,004,956.98
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	37,764,011.88	41,434,253.00	244,311,991.76	98,057,455.90	-	165,603,083.88	587,170,796.42
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,591,808.91	1,591,808.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	196,204.23	196,204.23
应付托管费	-	-	-	-	-	49,051.07	49,051.07
应付证券清算款	-	-	-	-	-	8,968,466.23	8,968,466.23
卖出回购金融资产款	16,000,000.00	-	-	-	-	-	16,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,240.77	31,240.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	256,467.88	256,467.88
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	22,132.83	22,132.83
其他负债	-	-	-	-	-	98,508.02	98,508.02
负债总计	16,000,000.00	-	-	-	-	11,213,879.94	27,213,879.94
利率敏感度缺口	21,764,011.88	41,434,253.00	244,311,991.76	98,057,455.90	-	154,389,203.94	559,956,916.48
上年度末							
2019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	1,155,773.19	-	-	-	-	-	1,155,773.19
结算备付金	952.60	-	-	-	-	-	952.60
存出保证金	31,412.01	-	-	-	-	-	31,412.01
交易性金融资产	90,874,186.40	99,342,000.00	82,046,404.80	24,678,474.72	-	81,296,603.09	378,237,669.01
买入返售金融	22,000,000.	-	-	-	-	-	22,000,000.

资产		00						.00
应收利息		-	-	-	-	-	5,082,087.20	5,082,087.20
应收股利		-	-	-	-	-	-	-
应收申购款		-	-	-	-	-	218,651.24	218,651.24
应收证券清算款		-	-	-	-	-	3,712.88	3,712.88
其他资产		-	-	-	-	-	-	-
资产总计	114,062,324.20	99,342,000.00	82,046,404.80	24,678,474.72	-	-	86,601,054.41	406,730,258.13
负债								
应付赎回款		-	-	-	-	-	17,222.52	17,222.52
应付管理人报酬		-	-	-	-	-	207,450.28	207,450.28
应付托管费		-	-	-	-	-	51,862.59	51,862.59
应付证券清算款		-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,000,000.00	-	-	-	-	-	-	3,000,000.00
应付销售服务费		-	-	-	-	-	39,130.99	39,130.99
应付交易费用		-	-	-	-	-	9,687.37	9,687.37
应付利息		-	-	-	-	-	1,516.44	1,516.44
应付利润		-	-	-	-	-	-	-
应交税费		-	-	-	-	-	26,500.91	26,500.91
其他负债		-	-	-	-	-	129,000.00	129,000.00
负债总计	3,000,000.00	-	-	-	-	-	482,371.10	3,482,371.10
利率敏感度缺口	111,062,324.20	99,342,000.00	82,046,404.80	24,678,474.72	-	-	86,118,683.31	403,247,887.03

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		
	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率下降 25	758,369.86	245,161.97

	基点		
	市场利率上升 25 基点	-756,501.52	-244,790.79

#### 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 2020年6月30日		上年度末 2019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	130,205,887.17	23.25	81,296,603.09	20.16
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	403,965,700.66	72.14	296,941,065.92	73.64
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	534,171,587.83	95.40	378,237,669.01	93.80

##### 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		
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 (2020年6月30日)	上年度末 (2019年12月31日)	
分析	沪深 300 指数上升百分之五	1,256,436.06	520,199.82

	沪深 300 指数下降百分之五	-1,256,436.06	-520,199.82
--	-----------------	---------------	-------------

#### 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 (单位: 人民币元)	本期末 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	合计	39,671,675.06	18865833.52

#### 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	130,205,887.17	22.18
	其中: 股票	130,205,887.17	22.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	403,965,700.66	68.80
	其中: 债券	403,965,700.66	68.80
	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	17,581,369.30	2.99
-	-	-	-
8	其他各项资产	35,417,839.29	6.03
9	合计	587,170,796.42	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 报告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	2,528,740.00	0.45
B	采矿业	2,475,761.44	0.44
C	制造业	68,122,403.45	12.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,180,740.31	0.39
E	建筑业	2,032,161.00	0.36
F	批发和零售业	1,542,732.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	3,381,697.20	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,846,320.77	1.04
J	金融业	29,159,910.21	5.21
K	房地产业	6,520,875.54	1.16
L	租赁和商务服务业	1,734,873.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	1,194,674.25	0.21
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	355,200.00	0.06
Q	卫生和社会工作	2,068,890.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	1,060,908.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	130,205,887.17	23.25

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	75,000	5,355,000.00	0.96
2	600519	贵州茅台	3,500	5,120,080.00	0.91
3	000858	五粮液	22,300	3,815,976.00	0.68
4	002475	立讯精密	48,300	2,480,205.00	0.44
5	600276	恒瑞医药	25,700	2,372,110.00	0.42
6	000002	万科A	78,200	2,044,148.00	0.37
7	600048	保利地产	134,528	1,988,323.84	0.36
8	000333	美的集团	31,600	1,889,364.00	0.34
9	000651	格力电器	31,677	1,791,967.89	0.32
10	300059	东方财富	74,100	1,496,820.00	0.27
11	000725	京东方A	311,300	1,453,771.00	0.26
12	002241	歌尔股份	49,300	1,447,448.00	0.26

13	000661	长春高新	3,300	1,436,490.00	0.26
14	000001	平安银行	111,515	1,427,392.00	0.25
15	600030	中信证券	59,000	1,422,490.00	0.25
16	002714	牧原股份	17,200	1,410,400.00	0.25
17	601166	兴业银行	86,341	1,362,460.98	0.24
18	600887	伊利股份	42,000	1,307,460.00	0.23
19	002415	海康威视	43,000	1,305,050.00	0.23
20	000860	顺鑫农业	22,500	1,282,050.00	0.23
21	000063	中兴通讯	31,000	1,244,030.00	0.22
22	600036	招商银行	35,800	1,207,176.00	0.22
23	600900	XD 长江电	60,936	1,154,127.84	0.21
24	300498	温氏股份	51,300	1,118,340.00	0.20
25	601888	中国中免	6,800	1,047,404.00	0.19
26	300015	爱尔眼科	23,100	1,003,695.00	0.18
27	601328	交通银行	190,262	976,044.06	0.17
28	000100	TCL 科技	155,500	964,100.00	0.17
29	300142	沃森生物	17,700	926,772.00	0.17
30	002142	宁波银行	34,500	906,315.00	0.16
31	600585	海螺水泥	16,618	879,258.38	0.16
32	688200	华峰测控	3,192	861,903.84	0.15
33	600000	浦发银行	81,300	860,154.00	0.15
34	600016	民生银行	147,300	835,191.00	0.15
35	603288	海天味业	6,700	833,480.00	0.15
36	002352	顺丰控股	15,200	831,440.00	0.15
37	600031	三一重工	40,900	767,284.00	0.14
38	601688	华泰证券	40,800	767,040.00	0.14
39	000568	泸州老窖	8,400	765,408.00	0.14
40	000338	潍柴动力	55,100	755,972.00	0.14
41	002594	比亚迪	10,400	746,720.00	0.13
42	601012	隆基股份	18,300	745,359.00	0.13
43	300122	智飞生物	7,400	741,110.00	0.13
44	002304	洋河股份	6,900	725,466.00	0.13
45	000876	新 希 望	24,200	721,160.00	0.13
46	002410	广联达	10,336	720,419.20	0.13
47	600837	海通证券	56,000	704,480.00	0.13
48	688106	金宏气体	16,986	702,540.96	0.13
49	603259	药明康德	7,200	695,520.00	0.12
50	601668	中国建筑	145,300	693,081.00	0.12
51	000895	双汇发展	14,900	686,741.00	0.12
52	002555	三七互娱	14,600	683,280.00	0.12
53	601288	农业银行	198,962	672,491.56	0.12
54	002230	科大讯飞	17,700	662,511.00	0.12



55	002456	欧菲光	36,000	662,040.00	0.12
56	002008	大族激光	18,300	657,885.00	0.12
57	002027	分众传媒	118,100	657,817.00	0.12
58	000938	紫光股份	15,200	653,296.00	0.12
59	300601	康泰生物	3,900	632,424.00	0.11
60	002007	华兰生物	12,600	631,386.00	0.11
61	002460	赣锋锂业	11,700	626,769.00	0.11
62	600570	恒生电子	5,800	624,660.00	0.11
63	000977	浪潮信息	15,700	615,126.00	0.11
64	300347	泰格医药	6,000	611,280.00	0.11
65	002024	苏宁易购	68,900	604,253.00	0.11
66	001979	招商蛇口	36,400	598,416.00	0.11
67	601601	中国太保	21,800	594,050.00	0.11
68	601229	上海银行	68,900	571,870.00	0.10
69	000538	云南白药	5,872	550,852.32	0.10
70	600309	万华化学	10,900	544,891.00	0.10
71	603986	兆易创新	2,300	542,593.00	0.10
72	601211	国泰君安	31,200	538,512.00	0.10
73	300413	芒果超媒	8,200	534,640.00	0.10
74	000166	申万宏源	103,600	523,180.00	0.09
75	300003	乐普医疗	14,268	521,067.36	0.09
76	002271	东方雨虹	12,600	511,938.00	0.09
77	601988	中国银行	145,950	507,906.00	0.09
78	300014	亿纬锂能	10,600	507,210.00	0.09
79	002129	中环股份	22,400	503,104.00	0.09
80	601169	北京银行	102,500	502,250.00	0.09
81	688222	成都先导	9,201	499,154.25	0.09
82	600588	用友网络	11,200	493,920.00	0.09
83	600009	上海机场	6,700	482,869.00	0.09
84	000776	广发证券	34,000	480,080.00	0.09
85	002371	北方华创	2,800	478,548.00	0.09
86	300136	信维通信	8,900	471,878.00	0.08
87	601766	中国中车	84,200	468,994.00	0.08
88	600690	海尔智家	26,200	463,740.00	0.08
89	002044	美年健康	31,500	453,915.00	0.08
90	300124	汇川技术	11,900	452,081.00	0.08
91	002050	三花智控	20,600	451,140.00	0.08
92	002001	新和成	15,100	439,410.00	0.08
93	002602	世纪华通	28,600	437,866.00	0.08
94	600999	招商证券	19,800	434,610.00	0.08
95	002311	海大集团	9,100	433,069.00	0.08
96	002624	完美世界	7,400	426,536.00	0.08

97	300433	蓝思科技	15,100	423,404.00	0.08
98	600703	三安光电	16,900	422,500.00	0.08
99	601899	XD 紫金矿	95,200	418,880.00	0.07
100	600104	上汽集团	24,272	412,381.28	0.07
101	002236	大华股份	20,700	397,647.00	0.07
102	601818	光大银行	110,271	394,770.18	0.07
103	002938	鹏鼎控股	7,800	390,468.00	0.07
104	600745	闻泰科技	3,100	390,445.00	0.07
105	000157	中联重科	59,600	383,228.00	0.07
106	600919	江苏银行	64,000	362,880.00	0.06
107	600028	中国石化	92,640	362,222.40	0.06
108	600436	片仔癀	2,100	357,525.00	0.06
109	002607	中公教育	12,800	355,200.00	0.06
110	002463	沪电股份	13,900	347,222.00	0.06
111	300033	同花顺	2,500	332,700.00	0.06
112	300408	三环集团	12,000	332,400.00	0.06
113	600547	山东黄金	9,000	329,580.00	0.06
114	601088	中国神华	22,839	327,968.04	0.06
115	002120	韵达股份	13,300	325,185.00	0.06
116	600406	国电南瑞	16,000	324,000.00	0.06
117	002736	国信证券	28,300	319,790.00	0.06
118	000425	徐工机械	54,000	319,140.00	0.06
119	002202	金风科技	31,700	316,049.00	0.06
120	601628	中国人寿	11,500	312,915.00	0.06
121	600050	中国联通	64,500	312,180.00	0.06
122	300144	宋城演艺	18,000	311,400.00	0.06
123	600438	通威股份	17,800	309,364.00	0.06
124	601009	南京银行	41,578	304,766.74	0.05
125	000783	长江证券	44,500	299,930.00	0.05
126	002841	视源股份	3,000	298,560.00	0.05
127	601939	建设银行	46,504	293,440.24	0.05
128	601006	大秦铁路	41,180	289,907.20	0.05
129	603160	汇顶科技	1,300	289,770.00	0.05
130	000069	华侨城 A	47,100	285,426.00	0.05
131	600196	复星医药	8,400	284,340.00	0.05
132	601390	中国中铁	56,400	283,128.00	0.05
133	000768	中航飞机	15,900	282,066.00	0.05
134	601857	中国石油	67,300	281,987.00	0.05
135	600019	宝钢股份	61,689	281,301.84	0.05
136	603019	中科曙光	7,200	276,480.00	0.05
137	002916	深南电路	1,600	268,032.00	0.05
138	601186	中国铁建	31,900	267,322.00	0.05

139	002493	荣盛石化	21,700	266,910.00	0.05
140	000066	中国长城	20,200	266,640.00	0.05
141	600809	山西汾酒	1,800	261,000.00	0.05
142	600015	华夏银行	42,600	260,712.00	0.05
143	002179	中航光电	6,300	258,363.00	0.05
144	000963	华东医药	10,200	258,060.00	0.05
145	601336	新华保险	5,800	256,824.00	0.05
146	601989	中国重工	63,200	252,800.00	0.05
147	002157	正邦科技	14,400	251,712.00	0.04
148	601933	永辉超市	26,500	248,570.00	0.04
149	000625	长安汽车	22,415	246,565.00	0.04
150	002422	科伦药业	11,600	243,600.00	0.04
151	603501	韦尔股份	1,200	242,340.00	0.04
152	600958	东方证券	24,800	235,352.00	0.04
153	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.04
154	002466	天齐锂业	10,200	234,090.00	0.04
155	600183	生益科技	7,900	231,233.00	0.04
156	600352	浙江龙盛	18,000	230,220.00	0.04
157	600741	XD 华域汽	10,916	226,943.64	0.04
158	601377	兴业证券	32,500	222,625.00	0.04
159	601788	光大证券	13,500	216,810.00	0.04
160	002601	龙鳞佰利	11,700	216,450.00	0.04
161	600383	金地集团	15,631	214,144.70	0.04
162	300628	亿联网络	3,100	211,606.00	0.04
163	601138	工业富联	13,800	209,070.00	0.04
164	000786	北新建材	9,700	206,901.00	0.04
165	600346	恒力石化	14,600	204,400.00	0.04
166	600660	福耀玻璃	9,709	202,626.83	0.04
167	601901	方正证券	28,500	201,780.00	0.04
168	003816	中国广核	67,800	200,688.00	0.04
169	000656	金科股份	24,500	199,920.00	0.04
170	601225	陕西煤业	27,700	199,717.00	0.04
171	601155	新城控股	6,300	196,812.00	0.04
172	002252	上海莱士	23,200	196,272.00	0.04
173	000596	古井贡酒	1,300	195,312.00	0.03
174	601877	正泰电器	7,400	194,990.00	0.03
175	000728	国元证券	23,200	194,880.00	0.03
176	600522	中天科技	17,000	194,650.00	0.03
177	000703	恒逸石化	21,200	193,556.00	0.03
178	600109	国金证券	16,800	191,688.00	0.03
179	600340	华夏幸福	8,300	189,738.00	0.03
180	000961	中南建设	21,300	189,570.00	0.03

181	601669	中国电建	53,000	183,380.00	0.03
182	603799	华友钴业	4,700	182,642.00	0.03
183	603993	洛阳钼业	48,900	179,463.00	0.03
184	601800	中国交建	24,400	179,096.00	0.03
185	601108	财通证券	17,400	178,350.00	0.03
186	601985	XD 中国核	43,100	176,279.00	0.03
187	688159	有方科技	3,341	176,170.93	0.03
188	601555	东吴证券	21,500	175,440.00	0.03
189	600089	特变电工	25,700	173,989.00	0.03
190	600867	通化东宝	9,900	172,557.00	0.03
191	002508	老板电器	5,500	171,105.00	0.03
192	603369	今世缘	4,300	171,097.00	0.03
193	002673	西部证券	20,100	164,016.00	0.03
194	002146	荣盛发展	20,000	162,000.00	0.03
195	600606	绿地控股	25,300	156,354.00	0.03
196	600487	亨通光电	9,500	155,895.00	0.03
197	600029	南方航空	29,800	154,066.00	0.03
198	600795	国电电力	81,600	150,960.00	0.03
199	600061	国投资本	11,700	148,941.00	0.03
200	002773	康弘药业	3,000	148,800.00	0.03
201	600886	国投电力	18,800	147,768.00	0.03
202	600705	中航资本	37,300	147,708.00	0.03
203	601607	上海医药	8,000	147,040.00	0.03
204	002739	万达电影	9,600	146,592.00	0.03
205	600926	杭州银行	16,400	146,288.00	0.03
206	603658	安图生物	900	146,196.00	0.03
207	600893	航发动力	6,200	145,576.00	0.03
208	002153	石基信息	3,700	144,411.00	0.03
209	601100	恒立液压	1,800	144,360.00	0.03
210	603899	晨光文具	2,600	141,960.00	0.03
211	600498	XD 烽火通	4,900	141,659.00	0.03
212	002958	青农商行	31,900	141,317.00	0.03
213	600111	北方稀土	15,100	140,732.00	0.03
214	601162	天风证券	23,100	139,986.00	0.02
215	601066	中信建投	3,500	137,830.00	0.02
216	600637	东方明珠	14,200	137,030.00	0.02
217	601111	中国国航	20,700	136,827.00	0.02
218	002032	苏泊尔	1,900	134,900.00	0.02
219	600176	中国巨石	14,600	133,590.00	0.02
220	002939	长城证券	10,700	131,824.00	0.02
221	600115	东方航空	31,000	130,820.00	0.02
222	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02

223	600011	华能国际	30,500	128,710.00	0.02
224	601360	三六零	7,000	128,170.00	0.02
225	600233	圆通速递	8,800	128,128.00	0.02
226	601727	上海电气	25,300	127,512.00	0.02
227	601816	京沪高铁	20,400	127,092.00	0.02
228	600118	中国卫星	4,100	126,403.00	0.02
229	600332	白云山	3,900	126,087.00	0.02
230	600271	航天信息	7,700	125,048.00	0.02
231	601600	中国铝业	45,300	125,028.00	0.02
232	601618	XD 中国中	49,500	124,245.00	0.02
233	002558	巨人网络	7,000	121,800.00	0.02
234	600221	海航控股	79,700	119,550.00	0.02
235	601838	成都银行	15,000	119,400.00	0.02
236	000671	阳光城	18,800	119,192.00	0.02
237	000627	天茂集团	22,700	118,267.00	0.02
238	600489	中金黄金	12,900	117,906.00	0.02
239	601919	中远海控	33,500	116,245.00	0.02
240	002468	申通快递	7,000	114,870.00	0.02
241	600177	雅戈尔	19,233	114,628.68	0.02
242	600068	葛洲坝	19,100	113,645.00	0.02
243	600066	宇通客车	9,199	112,227.80	0.02
244	601997	贵阳银行	15,600	111,696.00	0.02
245	600390	五矿资本	15,600	110,136.00	0.02
246	600004	白云机场	7,200	109,728.00	0.02
247	601998	中信银行	21,223	109,298.45	0.02
248	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
249	603833	欧派家居	900	104,310.00	0.02
250	601198	东兴证券	9,500	103,550.00	0.02
251	600085	同仁堂	3,800	103,056.00	0.02
252	601881	中国银河	8,900	102,083.00	0.02
253	600018	上港集团	24,100	101,220.00	0.02
254	600219	南山铝业	49,700	100,891.00	0.02
255	601231	环旭电子	4,600	100,464.00	0.02
256	000709	河钢股份	48,800	99,552.00	0.02
257	600516	方大炭素	15,800	99,224.00	0.02
258	600655	豫园股份	11,100	98,346.00	0.02
259	601018	宁波港	27,400	97,818.00	0.02
260	600362	江西铜业	7,200	96,912.00	0.02
261	600998	九州通	5,200	96,824.00	0.02
262	600760	中航沈飞	2,900	95,178.00	0.02
263	601319	中国人保	14,700	94,668.00	0.02
264	600170	上海建工	30,800	94,556.00	0.02

265	601117	中国化学	17,100	93,708.00	0.02
266	601878	浙商证券	9,200	91,172.00	0.02
267	600297	广汇汽车	28,100	89,639.00	0.02
268	600369	西南证券	19,500	89,505.00	0.02
269	600208	新湖中宝	29,800	88,804.00	0.02
270	000723	美锦能源	14,100	88,266.00	0.02
271	601021	春秋航空	2,500	88,100.00	0.02
272	600848	上海临港	4,100	88,027.00	0.02
273	601658	邮储银行	18,600	85,002.00	0.02
274	600674	川投能源	9,145	84,774.15	0.02
275	600038	中直股份	2,000	82,140.00	0.01
276	600027	华电国际	22,600	77,292.00	0.01
277	603156	养元饮品	3,505	75,357.50	0.01
278	601992	金隅集团	23,100	70,686.00	0.01
279	600482	中国动力	4,500	70,650.00	0.01
280	000708	中信特钢	4,100	70,069.00	0.01
281	600583	海油工程	15,300	69,615.00	0.01
282	600977	中国电影	5,200	68,276.00	0.01
283	601633	长城汽车	8,400	64,848.00	0.01
284	601216	君正集团	23,400	59,436.00	0.01
285	601916	浙商银行	15,000	59,100.00	0.01
286	601238	广汽集团	6,400	57,600.00	0.01
287	601577	长沙银行	7,100	56,374.00	0.01
288	601236	红塔证券	2,800	54,320.00	0.01
289	601808	中海油服	4,100	53,874.00	0.01
290	600398	海澜之家	9,182	53,439.24	0.01
291	600188	兖州煤业	6,100	53,436.00	0.01
292	601698	中国卫通	2,800	50,428.00	0.01
293	600372	中航电子	3,700	49,284.00	0.01
294	600928	西安银行	9,200	48,392.00	0.01
295	601898	中煤能源	12,700	48,260.00	0.01
296	600025	华能水电	12,500	47,375.00	0.01
297	600989	宝丰能源	5,600	47,152.00	0.01
298	002945	华林证券	3,100	42,811.00	0.01
299	601077	渝农商行	8,000	37,760.00	0.01
300	600968	海油发展	14,100	32,853.00	0.01
301	601828	美凯龙	2,800	29,652.00	0.01
302	601298	青岛港	4,900	27,832.00	0.00
303	603260	合盛硅业	1,000	27,340.00	0.00
304	601212	XD 白银有	10,300	26,265.00	0.00
305	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
306	600299	安迪苏	2,000	24,440.00	0.00

307	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
308	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
309	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
310	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
311	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
312	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
313	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

## 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	601988	中国银行	9,999,500.00	2.48
2	601288	农业银行	9,998,120.00	2.48
3	601939	建设银行	9,983,100.00	2.48
4	601318	中国平安	5,513,079.00	1.37
5	600519	贵州茅台	4,917,522.00	1.22
6	000858	五粮液	3,512,322.00	0.87
7	600507	方大特钢	3,046,464.00	0.76
8	600276	恒瑞医药	2,281,146.00	0.57
9	002475	立讯精密	2,154,386.00	0.53
10	600114	东睦股份	1,938,351.00	0.48
11	601003	柳钢股份	1,848,549.00	0.46
12	000333	美的集团	1,812,972.00	0.45
13	600808	马钢股份	1,714,608.00	0.43
14	000725	京东方 A	1,417,971.00	0.35
15	600030	中信证券	1,356,053.00	0.34
16	002415	海康威视	1,297,239.00	0.32
17	000063	中兴通讯	1,290,945.00	0.32
18	002241	歌尔股份	1,284,411.00	0.32
19	002714	牧原股份	1,249,872.00	0.31
20	300059	东方财富	1,239,994.00	0.31

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	601988	中国银行	10,836,089.05	2.69
2	601939	建设银行	10,789,654.17	2.68
3	601288	农业银行	10,676,059.94	2.65
4	688111	金山办公	4,082,544.39	1.01

5	600507	方大特钢	3,037,670.70	0.75
6	000625	长安汽车	2,820,750.20	0.70
7	603328	依顿电子	2,599,267.92	0.64
8	600183	生益科技	2,387,609.23	0.59
9	601636	旗滨集团	2,217,236.64	0.55
10	600873	梅花生物	2,098,037.94	0.52
11	600114	东睦股份	2,048,287.00	0.51
12	600808	马钢股份	2,007,559.00	0.50
13	600383	金地集团	1,960,452.67	0.49
14	600036	招商银行	1,958,289.76	0.49
15	601088	中国神华	1,871,915.24	0.46
16	000538	云南白药	1,794,527.88	0.45
17	601003	柳钢股份	1,766,483.00	0.44
18	600325	华发股份	1,621,047.60	0.40
19	601566	九牧王	1,536,855.11	0.38
20	688266	泽璟制药	1,462,710.00	0.36

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	166,214,030.30
卖出股票收入（成交）总额	129,407,377.24

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	32,988,744.76	5.89
	其中：政策性金融债	32,988,744.76	5.89
4	企业债券	181,367,500.00	32.39
5	企业短期融资券	79,947,000.00	14.28
6	中期票据	106,788,500.00	19.07
7	可转债（可交换债）	2,873,955.90	0.51
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-



10	合计	403,965,700.66	72.14
----	----	----------------	-------

### 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	112273	15 金街 01	300,000	30,654,000.00	5.47
2	101800703	18 电网 MTN001	300,000	30,567,000.00	5.46
3	101800772	18 亦庄控股 MTN001	200,000	20,540,000.00	3.67
4	143623	18 粤电 01	200,000	20,344,000.00	3.63
5	112312	16 徐工 01	200,000	20,170,000.00	3.60

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

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

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	20,642.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,392,239.73

5	应收申购款	30,004,956.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	35,417,839.29

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	120002	18 中原 EB	2,873,955.90	0.51

#### 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 (%)
华富益鑫灵活配置混合 A	149	1,794,538.97	265,732,125.07	99.38	1,654,181.40	0.62
华富益鑫灵	149	1,317,816.08	193,797,107.82	98.70	2,557,487.63	1.30

活配置混合 C						
合计	298	1,556,177.52	459,529,232.89	99.09	4,211,669.03	0.91

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自份额级别的比例，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

项目	份额级别	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	华富益鑫灵活配置混合 A	12,103.93	0.0045
	华富益鑫灵活配置混合 C	38,034.63	0.0194
	合计	50,138.56	0.0108

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。

### 8.3 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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	华富益鑫灵活配置混合 A	0~10
	华富益鑫灵活配置混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华富益鑫灵活配置混合 A	0~10
	华富益鑫灵活配置混合 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富益鑫灵活配置混合 A	华富益鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2016年9月7日) 基金份额总额	11,977.43	200,370,614.22
本报告期期初基金份	137,158,885.76	193,052,922.27

额总额		
本报告期基金总申购份额	199,808,809.79	137,353,809.53
减：本报告期基金总赎回份额	69,581,389.08	134,052,136.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	267,386,306.47	196,354,595.45

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. 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
2. 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。
3. 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
4. 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
5. 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜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。
6. 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
7. 2020年4月21日，华富基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过，因工作需要，聘任邵恒先生担任公司副总经理职务。
8. 2020年5月11日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，倪莉莎女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。
9. 2020年5月11日，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

聘陶祺先生为华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

10. 2020 年 5 月 11 日, 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, 增聘陶祺先生为华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理。

11. 2020 年 5 月 11 日, 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, 增聘陶祺先生为华富货币市场基金基金经理。

12. 2020 年 5 月 11 日, 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, 增聘陶祺先生为华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

13. 2020 年 6 月 28 日, 华富基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过, 因工作需要, 章宏韬先生不再担任公司董事长职务, 聘任赵万利先生担任公司董事长。

14. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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	
华安证券	2	112, 101, 350. 08	38. 99%	104, 399. 38	39. 17%	-
华西证券	1	104, 740, 867. 65	36. 43%	97, 544. 65	36. 60%	-
安信证券	1	63, 149, 785. 15	21. 96%	57, 548. 54	21. 59%	-

西南证券	1	7,532,491.39	2.62%	7,014.95	2.63%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)，我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的几家券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金新增海通证券 1 个席位。

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
华安证券	823,570.40	0.39%	288,200,000.00	11.26%	-	-
华西证券	9,999,195.90	4.70%	239,000,000.00	9.33%	-	-
安信证券	23,578,439.53	11.08%	79,400,000.00	3.10%	-	-
西南证券	15,929,214.00	7.49%	1,954,000,000.00	76.31%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	162,482,600.00	76.35%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	《华富基金管理有限公司关于公司住所变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月8日
2	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月21日
3	《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020年1月21日
4	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书（更新）的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年2月29日
5	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年3月13日
6	《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年分红公告》	中国证监会指定媒介	2020年3月25日
7	《华富基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	中国证监会指定媒介	2020年3月26日
8	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	中国证监会指定媒介	2020年3月28日
9	《华富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020年4月22日
10	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年4月22日
11	《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020年4月22日
12	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年4月29日
13	《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告》	中国证监会指定媒介	2020年4月29日
14	《华富基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020年5月8日
15	《华富基金管理有限公司关于恢复银联支付通道服务的公告》	中国证监会指定媒介	2020年6月1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、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

### 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。

华富基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日