

华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 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

送出日期：2021 年 3 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 2021 年 3 月 30 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。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	51

8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 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	67
8.7 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	67
8.8 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	67
8.9 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	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 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	69
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 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	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	73
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 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	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华富华鑫灵活配置混合	
基金主代码	002730	
交易代码	002730	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月11日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	68,472,321.07份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002730	002731
报告期末下属分级基金的份额总额	63,455,741.11份	5,016,579.96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	北京市西城区复兴门内大街 55

	嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	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	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	浙江省杭州市钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年		2019 年		2018 年	
	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
本期已实现收益	39,213,461.39	3,670,471.70	15,577,841.16	8,116,247.24	-20,532,758.49	-1,418,387.08
本期利润	41,586,302.61	3,442,149.36	39,118,151.49	9,751,988.86	-33,038,110.25	-2,201,962.58
加权平均基金份额本期利润	0.4122	0.3336	0.3363	0.3749	-0.2601	-0.2468
本期加权平均	32.12%	25.64%	35.03%	38.56%	-27.72%	-26.28%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	37.52%	37.24%	42.11%	42.02%	-26.25%	-26.33%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	26,339,701.62	2,036,965.16	482,299.58	-9,627.35	-28,651,311.76	-1,989,211.18
期末可供分配基金份额利润	0.4151	0.4060	0.0041	-0.0008	-0.2326	-0.2361
期末基金资产净值	95,118,247.32	7,472,150.58	129,594,924.11	13,072,077.41	94,541,836.79	6,436,084.63
期末基金份额净值	1.499	1.489	1.090	1.085	0.767	0.764
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	52.88%	51.86%	9.00%	8.50%	-21.78%	-22.08%

注：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 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富华鑫灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.00%	1.03%	6.88%	0.50%	0.12%	0.53%
过去六个月	18.87%	1.33%	12.61%	0.67%	6.26%	0.66%
过去一年	37.52%	1.50%	15.58%	0.71%	21.94%	0.79%
过去三年	44.13%	1.39%	23.60%	0.67%	20.53%	0.72%
自基金合同生效起至今	52.88%	1.19%	34.99%	0.59%	17.89%	0.60%

华富华鑫灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.89%	1.03%	6.88%	0.50%	0.01%	0.53%
过去六个月	18.74%	1.33%	12.61%	0.67%	6.13%	0.66%

过去一年	37.24%	1.50%	15.58%	0.71%	21.66%	0.79%
过去三年	43.59%	1.39%	23.60%	0.67%	19.99%	0.72%
自基金合同生效起至今	51.86%	1.19%	34.99%	0.59%	16.87%	0.60%

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%。

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

华富华鑫灵活配置混合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



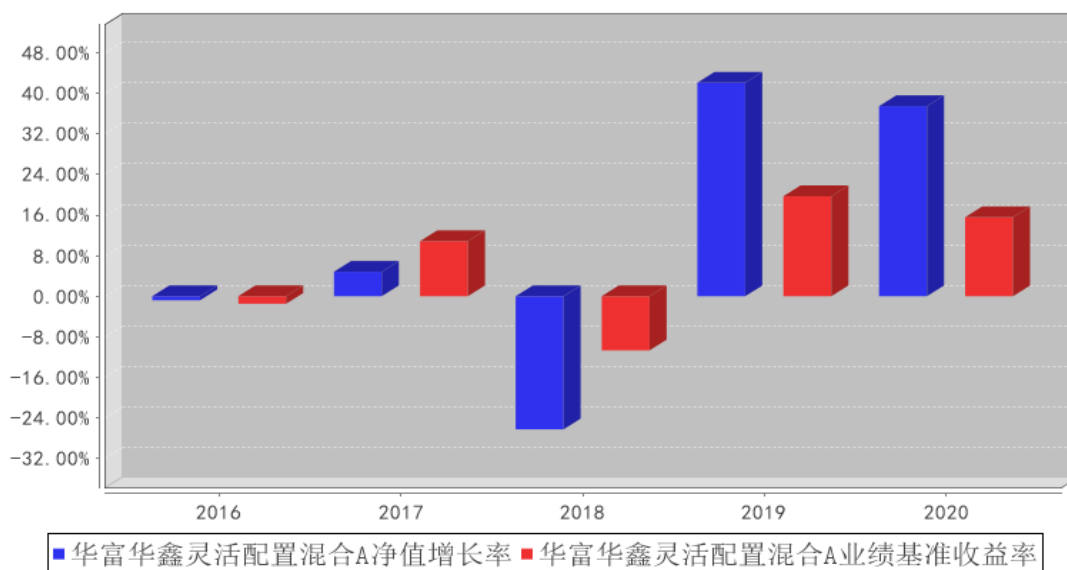
华富华鑫灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



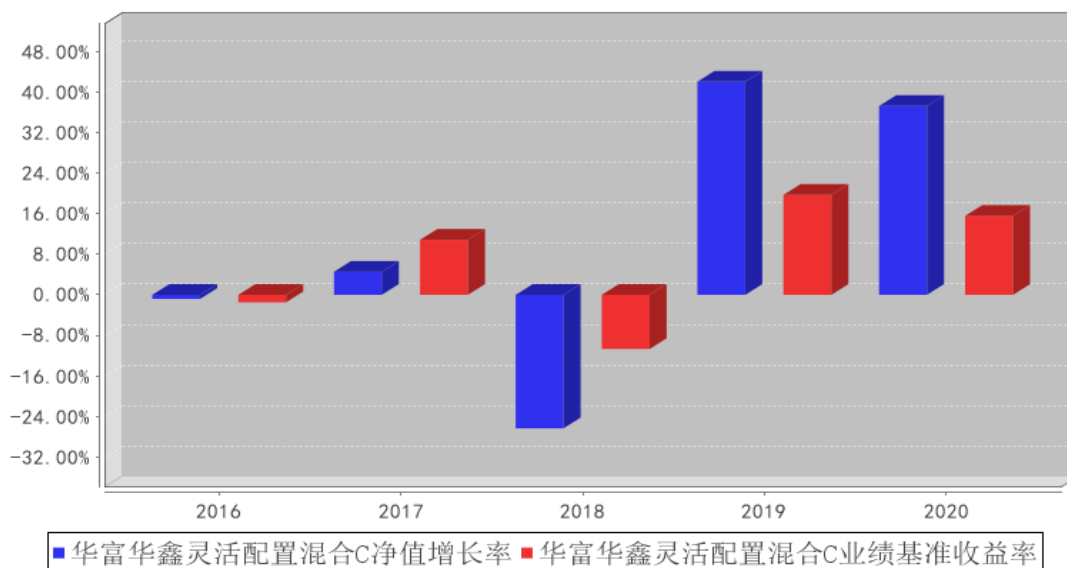
注：根据《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票资产占基金资产的 0%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为 2016 年 11 月 11 日到 2017 年 5 月 11 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富华鑫灵活配置混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华富华鑫灵活配置混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 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 年中高等级交易所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联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金共四十三只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
尹培俊	华富华鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富强化回报债券型基金基金经理、华富安享债券型基金基金经理、华富收益增强债券型基金基金经理、华富可转债债券型基金基金经理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会委员	2016 年 11 月 11 日	-	14 年	兰州大学工商管理硕士，研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012 年加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用研究员、固定收益部总监助理、固定收益部副总监，2016 年 5 月 5 日至 2018 年 9 月 4 日（9.5 基金合同终止）任华富诚鑫灵活配置混合型基金基金经理、2014 年 3 月 6 日至 2019 年 6 月 20 日任华富货币市场基金基金经理。

注：这里的任职日期指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体

控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

4.3.2 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。

4.3.3 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，全球在突如其来的疫情冲击之下，各个国家都展开了一场持续的危机应对与经济修复之旅。由于国内疫情在春节期间爆发升温，导致整个 2 月国内生产接近停滞，一季度实际 GDP 同比录得-6.8%，为有数据以来首次负增长。随着三月开始国内疫情控制较为有效且复工逐渐爬坡，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。三季度宏观经济持续修复，制造业产成品库存继续出现补库情况，三季度 GDP 同比上升至 4.9%，非服务型消费经济基本回到疫情前状态。四季度国内整体经济维持上行，年末扩张斜率略有放缓，四季度 GDP 同比增速上升至 6.5%，至年底，多数行业已经由被动去库存转向主动补库。通胀方面，由于猪周期的影响，CPI 数据持续走低，PPI 则是持续环比回升，形成再通胀格局。

货币信用环境方面，疫情发生后在信贷扩张、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，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。三季度开始随着经济修复明显，货币政策逐渐偏向中性，但年末的永煤事件后，央行对于流动性相对呵护，年底中央经济工作会议释放政策“保持连续性、稳定性、可持续性”并且“不急转弯”，市场对货币政策转向的预期相对偏暖。但随着社融增速至年底基本见顶，市场预期 2021 年赤字率、专项债额度等均低于 2020 年，融资环境见顶、信用收缩的趋势基本形成。

海外方面，全年疫情冲击成为海外经济主线，疫苗大规模接种之前整个海外市场均表现比较低迷。下半年海外市场关注重点主要围绕疫苗落地和美国大选，拜登政府胜出后海外资产普遍涌现“拜登交易”。

从国内资本市场的表现来看，受益于疫情后相对宽松的货币环境以及国内经济下半年开始的强劲复苏，风险资产全年表现最好。一季度受到疫情的突发冲击，医疗物资、居家办公等行业率先恢复景气上行；二季度开始随着国内疫情的有效控制经济触底反弹，周期类行业景气较好；三季度开始，随着海外疫情的恶化，具有中国制造优势的行业和公司进一步抢占全球份额，同时新能源产业需求爆发带动相关行业景气上行。全年来看，围绕疫情后行业景气度回升，A 股走出了一波较大的行情，以食品饮料、新能源、光伏等行业为主的高景气度行业确定性公司估值得到明显提升。2020 年债券市场先扬后抑，收益水平全年呈“V”型走势。上半年，因爆发新冠疫情，国内基本面快速回落，央行采取降息、降准等手段托底经济，债券市场持续上涨。下半年，随着国内疫情逐步得到控制，基本面温和复苏，货币政策开始边际收紧，债券收益率单调上行。

本基金以打新增强为主要投资策略，以中小盘为主的权益底仓波动相对较大，全年来看组合

净值获得较好上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 11 月 11 日正式成立。截止到 2020 年 12 月 31 日，华富华鑫 A 类基金份额净值 1.499 元，累计份额净值为 1.519 元，本报告期的份额累计净值增长率为 37.52%，同期业绩比较基准收益率为 15.58%；华富华鑫 C 基金份额净值为 1.489 元，累计份额净值为 1.509 元，本报告期的份额累计净值增长率为 37.24%，同期业绩比较基准收益率为 15.58%。

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 2021 年，国内来看，中央工作会议定调明年宏观政策要保持连续性、稳定性、可持续性，要继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，不急转弯，表明短期内政策面转向的可能性降低，虽然社融拐点可能已经出现，但经济有望继续修复，基本面由复苏进入扩张期，PPI 上行也将带动企业部门整体盈利的进一步改善。但全年来看，政策还是会随着经济修复逐步退出，逐步转向“紧货币、紧信用”并对经济产生压力。全球来看，美国大选落地，欧美日等国经济也在渐进修复，有助于全球经济共振和市场风险偏好提升。整体而言，市场处在经济将呈现出企业主动补库存、盈利扩张，中性温和再通胀叠加信用环境收紧的格局，海外则逐渐呈现疫后修复爬坡叠加全球通胀上行的格局。从资产配置角度，股债估值性价比较为均衡，债券资产赔率改善但胜率不足，风险资产赔率降低但胜率仍高，现阶段股票市场相比债券市场仍具有相对吸引力；但中期来看股票估值有泡沫化的倾向，同时随着政策收紧和经济下行压力加大，股债可能迎来切换。本基金权益仓位尽量控制大幅波动和回撤，并利用新股申购等手段增强收益，稳健地做好配置策略，均衡投资，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、逐步建立和完善架构清晰、控制有效的内部控制机制。2020 年修订了《华富基金管理有限公司廉洁从业管理制度》，加强了公司内部廉洁从业管理，促进了公司健康发展和保护投资者合法权益；修订了《华富基金管理有限公司营销费用报销管理细则》，促进了公司营销费用管理合规有序开展，加强了公司内部廉洁从业管理，也保障了公司的健康、持续发展；制定了《华富基金

管理有限公司转融通证券出借投资管理办法》，以规范公司运用基金财产参与转融通证券出借业务流程及妥善管理业务过程中的风险；制定了《华富基金管理有限公司专户融券管理工作流程》，以建立专户融券打新业务融券管理工作流程、保障专户融券打新产品交易的正常进行及有效控制专户融券操作风险；修订了《华富基金管理有限公司债券池管理办法》，以规范公司旗下基金固定收益投资业务的操作、防范信用风险、降低利率风险及保障基金正常运作；修订了《华富基金管理有限公司债券信用评级管理办法》，规范了债券的投资行为，以管理债券的信用风险并服务于债券投资策略。监察稽核的监督范围覆盖了公司的所有部门和业务环节，基本建成了以法务、稽核、合规以及风险控制为核心的事前预防、事中控制、事后稽核的风险控制体系。2020 年度公司上述部门各司其职，在公司日常运营中起到了事前防范风险、事中控制风险以及事后评估风险的作用。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所（特殊普通合伙）进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内未实施利润分配，本期利润为 45,028,451.97 元，期末可供分配利润为 28,376,666.78 元，滚存至下一期进行分配。

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华富基金管理有限公司编制和披露的华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审〔2021〕6-34 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简

	<p>称华富华鑫灵活基金)财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年度的利润表、持有人权益(基金净值)变动表,以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华富华鑫灵活基金2020年12月31日的财务状况,以及2020年度的经营成果和持有人权益(基金净值)变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华富华鑫灵活基金及其管理人华富基金管理有限公司(以下简称基金管理人),并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层(以下简称管理层)负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估华富华鑫灵活基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层(以下简称治理层)负责监督华富华鑫灵活基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对华富华鑫灵活基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华富华鑫灵活基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	曹俊炜	朱慧
会计师事务所的地址	浙江省杭州市钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 层	
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	837,778.55	1,528,869.96
结算备付金		77,402.57	40,078.98
存出保证金		51,880.94	54,439.60
交易性金融资产	7.4.7.2	101,885,114.15	141,479,830.00
其中: 股票投资		96,763,224.15	134,112,750.00
基金投资		-	-
债券投资		5,121,890.00	7,367,080.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		98,529.62	33,019.97
应收利息	7.4.7.5	67,592.14	195,573.64
应收股利		-	-
应收申购款		499.25	599.85

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		103,018,797.22	143,332,412.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		174,865.07	356,893.60
应付管理人报酬		51,513.83	70,648.77
应付托管费		12,878.49	17,662.19
应付销售服务费		1,267.95	2,174.96
应付交易费用	7.4.7.7	8,814.44	38,999.49
应交税费		11.63	5.30
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,047.91	179,026.17
负债合计		428,399.32	665,410.48
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	68,472,321.07	130,952,242.11
未分配利润	7.4.7.10	34,118,076.83	11,714,759.41
所有者权益合计		102,590,397.90	142,667,001.52
负债和所有者权益总计		103,018,797.22	143,332,412.00

注：报告截止日2020年12月31日，华富华鑫A基金份额净值1.499元，基金份额总额63,455,741.11份；华富永鑫C基金份额净值1.489元，基金份额总额5,016,579.96份。华富华鑫灵活配置混合基金合份额总额合计为68,472,321.07份。

7.2 利润表

会计主体：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
一、收入		46,932,577.11	50,717,964.47
1. 利息收入		191,984.30	249,853.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,177.87	27,767.23
债券利息收入		181,806.43	222,085.94

资产支持证券利息收入			-	-
买入返售金融资产收入			-	-
证券出借利息收入			-	-
其他利息收入			-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）			44,543,274.05	24,439,499.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12		42,834,537.24	23,043,189.13
基金投资收益	-		-	-
债券投资收益	7.4.7.13		79,784.15	3,002.15
资产支持证券投资	7.4.7.13.3		-	-
收益				
贵金属投资收益	7.4.7.14		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15		-	-
股利收益	7.4.7.16		1,628,952.66	1,393,308.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17		2,144,518.88	25,176,051.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18		52,799.88	852,559.85
减：二、费用			1,904,125.14	1,847,824.12
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1		852,510.22	818,927.37
2. 托管费	7.4.10.2.2		213,127.53	204,731.77
3. 销售服务费	7.4.10.2.3		26,587.11	50,185.34
4. 交易费用	7.4.7.19		601,571.18	552,739.12
5. 利息支出			77.07	-
其中：卖出回购金融资产支出			77.07	-
6. 税金及附加			0.67	0.24
7. 其他费用	7.4.7.20		210,251.36	221,240.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			45,028,451.97	48,870,140.35
减：所得税费用			-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）			45,028,451.97	48,870,140.35

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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)	130,952,242.11	11,714,759.41	142,667,001.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,028,451.97	45,028,451.97
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)	-62,479,921.04	-22,625,134.55	-85,105,055.59
其中：1. 基金申购款	30,465,865.72	12,645,231.63	43,111,097.35
2. 基金赎回款	-92,945,786.76	-35,270,366.18	-128,216,152.94
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)	68,472,321.07	34,118,076.83	102,590,397.90
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	131,618,444.36	-30,640,522.94	100,977,921.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,870,140.35	48,870,140.35
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)	-666,202.25	-6,514,858.00	-7,181,060.25
其中：1. 基金申购款	209,226,254.64	-13,802,936.31	195,423,318.33
2. 基金赎回款	-209,892,456.89	7,288,078.31	-202,604,378.58

回款			
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）	130,952,242.11	11,714,759.41	142,667,001.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万利

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华富华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] 851 号）核准，基金合同于 2016 年 11 月 11 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）6-120 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《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券、中期票据、短期融资券、债券回购等）、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行

后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告（2017）13号）规定，在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下：

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价

且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

② 对不存在活跃市场的投资品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

③ 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），根据中国证券投资基金业协会《关于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的通知》（中基协发〔2017〕6号），估值处理如下：

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值： $FV=S \times (1-LoMD)$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值；S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。 $LoMD=P/S$ ，P 是估值日看跌期权的价格。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权的价格。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认；

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后最后一位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式及红利再投资形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 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	以按税法规定计算的金融服务销售额	3%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加[注]	实际缴纳的流转税税额	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%。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
活期存款	837,778.55	1,528,869.96
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	837,778.55	1,528,869.96

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	83,424,371.98	96,763,224.15	13,338,852.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,138,608.85	5,121,890.00
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	5,138,608.85	5,121,890.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	88,562,980.83	101,885,114.15	13,322,133.32
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	122,942,495.22	134,112,750.00	11,170,254.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,359,720.34	7,367,080.00
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	7,359,720.34	7,367,080.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	130,302,215.56	141,479,830.00	11,177,614.44

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末和上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	64.37	272.44
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	38.28	19.80
应收债券利息	67,463.75	195,254.45
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	25.74	26.95
合计	67,592.14	195,573.64

注：本表列示的“应收其他存款利息”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应收银行存款利息；“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末和上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	8,814.44	38,999.49
银行间市场应付交易费用	-	-
	-	-
合计	8,814.44	38,999.49

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	47.91	26.17

应付证券出借违约金	-	-
上清账户维护费	4,500.00	4,500.00
应付审计费	50,000.00	50,000.00
中债账户维护费	4,500.00	4,500.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	179,047.91	179,026.17

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,898,866.76	118,898,866.76
本期申购	2,164,000.24	2,164,000.24
本期赎回（以“-”号填列）	-57,607,125.89	-57,607,125.89
-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	63,455,741.11	63,455,741.11

华富华鑫灵活配置混合 C

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,053,375.35	12,053,375.35
本期申购	28,301,865.48	28,301,865.48
本期赎回（以“-”号填列）	-35,338,660.87	-35,338,660.87
-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	5,016,579.96	5,016,579.96

注：注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	482,299.58	10,213,757.77	10,696,057.35
本期利润	39,213,461.39	2,372,841.22	41,586,302.61
本期基金份额交易产生的变	-13,356,059.35	-7,263,794.40	-20,619,853.75

动数			
其中：基金申购款	366,718.01	336,199.20	702,917.21
基金赎回款	-13,722,777.36	-7,599,993.60	-21,322,770.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,339,701.62	5,322,804.59	31,662,506.21

华富华鑫灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,627.35	1,028,329.41	1,018,702.06
本期利润	3,670,471.70	-228,322.34	3,442,149.36
本期基金份额交易产生的变动数	-1,623,879.19	-381,401.61	-2,005,280.80
其中：基金申购款	6,555,613.96	5,386,700.46	11,942,314.42
基金赎回款	-8,179,493.15	-5,768,102.07	-13,947,595.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,036,965.16	418,605.46	2,455,570.62

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	7,882.93	23,999.79
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	1,825.12	2,229.64
其他	469.82	1,537.80
合计	10,177.87	27,767.23

注：“其他存款利息收入”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利息收入。本期“其他”为结算保证金利息收入；上年度可比期间“其他”为直销申购款利息收入 1,021.98 元及结算保证金利息收入 515.82 元。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	42,834,537.24	23,043,189.13
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	42,834,537.24	23,043,189.13

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	218,657,455.34	169,180,848.85
减：卖出股票成本总额	175,822,918.10	146,137,659.72
买卖股票差价收入	42,834,537.24	23,043,189.13

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	79,784.15	3,002.15
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	79,784.15	3,002.15

7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,780,874.48	19,237,815.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,283,612.43	18,683,234.91
减：应收利息总额	417,477.90	551,577.98
买卖债券差价收入	79,784.15	3,002.15

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内和上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内和上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期和上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,628,952.66	1,393,308.22
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	1,628,952.66	1,393,308.22

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	2,144,518.88	25,176,051.95
股票投资	2,168,597.39	25,179,142.29
债券投资	-24,078.51	-3,090.34
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	2,144,518.88	25,176,051.95

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	52,799.88	835,219.70
转换费收入 002730	-	17,340.15
合计	52,799.88	852,559.85

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	601,571.18	552,739.12
银行间市场交易费用	-	-
-	-	-
合计	601,571.18	552,739.12

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	3,051.36	5,040.28
账户维护费	36,000.00	45,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	210,251.36	221,240.28

注：注：其他所列金额为上清所查询费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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（“中国工商银行股份有限公司”）	基金托管人、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
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股（集团）有限公司	基金管理人的股东
华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	113,441,548.47	33.09	84,694,867.44	27.08

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	6,315,023.74	29.13	133,387.60	0.44

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	200,000.00	25.00	-	-

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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12月31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	103,981.99	32.99	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	78,421.27	27.22	8,330.12	21.36

注：上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	852,510.22	818,927.37
其中：支付销售机构的客户维护费	45,054.24	80,683.99

注：注基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ (H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值)。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	213,127.53	204,731.77

注：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）。

7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	-	6,526.72	6,526.72
工商银行银行股份有限公司	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	5.91	5.91
合计	-	6,532.63	6,532.63
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	-	21,895.28	21,895.28
工商银行银行股份有限公司	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	21,895.28	21,895.28

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）。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内和上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	837,778.55	7,882.93	1,528,869.96	23,999.79

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.10.7 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和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	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

003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年01月06日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年01月04日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年02月25日	新股流通受限	71.71	90.85	91	6,525.61	8,267.35	-
300865	大宏立	2020年8月11日	2021年03月01日	新股流通受限	20.20	37.22	2,850	57,570.00	106,077.00	-
300866	安克创新	2020年8月11日	2021年2月24日	新股流通受限	66.32	156.18	1,563	103,658.16	244,109.34	-
300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年02月25日	新股流通受限	20.09	36.62	302	6,067.18	11,059.24	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年03月03日	新股流通受限	41.34	48.72	235	9,714.90	11,449.20	-
30087	大	202	2021年3月1	新	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-

9	叶股份	2020年8月25日	日	股 流 通 受 限							
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年03月05日	新 股 流 通 受 限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-	
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新 股 流 通 受 限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-	
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新 股 流 通 受 限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-	
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新 股 流 通 受 限	44.47	74.52	150	6,670.50	11,178.00	-	
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新 股 流 通 受 限	27.97	30.12	296	8,279.12	8,915.52	-	
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年03月18日	新 股 流 通 受 限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-	
300891	惠云钛	2020年9月	2021年3月17日	新 股 流	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-	

	业	10日		通受限						
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年03月30日	新股流通受限	26.66	60.01	223	5,945.18	13,382.23	-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新股流通受限	118.27	603.36	76	8,988.52	45,855.36	-
300898	熊猫乳品	2020年10月9日	2021年4月16日	新股流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股流通受限	17.87	33.16	299	5,343.13	9,914.84	-
300902	国安达	2020年10月22日	2021年4月29日	新股流通受限	15.38	24.26	303	4,660.14	7,350.78	-
601995	中金公司	2020年10月22日	2021年5月6日	新股流通受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-

		日		限						
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年01月06日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688057	金达莱	2020年11月4日	2021年5月11日	新股流通受限	25.84	28.71	2,971	76,770.64	85,297.41	-
688335	复洁环保	2020年8月7日	2021年2月18日	新股流通受限	46.22	36.69	1,682	77,742.04	61,712.58	-
688336	三生国健	2020年7月15日	2021年1月22日	新股流通受限	28.18	24.29	3,298	92,937.64	80,108.42	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2021年1月8日	新股流通受限	16.42	18.68	3,459	56,796.78	64,614.12	-
688557	兰剑智能	2020年11月25日	2021年6月2日	新股流通受限	27.70	32.75	997	27,616.90	32,651.75	-
688586	江航装备	2020年7月24日	2021年2月1日	新股流通受限	10.27	30.20	7,269	74,652.63	219,523.80	-
68859	新	202	2021年6月7日	新	10.73	15.79	2,951	31,664.23	46,596.29	-

0	致软件	2020年11月27日	日	股流通受限						
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年01月07日	新股流通受限	74.46	74.46	401	29,858.46	29,858.46	-

7.4.12.1.2 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
113044	大秦转债	2020年12月17日	2021年1月15日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

7.4.12.1.3 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.12.1.4 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300182	捷成股份	2020年12月30日	重大事项停牌	3.23	2021年1月7日	3.40	20,786	97,212.77	67,138.78	-

7.4.12.3 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 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按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 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按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	1,000.00	0.00
AAA 以下	0.00	225,900.00
-	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,000.00	225,900.00

7.4.13.2.5 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按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 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按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	837,778.55	-	-	-	-	-	837,778.55
结算备付金	77,402.57	-	-	-	-	-	77,402.57
存出保证金	51,880.94	-	-	-	-	-	51,880.94
交易性金融资产	-	-	5,121,890.00	-	-	96,763,224.15	101,885,114.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	67,592.14	67,592.14
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	499.25	499.25
应收证券清算款	-	-	-	-	-	98,529.62	98,529.62
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	967,062.06	-	5,121,890.00	-	-	96,929,845.16	103,018,797.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	174,865.07	174,865.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,513.83	51,513.83

应付托管费	-	-	-	-	-	12,878.49	12,878.49
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,267.95	1,267.95
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,814.44	8,814.44
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	11.63	11.63
其他负债	-	-	-	-	-	179,047.91	179,047.91
负债总计	-	-	-	-	-	428,399.32	428,399.32
利率敏感度缺口	967,062.06	-	5,121,890.00	-	-	96,501,445.84	102,590,397.90
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	1,528,869.96	-	-	-	-	-	1,528,869.96
结算备付金	40,078.98	-	-	-	-	-	40,078.98
存出保证金	54,439.60	-	-	-	-	-	54,439.60
交易性金融资产	-	-	7,367,080.00	-	-	134,112,750.00	141,479,830.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	33,019.97	33,019.97
应收利息	-	-	-	-	-	195,573.64	195,573.64
应收申购款	-	-	-	-	-	599.85	599.85
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,623,388.54	-	7,367,080.00	-	-	134,341,943.46	143,332,412.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	356,893.60	356,893.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,648.77	70,648.77
应付托管费	-	-	-	-	-	17,662.19	17,662.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,174.96	2,174.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	38,999.49	38,999.49

应交税费	-	-	-	-	5.30	5.30
其他负债	-	-	-	-	179,026.17	179,026.17
负债总计	-	-	-	-	665,410.48	665,410.48
利率敏感度缺口	1,623,388.54	-	7,367,080.00	-	133,676,532.98	142,667,001.52

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 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12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率下降 25 基点	7,305.74	8,108.85
	市场利率上升 25 基点	-7,291.65	-8,098.72

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	96,763,224.15	94.32	134,112,750.00	94.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,121,890.00	4.99	7,367,080.00	5.16

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	101,885,114.15	99.31	141,479,830.00	99.17

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 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 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升百分之五	4,129,175.46	6,320,985.92
	沪深 300 指数下降百分之五	-4,129,175.46	-6,320,985.92

7.4.13.4.3 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 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	31,519,515.50	41,586,505.71

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据“财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好 2010 年年报工作的通知（财会〔2010〕25 号）”（以下简称“通知”）要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以

其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

类别	2020 年 12 月 31 日公允价值	2019 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	93,759,970.63	132,469,969.07
第二层次	8,125,143.52	9,009,860.93
第三层次		
合计	101,885,114.15	141,479,830.00

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号）的要求，本基金对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值（估值标准另有规定的除外），本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	96,763,224.15	93.93
	其中：股票	96,763,224.15	93.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,121,890.00	4.97
	其中：债券	5,121,890.00	4.97
	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	915,181.12	0.89
-	-	-	-
8	其他各项资产	218,501.95	0.21
9	合计	103,018,797.22	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 其他各项资产构成。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	834,615.36	0.81
B	采矿业	2,990,995.98	2.92
C	制造业	58,113,589.14	56.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,381,648.53	2.32
E	建筑业	1,225,850.45	1.19
F	批发和零售业	5,672,752.94	5.53
G	交通运输、仓储和邮政业	2,953,450.38	2.88
H	住宿和餐饮业	718,981.85	0.70
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,686,885.89	6.52
J	金融业	6,252,003.34	6.09
K	房地产业	3,544,886.63	3.46
L	租赁和商务服务业	1,171,209.91	1.14
M	科学研究和技术服务业	549,143.99	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	880,143.96	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	151,704.96	0.15
Q	卫生和社会工作	931,010.80	0.91
R	文化、体育和娱乐业	1,179,174.24	1.15
S	综合	525,175.80	0.51
	合计	96,763,224.15	94.32

8.2.2 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港股通投资股票。

8.3 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	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	1.67
2	600426	华鲁恒升	30,329	1,131,271.70	1.10
3	600739	辽宁成大	40,753	991,112.96	0.97
4	600079	人福医药	25,244	855,266.72	0.83
5	600143	金发科技	47,960	822,034.40	0.80
6	603882	金域医学	6,098	781,275.76	0.76
7	600132	重庆啤酒	6,444	766,771.56	0.75
8	300274	阳光电源	10,264	741,881.92	0.72
9	601099	太平洋	181,771	741,625.68	0.72
10	601799	星宇股份	3,677	737,238.50	0.72
11	600161	天坛生物	16,692	696,056.40	0.68
12	600298	安琪酵母	13,172	672,694.04	0.66

13	600521	华海药业	19,392	655,643.52	0.64
14	600486	扬农化工	4,957	654,324.00	0.64
15	600316	洪都航空	11,475	652,583.25	0.64
16	600885	宏发股份	11,911	645,814.42	0.63
17	600529	山东药玻	12,689	636,353.35	0.62
18	601168	西部矿业	50,811	629,040.18	0.61
19	603517	绝味食品	8,107	628,616.78	0.61
20	600201	生物股份	29,987	626,428.43	0.61
21	601233	桐昆股份	29,510	607,610.90	0.59
22	600884	杉杉股份	30,400	548,112.00	0.53
23	601128	常熟银行	73,030	538,961.40	0.53
24	603486	科沃斯	6,017	532,444.33	0.52
25	603806	福斯特	6,148	525,039.20	0.51
26	600460	士兰微	20,952	523,800.00	0.51
27	603338	浙江鼎力	5,176	523,759.44	0.51
28	601966	玲珑轮胎	14,656	515,451.52	0.50
29	603939	益丰药房	5,658	510,295.02	0.50
30	600699	均胜电子	19,762	501,164.32	0.49
31	603444	吉比特	1,148	489,048.00	0.48
32	600845	宝信软件	6,855	472,857.90	0.46
33	600862	中航高科	14,855	447,135.50	0.44
34	600754	锦江酒店	8,547	440,426.91	0.43
35	600879	航天电子	58,018	433,974.64	0.42
36	600779	水井坊	5,211	432,617.22	0.42
37	601689	拓普集团	11,231	431,607.33	0.42
38	600418	江淮汽车	35,289	431,584.47	0.42
39	600155	华创阳安	32,406	427,435.14	0.42
40	002821	凯莱英	1,397	417,898.58	0.41
41	603233	大参林	5,246	411,024.10	0.40
42	600733	北汽蓝谷	46,617	404,169.39	0.39
43	600415	小商品城	72,480	399,364.80	0.39
44	600511	国药股份	8,034	396,156.54	0.39
45	603659	璞泰来	3,478	390,892.42	0.38
46	600497	驰宏锌锗	81,309	390,283.20	0.38
47	600563	法拉电子	3,590	386,104.50	0.38
48	600166	福田汽车	122,430	385,654.50	0.38
49	600549	厦门钨业	22,452	378,316.20	0.37
50	600801	华新水泥	18,126	373,939.38	0.36
51	600153	建发股份	45,382	372,586.22	0.36
52	600765	中航重机	14,879	371,975.00	0.36
53	000830	鲁西化工	28,851	368,715.78	0.36
54	300012	华测检测	13,389	366,456.93	0.36

55	600598	北大荒	18,971	365,191.75	0.36
56	600380	健康元	25,919	360,533.29	0.35
57	600535	天士力	24,183	357,666.57	0.35
58	603816	顾家家居	5,058	356,639.58	0.35
59	000547	航天发展	12,941	355,877.50	0.35
60	002074	国轩高科	9,033	353,370.96	0.34
61	600895	张江高科	20,643	351,756.72	0.34
62	603858	步长制药	15,218	351,079.26	0.34
63	300285	国瓷材料	7,764	350,234.04	0.34
64	300496	中科创达	2,980	348,660.00	0.34
65	600642	申能股份	65,335	341,048.70	0.33
66	300207	欣旺达	11,065	339,806.15	0.33
67	600409	三友化工	33,012	338,373.00	0.33
68	600859	王府井	10,350	337,203.00	0.33
69	600008	首创股份	118,135	334,322.05	0.33
70	600580	卧龙电驱	20,846	325,197.60	0.32
71	600667	太极实业	33,635	317,850.75	0.31
72	601866	中远海发	105,510	313,364.70	0.31
73	600827	百联股份	21,365	311,929.00	0.30
74	603866	桃李面包	5,256	310,629.60	0.30
75	600315	上海家化	8,938	310,416.74	0.30
76	600528	中铁工业	35,490	310,182.60	0.30
77	600256	广汇能源	108,428	306,851.24	0.30
78	601717	郑煤机	27,765	303,471.45	0.30
79	300253	卫宁健康	17,196	300,930.00	0.29
80	002185	华天科技	22,066	300,538.92	0.29
81	600704	物产中大	67,548	295,184.76	0.29
82	600875	东方电气	29,588	294,992.36	0.29
83	600160	巨化股份	35,935	291,432.85	0.28
84	600392	盛和资源	32,680	290,525.20	0.28
85	600811	东方集团	79,152	288,904.80	0.28
86	002709	天赐材料	2,765	287,007.00	0.28
87	002385	大北农	29,596	285,897.36	0.28
88	603605	珀莱雅	1,606	285,868.00	0.28
89	600839	四川长虹	98,336	285,174.40	0.28
90	600728	佳都科技	37,296	283,076.64	0.28
91	600515	海航基础	41,695	281,441.25	0.27
92	600325	华发股份	45,020	279,574.20	0.27
93	601615	明阳智能	14,720	279,385.60	0.27
94	600258	首旅酒店	13,127	278,554.94	0.27
95	600167	联美控股	24,384	276,758.40	0.27
96	600737	中粮糖业	28,555	276,412.40	0.27

97	603883	老百姓	4,366	274,315.78	0.27
98	600967	内蒙一机	22,470	273,235.20	0.27
99	600820	隧道股份	50,316	272,209.56	0.27
100	002340	格林美	38,496	269,087.04	0.26
101	002013	中航机电	23,458	268,594.10	0.26
102	600881	亚泰集团	86,613	268,500.30	0.26
103	002414	高德红外	6,405	267,408.75	0.26
104	600039	四川路桥	59,266	267,289.66	0.26
105	600597	光明乳业	16,348	265,818.48	0.26
106	600959	江苏有线	79,767	264,028.77	0.26
107	603707	健友股份	7,481	262,807.53	0.26
108	600446	金证股份	16,068	260,462.28	0.25
109	600410	华胜天成	29,289	259,500.54	0.25
110	600567	山鹰国际	85,486	258,167.72	0.25
111	603712	七一二	6,175	257,188.75	0.25
112	600804	鹏博士	38,090	255,964.80	0.25
113	600282	南钢股份	81,807	255,237.84	0.25
114	002797	第一创业	25,386	252,590.70	0.25
115	601179	中国西电	54,535	251,406.35	0.25
116	300595	欧普康视	3,053	250,101.76	0.24
117	600435	北方导航	27,690	249,210.00	0.24
118	603000	人民网	14,745	249,190.50	0.24
119	600021	上海电力	34,862	248,217.44	0.24
120	600273	嘉化能源	26,754	247,206.96	0.24
121	600026	中远海能	36,843	246,111.24	0.24
122	600216	浙江医药	17,961	244,269.60	0.24
123	300866	安克创新	1,563	244,109.34	0.24
124	000636	风华高科	7,217	243,212.90	0.24
125	300357	我武生物	3,159	242,295.30	0.24
126	600718	东软集团	23,208	241,595.28	0.24
127	600060	海信视像	20,886	239,771.28	0.23
128	600037	歌华有线	25,893	238,215.60	0.23
129	002127	南极电商	17,292	236,554.56	0.23
130	600064	南京高科	22,984	236,045.68	0.23
131	002507	涪陵榨菜	5,563	235,314.90	0.23
132	600572	康恩贝	49,756	234,350.76	0.23
133	600260	凯乐科技	21,369	232,922.10	0.23
134	600755	厦门国贸	34,599	231,121.32	0.23
135	601005	重庆钢铁	156,114	231,048.72	0.23
136	601975	招商南油	92,040	231,020.40	0.23
137	002078	太阳纸业	15,667	226,074.81	0.22
138	000750	国海证券	38,325	224,584.50	0.22

139	603198	迎驾贡酒	6,414	223,848.60	0.22
140	601118	海南橡胶	45,565	219,623.30	0.21
141	688586	江航装备	7,269	219,523.80	0.21
142	300088	长信科技	24,582	218,533.98	0.21
143	601106	中国一重	72,916	218,018.84	0.21
144	300558	贝达药业	2,021	216,994.77	0.21
145	002030	达安基因	6,176	211,836.80	0.21
146	600808	马钢股份	79,630	211,815.80	0.21
147	600171	上海贝岭	15,022	210,608.44	0.21
148	600908	无锡银行	34,549	210,057.92	0.20
149	600158	中体产业	17,055	209,094.30	0.20
150	600022	山东钢铁	146,096	208,917.28	0.20
151	600195	中牧股份	16,210	207,650.10	0.20
152	601699	潞安环能	31,913	207,434.50	0.20
153	002131	利欧股份	67,927	205,818.81	0.20
154	603228	景旺电子	6,801	205,050.15	0.20
155	601860	紫金银行	48,667	204,888.07	0.20
156	600056	中国医药	14,187	203,299.71	0.20
157	002353	杰瑞股份	5,790	202,650.00	0.20
158	600388	龙净环保	22,783	202,313.04	0.20
159	600673	东阳光	40,196	202,185.88	0.20
160	600376	首开股份	34,408	201,974.96	0.20
161	600006	东风汽车	21,358	201,619.52	0.20
162	002465	海格通信	18,549	200,885.67	0.20
163	601333	广深铁路	90,299	200,463.78	0.20
164	603077	和邦生物	141,051	200,292.42	0.20
165	600507	方大特钢	28,692	199,122.48	0.19
166	002500	山西证券	22,194	198,636.30	0.19
167	600643	爱建集团	25,990	195,444.80	0.19
168	600782	新钢股份	42,572	195,405.48	0.19
169	000009	中国宝安	25,948	195,388.44	0.19
170	601000	唐山港	78,754	195,309.92	0.19
171	002075	沙钢股份	17,787	195,123.39	0.19
172	300316	晶盛机电	6,461	194,346.88	0.19
173	600500	中化国际	36,663	193,214.01	0.19
174	002625	光启技术	8,675	193,018.75	0.19
175	002439	启明星辰	6,579	192,172.59	0.19
176	600970	中材国际	27,791	191,202.08	0.19
177	000630	铜陵有色	74,187	190,660.59	0.19
178	600126	杭钢股份	35,957	190,212.53	0.19
179	601200	上海环境	17,429	189,976.10	0.19
180	603568	伟明环保	10,020	189,678.60	0.18

181	000988	华工科技	8,093	187,676.67	0.18
182	600729	重庆百货	6,488	187,503.20	0.18
183	600466	蓝光发展	40,285	186,519.55	0.18
184	300482	万孚生物	2,072	184,843.12	0.18
185	601598	中国外运	41,961	184,628.40	0.18
186	000998	隆平高科	9,271	183,658.51	0.18
187	600266	城建发展	36,110	183,438.80	0.18
188	601608	中信重工	46,290	183,308.40	0.18
189	600649	城投控股	33,745	183,235.35	0.18
190	601098	中南传媒	19,194	182,918.82	0.18
191	601016	节能风电	53,067	182,019.81	0.18
192	300168	万达信息	8,374	181,632.06	0.18
193	600373	中文传媒	17,993	181,549.37	0.18
194	600073	上海梅林	17,510	180,177.90	0.18
195	600348	华阳股份	31,918	179,059.98	0.17
196	603885	吉祥航空	15,744	179,009.28	0.17
197	002250	联化科技	7,435	178,365.65	0.17
198	601718	际华集团	58,516	177,303.48	0.17
199	600120	浙江东方	29,603	176,729.91	0.17
200	300001	特锐德	6,016	176,629.76	0.17
201	601865	福莱特	4,404	175,719.60	0.17
202	002156	通富微电	6,961	175,695.64	0.17
203	600566	济川药业	8,676	175,515.48	0.17
204	002212	天融信	8,164	171,525.64	0.17
205	600645	中源协和	8,746	171,509.06	0.17
206	002223	鱼跃医疗	6,049	170,642.29	0.17
207	600094	大名城	42,444	170,624.88	0.17
208	600633	浙数文化	20,866	169,849.24	0.17
209	002444	巨星科技	5,416	168,491.76	0.16
210	600777	新潮能源	108,863	167,649.02	0.16
211	600062	华润双鹤	13,914	166,828.86	0.16
212	600835	上海机电	8,560	166,577.60	0.16
213	601228	广州港	49,530	166,420.80	0.16
214	002572	索菲亚	6,424	166,381.60	0.16
215	002926	华西证券	13,209	164,848.32	0.16
216	300418	昆仑万维	8,261	164,806.95	0.16
217	002557	洽洽食品	3,060	164,781.00	0.16
218	002080	中材科技	6,770	163,698.60	0.16
219	600675	中华企业	48,565	163,178.40	0.16
220	000039	中集集团	10,745	161,067.55	0.16
221	002670	国盛金控	11,697	160,833.75	0.16
222	601958	金钼股份	25,845	160,497.45	0.16

223	601880	大连港	82,609	159,435.37	0.16
224	002138	顺络电子	6,488	159,085.76	0.16
225	600863	内蒙华电	61,817	158,869.69	0.15
226	600138	中青旅	15,435	158,363.10	0.15
227	300271	华宇软件	6,534	155,966.58	0.15
228	300024	机器人	12,582	154,758.60	0.15
229	002603	以岭药业	6,060	154,530.00	0.15
230	600312	平高电气	21,625	154,402.50	0.15
231	000623	吉林敖东	9,361	154,175.67	0.15
232	600717	天津港	32,226	154,040.28	0.15
233	601611	中国核建	21,115	153,717.20	0.15
234	002373	千方科技	7,954	152,080.48	0.15
235	600141	兴发集团	13,769	151,872.07	0.15
236	603377	东方时尚	7,836	151,704.96	0.15
237	600478	科力远	30,947	151,640.30	0.15
238	000513	丽珠集团	3,735	151,267.50	0.15
239	601678	滨化股份	28,739	150,879.75	0.15
240	600776	东方通信	12,712	150,637.20	0.15
241	300244	迪安诊断	4,368	149,735.04	0.15
242	000878	云南铜业	10,277	148,708.19	0.14
243	600125	铁龙物流	24,429	147,062.58	0.14
244	300070	碧水源	19,145	146,459.25	0.14
245	000050	深天马A	9,910	146,073.40	0.14
246	600259	广晟有色	4,818	145,359.06	0.14
247	603650	彤程新材	4,673	144,863.00	0.14
248	603317	天味食品	1,759	144,660.16	0.14
249	300618	寒锐钴业	1,522	144,453.02	0.14
250	000975	银泰黄金	16,753	144,243.33	0.14
251	300251	光线传媒	11,834	142,836.38	0.14
252	002273	水晶光电	12,270	142,209.30	0.14
253	600017	日照港	49,347	142,119.36	0.14
254	300315	掌趣科技	27,793	142,022.23	0.14
255	002019	亿帆医药	7,476	141,520.68	0.14
256	002064	华峰化学	14,022	141,481.98	0.14
257	300009	安科生物	9,618	141,192.24	0.14
258	000021	深科技	7,401	140,693.01	0.14
259	002648	卫星石化	5,375	140,395.00	0.14
260	002920	德赛西威	1,659	139,588.26	0.14
261	000686	东北证券	14,163	139,080.66	0.14
262	600648	外高桥	9,945	138,931.65	0.14
263	600823	世茂股份	30,042	138,493.62	0.13
264	603708	家家悦	6,495	138,343.50	0.13

265	600307	酒钢宏兴	83,803	138,274.95	0.13
266	000739	普洛药业	5,937	138,213.36	0.13
267	002407	多氟多	6,883	137,866.49	0.13
268	002511	中顺洁柔	6,598	137,700.26	0.13
269	000581	威孚高科	5,904	136,913.76	0.13
270	600582	天地科技	44,297	136,434.76	0.13
271	603025	大豪科技	4,974	135,640.98	0.13
272	300115	长盈精密	5,499	135,550.35	0.13
273	300017	网宿科技	19,587	134,954.43	0.13
274	000401	冀东水泥	9,496	134,368.40	0.13
275	600329	中新药业	7,619	133,484.88	0.13
276	000738	航发控制	5,767	132,237.31	0.13
277	600901	江苏租赁	23,810	131,193.10	0.13
278	002195	二三四五	57,704	130,411.04	0.13
279	002506	协鑫集成	30,668	130,339.00	0.13
280	002152	广电运通	12,145	129,708.60	0.13
281	600428	中远海特	28,497	129,661.35	0.13
282	600985	淮北矿业	11,549	129,233.31	0.13
283	601928	凤凰传媒	20,357	128,859.81	0.13
284	600707	彩虹股份	19,277	128,384.82	0.13
285	600664	哈药股份	40,087	127,877.53	0.12
286	000690	宝新能源	17,504	127,779.20	0.12
287	600770	综艺股份	20,782	127,601.48	0.12
288	600751	海航科技	48,036	126,815.04	0.12
289	002081	金螳螂	13,491	126,680.49	0.12
290	002056	横店东磁	8,258	125,439.02	0.12
291	002028	思源电气	6,134	123,048.04	0.12
292	603515	欧普照明	4,026	121,625.46	0.12
293	000060	中金岭南	25,116	121,059.12	0.12
294	600748	上实发展	24,584	120,707.44	0.12
295	000729	燕京啤酒	14,160	120,643.20	0.12
296	300058	蓝色光标	20,101	120,606.00	0.12
297	002690	美亚光电	2,719	120,397.32	0.12
298	300212	易华录	3,926	120,331.90	0.12
299	002595	豪迈科技	4,029	119,459.85	0.12
300	002294	信立泰	4,215	119,410.95	0.12
301	002281	光迅科技	4,088	118,715.52	0.12
302	000807	云铝股份	15,745	118,559.85	0.12
303	002372	伟星新材	6,339	118,539.30	0.12
304	002221	东华能源	11,619	117,816.66	0.11
305	600869	远东股份	29,501	117,708.99	0.11
306	002124	天邦股份	7,952	116,099.20	0.11

307	000983	山西焦煤	20,571	116,020.44	0.11
308	601127	小康股份	6,723	114,828.84	0.11
309	300296	利亚德	17,931	114,041.16	0.11
310	002390	信邦制药	13,447	114,030.56	0.11
311	000997	新大陆	7,413	113,270.64	0.11
312	002429	兆驰股份	18,198	112,827.60	0.11
313	600557	康缘药业	11,088	112,764.96	0.11
314	000960	锡业股份	10,052	112,582.40	0.11
315	600565	迪马股份	41,187	112,440.51	0.11
316	600639	浦东金桥	9,059	112,331.60	0.11
317	601139	深圳燃气	15,260	110,482.40	0.11
318	600277	亿利洁能	36,409	108,862.91	0.11
319	000800	一汽解放	9,290	108,507.20	0.11
320	002831	裕同科技	3,536	108,272.32	0.11
321	600787	中储股份	23,338	107,588.18	0.10
322	002092	中泰化学	17,255	106,118.25	0.10
323	300865	大宏立	2,850	106,077.00	0.10
324	600545	卓郎智能	30,286	106,001.00	0.10
325	603888	新华网	5,549	105,431.00	0.10
326	002745	木林森	7,157	104,420.63	0.10
327	000012	南玻A	14,093	104,006.34	0.10
328	600640	号百控股	8,460	103,635.00	0.10
329	002382	蓝帆医疗	4,860	102,497.40	0.10
330	600350	山东高速	16,554	102,303.72	0.10
331	600338	西藏珠峰	9,758	102,263.84	0.10
332	300002	神州泰岳	19,737	100,856.07	0.10
333	002242	九阳股份	3,089	98,971.56	0.10
334	002268	卫士通	5,917	98,813.90	0.10
335	600291	西水股份	17,427	98,811.09	0.10
336	000999	华润三九	3,938	98,213.72	0.10
337	603056	德邦股份	7,689	97,573.41	0.10
338	600575	淮河能源	41,406	96,061.92	0.09
339	603766	隆鑫通用	27,392	95,872.00	0.09
340	000877	天山股份	6,344	95,794.40	0.09
341	000930	中粮科技	11,263	94,834.46	0.09
342	002396	星网锐捷	4,101	94,569.06	0.09
343	601019	山东出版	16,698	94,343.70	0.09
344	002387	维信诺	8,263	94,198.20	0.09
345	000629	攀钢钒钛	43,180	93,700.60	0.09
346	002807	江阴银行	21,889	93,684.92	0.09
347	300166	东方国信	8,491	92,976.45	0.09
348	600657	信达地产	22,716	91,999.80	0.09

349	001914	招商积余	4,271	91,954.63	0.09
350	000301	东方盛虹	9,695	91,908.60	0.09
351	300630	普利制药	2,194	91,906.66	0.09
352	002233	塔牌集团	7,214	91,906.36	0.09
353	002368	太极股份	3,496	91,280.56	0.09
354	002925	盈趣科技	1,383	88,968.39	0.09
355	000778	新兴铸管	24,099	88,684.32	0.09
356	000932	华菱钢铁	18,545	88,645.10	0.09
357	002004	华邦健康	15,927	88,235.58	0.09
358	000400	许继电气	6,098	88,177.08	0.09
359	601869	长飞光纤	3,246	87,771.84	0.09
360	002936	郑州银行	19,570	87,282.20	0.09
361	000027	深圳能源	14,325	87,239.25	0.09
362	002085	万丰奥威	13,228	86,775.68	0.08
363	000488	晨鸣纸业	13,482	86,554.44	0.08
364	000598	兴蓉环境	18,017	86,481.60	0.08
365	600623	华谊集团	14,910	86,478.00	0.08
366	000887	中鼎股份	7,368	86,279.28	0.08
367	600757	长江传媒	16,293	86,189.97	0.08
368	688057	金达莱	2,971	85,297.41	0.08
369	300474	景嘉微	1,214	84,870.74	0.08
370	603328	依顿电子	10,652	84,683.40	0.08
371	000089	深圳机场	10,313	84,257.21	0.08
372	300026	红日药业	18,192	83,319.36	0.08
373	002110	三钢闽光	12,350	83,115.50	0.08
374	600058	五矿发展	11,323	82,997.59	0.08
375	000825	太钢不锈	22,924	82,755.64	0.08
376	002174	游族网络	6,247	82,210.52	0.08
377	002191	劲嘉股份	8,829	81,491.67	0.08
378	002563	森马服饰	8,130	81,462.60	0.08
379	000970	中科三环	8,608	81,345.60	0.08
380	300072	三聚环保	14,213	80,729.84	0.08
381	000987	越秀金控	5,539	80,647.84	0.08
382	688336	三生国健	3,298	80,108.42	0.08
383	600694	大商股份	3,934	79,860.20	0.08
384	603786	科博达	1,171	79,183.02	0.08
385	600874	创业环保	11,617	78,647.09	0.08
386	002048	宁波华翔	5,034	78,379.38	0.08
387	000090	天健集团	13,167	78,211.98	0.08
388	002839	张家港行	12,762	77,848.20	0.08
389	000967	盈峰环境	9,562	77,834.68	0.08
390	000402	金融街	12,028	77,580.60	0.08

391	002217	合力泰	18,813	77,133.30	0.08
392	600903	贵州燃气	6,068	77,063.60	0.08
393	300133	华策影视	12,357	76,366.26	0.07
394	000528	柳工	10,367	76,301.12	0.07
395	601801	皖新传媒	16,019	76,090.25	0.07
396	000883	湖北能源	19,606	76,071.28	0.07
397	000563	陕国投A	19,886	74,970.22	0.07
398	300376	易事特	9,332	74,282.72	0.07
399	000685	中山公用	8,884	73,737.20	0.07
400	000898	鞍钢股份	24,116	73,312.64	0.07
401	002266	浙富控股	16,241	73,084.50	0.07
402	002203	海亮股份	9,825	72,606.75	0.07
403	002317	众生药业	6,559	72,280.18	0.07
404	300113	顺网科技	4,204	72,098.60	0.07
405	002155	湖南黄金	8,471	72,088.21	0.07
406	603556	海兴电力	5,235	71,981.25	0.07
407	002244	滨江集团	15,614	71,668.26	0.07
408	000712	锦龙股份	4,524	71,524.44	0.07
409	000559	万向钱潮	13,338	71,358.30	0.07
410	000758	中色股份	13,932	70,774.56	0.07
411	601003	柳钢股份	13,607	70,620.33	0.07
412	000519	中兵红箭	7,021	70,350.42	0.07
413	002701	奥瑞金	14,158	69,940.52	0.07
414	000028	国药一致	1,502	68,791.60	0.07
415	300010	豆神教育	7,000	68,320.00	0.07
416	600053	九鼎投资	3,452	67,486.60	0.07
417	300182	捷成股份	20,786	67,138.78	0.07
418	000078	海王生物	16,697	66,954.97	0.07
419	002458	益生股份	5,932	66,141.80	0.06
420	002183	怡亚通	14,986	65,338.96	0.06
421	002505	鹏都农牧	25,768	65,193.04	0.06
422	603355	莱克电气	2,151	65,024.73	0.06
423	002399	海普瑞	3,772	64,953.84	0.06
424	002440	闰土股份	6,940	64,680.80	0.06
425	688377	迪威尔	3,459	64,614.12	0.06
426	002249	大洋电机	14,238	64,071.00	0.06
427	002128	露天煤业	5,829	63,769.26	0.06
428	002038	双鹭药业	6,226	62,882.60	0.06
429	000564	供销大集	24,133	62,504.47	0.06
430	601969	海南矿业	10,372	62,024.56	0.06
431	603225	新凤鸣	4,444	61,771.60	0.06
432	688335	复洁环保	1,682	61,712.58	0.06

433	002010	传化智联	13,084	61,625.64	0.06
434	600996	贵广网络	11,257	61,463.22	0.06
435	603983	丸美股份	1,171	61,137.91	0.06
436	000959	首钢股份	15,937	61,038.71	0.06
437	002285	世联行	12,288	60,456.96	0.06
438	002434	万里扬	6,748	60,192.16	0.06
439	002408	齐翔腾达	7,170	59,941.20	0.06
440	000415	渤海租赁	24,863	59,671.20	0.06
441	000869	张裕A	1,364	59,470.40	0.06
442	603868	飞科电器	1,269	59,363.82	0.06
443	002867	周大生	2,204	58,736.60	0.06
444	002544	杰赛科技	3,499	58,713.22	0.06
445	688698	伟创电气	3,253	58,196.17	0.06
446	600335	国机汽车	11,661	57,955.17	0.06
447	000031	大悦城	12,940	56,936.00	0.06
448	300459	金科文化	17,785	56,734.15	0.06
449	002583	海能达	9,233	56,690.62	0.06
450	002640	跨境通	11,008	56,581.12	0.06
451	002589	瑞康医药	10,613	55,505.99	0.05
452	002424	贵州百灵	7,088	55,499.04	0.05
453	002635	安洁科技	3,207	55,256.61	0.05
454	000681	视觉中国	4,241	55,133.00	0.05
455	000501	鄂武商A	4,644	54,102.60	0.05
456	300324	旋极信息	12,396	52,435.08	0.05
457	300197	铁汉生态	16,529	52,396.93	0.05
458	000718	苏宁环球	15,224	52,218.32	0.05
459	000717	韶钢松山	12,202	52,102.54	0.05
460	000046	泛海控股	15,743	51,637.04	0.05
461	002815	崇达技术	3,554	51,319.76	0.05
462	300180	华峰超纤	8,603	50,843.73	0.05
463	002375	亚厦股份	6,751	50,227.44	0.05
464	000008	神州高铁	19,628	49,855.12	0.05
465	000156	华数传媒	5,793	49,588.08	0.05
466	002948	青岛银行	8,269	49,035.17	0.05
467	000826	启迪环境	7,213	48,759.88	0.05
468	000061	农产品	6,828	48,137.40	0.05
469	000543	皖能电力	11,460	47,902.80	0.05
470	002002	鸿达兴业	15,672	47,016.00	0.05
471	300257	开山股份	3,440	46,956.00	0.05
472	688590	新致软件	2,951	46,596.29	0.05
473	002416	爱施德	6,237	46,528.02	0.05
474	000848	承德露露	6,489	46,071.90	0.04

475	300896	爱美客	76	45,855.36	0.04
476	000990	诚志股份	3,797	45,032.42	0.04
477	000937	冀中能源	10,674	44,403.84	0.04
478	002302	西部建设	5,057	44,400.46	0.04
479	603379	三美股份	2,294	43,815.40	0.04
480	002665	首航高科	20,494	43,652.22	0.04
481	601512	中新集团	4,344	43,179.36	0.04
482	002503	搜于特	18,781	42,069.44	0.04
483	000600	建投能源	7,260	40,728.60	0.04
484	300134	大富科技	3,879	40,070.07	0.04
485	000813	德展健康	9,020	39,958.60	0.04
486	000062	深圳华强	3,177	39,521.88	0.04
487	601811	新华文轩	4,198	38,159.82	0.04
488	002419	天虹股份	4,849	37,046.36	0.04
489	002093	国脉科技	5,067	36,938.43	0.04
490	000553	安道麦 A	4,618	36,112.76	0.04
491	002051	中工国际	5,012	35,535.08	0.03
492	000537	广宇发展	5,596	35,086.92	0.03
493	600917	重庆燃气	4,997	34,279.42	0.03
494	000732	泰禾集团	10,076	32,948.52	0.03
495	688557	兰剑智能	997	32,651.75	0.03
496	002491	通鼎互联	7,603	31,020.24	0.03
497	003021	兆威机电	425	30,226.00	0.03
498	002901	大博医疗	407	30,008.11	0.03
499	688617	惠泰医疗	401	29,858.46	0.03
500	601686	友发集团	2,374	29,390.12	0.03
501	601068	中铝国际	8,241	29,337.96	0.03
502	002653	海思科	1,610	28,207.20	0.03
503	000785	居然之家	3,055	25,631.45	0.02
504	002118	紫鑫药业	7,794	25,096.68	0.02
505	002946	新乳业	1,277	22,487.97	0.02
506	603256	宏和科技	2,544	22,463.52	0.02
507	002818	富森美	1,525	21,548.25	0.02
508	002941	新疆交建	1,949	21,439.00	0.02
509	000025	特力 A	1,175	19,857.50	0.02
510	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.02
511	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.02
512	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.02
513	002423	中粮资本	1,837	17,782.16	0.02
514	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.02
515	001872	招商港口	1,069	17,018.48	0.02
516	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.02

517	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.02
518	003016	欣贺股份	1,681	15,784.59	0.02
519	605151	西上海	723	15,219.15	0.01
520	605500	森林包装	762	14,980.92	0.01
521	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.01
522	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
523	300892	品渥食品	223	13,382.23	0.01
524	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.01
525	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.01
526	300878	维康药业	235	11,449.20	0.01
527	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
528	003023	彩虹集团	296	11,262.80	0.01
529	300887	谱尼测试	150	11,178.00	0.01
530	300876	蒙泰高新	302	11,059.24	0.01
531	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
532	300900	广联航空	299	9,914.84	0.01
533	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.01
534	300889	爱克股份	296	8,915.52	0.01
535	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
536	002957	科瑞技术	411	8,404.95	0.01
537	003027	同兴环保	209	8,389.26	0.01
538	300864	南大环境	91	8,267.35	0.01
539	300902	国安达	303	7,350.78	0.01
540	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
541	300886	华业香料	147	6,713.49	0.01
542	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600521	华海药业	1,319,343.00	0.92
2	002185	华天科技	1,188,711.00	0.83
3	600529	山东药玻	1,043,663.00	0.73
4	601995	中金公司	1,025,805.54	0.72
5	300558	贝达药业	1,008,735.00	0.71
6	300012	华测检测	993,359.00	0.70
7	300285	国瓷材料	941,364.00	0.66
8	300253	卫宁健康	850,779.00	0.60
9	601799	星宇股份	848,213.00	0.59
10	603858	步长制药	844,948.00	0.59
11	300496	中科创达	843,813.00	0.59

12	002127	南极电商	814,594.00	0.57
13	300595	欧普康视	804,570.00	0.56
14	600153	建发股份	797,456.23	0.56
15	300357	我武生物	787,660.00	0.55
16	300482	万孚生物	786,672.00	0.55
17	601099	太平洋	777,750.00	0.55
18	600667	太极实业	764,190.00	0.54
19	603882	金域医学	756,114.00	0.53
20	603338	浙江鼎力	745,493.60	0.52

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600745	闻泰科技	1,478,558.01	1.04
2	300253	卫宁健康	1,475,048.99	1.03
3	002821	凯莱英	1,427,979.19	1.00
4	600521	华海药业	1,287,865.52	0.90
5	002127	南极电商	1,263,942.06	0.89
6	600183	生益科技	1,162,571.04	0.81
7	600872	中炬高新	1,085,429.01	0.76
8	600584	长电科技	1,024,068.80	0.72
9	603501	韦尔股份	1,016,841.54	0.71
10	002129	中环股份	991,855.02	0.70
11	002507	涪陵榨菜	990,786.67	0.69
12	600763	通策医疗	989,586.26	0.69
13	300274	阳光电源	983,367.32	0.69
14	002385	大北农	982,638.54	0.69
15	300088	长信科技	924,693.13	0.65
16	002463	沪电股份	911,974.45	0.64
17	300315	掌趣科技	910,820.48	0.64
18	000547	航天发展	899,460.63	0.63
19	002075	沙钢股份	898,077.80	0.63
20	002797	第一创业	897,069.92	0.63

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。

8.4.3 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	136,304,794.86
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	218,657,455.34
--------------	----------------

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、债转股及行权等获得的股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,120,890.00	4.99
	其中：政策性金融债	5,120,890.00	4.99
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）	1,000.00	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,121,890.00	4.99

8.6 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	108802	进出 1902	32,000	3,205,120.00	3.12
2	108604	国开 1805	19,000	1,915,770.00	1.87
3	113044	大秦转债	10	1,000.00	-

8.7 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。

8.8 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：注：本基金本报告期末未持有贵金属投资

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否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。

8.12.3 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	51,880.94
2	应收证券清算款	98,529.62
3	应收股利	-
4	应收利息	67,592.14
5	应收申购款	499.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	218,501.95

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601995	中金公司	1,714,383.21	1.67	新股流通受限

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份 额	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

级别			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华富华鑫灵活配置混合 A	196	323,753.78	57,930,890.29	91.29	5,524,850.82	8.71
华富华鑫灵活配置混合 C	109	46,023.67	0.00	0.00	5,016,579.96	100.00
合计	305	224,499.41	57,930,890.29	84.60	10,541,430.78	15.40

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。

9.2 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	华富华鑫灵活配置混合 A	10,669.48	0.0168
	华富华鑫灵活配置混合 C	-	-
	合计	10,669.48	0.0156

注：本表列示“占基金总份额比例”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。

9.3 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

注：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研发部门负责人、本基金的基金经理未持

有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2016 年 11 月 11 日) 基金份额总额	408,167,084.54	179,267,613.14
本报告期期初基金份 额总额	118,898,866.76	12,053,375.35
本报告期基金总申购 份额	2,164,000.24	28,301,865.48
减：本报告期基金总 赎回份额	57,607,125.89	35,338,660.87
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	63,455,741.11	5,016,579.96

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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. 2020 年 8 月 17 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，增聘尤之奇先生为华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金基金经理。

15. 2020 年 8 月 26 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，增聘陈奇先生为华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

16. 2020 年 11 月 9 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，增聘张惠女士为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

17. 2020 年 11 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，张娅女士不再担任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

18. 2020 年 11 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，郜哲先生不再担任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

19. 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 5 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	113,441,548.47	33.09%	103,981.99	32.99%	-
华西证券	1	102,595,362.39	29.93%	95,546.69	30.31%	-
安信证券	1	92,017,445.80	26.84%	83,856.01	26.60%	-
招商证券	2	23,431,321.83	6.84%	21,422.72	6.80%	-
海通证券	1	5,848,007.77	1.71%	5,329.22	1.69%	-
西南证券	1	5,208,686.09	1.52%	4,850.92	1.54%	-
东方证券	2	161,696.47	0.05%	150.63	0.05%	-
太平洋证券	2	101,025.23	0.03%	92.07	0.03%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

中银国际	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：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海通证券 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。

11.7.2 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	6,315,023.74	29.13%	200,000.00	25.00%	-	-
华西证券	2,360,944.10	10.89%	-	-	-	-
安信证券	9,190,588.52	42.39%	100,000.00	12.50%	-	-
招商证券	1,713,587.50	7.90%	-	-	-	-
海通证券	1,817,865.10	8.38%	-	-	-	-
西南证券	15,608.00	0.07%	-	-	-	-
东方证券	11,979.00	0.06%	-	-	-	-
太平洋证券	256,430.41	1.18%	500,000.00	62.50%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：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。

11.8 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	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资	中国证监会指定媒介	2020年1月22日

	基金 2019 年第 4 季度报告》		
3	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金调整开放日的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 1 月 29 日
4	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与申万宏源证券有限公司费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 3 月 10 日
5	《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 27 日
6	《华富华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
7	《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
8	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年度报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 29 日
9	《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
10	《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	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与恒泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 6 月 12 日
12	《华富基金管理有限公司关于变更董事长的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 7 月 1 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交通银行基金申购及定期定额投资费率优惠的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 7 月 1 日
14	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加诺亚正行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 7 月 8 日
15	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与申万宏源证券有限公司费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 7 月 9 日
16	《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 7 月 18 日
17	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第二季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 7 月 21 日
18	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 7 月 21 日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与渤海银行股份有限公司费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 7 月 31 日
20	《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	中国证监会指定媒介	2020 年 8 月 5 日

	提示性公告》		
21	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与长城国瑞证券有限公司费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 8 月 24 日
22	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新》	中国证监会指定媒介	2020 年 8 月 27 日
23	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 8 月 31 日
24	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 8 月 31 日
25	《华富基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售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 10 月 28 日
26	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第三季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 10 月 28 日
27	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 10 月 28 日
28	《华富基金管理有限公司澄清公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 11 月 7 日
29	《华富基金管理有限公司关于对投资者在微信直销平台上交易申购定投基金实施费率优惠的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 11 月 7 日
30	《华富基金管理有限公司关于开通微信网上直销系统端口的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 11 月 7 日
31	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》	中国证监会指定媒介	2020 年 12 月 3 日
32	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新》	中国证监会指定媒介	2020 年 12 月 7 日
33	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行基金申购及定期定额投资费率优惠的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020.1.1-2020.12.31	95,600,382.40	0.00	47,800,191.20	47,800,191.20	69.81

个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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

2021年3月31日