

# 华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

2023 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

报告送出日期：2023 年 7 月 21 日

## 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华富永鑫灵活配置混合	
基金主代码	001466	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 15 日	
报告期末基金份额总额	10,877,135.93 份	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	华富永鑫灵活配置混合 A	华富永鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001466	001467
报告期末下属分级基金的份额总额	286,564.08 份	10,590,571.85 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023年4月1日-2023年6月30日)	
	华富永鑫灵活配置混合A	华富永鑫灵活配置混合C
1. 本期已实现收益	1,530.47	10,155.04
2. 本期利润	17,740.70	179,348.84
3. 加权平均基金份额	0.0983	0.0909

期利		
润		
4. 期	28, 1	10
末基	1, 25	
金资	38, 4	
产净	6. 28	
值	04. 4	
		1
5. 期		
末基	0. 0.	
金份	9895	
额净	1961	
值		

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

华富永鑫灵活配置混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-8.60%	1.43%	-1.87%	0.41%	-6.73%	1.02%
过去六个月	-7.98%	1.01%	0.79%	0.42%	-8.77%	0.59%
过去一年	-10.50%	0.73%	-5.44%	0.49%	-5.06%	0.24%
过去三年	-7.32%	0.51%	2.62%	0.60%	-9.94%	-0.09%
过去五年	-7.58%	0.54%	18.75%	0.64%	-26.33%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	-1.81%	0.45%	3.85%	0.70%	-5.66%	-0.25%

华富永鑫灵活配置混合 C

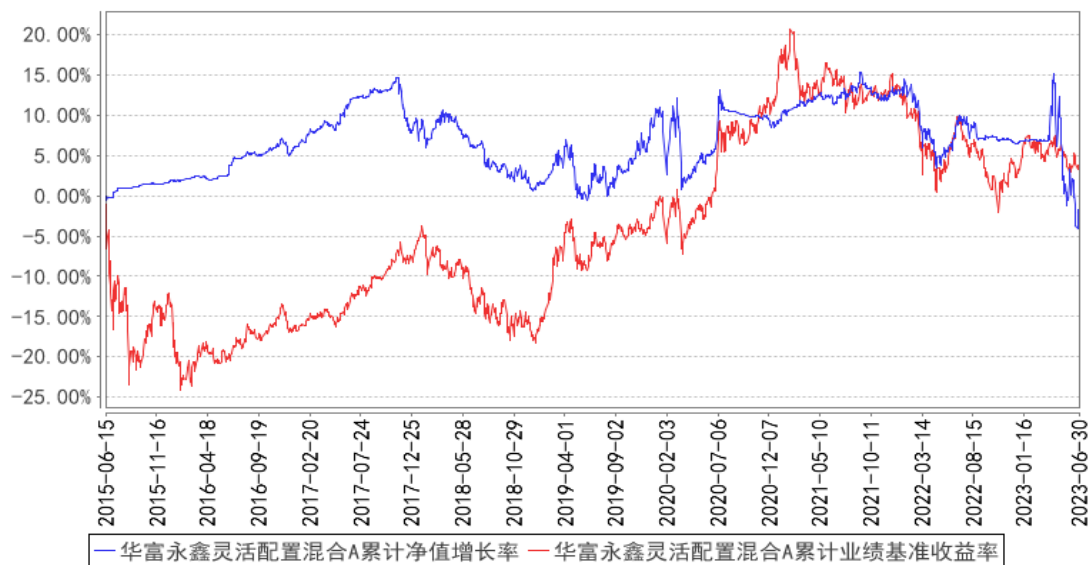
阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-8.61%	1.43%	-1.87%	0.41%	-6.74%	1.02%
过去六个月	-8.02%	1.01%	0.79%	0.42%	-8.81%	0.59%
过去一年	-10.59%	0.73%	-5.44%	0.49%	-5.15%	0.24%
过去三年	-7.61%	0.51%	2.62%	0.60%	-10.23%	-0.09%
过去五年	-8.09%	0.54%	18.75%	0.64%	-26.84%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-4.39%	0.45%	3.85%	0.70%	-8.24%	-0.25%

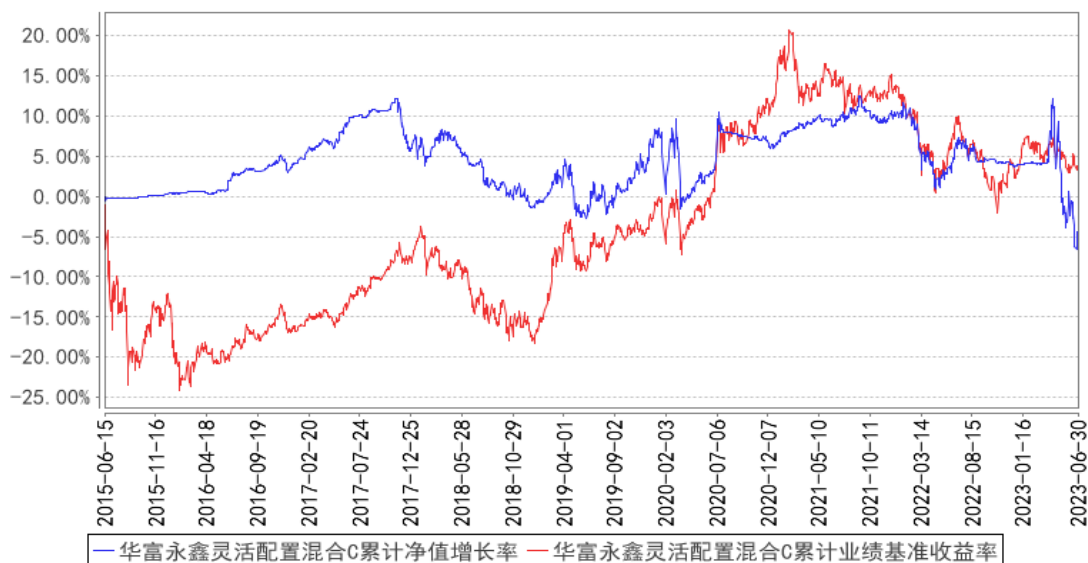
注：本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

### 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

华富永鑫灵活配置混合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



华富永鑫灵活配置混合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《华富永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%；债券、货币市场工具、资产支持证券等固定收益类资产占基金资产的 5%-100%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年期以内的政府债券的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本基金投资其他品种，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 2015 年 6 月 15 日到 2015 年 12 月 15 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《华富永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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李孝华	本基金基金经理	2023 年 3 月 24 日	-	十年	南开大学金融学硕士、硕士研究生学历。曾任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰安信息技术有限公司量化投资平台设计与开发员、华泰柏瑞基金基金经理助理。2019 年 10 月加入华富基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2021 年 5 月 7 日起任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 28 日起任华富中证证券公司先

				<p>锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 17 日起任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 5 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任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经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 24 日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年二季度市场未能延续一季度的反弹态势，因宏观经济数据及经济复苏力度不及市场预期，A 股在低位弱势震荡调整，市场情绪处于底部区域，期间沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指分别下跌 5.15%、5.38%、3.98% 和 7.69%。分行业来看，通信、传媒、火电及军工等板块表现居前，以商贸零售、食品饮料、美容护理、农林牧渔和社会服务为代表的大消费板块则表现落后。从市场风格来看，价值风格明显优于成长风格，期间沪深 300 价值小幅下跌 0.25%，而沪深 300 成长下跌 9.78%，表现显著弱于价值风格。

二季度本基金仍主要聚焦于黄金主题（包括金矿开采及黄金饰品销售等）相关个股的投资。本季度该板块的表现低于预期，这主要是受到美联储加息预期升温等因素影响，期间金价在短暂触碰历史高位后出现回落，受此影响黄金主题相关个股表现不佳。尽管美联储短期偏鹰，但从长周期角度来看，目前美债利率依然处于高位，未来利率逐渐进入下行周期为大概率事件，金价将因此受益。面对变幻莫测的宏观及市场环境，未来本基金将继续以对持有人高度负责的态度保持对投资的思考与研究，以期转化为更好的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富永鑫灵活配置混合 A 份额净值为 0.9819 元，累计份额净值为 0.9819 元。报告期，华富永鑫灵活配置混合 A 份额净值增长率为-8.60%，同期业绩比较基准收益率为-1.87%。截止本期末，华富永鑫灵活配置混合 C 份额净值为 0.9561 元，累计份额净值为 0.9561 元。报告期，华富永鑫灵活配置混合 C 份额净值增长率为-8.61%，同期业绩比较基准收益率为-1.87%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2020 年 03 月 17 日起至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于 5000 万元的情形，至本报告期期末（2023 年 06 月 30 日）基金资产净值仍低于 5000 万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。



## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,808,012.00	93.69
	其中：股票	9,808,012.00	93.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	640,132.47	6.11
8	其他资产	20,497.15	0.20
9	合计	10,468,641.62	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,629,252.00	63.70
C	制造业	3,032,316.00	29.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	146,444.00	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务	-	-

	业		
P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	9,808,012.00	94.25

### 5.2.2 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600489	中金黄金	90,400	933,832.00	8.97
2	600547	山东黄金	38,000	892,240.00	8.57
3	000975	银泰黄金	72,800	851,760.00	8.18
4	601899	紫金矿业	74,400	845,928.00	8.13
5	002237	恒邦股份	76,000	827,640.00	7.95
6	601069	西部黄金	62,300	799,932.00	7.69
7	600988	赤峰黄金	56,800	764,528.00	7.35
8	002867	周大生	42,500	755,650.00	7.26
9	002155	湖南黄金	59,600	727,120.00	6.99
10	000603	盛达资源	57,200	691,548.00	6.65

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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中，周大生珠宝股份有限公司、山东恒邦冶炼股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,216.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	18,280.40
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	20,497.15

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富永鑫灵活配置混合 A	华富永鑫灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	64,289.78	9,963,601.45
报告期期间基金总申购份额	241,174.77	1,128,983.93
减：报告期期间基金总赎回份额	18,900.47	502,013.53
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	286,564.08	10,590,571.85

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华富永鑫灵活配置混合 A	华富永鑫灵活配置混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	9,779,623.22
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份	0.00	0.00

额		
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00	9,779,623.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0	89.91

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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	2023.4.1-2023.6.30	9,779,623.22	0.00	0.00	9,779,623.22	89.9100
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

无

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富永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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 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

2023 年 7 月 21 日