

# 华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<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	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 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	
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	34,724,254.85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	29,971,490.79份	4,752,764.06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	(010) 66105799
	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	《证券时报》
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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	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	9,417,616.07	1,674,221.06
本期利润	3,000,215.31	495,722.29
加权平均基金份额本期利润	0.0873	0.1068
本期加权平均净值利润率	5.76%	7.10%
本期基金份额净值增长率	7.14%	7.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	期末可供分配利润	2,826,396.13
	期末可供分配基金份额利润	0.5947
	期末基金资产净值	7,579,160.19

期末基金份额净值	1.606	1.595
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	63.79%	62.67%

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
过去一个月	2.42%	0.72%	-0.94%	0.41%	3.36%	0.31%
过去三个月	9.70%	0.67%	2.23%	0.49%	7.47%	0.18%
过去六个月	7.14%	0.94%	1.21%	0.66%	5.93%	0.28%
过去一年	27.36%	1.16%	13.98%	0.67%	13.38%	0.49%
过去三年	71.22%	1.37%	31.90%	0.68%	39.32%	0.69%
自基金合同生效起至今	63.79%	1.16%	36.63%	0.60%	27.16%	0.56%

华富华鑫灵活配置混合 C

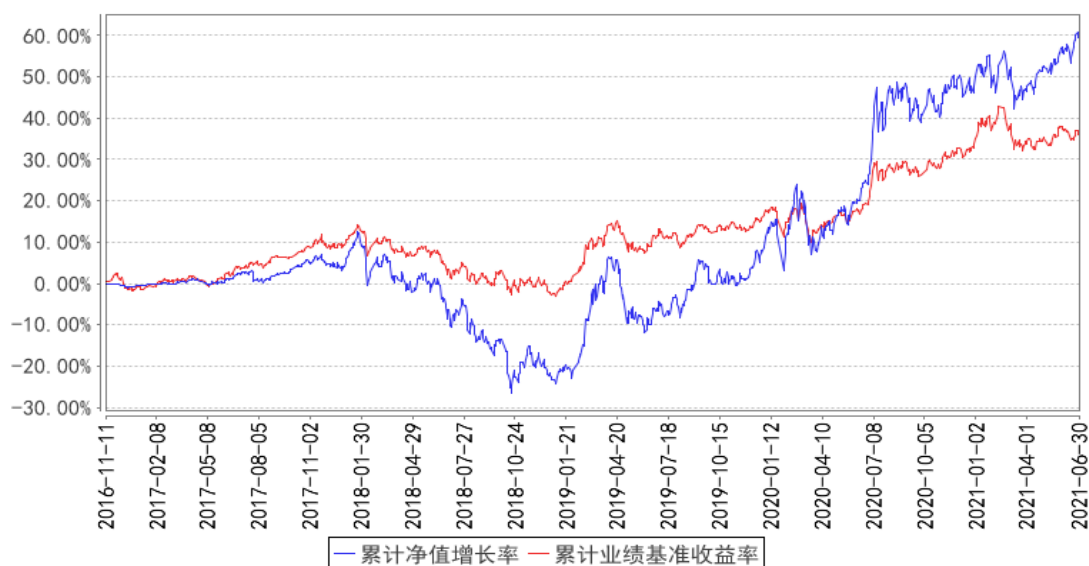
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
	率	准	准收益率③	收益率标准差		

	率①	准差②		④		
过去一个月	2.44%	0.74%	-0.94%	0.41%	3.38%	0.33%
过去三个月	9.70%	0.68%	2.23%	0.49%	7.47%	0.19%
过去六个月	7.12%	0.95%	1.21%	0.66%	5.91%	0.29%
过去一年	27.19%	1.16%	13.98%	0.67%	13.21%	0.49%
过去三年	70.59%	1.37%	31.90%	0.68%	38.69%	0.69%
自基金合同生效起 至今	62.67%	1.17%	36.63%	0.60%	26.04%	0.57%

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。

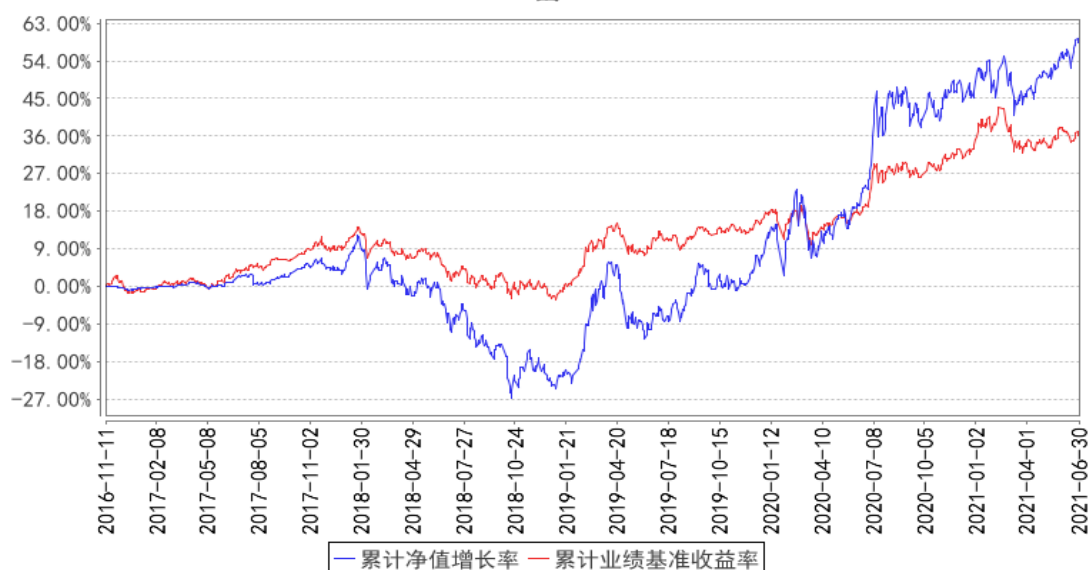
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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，本基金的投资资产配置比例为：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 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。

## § 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、安徽省信用融资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 2021 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、华富中小企业 100 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联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金和华富新能源股票型发起式证券投资基金共四十六只基金。

#### 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	2016 年 11 月 11 日	-	十五年	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。

	经理、华富安华债券型基金基金经理、公司总经理助理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会委员				
--	------------------------------------------------	--	--	--	--

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，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

2021 年上半年，国内经济整体进入扩张尾部的环境。6 月官方制造业 PMI 在回落至 50.9%，显示经济仍在扩张区间但仍修复斜率有所放缓，企业盈利相对有韧性，1-5 月规模以上工业企业

收入和利润累计同比分别为 30.5%和 83.4%，以 2019 年为基期的两年复合增速分别为 9.9%和 48%，5 月当月利润同比增长 36.4%，两年复合增速 20.2%，较 4 月的 22.5%略有放缓但维持在偏高的位置。库存周期方面，5 月末工业产成品库存同比增速回升至 10.2%，今年以来虽波动较大，但仍处在“主动补库存”阶段。融资环境方面，前 5 月信贷与社融增速总体看趋势下行，有财政后置的影响，也反应企业融资环境趋于恶化。通胀方面，5 月 PPI 同比高达 9%，显著高于市场预期，但由于猪周期等原因，工业品通胀对于 CPI 的传导尚不显著。总体而言，融资环境逐渐收紧、企业盈利维持韧性、制造业波动补库存、PPI 通胀趋势上行，总体而言国内经济处于扩张的尾部，需要关注滞胀风险。

海外宏观主线主要在美债、疫苗和中美关系三个方面。疫情方面，近期部分国家疫情再度反复引发关注，尤其是英国等国受到变异病毒影响严重，欧洲其他国家如德、法、意等疫情维持改善趋势不变。全球流动性方面，6 月美联储议息会议维持基准利率水平与购债规模描述并大幅上调今年经济增长及通胀预期。参照过往经验，美联储可能在就业恢复到 75%附近时释放缩减 QE 信号，并最快在今年 4 季度开始缩减 QE，美债与美元走强的风险较高，对于风险资产或会形成阶段性冲击。

从国内资本市场的表现来看，上半年 A 股市场冲高回落，然后震荡上行，“核心资产”抱团瓦解之后仍然处在估值消化过程中，周期和中小价值品种估值有所修复，半导体、新能源等高景气成长行业表现突出，结构分化依然较为严重；转债市场整体表现较强，转债指数创出阶段新高；债券市场表现相对稳健，在偏宽松的资金利率水平下，利率债小幅走强，高等级信用债需求旺盛。本基金以打新增强为主要投资策略，中小市值的权益底仓表现相对较好，上半年整体表现符合预期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富华鑫 A 份额净值为 1.606 元，累计份额净值为 1.626 元。本报告期的基金份额净值增长率为 7.14%，同期业绩比较基准收益率为 1.21%。截止本期末，华富华鑫 C 份额净值为 1.595 元，累计份额净值为 1.615 元。本报告期的基金份额净值增长率为 7.12%，同期业绩比较基准收益率为 1.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面仍有韧性但下行压力加大，基建乏力，出口承压，经济增长见顶回落趋势不改；通胀层面 PPI 高位回落，CPI 低位回升，通胀预期有所回落。在全球疫情持续反复的背景下，稳增长压力将明显增大，财政政策将比上半年更为积极，货币政策仍将合理充裕，政

策面整体趋于稳中偏松。全球来看，欧美经济复苏晚于中国，下半年也需要重点关注政策的逐步退出对市场的影响。整体而言，全面降准之后，政策较前期预期更为偏松，对资产价格形成支撑。从资产配置角度，股债估值性价比较为均衡，债券资产胜率在改善，但是上半年偏强的表现导致赔率不足，风险资产整体不贵，估值分化持续收敛，但结构性机会操作难度加大；中期来看随着政策对冲经济下行压力，股债系统性风险均不大。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。

#### 4.7 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，本期利润为 3,495,937.60 元，期末可供分配利润为 21,000,252.08 元。本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华富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，本基金的管理人——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，本基金未进行利润分配。

## 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华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 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：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,039,965.84	837,778.55
结算备付金		232,600.83	77,402.57
存出保证金		18,541.18	51,880.94
交易性金融资产	6.4.7.2	54,521,180.22	101,885,114.15
其中：股票投资		51,816,647.12	96,763,224.15
基金投资		-	-
债券投资		2,704,533.10	5,121,890.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	98,529.62
应收利息	6.4.7.5	79,133.87	67,592.14
应收股利		-	-
应收申购款		3,438.49	499.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		55,894,860.43	103,018,797.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,686.52	174,865.07
应付管理人报酬		26,764.58	51,513.83
应付托管费		6,691.12	12,878.49
应付销售服务费		1,176.26	1,267.95
应付交易费用	6.4.7.7	40,720.83	8,814.44
应交税费		11.63	11.63
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,302.56	179,047.91
负债合计		170,353.50	428,399.32
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	34,724,254.85	68,472,321.07
未分配利润	6.4.7.10	21,000,252.08	34,118,076.83
所有者权益合计		55,724,506.93	102,590,397.90
负债和所有者权益总计		55,894,860.43	103,018,797.22

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，华富华鑫灵活配置混合 A 基金份额净值 1.606 元，基金份额总额 29,971,490.79 份；华富华鑫灵活配置混合 C 基金份额净值 1.595 元，基金份额总额 4,752,764.06 份。华富华鑫灵活配置混合份额总额合计为 34,724,254.85 份。

## 6.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,042,014.94	22,067,893.35
1. 利息收入		53,883.13	106,670.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,116.10	4,068.02
债券利息收入		50,767.03	102,602.12
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）		11,582,361.77	20,620,202.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,236,844.57	19,548,489.21
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-7,579.69	46,902.99
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	353,096.89	1,024,810.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,595,899.53	1,335,975.89
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	1,669.57	5,044.41
减：二、费用		546,077.34	947,356.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	174,807.79	428,101.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,701.98	107,025.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,929.42	11,374.75
4. 交易费用	6.4.7.19	216,303.51	296,356.04
5. 利息支出		134.08	29.22
其中：卖出回购金融资产支出		134.08	29.22
6. 税金及附加		-	0.62
7. 其他费用	6.4.7.20	104,200.56	104,468.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,495,937.60	21,120,536.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,495,937.60	21,120,536.67

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：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	68,472,321.07	34,118,076.83	102,590,397.90



权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,495,937.60	3,495,937.60
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)	-33,748,066.22	-16,613,762.35	-50,361,828.57
其中:1.基金申购款	15,628,951.52	8,363,617.90	23,992,569.42
2.基金赎回款	-49,377,017.74	-24,977,380.25	-74,354,397.99
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	34,724,254.85	21,000,252.08	55,724,506.93
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	21,120,536.67	21,120,536.67
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)	-9,471,296.46	-1,192,876.13	-10,664,172.59
其中:1.基金申购款	1,085,681.55	154,816.01	1,240,497.56
2.基金赎回款	-10,556,978.01	-1,347,692.14	-11,904,670.15
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)	121,480,945.65	31,642,419.95	153,123,365.60

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）。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征税率缴纳增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

主要税种及税率列示如下:

税种	计税依据	税率
增值税	金融服务销售额	3%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加[注]	应缴流转税税额	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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,039,965.84
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	1,039,965.84

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	46,079,321.68	51,816,647.12	5,737,325.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,704,533.10	-11,091.65
	银行间市场	-	-
	合计	2,704,533.10	-11,091.65
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	48,794,946.43	54,521,180.22	5,726,233.79

##### 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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	78.64
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	104.70
应收债券利息	78,942.13
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	8.40
合计	79,133.87

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	40,720.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,720.83

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
上清账户维护费	4,500.00
应付审计费	24,795.19
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	59,507.37
合计	93,302.56

#### 6.4.7.9 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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,455,741.11	63,455,741.11
本期申购	15,334,286.99	15,334,286.99
本期赎回（以“-”号填列）	-48,818,537.31	-48,818,537.31
-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	29,971,490.79	29,971,490.79

华富华鑫灵活配置混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,016,579.96	5,016,579.96
本期申购	294,664.53	294,664.53
本期赎回（以“-”号填列）	-558,480.43	-558,480.43
—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	4,752,764.06	4,752,764.06

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	26,339,701.62	5,322,804.59	31,662,506.21
本期利润	9,417,616.07	-6,417,400.76	3,000,215.31
本期基金份额 交易产生的变 动数	-12,391,377.28	-4,097,488.29	-16,488,865.57
其中：基金申 购款	11,735,710.24	-3,536,495.81	8,199,214.43
基金赎 回款	-24,127,087.52	-560,992.48	-24,688,080.00
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	23,365,940.41	-5,192,084.46	18,173,855.95

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	2,036,965.16	418,605.46	2,455,570.62
本期利润	1,674,221.06	-1,178,498.77	495,722.29
本期基金份额 交易产生的变 动数	-67,387.81	-57,508.97	-124,896.78
其中：基金申	201,640.12	-37,236.65	164,403.47

购款			
基金赎回款	-269,027.93	-20,272.32	-289,300.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,643,798.41	-817,402.28	2,826,396.13

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	2,425.66
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	494.84
其他	195.60
合计	3,116.10

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,236,844.57
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	11,236,844.57

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	87,345,734.90
减：卖出股票成本总额	76,108,890.33
买卖股票差价收入	11,236,844.57

### 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 2021年1月1日至2021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	-7,579.69
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	-7,579.69

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,783,094.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,720,075.10
减：应收利息总额	70,598.78
买卖债券差价收入	-7,579.69

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	353,096.89
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	353,096.89



#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,595,899.53
股票投资	-7,601,526.73
债券投资	5,627.20
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	-7,595,899.53

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,669.57
合计	1,669.57

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	216,303.51
银行间市场交易费用	-
合计	216,303.51

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,298.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	104,200.56

注：其他为上交所查询服务费。

#### 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

无

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	337,440.29	0.27	10,453,827.74	5.73

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	151,110.00	3.04	794,096.39	7.77

注：本表中“当期债券成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券交易成交总额。

### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	100,000.00	22.22	200,000.00	66.67

### 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 2021年1月1日至2021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	307.52	0.27	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	9,728.36	5.78	358.81	0.23

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。

### 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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	174,807.79	428,101.88
其中：支付销售机构的客户维护费	18,314.26	20,388.45

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）。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	43,701.98	107,025.44

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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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		2,163.80	2,163.80
工商银行银行股份有限公司			
华安证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	2,163.80	2,163.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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	0.00	4,739.04	4,739.04
工商银行银行股份有限公司	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	3.37	3.37
合计	0.00	4,742.41	4,742.41

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：报告期内未发生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自有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期和上年度可比期间内本基金管理人没有运用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

份额单位：份

华富华鑫灵活配置混合 A

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
上海华富利得资产管理有限公司	14,983,061.89	43.15	0.00	0

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,039,965.84	2,425.66	1,031,548.38	3,849.17

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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021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
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年07月06日	新股流通受限	31.56	31.56	196	6,185.76	6,185.76	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年7月7日	新股流通受限	74.46	373.24	401	29,858.46	149,669.24	-

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

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
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项停牌	3.05	2021年7月14日	3.36	25,199	94,642.03	76,856.95	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 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按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	1,000.00

AAA 以下	1,083.10	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,083.10	1,000.00

#### 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按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元



本期末 2021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	1,039,965.84	-	-	-	-	-	1,039,965.84
结算备付金	232,600.83	-	-	-	-	-	232,600.83
存出保证金	18,541.18	-	-	-	-	-	18,541.18
交易性金融资产	1,600,480.00	1,102,970.00	1,083.10	-	-	51,816,647.12	54,521,180.22
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	79,133.87	79,133.87
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	3,438.49	3,438.49
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,891,587.85	1,102,970.00	1,083.10	-	-	51,899,219.48	55,894,860.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,686.52	1,686.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,764.58	26,764.58
应付托管费	-	-	-	-	-	6,691.12	6,691.12
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,176.26	1,176.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	40,720.83	40,720.83
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	11.63	11.63
其他负债	-	-	-	-	-	93,302.56	93,302.56
负债总计	-	-	-	-	-	170,353.50	170,353.50
利率敏感度缺口	2,891,587.85	1,102,970.00	1,083.10	-	-	51,728,865.98	55,724,506.93
上年度末 2020年12月 31日							
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

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	1. 除利率外其他市场变量保持不变
	对资产负债表日基金资产净值的
	相关风险变量的变

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 25 基点	608.94	7,305.74
	市场利率上升 25 基点	-608.10	-7,291.65

#### 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 2021年6月30日		上年度末 2020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	51,816,647.12	92.99	96,763,224.15	94.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,704,533.10	4.85	5,121,890.00	4.99
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	54,521,180.22	97.84	101,885,114.15	99.31

##### 6.4.13.4.2.2 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升百分之五	784,682.15	4,129,175.46
	沪深 300 指数下降百分之五	-784,682.15	-4,129,175.46

#### 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
		合计	14,055,610.76

#### 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	51,816,647.12	92.70
	其中：股票	51,816,647.12	92.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,704,533.10	4.84
	其中：债券	2,704,533.10	4.84
	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	1,272,566.67	2.28
8	其他各项资产	101,113.54	0.18
9	合计	55,894,860.43	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	490,697.97	0.88
B	采矿业	1,650,113.50	2.96
C	制造业	34,737,004.61	62.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,069,465.70	1.92
E	建筑业	694,037.35	1.25
F	批发和零售业	1,681,523.38	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	979,286.18	1.76
H	住宿和餐饮业	276,760.83	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,700,725.86	6.64
J	金融业	2,361,717.45	4.24
K	房地产业	1,280,206.43	2.30
L	租赁和商务服务业	522,166.16	0.94
M	科学研究和技术服务业	515,424.42	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	440,304.24	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	25,527.72	0.05
Q	卫生和社会工作	523,207.91	0.94
R	文化、体育和娱乐业	410,825.99	0.74
S	综合	457,651.42	0.82
	合计	51,816,647.12	92.99

### 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	300274	阳光电源	8,648	995,038.88	1.79
2	002709	天赐材料	4,692	500,073.36	0.90
3	300012	华测检测	14,139	450,751.32	0.81
4	603486	科沃斯	1,950	444,756.00	0.80
5	600089	特变电工	31,477	404,479.45	0.73

6	600132	重庆啤酒	2,025	400,848.75	0.72
7	000009	中国宝安	21,897	400,058.19	0.72
8	600426	华鲁恒升	12,685	392,600.75	0.70
9	300496	中科创达	2,478	389,194.68	0.70
10	603882	金域医学	2,383	380,731.91	0.68
11	002074	国轩高科	8,667	377,534.52	0.68
12	600460	士兰微	6,661	375,347.35	0.67
13	300595	欧普康视	3,580	370,709.00	0.67
14	603806	福斯特	3,120	328,005.60	0.59
15	600143	金发科技	15,721	327,940.06	0.59
16	601233	桐昆股份	13,557	326,588.13	0.59
17	300285	国瓷材料	6,589	321,213.75	0.58
18	002340	格林美	32,519	304,052.65	0.55
19	300207	欣旺达	9,330	303,784.80	0.55
20	002568	百润股份	3,144	298,019.76	0.53
21	002185	华天科技	18,595	286,177.05	0.51
22	600885	宏发股份	4,425	277,447.50	0.50
23	300316	晶盛机电	5,493	277,396.50	0.50
24	603345	安井食品	1,051	266,975.02	0.48
25	601799	星宇股份	1,142	257,772.24	0.46
26	601966	玲珑轮胎	5,797	253,560.78	0.46
27	600733	北汽蓝谷	17,760	239,404.80	0.43
28	600079	人福医药	8,358	236,280.66	0.42
29	002648	卫星石化	5,855	229,457.45	0.41
30	600884	杉杉股份	9,696	226,110.72	0.41
31	603737	三棵树	1,261	221,936.00	0.40
32	300146	汤臣倍健	6,679	219,739.10	0.39
33	600219	南山铝业	60,889	219,200.40	0.39
34	002353	杰瑞股份	4,871	217,733.70	0.39
35	600739	辽宁成大	10,394	216,299.14	0.39
36	002138	顺络电子	5,505	213,428.85	0.38
37	002791	坚朗五金	1,098	213,066.90	0.38
38	603444	吉比特	401	212,530.00	0.38
39	603589	口子窖	3,075	208,146.75	0.37
40	600392	盛和资源	11,929	207,087.44	0.37
41	603816	顾家家居	2,672	206,492.16	0.37
42	000547	航天发展	10,874	205,192.38	0.37
43	600779	水井坊	1,609	203,297.15	0.36
44	002444	巨星科技	5,832	198,754.56	0.36
45	002223	鱼跃医疗	5,197	198,161.61	0.36
46	601099	太平洋	57,806	195,962.34	0.35
47	601168	西部矿业	16,167	192,872.31	0.35

48	688099	晶晨股份	1,710	191,862.00	0.34
49	002625	光启技术	9,114	189,662.34	0.34
50	600862	中航高科	5,936	182,710.08	0.33
51	000636	风华高科	6,038	182,468.36	0.33
52	000830	鲁西化工	9,634	180,444.82	0.32
53	002030	达安基因	8,477	180,051.48	0.32
54	600563	法拉电子	1,129	178,788.44	0.32
55	002797	第一创业	25,005	178,535.70	0.32
56	002078	太阳纸业	13,259	177,007.65	0.32
57	600754	锦江酒店	3,103	176,715.85	0.32
58	600699	均胜电子	6,913	176,419.76	0.32
59	002507	涪陵榨菜	4,669	175,834.54	0.32
60	600486	扬农化工	1,566	175,031.82	0.31
61	002250	联化科技	6,237	174,012.30	0.31
62	600315	上海家化	2,876	172,962.64	0.31
63	300088	长信科技	20,777	171,618.02	0.31
64	000301	东方盛虹	8,199	171,359.10	0.31
65	300357	我武生物	2,661	170,623.32	0.31
66	000630	铜陵有色	62,616	170,315.52	0.31
67	002385	大北农	24,977	169,843.60	0.30
68	600704	物产中大	21,374	168,213.38	0.30
69	300699	光威复材	2,205	167,469.75	0.30
70	002064	华峰化学	11,763	167,034.60	0.30
71	600201	生物股份	9,544	166,542.80	0.30
72	002013	中航机电	16,442	165,570.94	0.30
73	002075	沙钢股份	15,124	165,002.84	0.30
74	000039	中集集团	9,074	164,965.32	0.30
75	000988	华工科技	6,844	160,970.88	0.29
76	300223	北京君正	1,574	158,848.08	0.29
77	000807	云铝股份	13,268	157,889.20	0.28
78	002028	思源电气	5,126	157,829.54	0.28
79	002212	天融信	7,962	157,408.74	0.28
80	000513	丽珠集团	3,127	156,412.54	0.28
81	601997	贵阳银行	21,694	155,329.04	0.28
82	002273	水晶光电	10,469	153,789.61	0.28
83	300001	特锐德	5,083	153,049.13	0.27
84	002511	中顺洁柔	5,550	152,902.50	0.27
85	002920	德赛西威	1,368	150,589.44	0.27
86	002465	海格通信	15,881	150,234.26	0.27
87	002080	中材科技	5,724	149,797.08	0.27
88	002092	中泰化学	14,583	149,767.41	0.27
89	688617	惠泰医疗	401	149,669.24	0.27

90	002603	以岭药业	5,099	148,686.84	0.27
91	600549	厦门钨业	7,127	148,455.41	0.27
92	000739	普洛药业	5,040	148,176.00	0.27
93	601128	常熟银行	23,841	147,814.20	0.27
94	600171	上海贝岭	4,825	146,824.75	0.26
95	300009	安科生物	9,835	146,541.50	0.26
96	300482	万孚生物	2,243	145,099.67	0.26
97	600867	通化东宝	12,133	144,868.02	0.26
98	601127	小康股份	2,172	144,807.24	0.26
99	600516	方大炭素	19,440	144,633.60	0.26
100	000825	太钢不锈	19,300	144,557.00	0.26
101	000983	山西焦煤	17,319	143,920.89	0.26
102	000021	深科技	7,512	143,779.68	0.26
103	600316	洪都航空	3,707	142,645.36	0.26
104	300244	迪安诊断	3,720	142,476.00	0.26
105	000750	国海证券	33,257	141,009.68	0.25
106	600418	江淮汽车	11,269	140,073.67	0.25
107	300463	迈克生物	3,315	139,528.35	0.25
108	600879	航天电子	18,422	138,533.44	0.25
109	600827	百联股份	6,831	137,644.65	0.25
110	300070	碧水源	18,791	137,362.21	0.25
111	002156	通富微电	5,697	136,955.88	0.25
112	600380	健康元	9,950	136,613.50	0.25
113	600529	山东药玻	4,018	136,411.10	0.24
114	000960	锡业股份	8,462	135,645.86	0.24
115	603290	斯达半导	423	135,360.00	0.24
116	002572	索菲亚	5,572	134,842.40	0.24
117	000975	银泰黄金	14,154	134,604.54	0.24
118	600166	福田汽车	39,007	134,574.15	0.24
119	002131	利欧股份	57,379	134,266.86	0.24
120	601689	拓普集团	3,560	133,250.80	0.24
121	002152	广电运通	10,200	132,906.00	0.24
122	601005	重庆钢铁	49,767	132,877.89	0.24
123	002690	美亚光电	2,361	131,649.36	0.24
124	600038	中直股份	2,474	130,478.76	0.23
125	600642	申能股份	20,836	127,933.04	0.23
126	300474	景嘉微	1,302	127,491.84	0.23
127	002299	圣农发展	5,298	126,516.24	0.23
128	601866	中远海发	33,627	126,101.25	0.23
129	300115	长盈精密	6,106	125,783.60	0.23
130	000998	隆平高科	7,797	125,063.88	0.22
131	002683	宏大爆破	4,440	123,298.80	0.22



132	000623	吉林敖东	7,931	122,851.19	0.22
133	002500	山西证券	18,213	122,209.23	0.22
134	600895	张江高科	6,598	120,545.46	0.22
135	688029	南微医学	386	120,312.34	0.22
136	601699	潞安环能	10,169	120,095.89	0.22
137	000012	南玻A	11,700	119,808.00	0.22
138	300296	利亚德	15,196	118,832.72	0.21
139	600415	小商品城	23,058	118,748.70	0.21
140	000050	深天马A	8,369	118,672.42	0.21
141	600153	建发股份	14,596	118,227.60	0.21
142	002831	裕同科技	3,965	117,720.85	0.21
143	002294	信立泰	3,548	116,729.20	0.21
144	300630	普利制药	2,218	116,223.20	0.21
145	600188	兖州煤业	7,525	115,584.00	0.21
146	600256	广汇能源	34,488	114,845.04	0.21
147	600667	太极实业	12,563	114,323.30	0.21
148	600535	天士力	7,719	114,318.39	0.21
149	300418	昆仑万维	6,913	113,234.94	0.20
150	601865	福莱特	2,864	113,213.92	0.20
151	300024	机器人	10,603	113,134.01	0.20
152	002557	洽洽食品	2,615	112,706.50	0.20
153	600060	海信视像	6,658	112,520.20	0.20
154	600008	首创环保	37,380	112,513.80	0.20
155	002373	千方科技	6,687	111,672.90	0.20
156	002670	国盛金控	9,794	111,553.66	0.20
157	000027	深圳能源	12,143	111,351.31	0.20
158	000878	云南铜业	8,655	111,043.65	0.20
159	600155	华创阳安	10,365	110,905.50	0.20
160	002372	伟星新材	5,328	110,129.76	0.20
161	002019	亿帆医药	6,345	109,451.25	0.20
162	002382	蓝帆医疗	5,244	109,337.40	0.20
163	600765	中航重机	4,819	109,150.35	0.20
164	603858	步长制药	4,851	109,098.99	0.20
165	600372	中航电子	6,583	108,948.65	0.20
166	002081	金螳螂	13,703	108,527.76	0.19
167	002221	东华能源	9,774	107,025.30	0.19
168	002926	华西证券	11,111	106,998.93	0.19
169	002966	苏州银行	14,557	106,993.95	0.19
170	300271	华宇软件	5,539	106,625.75	0.19
171	000718	苏宁环球	12,851	106,534.79	0.19
172	002174	游族网络	6,204	106,522.68	0.19
173	600409	三友化工	10,459	105,740.49	0.19

174	000932	华菱钢铁	15,976	105,441.60	0.19
175	600511	国药股份	3,159	104,436.54	0.19
176	600170	上海建工	37,697	104,043.72	0.19
177	002390	信邦制药	9,924	104,003.52	0.19
178	600875	东方电气	9,476	103,951.72	0.19
179	002506	协鑫集成	29,817	103,763.16	0.19
180	601615	明阳智能	6,389	103,437.91	0.19
181	603866	桃李面包	3,312	103,334.40	0.19
182	000997	新大陆	6,217	103,140.03	0.19
183	300168	万达信息	7,062	103,105.20	0.19
184	601717	郑煤机	8,847	102,890.61	0.18
185	300618	寒锐钴业	1,304	102,807.36	0.18
186	300058	蓝色光标	16,879	102,117.95	0.18
187	600160	巨化股份	11,485	101,527.40	0.18
188	600039	四川路桥	16,179	101,442.33	0.18
189	600801	华新水泥	5,772	101,414.04	0.18
190	000738	航发控制	4,859	101,212.97	0.18
191	000686	东北证券	11,919	100,715.55	0.18
192	002408	齐翔腾达	8,069	100,216.98	0.18
193	600258	首旅酒店	4,193	100,044.98	0.18
194	300315	掌趣科技	23,426	99,560.50	0.18
195	000401	冀东水泥	7,996	98,750.60	0.18
196	002195	二三四五	48,549	98,554.47	0.18
197	600282	南钢股份	27,659	98,466.04	0.18
198	000540	中天金融	35,640	97,297.20	0.17
199	300017	网宿科技	16,625	97,256.25	0.17
200	688088	虹软科技	1,744	97,228.00	0.17
201	600325	华发股份	14,381	96,927.94	0.17
202	000060	中金岭南	21,232	95,968.64	0.17
203	002268	卫士通	4,925	95,939.00	0.17
204	600859	王府井	3,306	95,477.28	0.17
205	601992	金隅集团	35,373	95,153.37	0.17
206	603605	珀莱雅	480	94,420.80	0.17
207	603338	浙江鼎力	1,605	94,197.45	0.17
208	600567	山鹰国际	27,255	94,029.75	0.17
209	603927	中科软	2,183	93,759.85	0.17
210	603077	和邦生物	45,009	93,618.72	0.17
211	600497	驰宏锌锗	21,670	93,397.70	0.17
212	002429	兆驰股份	15,308	92,919.56	0.17
213	600598	北大荒	6,207	92,856.72	0.17
214	002056	横店东磁	7,119	92,547.00	0.17
215	603638	艾迪精密	2,152	92,256.24	0.17

216	600500	中化国际	11,735	92,237.10	0.17
217	603883	老百姓	1,749	92,137.32	0.17
218	600216	浙江医药	5,744	91,961.44	0.17
219	600528	中铁工业	11,315	91,651.50	0.16
220	600839	四川长虹	31,433	91,470.03	0.16
221	600755	厦门国贸	11,084	90,999.64	0.16
222	600737	中粮糖业	9,067	90,760.67	0.16
223	000898	鞍钢股份	20,369	90,642.05	0.16
224	002595	豪迈科技	3,361	89,738.70	0.16
225	603198	迎驾贡酒	2,020	89,486.00	0.16
226	300212	易华录	3,320	89,341.20	0.16
227	000999	华润三九	3,323	88,890.25	0.16
228	603260	合盛硅业	1,155	88,831.05	0.16
229	000709	河钢股份	36,055	88,695.30	0.16
230	600141	兴发集团	4,708	88,651.64	0.16
231	600728	佳都科技	11,961	88,631.01	0.16
232	600580	卧龙电驱	6,648	88,418.40	0.16
233	000581	威孚高科	4,241	88,340.03	0.16
234	300166	东方国信	7,120	88,003.20	0.16
235	002203	海亮股份	8,240	87,673.60	0.16
236	002281	光迅科技	3,553	87,403.80	0.16
237	300182	捷成股份	17,475	87,200.25	0.16
238	000729	燕京啤酒	11,963	86,612.12	0.16
239	600808	马钢股份	20,185	86,593.65	0.16
240	000930	中粮科技	9,518	85,757.18	0.15
241	002242	九阳股份	2,624	85,253.76	0.15
242	002010	传化智联	11,052	85,210.92	0.15
243	002396	星网锐捷	3,969	84,738.15	0.15
244	600820	隧道股份	15,996	84,618.84	0.15
245	000488	晨鸣纸业	10,394	84,607.16	0.15
246	002563	森马服饰	7,076	84,558.20	0.15
247	002745	木林森	6,259	83,870.60	0.15
248	002004	华邦健康	13,472	83,661.12	0.15
249	000629	攀钢钒钛	36,346	83,232.34	0.15
250	002048	宁波华翔	4,232	82,524.00	0.15
251	600970	中材国际	8,838	81,044.46	0.15
252	688321	微芯生物	1,751	80,878.69	0.15
253	300002	神州泰岳	16,613	80,573.05	0.14
254	002124	天邦股份	11,484	80,502.84	0.14
255	603000	人民网	4,675	80,363.25	0.14
256	600398	海澜之家	11,033	79,878.92	0.14
257	002191	劲嘉股份	7,493	79,725.52	0.14

258	600022	山东钢铁	46,309	79,651.48	0.14
259	000598	兴蓉环境	15,248	79,442.08	0.14
260	605499	东鹏饮料	316	79,252.80	0.14
261	600037	歌华有线	8,221	79,003.81	0.14
262	601106	中国一重	23,264	78,864.96	0.14
263	600881	亚泰集团	27,496	78,363.60	0.14
264	002925	盈趣科技	1,987	77,314.17	0.14
265	603885	吉祥航空	5,050	77,063.00	0.14
266	600811	东方集团	25,199	76,856.95	0.14
267	601880	辽港股份	44,558	76,194.18	0.14
268	000883	湖北能源	16,566	76,037.94	0.14
269	002807	江阴银行	19,270	75,923.80	0.14
270	000959	首钢股份	13,490	75,813.80	0.14
271	600348	华阳股份	10,211	75,765.62	0.14
272	000778	新兴铸管	20,342	75,672.24	0.14
273	600597	光明乳业	5,250	75,652.50	0.14
274	000690	宝新能源	14,787	75,561.57	0.14
275	600782	新钢股份	13,534	75,519.72	0.14
276	601456	国联证券	4,903	75,506.20	0.14
277	600273	嘉化能源	8,668	75,411.60	0.14
278	600260	凯乐科技	8,456	75,089.28	0.13
279	000887	中鼎股份	6,215	75,077.20	0.13
280	601118	海南橡胶	14,581	74,217.29	0.13
281	002701	奥瑞金	14,361	73,815.54	0.13
282	002085	万丰奥威	13,036	73,001.60	0.13
283	002867	周大生	3,691	72,971.07	0.13
284	603650	彤程新材	1,516	72,919.60	0.13
285	600026	中远海能	11,768	72,490.88	0.13
286	002183	怡亚通	12,635	72,398.55	0.13
287	600908	无锡银行	12,459	72,262.20	0.13
288	000528	柳工	8,811	72,250.20	0.13
289	600410	华胜天成	9,310	72,245.60	0.13
290	002387	维信诺	6,920	72,175.60	0.13
291	600967	内蒙一机	7,131	72,165.72	0.13
292	000877	天山股份	5,530	72,055.90	0.13
293	603568	伟明环保	3,150	71,914.50	0.13
294	600718	东软集团	7,347	71,853.66	0.13
295	601179	中国西电	17,327	71,387.24	0.13
296	603712	七一二	1,977	71,369.70	0.13
297	002705	新宝股份	2,689	70,586.25	0.13
298	600435	北方导航	8,847	70,245.18	0.13
299	002110	三钢闽光	10,393	70,048.82	0.13

300	002368	太极股份	3,490	70,009.40	0.13
301	600572	康恩贝	15,767	70,005.48	0.13
302	600446	金证股份	4,830	69,745.20	0.13
303	000970	中科三环	7,262	69,352.10	0.12
304	600167	联美控股	7,745	69,162.85	0.12
305	601200	上海环境	5,744	68,755.68	0.12
306	300072	三聚环保	11,973	68,725.02	0.12
307	000402	金融街	10,175	68,681.25	0.12
308	002266	浙富控股	13,712	68,422.88	0.12
309	600329	中新药业	2,432	68,314.88	0.12
310	600064	南京高科	7,333	68,123.57	0.12
311	601598	中国外运	13,458	67,962.90	0.12
312	000990	诚志股份	5,316	67,672.68	0.12
313	002128	露天煤业	6,476	67,415.16	0.12
314	000089	深圳机场	8,675	67,404.75	0.12
315	002002	鸿达兴业	16,963	66,664.59	0.12
316	600158	中体产业	5,733	65,413.53	0.12
317	601000	唐山港	27,100	65,311.00	0.12
318	300026	红日药业	15,300	65,025.00	0.12
319	000400	许继电气	5,112	64,717.92	0.12
320	600645	中源协和	2,818	64,673.10	0.12
321	002985	北摩高科	657	64,057.50	0.11
322	601016	节能风电	17,064	63,819.36	0.11
323	300376	易事特	7,923	63,700.92	0.11
324	000519	中兵红箭	5,928	63,548.16	0.11
325	600120	浙江东方	14,746	63,112.88	0.11
326	002249	大洋电机	11,992	62,958.00	0.11
327	601975	招商南油	29,401	62,918.14	0.11
328	002233	塔牌集团	6,028	61,967.84	0.11
329	300133	华策影视	10,433	61,763.36	0.11
330	600507	方大特钢	9,102	61,711.56	0.11
331	600307	酒钢宏兴	26,538	61,568.16	0.11
332	600195	中牧股份	5,136	61,426.56	0.11
333	000090	天健集团	11,104	61,405.12	0.11
334	000685	中山公用	7,515	61,322.40	0.11
335	600021	上海电力	8,872	61,305.52	0.11
336	001914	招商积余	3,568	61,298.24	0.11
337	601333	广深铁路	28,828	61,115.36	0.11
338	600376	首开股份	10,892	60,995.20	0.11
339	000559	万向钱潮	11,129	59,094.99	0.11
340	600126	杭钢股份	11,491	58,948.83	0.11
341	600804	鹏博士	12,160	58,854.40	0.11

342	002839	张家港行	10,678	58,088.32	0.10
343	603893	瑞芯微	414	57,736.44	0.10
344	603228	景旺电子	2,200	57,640.00	0.10
345	600673	东阳光	12,827	57,593.23	0.10
346	002217	合力泰	15,941	56,909.37	0.10
347	600707	彩虹股份	6,028	56,723.48	0.10
348	600373	中文传媒	5,752	56,714.72	0.10
349	601860	紫金银行	15,487	56,217.81	0.10
350	000758	中色股份	11,742	55,774.50	0.10
351	600901	江苏租赁	10,663	55,447.60	0.10
352	002244	滨江集团	13,230	55,433.70	0.10
353	002038	双鹭药业	5,260	55,387.80	0.10
354	000967	盈峰环境	8,021	55,104.27	0.10
355	600582	天地科技	14,129	55,103.10	0.10
356	002155	湖南黄金	7,110	55,102.50	0.10
357	002416	爱施德	5,477	54,934.31	0.10
358	601608	中信重工	14,662	54,835.88	0.10
359	688590	新致软件	2,951	54,593.50	0.10
360	002936	郑州银行	14,855	54,517.85	0.10
361	600056	中国医药	4,487	54,517.05	0.10
362	600266	城建发展	11,478	54,405.72	0.10
363	600338	西藏珠峰	3,835	54,341.95	0.10
364	600388	龙净环保	6,376	54,323.52	0.10
365	000563	陕国投A	16,811	54,131.42	0.10
366	601098	中南传媒	6,033	53,211.06	0.10
367	601958	金钼股份	8,205	53,168.40	0.10
368	601665	齐鲁银行	5,690	52,917.00	0.09
369	600062	华润双鹤	4,428	52,737.48	0.09
370	600928	西安银行	11,288	52,602.08	0.09
371	601718	际华集团	18,567	52,358.94	0.09
372	600259	广晟有色	1,546	52,270.26	0.09
373	300180	华峰超纤	10,456	51,757.20	0.09
374	600959	江苏有线	16,875	51,468.75	0.09
375	600649	城投控股	10,800	51,408.00	0.09
376	002440	闰土股份	5,802	51,347.70	0.09
377	600094	大名城	13,502	50,902.54	0.09
378	000415	渤海租赁	21,021	50,870.82	0.09
379	002458	益生股份	5,072	50,567.84	0.09
380	600643	爱建集团	7,190	50,186.20	0.09
381	002399	海普瑞	3,137	49,972.41	0.09
382	600776	东方通信	4,023	49,885.20	0.09
383	600006	东风汽车	6,826	49,829.80	0.09

384	000028	国药一致	1,292	48,889.28	0.09
385	603225	新凤鸣	2,403	48,780.90	0.09
386	002434	万里扬	6,009	48,732.99	0.09
387	300257	开山股份	3,389	48,699.93	0.09
388	002505	鹏都农牧	21,722	48,657.28	0.09
389	600675	中华企业	15,518	48,571.34	0.09
390	300459	金科文化	15,006	48,469.38	0.09
391	601611	中国核建	6,698	48,359.56	0.09
392	600717	天津港	12,264	48,074.88	0.09
393	600546	山煤国际	6,689	48,027.02	0.09
394	600729	重庆百货	1,749	48,010.05	0.09
395	600985	淮北矿业	3,931	47,997.51	0.09
396	600633	浙数文化	6,645	47,711.10	0.09
397	002317	众生药业	5,518	47,509.98	0.09
398	000717	韶钢松山	10,238	46,992.42	0.08
399	600648	外高桥	3,139	46,394.42	0.08
400	000501	鄂武商A	3,945	46,156.50	0.08
401	600863	内蒙华电	19,732	45,975.56	0.08
402	601928	凤凰传媒	6,439	45,974.46	0.08
403	000681	视觉中国	3,553	45,940.29	0.08
404	300113	顺网科技	3,548	45,911.12	0.08
405	600869	远东股份	9,498	45,875.34	0.08
406	000078	海王生物	13,944	45,457.44	0.08
407	600073	上海梅林	5,550	45,454.50	0.08
408	002375	亚厦股份	5,717	45,278.64	0.08
409	000062	深圳华强	2,668	45,115.88	0.08
410	601828	美凯龙	3,754	45,048.00	0.08
411	600968	海油发展	17,283	44,762.97	0.08
412	300324	旋极信息	10,405	44,325.30	0.08
413	002424	贵州百灵	5,968	43,924.48	0.08
414	600835	上海机电	2,702	43,907.50	0.08
415	603355	莱克电气	683	42,503.09	0.08
416	000869	张裕A	1,131	42,005.34	0.08
417	600566	济川药业	2,337	41,832.30	0.08
418	600623	华谊集团	4,707	41,468.67	0.07
419	600131	国网信通	3,075	40,713.00	0.07
420	600312	平高电气	6,869	40,114.96	0.07
421	600787	中储股份	7,495	39,948.35	0.07
422	002583	海能达	7,904	39,836.16	0.07
423	000031	大悦城	11,020	39,672.00	0.07
424	600277	亿利洁能	11,700	39,429.00	0.07
425	002589	瑞康医药	8,889	39,378.27	0.07

426	600639	浦东金桥	2,877	39,271.05	0.07
427	002468	申通快递	5,135	39,128.70	0.07
428	000826	启迪环境	7,242	38,744.70	0.07
429	002544	杰赛科技	2,894	38,605.96	0.07
430	600823	世茂股份	9,544	38,557.76	0.07
431	601778	晶科科技	7,042	38,449.32	0.07
432	601969	海南矿业	3,301	38,390.63	0.07
433	603317	天味食品	1,302	38,317.86	0.07
434	600466	蓝光发展	12,895	38,040.25	0.07
435	002815	崇达技术	3,034	37,864.32	0.07
436	603888	新华网	1,759	37,238.03	0.07
437	600664	哈药股份	12,782	36,939.98	0.07
438	601298	青岛港	5,962	36,845.16	0.07
439	000008	神州高铁	16,591	36,832.02	0.07
440	000543	皖能电力	9,703	36,774.37	0.07
441	300134	大富科技	3,276	36,723.96	0.07
442	600517	国网英大	5,333	36,317.73	0.07
443	000156	华数传媒	4,675	36,044.25	0.06
444	600748	上实发展	7,776	35,769.60	0.06
445	603708	家家悦	2,036	35,365.32	0.06
446	002635	安洁科技	2,413	35,302.19	0.06
447	000937	冀中能源	8,905	34,996.65	0.06
448	000813	德展健康	7,694	34,930.76	0.06
449	000553	安道麦 A	3,726	34,540.02	0.06
450	002948	青岛银行	6,913	34,357.61	0.06
451	002302	西部建设	4,334	34,238.60	0.06
452	600764	中国海防	1,200	33,960.00	0.06
453	300010	豆神教育	5,948	33,725.16	0.06
454	688557	兰剑智能	997	33,549.05	0.06
455	603515	欧普照明	1,304	33,473.68	0.06
456	601228	广州港	10,460	33,262.80	0.06
457	600640	号百控股	2,693	32,827.67	0.06
458	600350	山东高速	5,309	32,650.35	0.06
459	600556	天下秀	3,085	32,577.60	0.06
460	601139	深圳燃气	4,880	32,012.80	0.06
461	000061	农产品	5,755	31,767.60	0.06
462	600871	石化油服	15,994	31,508.18	0.06
463	000600	建投能源	6,243	30,653.13	0.06
464	600545	卓郎智能	9,724	30,630.60	0.05
465	603786	科博达	405	30,577.50	0.05
466	000046	泛海控股	13,110	30,153.00	0.05
467	002901	大博医疗	407	29,666.23	0.05



468	603379	三美股份	1,556	29,112.76	0.05
469	002653	海思科	1,351	29,073.52	0.05
470	601528	瑞丰银行	1,863	29,006.91	0.05
471	603056	德邦股份	2,628	28,881.72	0.05
472	600575	淮河能源	13,228	28,704.76	0.05
473	002051	中工国际	4,221	26,887.77	0.05
474	002093	国脉科技	4,258	26,697.66	0.05
475	002419	天虹股份	4,046	26,541.76	0.05
476	601869	长飞光纤	1,063	25,894.68	0.05
477	601003	柳钢股份	4,382	25,853.80	0.05
478	603377	东方时尚	2,388	25,527.72	0.05
479	600657	信达地产	7,286	25,355.28	0.05
480	000537	广宇发展	4,815	25,182.45	0.05
481	603328	依顿电子	3,377	25,158.65	0.05
482	002503	搜于特	15,759	24,741.63	0.04
483	601801	皖新传媒	5,080	23,977.60	0.04
484	603983	丸美股份	445	23,188.95	0.04
485	002946	新乳业	1,499	22,709.85	0.04
486	605296	神农集团	455	21,476.00	0.04
487	600053	九鼎投资	1,106	19,366.06	0.03
488	000732	泰禾集团	8,474	18,303.84	0.03
489	603719	良品铺子	403	18,135.00	0.03
490	600903	贵州燃气	1,954	17,976.80	0.03
491	002957	科瑞技术	700	17,822.00	0.03
492	603868	飞科电器	420	17,665.20	0.03
493	002941	新疆交建	1,601	17,114.69	0.03
494	002818	富森美	1,327	16,003.62	0.03
495	001872	招商港口	900	15,228.00	0.03
496	603511	爱慕股份	454	14,982.00	0.03
497	600956	新天绿能	1,200	14,052.00	0.03
498	603256	宏和科技	1,520	13,892.80	0.02
499	002423	中粮资本	1,500	13,575.00	0.02
500	601512	中新集团	1,357	13,515.72	0.02
501	600917	重庆燃气	1,577	12,884.09	0.02
502	001207	联科科技	358	11,853.38	0.02
503	601068	中铝国际	2,646	9,128.70	0.02
504	001208	华菱线缆	947	7,320.31	0.01
505	605319	无锡振华	397	7,122.18	0.01
506	605189	富春染织	264	6,359.76	0.01
507	605287	德才股份	196	6,185.76	0.01
508	603171	税友股份	280	5,376.00	0.01
509	605259	绿田机械	123	4,384.95	0.01

510	605011	杭州热电	252	2,237.76	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	600089	特变电工	1,097,220.00	1.07
2	600219	南山铝业	723,485.00	0.71
3	603589	口子窖	675,286.00	0.66
4	603345	安井食品	634,849.00	0.62
5	688002	睿创微纳	628,490.68	0.61
6	601997	贵阳银行	556,384.00	0.54
7	600038	中直股份	500,555.00	0.49
8	600867	通化东宝	489,999.00	0.48
9	603737	三棵树	465,797.84	0.45
10	600516	方大炭素	456,284.00	0.44
11	688099	晶晨股份	439,229.23	0.43
12	600372	中航电子	425,661.00	0.41
13	002568	百润股份	408,895.00	0.40
14	603638	艾迪精密	378,367.00	0.37
15	600170	上海建工	370,700.00	0.36
16	300274	阳光电源	357,923.00	0.35
17	688088	虹软科技	353,940.00	0.35
18	601992	金隅集团	338,394.00	0.33
19	603290	斯达半导	320,427.00	0.31
20	002791	坚朗五金	319,201.00	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	601995	中金公司	1,051,473.10	1.02
2	600426	华鲁恒升	989,131.16	0.96
3	600143	金发科技	948,535.72	0.92
4	600089	特变电工	871,740.37	0.85
5	600739	辽宁成大	815,819.77	0.80
6	603882	金域医学	786,974.04	0.77
7	600298	安琪酵母	744,989.20	0.73
8	600132	重庆啤酒	741,614.78	0.72
9	600161	天坛生物	699,884.04	0.68
10	603517	绝味食品	698,533.28	0.68

11	601233	桐昆股份	640,312.75	0.62
12	603486	科沃斯	626,343.77	0.61
13	688002	睿创微纳	614,072.29	0.60
14	601799	星宇股份	607,547.22	0.59
15	600079	人福医药	603,110.78	0.59
16	601966	玲珑轮胎	583,304.56	0.57
17	300274	阳光电源	577,318.12	0.56
18	603806	福斯特	560,470.57	0.55
19	600521	华海药业	560,407.80	0.55
20	603939	益丰药房	549,442.60	0.54

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	38,763,840.03
卖出股票收入（成交）总额	87,345,734.90

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	2,703,450.00	4.85
	其中：政策性金融债	2,703,450.00	4.85
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）	1,083.10	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,704,533.10	4.85

### 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	108802	进出 1902	16,000	1,600,480.00	2.87
2	108604	国开 1805	11,000	1,102,970.00	1.98

3	111000	起帆转债	10	1,083.10	0.00
---	--------	------	----	----------	------

### 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。

#### 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	18,541.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	79,133.87
5	应收申购款	3,438.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,113.54

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
华富华鑫灵活配置混合 A	188	159,422.82	25,113,760.98	83.79	4,857,729.81	16.21
华富华鑫灵活配置混合 C	707	6,722.44	0.00	0	4,752,764.06	100
合计	895	38,798.05	25,113,760.98	72.32	9,610,493.87	27.68

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

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

### 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

注：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和部门负责人、本基金基金经理未持有本基金份额。

## § 9 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	63,455,741.11	5,016,579.96
本报告期基金总申购 份额	15,334,286.99	294,664.53
减：本报告期基金总 赎回份额	48,818,537.31	558,480.43
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	29,971,490.79	4,752,764.06

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. 2021 年 3 月 19 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，增聘姚姣女士为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
2. 2021 年 3 月 19 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国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
3. 2021 年 3 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，因工作安排，张亮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. 2021 年 3 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，因工作安排，张亮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。

5. 2021 年 5 月 7 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, 增聘李孝华先生为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。

6. 2021 年 6 月 28 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, 增聘李孝华先生为华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

7. 中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”) 根据工作需要, 任命刘彤女士担任工商银行资产托管部总经理, 全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任工商银行资产托管部总经理职务。

### 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	
华西证券	1	88,501,040.60	70.78%	82,421.24	71.23%	-
海通证券	1	22,664,278.68	18.13%	20,654.15	17.85%	-
申万宏源	1	13,007,535.79	10.40%	11,853.81	10.24%	-
安信证券	1	523,015.48	0.42%	476.63	0.41%	-
华安证券	2	337,440.29	0.27%	307.52	0.27%	-

东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
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中银证券、西南证券各 1 个交易单元，退租华信证券 1 个交易单元。

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	33,527.00	0.67%	-	-	-	-
海通证券	2,061,764.35	41.50%	350,000.00	77.78%	-	-
申万宏源	2,721,294.68	54.78%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	151,110.00	3.04%	100,000.00	22.22%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-



天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
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旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2021倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月4日
2	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行AI投服务基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月4日
3	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月4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国金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	2021年1月16日
5	华富基金管理有限公司旗下全部基金2020年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021年1月22日
6	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2021年1月22日
7	华富基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月26日
8	华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告	中国证监会指定媒介	2021年3月18日
9	华富基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2021年3月20日
10	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加国金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	2021年3月26日
11	华富基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会指定媒介	2021年3月30日
12	华富基金管理有限公司旗下全部基金2020年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021年3月31日
13	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金2020年度报告	中国证监会指定媒介	2021年3月31日
14	关于华富基金管理有限公司旗下部分	中国证监会指定媒介	2021年4月16日

	基金参加天风证券股份有限公司费率优惠活动的公告		
15	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加招商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	2021 年 4 月 17 日
16	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
17	华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
18	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通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	2021 年 6 月 30 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

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	2021.5.25-2021.6.30	0.00	14,983,061.89	0.00	14,983,061.89	43.15
	2	2021.1.1-2021.6.30	10,130,699.09	0.00	0.00	10,130,699.09	29.17
产品特有风险							
无							

### 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

## 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

2021 年 8 月 31 日