

# 华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 25 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 2018 年 8 月 24 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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的情况.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</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.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
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.....	56
<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>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
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	134,505,917.76 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	126,013,135.68 份	8,492,782.08 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) 66105799
注册地址	中国(上海)自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大街 55

	区陆家嘴环路 1000 号 31 层	号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层	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	章宏韬	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号 31 层

### § 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

基金级别	华富华鑫灵活配置混合 A	华富华鑫灵活配置混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,791,444.36	251,349.24
本期利润	-11,895,183.43	-755,203.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0913	-0.0802
本期加权平均净值利润率	-8.87%	-7.80%
本期基金份额净值增长率	-9.81%	-9.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-7,758,100.12	-551,457.40
期末可供分配基金份额利润	-0.0616	-0.0649
期末基金资产净值	118,255,035.56	7,941,324.68
期末基金份额净值	0.9380	0.9350
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-4.34%	-4.64%

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	-6.20%	1.27%	-3.65%	0.64%	-2.55%	0.63%



过去三个月	-7.77%	1.10%	-4.28%	0.57%	-3.49%	0.53%
过去六个月	-9.81%	1.09%	-5.15%	0.58%	-4.66%	0.51%
过去一年	-6.67%	0.79%	-0.34%	0.48%	-6.33%	0.31%
自基金合同生效起至今	-4.34%	0.63%	3.59%	0.42%	-7.93%	0.21%

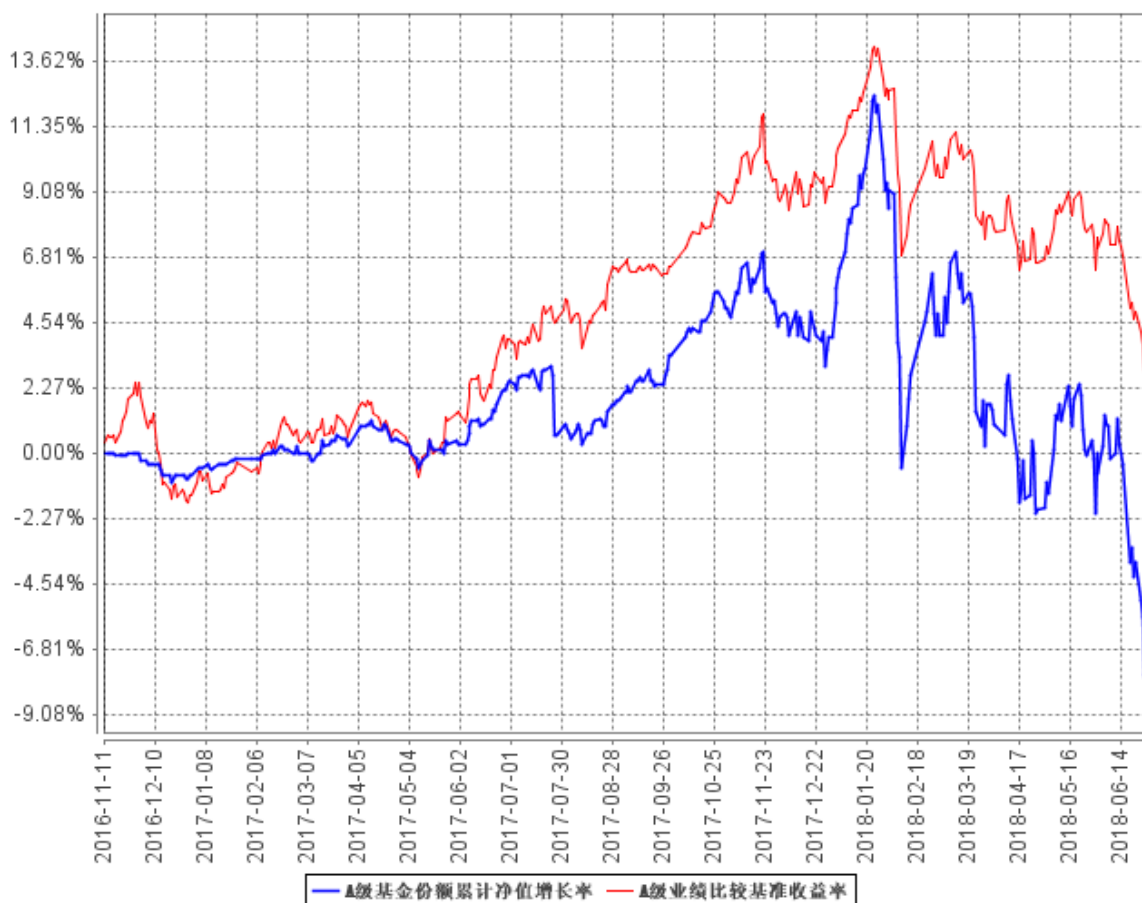
华富华鑫灵活配置混合 C

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
过去一个月	-6.12%	1.27%	-3.65%	0.64%	-2.47%	0.63%
过去三个月	-7.79%	1.10%	-4.28%	0.57%	-3.51%	0.53%
过去六个月	-9.84%	1.09%	-5.15%	0.58%	-4.69%	0.51%
过去一年	-6.87%	0.80%	-0.34%	0.48%	-6.53%	0.32%
自基金合同生效起至今	-4.64%	0.63%	3.59%	0.42%	-8.23%	0.21%

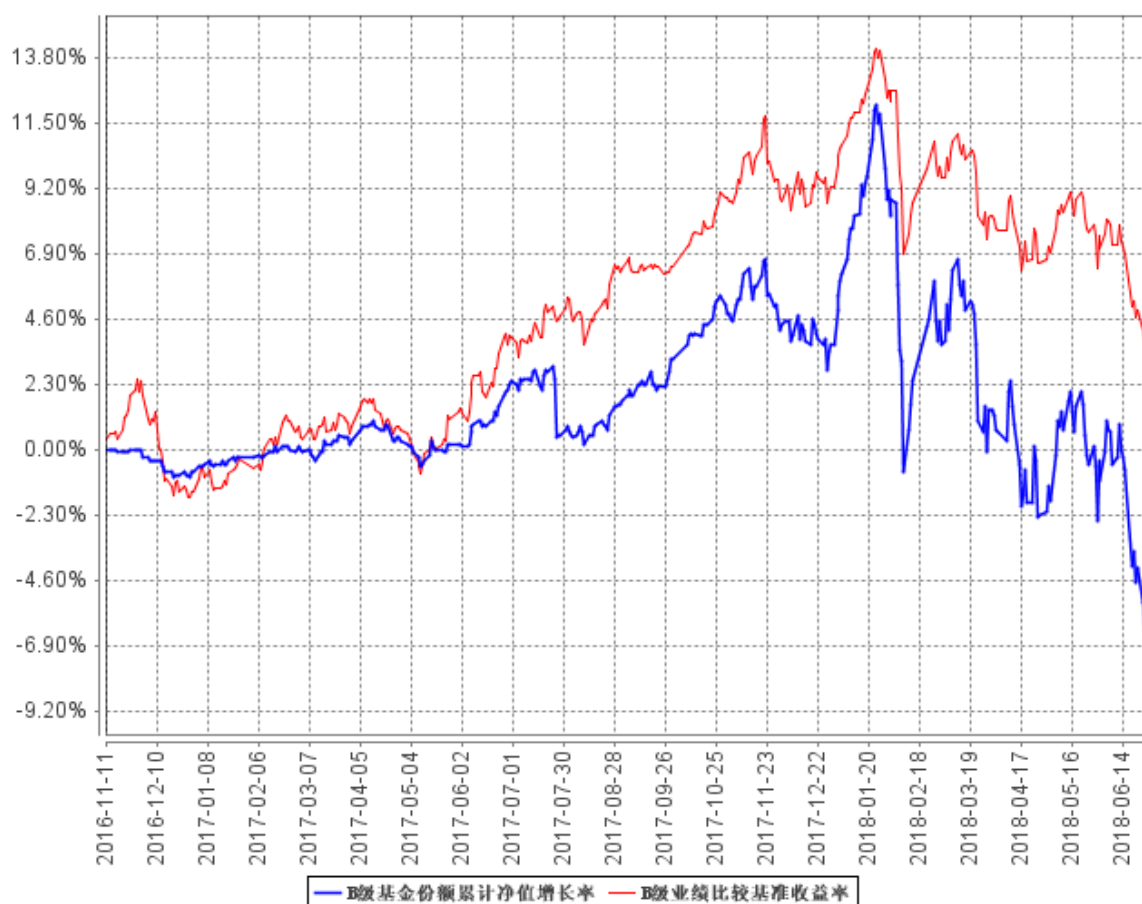
注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



**B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



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。本基金合同生效未满一年。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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富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、华富恒财分级债券型证券投资基金、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、华富安福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、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、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金、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、华富恒悦定期开放债券型证券投资基金共三十七只基金。

#### 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、华富诚鑫灵活配置混	2016 年 11 月 11 日	-	十二年	华东师范大学经济学学士，本科学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾

	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 货币市场基金基金经 理、华富安享债券型 基金基金经理、固定 收益部副总监、公司 公募投资决策委员会 委员			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。
--	--	--	--	--

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

从基本面来看, 2018 年上半年经济走势仍保持较强的韧性, 但近期社融、投资等数据开始走弱, 下行风险逐步显现。上半年对市场最大的影响因素是去杠杆和中美贸易摩擦, 在去杠杆背景下, 影子银行表外资产在回归表内过程中面临诸多限制, 造成资质较差的企业出现再融资困境, 信用利差迅速走阔, 社会融资需求和规模回落。中美贸易摩擦在上半年持续影响资本市场, 三次谈判从形成一定成果到最终冲突升级, 对市场风险偏好形成了巨大的扰动并在最后严重打击了市场信心。政策层面, 央行在上半年继续通过定向降准等手段对冲各种内外部冲击的负面影响, 货币政策基调确认转向, 资金面较为宽松。从资本市场表现来看, 随着社会融资需求逐步下滑、经济预期走弱、中美贸易摩擦加剧, 上半年债市整体表现领跑各大类资产, 但结构分化加剧, 利率债和高等级信用债收益率震荡下行, 而随着违约债券增加, 中低等级信用债表现持续疲弱。而上半年股市波动继续加大, 除医药、消费等少数板块成为避险集中地, 市场整体表现已步入熊市。本基金以债券、新股申购等低风险资产投资为主, 但权益底仓占比较高, 二季度净值继续受底仓波动影响波动较大, 产品净值出现较大回撤, 整体表现欠佳。

### 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 2018 年 6 月 30 日, 华富华鑫 A 类基金份额净值为 0.938 元, 累计份额净值为 0.938 元, 本报告期的份额累计净值增长率为-9.81%, 同期业绩比较基准收益率为-5.15%; 华富华鑫 C 基金份额净值为 0.935 元, 累计份额净值为 0.935 元, 本报告期的份额累计净值增长率为-9.84%, 同期业绩比较基准收益率为-5.15%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国目前显然处于内外交困阶段, 内部债务、杠杆问题仍然需要相当的时间和空间才可能得以解决, 外部来看中国将在很长时间面临美国相对强硬的立场, 而其背后并不仅仅是贸易摩擦问题, 而是全球地位和价值观取向之争。中国目前的困境和未来长期的发展无疑需要巨大的改革勇气和行动来解决。短期来看, 经济走弱预期强化, 中美贸易战确认开打, 虽仍有政策托底, 但趋势不变, 债券市场已验证之前偏右侧阶段的判断, 短期可以继续利用阶段调整拉长债券仓位久期。而权益市场仍然面临更为复杂而不利的环境, 虽然静态来看估值已经接近历史低位, 但中美贸易战、去杠杆带来的对金融体系的冲击和对经济基本面的负向反馈仍会持续影响市场, 也会增加盈利预期的不确定性。但抛开短期波动, 应该在情绪低点寻找有长期投资价值的资产。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-12,650,387.21元，期末可供分配利润为-8,309,557.52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 托管人对本半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 2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	513,368.33	499,326.53
结算备付金		12,427.47	1,392,122.06
存出保证金		6,335.38	19,387.17
交易性金融资产	6.4.7.2	125,878,223.49	158,157,446.73
其中：股票投资		119,152,763.49	123,995,746.73
基金投资		-	-
债券投资		6,725,460.00	34,161,700.00
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	-	10,120,135.18
应收证券清算款		-	267,163.17
应收利息	6.4.7.5	60,096.42	1,064,062.24
应收股利		-	-
应收申购款		-	295.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		126,470,451.09	171,519,938.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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		-	461,679.08
应付管理人报酬		65,259.11	112,108.17
应付托管费		16,314.75	28,027.06
应付销售服务费		1,365.47	2,456.85
应付交易费用	6.4.7.7	12,631.22	306,778.98

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	178,520.30	480,114.95
负债合计		274,090.85	1,391,165.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	134,505,917.76	163,687,693.16
未分配利润	6.4.7.10	-8,309,557.52	6,441,080.40
所有者权益合计		126,196,360.24	170,128,773.56
负债和所有者权益总计		126,470,451.09	171,519,938.65

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，华富华鑫灵活配置混合 A 基金份额净值 0.9380 元，基金份额总额 126,013,135.68 份；华富华鑫灵活配置混合 C 基金份额净值 0.9350 元，基金份额总额 8,492,782.08 份。华富华鑫灵活配置混合份额总额合计为 134,505,917.76 份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-11,881,059.30	18,221,613.51
1.利息收入		387,362.10	9,065,451.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,539.33	676,089.25
债券利息收入		339,193.31	8,381,214.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,629.46	8,147.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,421,421.93	2,619,911.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,687,508.11	2,049,574.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-417,700.02	-284,669.78
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,151,613.84	855,006.70
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	-16,693,180.81	6,431,952.54

“-”号填列)			
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	3,337.48	104,298.18
<b>减：二、费用</b>		769,327.91	3,430,590.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	426,992.58	1,406,007.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	106,748.13	351,501.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,599.23	93,059.19
4. 交易费用	6.4.7.19	26,376.18	327,369.72
5. 利息支出		-	1,027,502.51
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,027,502.51
6. 税金及附加		601.58	-
7. 其他费用	6.4.7.20	199,010.21	225,149.42
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-12,650,387.21	14,791,023.26
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-12,650,387.21	14,791,023.26

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：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	163,687,693.16	6,441,080.40	170,128,773.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,650,387.21	-12,650,387.21
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)	-29,181,775.40	-2,100,250.71	-31,282,026.11

其中：1.基金申购款	155,985.62	11,394.45	167,380.07
2.基金赎回款	-29,337,761.02	-2,111,645.16	-31,449,406.18
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）	134,505,917.76	-8,309,557.52	126,196,360.24
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	365,604,839.32	-2,805,052.19	362,799,787.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,791,023.26	14,791,023.26
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）	87,635,119.76	-688,081.52	86,947,038.24
其中：1.基金申购款	250,179,089.81	-356.20	250,178,733.61
2.基金赎回款	-162,543,970.05	-687,725.32	-163,231,695.37
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）	453,239,959.08	11,297,889.55	464,537,848.63

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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：

\_\_\_\_\_  
章宏韬

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
余海春

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
陈大毅

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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(三) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(四) 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。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。

### 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 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	513,368.33
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：	513,368.33

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	136,564,164.55	119,152,763.49	-17,411,401.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,716,750.00	6,725,460.00
	银行间市场	-	-
	合计	6,716,750.00	6,725,460.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	143,280,914.55	125,878,223.49	-17,402,691.06

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	415.70
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	5.60
应收债券利息	59,672.22
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	-
其他	2.90
合计	60,096.42

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	12,631.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,631.22

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
审计费	29,752.78
信息披露费	148,767.52
合计	178,520.30



### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,392,155.30	150,392,155.30
本期申购	127,489.90	127,489.90
本期赎回(以“-”号填列)	-24,506,509.52	-24,506,509.52
本期末	126,013,135.68	126,013,135.68

金额单位：人民币元

华富华鑫灵活配置混合 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,295,537.86	13,295,537.86
本期申购	28,495.72	28,495.72
本期赎回(以“-”号填列)	-4,831,251.50	-4,831,251.50
本期末	8,492,782.08	8,492,782.08

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	6,927,626.73	-977,905.37	5,949,721.36
本期利润	3,791,444.36	-15,686,627.79	-11,895,183.43
本期基金份额交易产生的变动数	-1,188,756.08	-623,881.97	-1,812,638.05
其中：基金申购款	6,527.52	2,262.65	8,790.17
基金赎回款	-1,195,283.60	-626,144.62	-1,821,428.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,530,315.01	-17,288,415.13	-7,758,100.12

单位：人民币元

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	578,081.77	-86,722.73	491,359.04
本期利润	251,349.24	-1,006,553.02	-755,203.78
本期基金份额交易产生的变动数	-219,343.60	-68,269.06	-287,612.66
其中：基金申购款	1,318.81	1,285.47	2,604.28
基金赎回款	-220,662.41	-69,554.53	-290,216.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	610,087.41	-1,161,544.81	-551,457.40

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	18,499.40
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	1,907.93
其他	132.00
合计	20,539.33

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	6,498,132.46
减：卖出股票成本总额	2,810,624.35
买卖股票差价收入	3,687,508.11

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	-417,700.02

券到期兑付) 差价收入	
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	-417,700.02

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	42,192,929.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	41,098,544.11
减：应收利息总额	1,512,085.48
买卖债券差价收入	-417,700.02

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,151,613.84
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,151,613.84

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-16,693,180.81
——股票投资	-17,129,065.54
——债券投资	435,884.73
——资产支持证券投资	-
——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	-16,693,180.81

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,337.48
合计	3,337.48

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	26,201.18
银行间市场交易费用	175.00
合计	26,376.18

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78

信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	1,889.91
自营托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	199,010.21

注：其他为上清所查询服务费。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

无

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司（华安证券）	基金管理人的股东、代销机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	1,496,760.13	7.71%	37,627,741.94	15.42%

### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	5,098,265.21	27.35%	3,600,318.30	5.86%

### 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华安证券	-	-	2,564,700,000.00	38.61%

### 6.4.10.1.4 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。

### 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 2018年1月1日至2018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	1,393.99	7.81%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	34,543.80	15.39%	-	-

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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	426,992.58	1,406,007.48
其中：支付销售机构的客户维护费	67,494.57	573,742.33

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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	106,748.13	351,501.93

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		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	-	-
工商银行银行股份有限公司	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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	-	-	-
工商银行银行股份有限公司	-	100.12	100.12
华安证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	100.12	100.12

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 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固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固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期和上年度可比期间内基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

#### 6.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	513,368.33	18,499.40	6,626,080.55	20,712.48

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

#### 6.4.10.6 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

#### 6.4.10.7 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（2018 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
002892	科力尔	2017 年 8 月 10 日	2018 年 8 月 17 日	公开发行有锁定期	17.56	29.90	11,000	193,160.00	328,900.00	-
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

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
002450	康得新	2018 年 6 月 4 日	重大事项停牌	17.08	-	-	30,000	684,842.98	512,400.00	-
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大事项	7.47	2018 年 8 月 20 日	7.25	64,300	549,765.00	480,321.00	-

			停牌							
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项停牌	23.28	2018年7月10日	24.00	15,400	579,542.00	358,512.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项停牌	15.03	-	-	21,400	436,018.00	321,642.00	-
601727	上海电气	2018年6月6日	重大事项停牌	6.34	2018年8月7日	5.71	30,300	201,798.00	192,102.00	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大事项停牌	32.50	-	-	5,800	194,719.00	188,500.00	-
000008	神州高铁	2018年6月6日	重大事项停牌	4.96	2018年8月7日	4.46	32,600	276,648.00	161,696.00	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项停牌	3.60	2018年7月3日	3.26	40,000	235,200.00	144,000.00	-
601118	海南橡胶	2018年5月24日	重大事项停牌	6.62	-	-	13,900	77,562.00	92,018.00	-

### 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。

## 6.4.13 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风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券、一年期以内的资产支持证券等债券基金可投资的短期信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。信用等级按期末评级结果列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

#### 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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	25,181,500.00
AAA 以下	0.00	0.00
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	25,181,500.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及

时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	513,368.33	-	-	-	-	-	513,368.33
结算备付金	12,427.47	-	-	-	-	-	12,427.47
存出保证金	6,335.38	-	-	-	-	-	6,335.38
交易性金融资产	-	-	6,725,460.00	-	-	119,152,763.49	125,878,223.49
应收利息	-	-	-	-	-	60,096.42	60,096.42
资产总计	532,131.18	-	6,725,460.00	-	-	119,212,859.91	126,470,451.09
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	65,259.11	65,259.11
应付托管费	-	-	-	-	-	16,314.75	16,314.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,365.47	1,365.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,631.22	12,631.22
其他负债	-	-	-	-	-	178,520.30	178,520.30
负债总计	-	-	-	-	-	274,090.85	274,090.85
利率敏感度缺口	532,131.18	-	6,725,460.00	-	-	118,938,769.06	126,196,360.24
上年度末 2017 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	499,326.53	-	-	-	-	-	499,326.53
结算备付金	1,392,122.06	-	-	-	-	-	1,392,122.06
存出保证金	19,387.17	-	-	-	-	-	19,387.17
交易性金融资产	-	10,086,000.00	19,025,200.00	5,050,500.00	-	123,995,746.73	158,157,446.73
买入返售金融资产	10,120,135.18	-	-	-	-	-	10,120,135.18
应收证券清算款	-	-	-	-	-	267,163.17	267,163.17
应收利息	-	-	-	-	-	1,064,062.24	1,064,062.24
应收申购款	-	-	-	-	-	295.57	295.57
资产总计	12,030,970.94	10,086,000.00	19,025,200.00	5,050,500.00	-	125,327,267.71	171,519,938.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	461,679.08	461,679.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	112,108.17	112,108.17
应付托管费	-	-	-	-	-	28,027.06	28,027.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,456.85	2,456.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	306,778.98	306,778.98
其他负债	-	-	-	-	-	480,114.95	480,114.95
负债总计	-	-	-	-	-	1,391,165.09	1,391,165.09
利率敏感度缺口	12,030,970.94	10,086,000.00	19,025,200.00	5,050,500.00	-	123,936,102.62	170,128,773.56

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场变量保持不变		
分析	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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降25基点	12,564.80	30,903.40
市场利率上升25基点	-12,511.07	-30,775.55	

#### 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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	119,152,763.49	94.42	123,995,746.73	72.88
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	6,725,460.00	5.33	34,161,700.00	20.08
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	125,878,223.49	99.75	158,157,446.73	92.96

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
分析	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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升百分之五	5,382,884.24	1,731,723.09
	沪深 300 指数下降百分之五	-5,382,884.24	-1,731,723.09

#### 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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	合计	26,265,757.56	19,795,109.58

#### 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	119,152,763.49	94.21
	其中：股票	119,152,763.49	94.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,725,460.00	5.32
	其中：债券	6,725,460.00	5.32
	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	525,795.80	0.42
8	其他各项资产	66,431.80	0.05
9	合计	126,470,451.09	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 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	403,238.00	0.32
B	采矿业	2,808,868.70	2.23
C	制造业	52,667,242.81	41.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,487,515.57	1.97
E	建筑业	3,525,875.25	2.79
F	批发和零售业	2,817,510.41	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	2,706,881.00	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,295,493.00	4.20
J	金融业	34,377,953.21	27.24



K	房地产业	8,566,106.00	6.79
L	租赁和商务服务业	1,135,931.00	0.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	825,957.54	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	482,736.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	967,505.00	0.77
S	综合	83,950.00	0.07
	合计	119,152,763.49	94.42

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	85,200	4,991,016.00	3.95
2	000333	美的集团	85,000	4,438,700.00	3.52
3	000651	格力电器	90,000	4,243,500.00	3.36
4	000002	万科A	159,700	3,928,620.00	3.11
5	600519	贵州茅台	3,900	2,852,694.00	2.26
6	000858	五粮液	37,000	2,812,000.00	2.23
7	002415	海康威视	75,000	2,784,750.00	2.21
8	600036	招商银行	87,500	2,313,500.00	1.83
9	000001	平安银行	247,353	2,248,438.77	1.78
10	601328	交通银行	323,800	1,858,612.00	1.47
11	601288	农业银行	529,267	1,820,678.48	1.44
12	601166	兴业银行	111,600	1,607,040.00	1.27
13	000725	京东方A	426,700	1,510,518.00	1.20
14	600016	民生银行	207,700	1,453,900.00	1.15
15	600887	伊利股份	50,100	1,397,790.00	1.11
16	600276	恒瑞医药	17,810	1,349,285.60	1.07
17	601818	光大银行	365,500	1,337,730.00	1.06
18	002304	洋河股份	10,100	1,329,160.00	1.05
19	000568	泸州老窖	20,000	1,217,200.00	0.96

20	601601	中国太保	38,139	1,214,727.15	0.96
21	600030	中信证券	71,100	1,178,127.00	0.93
22	002008	大族激光	22,000	1,170,180.00	0.93
23	600900	长江电力	70,648	1,140,258.72	0.90
24	002142	宁波银行	68,956	1,123,293.24	0.89
25	000338	潍柴动力	123,000	1,076,250.00	0.85
26	600104	上汽集团	30,200	1,056,698.00	0.84
27	000895	双汇发展	39,376	1,039,920.16	0.82
28	002236	大华股份	45,000	1,014,750.00	0.80
29	000963	华东医药	20,966	1,011,609.50	0.80
30	601668	中国建筑	183,400	1,001,364.00	0.79
31	001979	招商蛇口	52,200	994,410.00	0.79
32	002230	科大讯飞	30,750	986,152.50	0.78
33	000538	云南白药	9,000	962,640.00	0.76
34	600000	浦发银行	97,500	932,100.00	0.74
35	002024	苏宁易购	65,300	919,424.00	0.73
36	300059	东方财富	63,720	839,829.60	0.67
37	002456	欧菲科技	50,000	806,500.00	0.64
38	600048	保利地产	64,200	783,240.00	0.62
39	000776	广发证券	58,798	780,249.46	0.62
40	601169	北京银行	128,100	772,443.00	0.61
41	002202	金风科技	58,000	733,120.00	0.58
42	601988	中国银行	201,500	727,415.00	0.58
43	600837	海通证券	76,300	722,561.00	0.57
44	600009	上海机场	13,000	721,240.00	0.57
45	600028	中国石化	103,942	674,583.58	0.53
46	000063	中兴通讯	50,000	651,500.00	0.52
47	600019	宝钢股份	83,500	650,465.00	0.52
48	601766	中国中车	83,100	639,870.00	0.51
49	300124	汇川技术	18,900	620,298.00	0.49
50	600585	海螺水泥	18,300	612,684.00	0.49
51	002475	立讯精密	27,000	608,580.00	0.48
52	601211	国泰君安	40,700	599,918.00	0.48
53	601939	建设银行	90,000	589,500.00	0.47
54	000423	东阿阿胶	10,743	578,080.83	0.46
55	000069	华侨城A	75,000	542,250.00	0.43
56	000166	申万宏源	121,000	528,770.00	0.42
57	300024	机器人	30,000	522,000.00	0.41
58	300070	碧水源	37,300	519,589.00	0.41

59	002027	分众传媒	54,000	516,780.00	0.41
60	601888	中国国旅	8,000	515,280.00	0.41
61	002450	康得新	30,000	512,400.00	0.41
62	002594	比亚迪	10,500	500,640.00	0.40
63	600196	复星医药	12,000	496,680.00	0.39
64	601688	华泰证券	32,500	486,525.00	0.39
65	600703	三安光电	25,300	486,266.00	0.39
66	002044	美年健康	21,360	482,736.00	0.38
67	601390	中国中铁	64,300	480,321.00	0.38
68	000768	中航飞机	30,100	470,764.00	0.37
69	300144	宋城演艺	20,000	470,000.00	0.37
70	601009	南京银行	60,405	466,930.65	0.37
71	002241	歌尔股份	45,300	461,607.00	0.37
72	600518	康美药业	20,000	457,600.00	0.36
73	002736	国信证券	50,200	456,820.00	0.36
74	600690	青岛海尔	23,700	456,462.00	0.36
75	601336	新华保险	10,000	428,800.00	0.34
76	000100	TCL 集团	144,300	418,470.00	0.33
77	601006	大秦铁路	50,600	415,426.00	0.33
78	600015	华夏银行	55,300	411,985.00	0.33
79	600031	三一重工	45,600	409,032.00	0.32
80	600050	中国联通	82,400	405,408.00	0.32
81	002007	华兰生物	12,000	385,920.00	0.31
82	000783	长江证券	70,000	380,100.00	0.30
83	600271	航天信息	15,000	379,050.00	0.30
84	300072	三聚环保	15,400	358,512.00	0.28
85	600741	华域汽车	15,000	355,800.00	0.28
86	000625	长安汽车	39,400	354,600.00	0.28
87	000157	中联重科	85,500	351,405.00	0.28
88	601186	中国铁建	40,500	349,110.00	0.28
89	601088	中国神华	17,200	342,968.00	0.27
90	002065	东华软件	39,500	339,700.00	0.27
91	600795	国电电力	129,100	338,242.00	0.27
92	000623	吉林敖东	18,700	336,226.00	0.27
93	601857	中国石油	42,700	329,217.00	0.26
94	002892	科力尔	11,000	328,900.00	0.26
95	000425	徐工机械	76,300	323,512.00	0.26
96	002310	东方园林	21,400	321,642.00	0.25
97	601899	紫金矿业	87,500	315,875.00	0.25

98	300017	网宿科技	29,100	311,661.00	0.25
99	002714	牧原股份	7,000	311,220.00	0.25
100	601628	中国人寿	13,800	310,776.00	0.25
101	000728	国元证券	41,800	309,320.00	0.25
102	000792	盐湖股份	27,900	301,878.00	0.24
103	002081	金螳螂	29,800	300,980.00	0.24
104	600660	福耀玻璃	11,500	295,665.00	0.23
105	600406	国电南瑞	18,701	295,475.80	0.23
106	600999	招商证券	21,125	288,990.00	0.23
107	000402	金融街	35,000	281,750.00	0.22
108	002146	荣盛发展	32,200	281,106.00	0.22
109	002508	老板电器	9,000	275,580.00	0.22
110	002465	海格通信	33,900	272,217.00	0.22
111	600436	片仔癀	2,400	268,632.00	0.21
112	600340	华夏幸福	10,400	267,800.00	0.21
113	000503	国新健康	8,400	266,952.00	0.21
114	601607	上海医药	10,974	262,278.60	0.21
115	600066	宇通客车	13,600	260,984.00	0.21
116	601901	方正证券	38,800	259,572.00	0.21
117	000630	铜陵有色	117,000	258,570.00	0.20
118	600958	东方证券	28,200	257,466.00	0.20
119	600886	国投电力	35,300	256,631.00	0.20
120	000839	中信国安	54,200	256,366.00	0.20
121	002673	西部证券	33,700	254,435.00	0.20
122	000876	新希望	39,600	251,064.00	0.20
123	600352	浙江龙盛	20,600	246,170.00	0.20
124	000709	河钢股份	82,800	244,260.00	0.19
125	600029	南方航空	28,800	243,360.00	0.19
126	601225	陕西煤业	29,496	242,457.12	0.19
127	000060	中金岭南	49,500	240,570.00	0.19
128	002074	国轩高科	17,000	239,020.00	0.19
129	000938	紫光股份	3,800	237,880.00	0.19
130	002500	山西证券	34,800	234,552.00	0.19
131	601377	兴业证券	44,500	234,515.00	0.19
132	600089	特变电工	33,100	229,383.00	0.18
133	600111	北方稀土	20,100	228,738.00	0.18
134	601155	新城控股	7,300	226,081.00	0.18
135	000826	启迪桑德	12,880	225,142.40	0.18
136	601985	中国核电	39,800	224,870.00	0.18

137	600570	恒生电子	4,200	222,390.00	0.18
138	600383	金地集团	21,400	218,066.00	0.17
139	000750	国海证券	60,400	215,628.00	0.17
140	000983	西山煤电	28,400	213,284.00	0.17
141	601669	中国电建	39,500	211,720.00	0.17
142	600606	绿地控股	31,900	208,626.00	0.17
143	601933	永辉超市	26,600	203,224.00	0.16
144	600535	天士力	7,840	202,428.80	0.16
145	000627	天茂集团	28,700	201,474.00	0.16
146	600115	东方航空	30,000	198,600.00	0.16
147	601066	中信建投	18,316	197,080.16	0.16
148	601788	光大证券	17,900	196,542.00	0.16
149	300027	华谊兄弟	31,400	193,424.00	0.15
150	601727	上海电气	30,300	192,102.00	0.15
151	600010	宝钢股份	123,600	191,580.00	0.15
152	600547	山东黄金	8,000	191,360.00	0.15
153	000559	万向钱潮	28,100	191,080.00	0.15
154	002602	世纪华通	5,800	188,500.00	0.15
155	600068	葛洲坝	26,100	188,181.00	0.15
156	000686	东北证券	29,100	186,531.00	0.15
157	002352	顺丰控股	4,100	184,500.00	0.15
158	600705	中航资本	39,000	182,130.00	0.14
159	600588	用友网络	7,410	181,619.10	0.14
160	600637	东方明珠	11,900	179,214.00	0.14
161	600018	上港集团	29,900	178,204.00	0.14
162	000671	阳光城	29,800	177,906.00	0.14
163	600522	中天科技	20,100	177,081.00	0.14
164	601919	中远海控	35,000	172,200.00	0.14
165	600893	航发动力	7,700	171,864.00	0.14
166	002153	石基信息	5,900	171,100.00	0.14
167	300315	掌趣科技	40,700	170,126.00	0.13
168	600085	同仁堂	4,800	169,344.00	0.13
169	300251	光线传媒	16,500	167,970.00	0.13
170	300033	同花顺	4,300	167,141.00	0.13
171	601998	中信银行	26,600	165,186.00	0.13
172	603993	洛阳钼业	25,800	162,282.00	0.13
173	000008	神州高铁	32,600	161,696.00	0.13
174	601111	中国国航	18,100	160,909.00	0.13
175	600739	辽宁成大	10,600	160,908.00	0.13

176	600674	川投能源	18,400	160,448.00	0.13
177	600023	浙能电力	34,200	159,372.00	0.13
178	002385	大北农	38,200	157,766.00	0.13
179	601800	中国交建	13,700	156,043.00	0.12
180	601555	东吴证券	22,600	154,358.00	0.12
181	600362	江西铜业	9,500	150,575.00	0.12
182	601618	中国中冶	45,000	149,850.00	0.12
183	600177	雅戈尔	19,100	147,070.00	0.12
184	601018	宁波港	34,900	146,929.00	0.12
185	600100	同方股份	16,500	144,870.00	0.11
186	002426	胜利精密	40,000	144,000.00	0.11
187	601099	太平洋	60,600	141,804.00	0.11
188	600816	安信信托	19,320	139,876.80	0.11
189	600109	国金证券	19,500	138,645.00	0.11
190	600208	新湖中宝	35,400	135,228.00	0.11
191	000961	中南建设	21,300	134,403.00	0.11
192	000959	首钢股份	32,700	134,397.00	0.11
193	600804	鹏博士	11,000	132,000.00	0.10
194	601198	东兴证券	10,000	130,400.00	0.10
195	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.10
196	000738	航发控制	9,300	123,969.00	0.10
197	600498	烽火通信	4,800	119,280.00	0.09
198	600170	上海建工	39,200	119,168.00	0.09
199	601333	广深铁路	27,900	118,575.00	0.09
200	600297	广汇汽车	20,100	117,786.00	0.09
201	601229	上海银行	7,400	116,624.00	0.09
202	600153	建发股份	12,769	114,793.31	0.09
203	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.09
204	002558	巨人网络	4,600	109,388.00	0.09
205	601117	中国化学	16,000	107,680.00	0.09
206	002174	游族网络	5,400	107,460.00	0.09
207	600663	陆家嘴	6,800	107,372.00	0.09
208	600688	上海石化	18,500	105,265.00	0.08
209	600369	西南证券	27,100	104,335.00	0.08
210	600415	小商品城	24,100	103,871.00	0.08
211	600489	中金黄金	15,100	102,982.00	0.08
212	600820	隧道股份	17,375	102,686.25	0.08
213	600583	海油工程	19,200	100,992.00	0.08
214	601633	长城汽车	9,900	97,218.00	0.08

215	601992	金隅集团	29,600	97,088.00	0.08
216	002424	贵州百灵	8,400	95,424.00	0.08
217	601866	中远海发	37,500	93,375.00	0.07
218	601118	海南橡胶	13,900	92,018.00	0.07
219	600118	中国卫星	4,800	91,680.00	0.07
220	002292	奥飞娱乐	10,100	90,193.00	0.07
221	600008	首创股份	20,600	86,932.00	0.07
222	600895	张江高科	7,300	83,950.00	0.07
223	600549	厦门钨业	5,460	82,882.80	0.07
224	002555	三七互娱	6,800	82,620.00	0.07
225	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.06
226	601877	正泰电器	3,600	80,352.00	0.06
227	601997	贵阳银行	6,400	79,104.00	0.06
228	600704	物产中大	15,100	78,973.00	0.06
229	002841	视源股份	1,440	76,910.40	0.06
230	600038	中直股份	1,900	75,981.00	0.06
231	600919	江苏银行	11,500	73,715.00	0.06
232	601021	春秋航空	2,100	73,563.00	0.06
233	600959	江苏有线	13,900	70,890.00	0.06
234	600977	中国电影	4,400	70,576.00	0.06
235	600061	国投资本	7,500	69,600.00	0.06
236	600827	百联股份	6,500	66,300.00	0.05
237	600649	城投控股	10,800	66,096.00	0.05
238	600376	首开股份	9,400	66,082.00	0.05
239	600373	中文传媒	5,100	65,535.00	0.05
240	600372	中航电子	4,800	62,688.00	0.05
241	603587	地素时尚	1,408	58,164.48	0.05
242	601958	金钼股份	8,400	52,668.00	0.04
243	600482	中国动力	3,000	52,350.00	0.04
244	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.04
245	601881	中国银河	6,200	50,406.00	0.04
246	600021	上海电力	7,300	49,202.00	0.04
247	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.04
248	601718	际华集团	11,500	46,230.00	0.04
249	600188	兖州煤业	3,500	45,640.00	0.04
250	002797	第一创业	6,500	44,005.00	0.03
251	601608	中信重工	16,600	43,160.00	0.03
252	600926	杭州银行	3,500	38,815.00	0.03
253	600233	圆通速递	2,900	38,280.00	0.03

254	601375	中原证券	8,000	37,360.00	0.03
255	601611	中国核建	4,700	37,130.00	0.03
256	601966	玲珑轮胎	2,300	36,271.00	0.03
257	002831	裕同科技	700	35,000.00	0.03
258	600871	*ST 油服	18,000	34,560.00	0.03
259	603858	步长制药	800	34,232.00	0.03
260	603160	汇顶科技	500	32,445.00	0.03
261	601163	三角轮胎	2,400	32,064.00	0.03
262	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
263	002839	张家港行	3,700	22,533.00	0.02
264	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

## 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	000001	平安银行	882,166.00	0.52
2	601818	光大银行	863,891.00	0.51
3	601288	农业银行	725,800.00	0.43
4	000858	五粮液	646,583.00	0.38
5	000002	万科A	578,265.00	0.34
6	000895	双汇发展	570,425.00	0.34
7	000568	泸州老窖	523,760.00	0.31
8	601328	交通银行	499,970.00	0.29
9	601601	中国太保	459,660.00	0.27
10	002236	大华股份	409,238.00	0.24
11	002202	金风科技	393,029.00	0.23
12	002142	宁波银行	381,563.68	0.22
13	000333	美的集团	349,498.00	0.21
14	000963	华东医药	332,877.00	0.20
15	002008	大族激光	305,209.00	0.18
16	000651	格力电器	261,408.00	0.15
17	601939	建设银行	259,554.00	0.15
18	000338	潍柴动力	249,312.00	0.15
19	600009	上海机场	232,866.00	0.14



20	002415	海康威视	225,281.00	0.13
----	--------	------	------------	------

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	603259	药明康德	612,226.49	0.36
2	002450	康得新	418,048.00	0.25
3	002860	星帅尔	300,406.54	0.18
4	600901	江苏租赁	284,816.94	0.17
5	002926	华西证券	246,800.16	0.15
6	300750	宁德时代	221,216.44	0.13
7	002925	盈趣科技	219,438.80	0.13
8	002920	德赛西威	200,396.34	0.12
9	300454	深信服	180,838.84	0.11
10	603156	养元饮品	172,849.69	0.10
11	601838	成都银行	171,006.98	0.10
12	600518	康美药业	133,150.00	0.08
13	603486	科沃斯	129,235.15	0.08
14	300737	科顺股份	126,830.44	0.07
15	300741	华宝股份	126,105.00	0.07
16	603013	亚普股份	116,849.93	0.07
17	601828	美凯龙	116,620.58	0.07
18	603712	七一二	115,270.52	0.07
19	300634	彩讯股份	112,366.80	0.07
20	300735	光弘科技	111,834.37	0.07

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	15,096,706.65
卖出股票收入（成交）总额	6,498,132.46

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	6,725,460.00	5.33
	其中：政策性金融债	6,725,460.00	5.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,725,460.00	5.33

### 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	018005	国开 1701	67,000	6,725,460.00	5.33

### 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

注：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 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	6,335.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	60,096.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,431.80

#### 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	181	696,205.17	95,600,382.40	75.87%	30,412,753.28	24.13%
华 富 华 鑫 灵 活 配 置 混 合 C	62	136,980.36	0.00	0.00%	8,492,782.08	100.00%
合计	243	553,522.30	95,600,382.40	71.08%	38,905,535.36	28.92%

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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的情况

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

## § 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	150,392,155.30	13,295,537.86
本报告期基金总申购份额	127,489.90	28,495.72
减：本报告期基金总赎回份额	24,506,509.52	4,831,251.50
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	126,013,135.68	8,492,782.08

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、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，增聘张娅女士为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2、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，王翔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。

3、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，王翔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。

4、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，王翔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。

5、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，王翔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。

6、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，增聘郜哲先生为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、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，增聘郜哲先生为华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理。

8、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，增聘郜哲先生为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。

9、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，张惠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。

10、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	7,567,193.84	39.00%	6,895.96	38.64%	-
太平洋证券	2	6,462,745.61	33.31%	5,956.46	33.37%	-
西南证券	1	2,140,462.78	11.03%	1,993.43	11.17%	-
华安证券	2	1,496,760.13	7.71%	1,393.99	7.81%	-
招商证券	2	1,230,760.15	6.34%	1,146.24	6.42%	-
中泰证券	1	281,109.83	1.45%	256.19	1.44%	-
长江证券	1	126,830.44	0.65%	115.58	0.65%	-
浙商证券	1	98,163.36	0.51%	89.46	0.50%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

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) 本报告期本基金交易单元新增浙商证券一个交易单元，退租浙商证券一个交易单元。

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
东方证券	6,001,919.38	32.20%	-	-	-	-
太平洋证券	7,238,012.80	38.83%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	5,098,265.21	27.35%	-	-	-	-
招商证券	300,180.00	1.61%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

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	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 1 月 22 日
2	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 2 月 28 日
3	《关于华富基金管理有限公	在《中国证券报》、	2018 年 2 月 28 日



	司旗下部分开放式基金参与珠海盈米财富管理有限公司费率优惠活动的公告》	《上海证券报》、《证券时报》上公告	
4	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 3 月 12 日
5	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告及摘要》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 3 月 28 日
6	《关于华富基金管理有限公司根据流动性风险管理规定修订基金合同及托管协议并调整旗下部分基金赎回费率的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 3 月 28 日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东海证券基金费率优惠活动的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 3 月 30 日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 4 月 17 日
9	《华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告》	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 4 月 21 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	1.1-6.30	95,600,382.40	0.00	0.00	95,600,382.40	71.08%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
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报刊上披露的各项公告

### 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。