

华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
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	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53

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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 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	121,480,945.65 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	112,434,467.34 份	9,046,478.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略的基本思想是在充分控制风险的前提下实现高收益。依据风险-收益-投资策略关系原理，本基金采用包括资产配置策略、行业配置策略和个股精选策略在内的多层次复合投资策略进行实际投资，高层策略作用是规避风险，低层策略用于提高收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等收益风险特征的基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	manzh@hffund.com
客户服务电话	400-700-8001	95588
传真	021-68887997	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	赵万利	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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(2020 年 1 月 1 日-2020 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	18,268,548.59	1,516,012.19	
本期利润	19,422,709.35	1,697,827.32	
加权平均基金份额本期利润	0.1698	0.1714	
本期加权平均净值利润率	14.71%	14.95%	
本期基金份额净值增长率	15.69%	15.58%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利润	18,572,136.45	1,431,955.36
	期末可供分配基金份额利润	0.1652	0.1583
	期末基金资产净值	141,783,427.43	11,339,938.17

期末基金份额净值	1.261	1.254
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	28.60%	27.90%

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	8.24%	0.81%	3.72%	0.45%	4.52%	0.36%
过去三个月	16.54%	1.05%	6.67%	0.45%	9.87%	0.60%
过去六个月	15.69%	1.66%	2.64%	0.75%	13.05%	0.91%
过去一年	35.30%	1.35%	7.54%	0.60%	27.76%	0.75%
过去三年	25.47%	1.28%	15.33%	0.63%	10.14%	0.65%
自基金合同生效起至	28.60%	1.17%	19.88%	0.58%	8.72%	0.59%

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	8.29%	0.81%	3.72%	0.45%	4.57%	0.36%
过去三个月	16.54%	1.05%	6.67%	0.45%	9.87%	0.60%
过去六个月	15.58%	1.66%	2.64%	0.75%	12.94%	0.91%
过去一年	35.28%	1.35%	7.54%	0.60%	27.74%	0.75%
过去三年	24.90%	1.28%	15.33%	0.63%	9.57%	0.65%
自基金合同生效起至	27.90%	1.17%	19.88%	0.58%	8.02%	0.59%

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、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金共四十只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹培俊	华富华鑫灵活配置	2016 年 11 月 11 日	-	14 年	兰州大学工商管理硕士，研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年。新冠疫情先后在国内外爆发，整个宏观经济环境主线为公共卫生危机与疫情冲击后的复工复产。由于疫情在春节期间爆发升温，导致整个 2 月国内生产接近停滞，2 月制造业 PMI 和非制造业 PMI 分别 35.7 和 29.6，创了有记录以来新低，前 2 个月的工业增加值、社会消费品零售以及固定资产投资均负增长逾 20%。随着三月国内疫情控制较为有效且复工逐渐爬坡，生产恢复情况较好，3 月制造业和非制造业 PMI 均回到 50 以上，一季度实际 GDP 同比录得-6.8%，为有数据以来首次负增长。进入二季度，整个宏观经济呈现从疫情冲击中爬坡态势，4、5、6 月制造业 PMI 分别录得 50.8%、50.4% 以及 50.9%，基本完成疫情 v 型冲击的修复，二季度实际 GDP 同比录得+3.2%，回到正增长区间。生产端基本已经回到疫情之前的水平，4、5、6 月的工业增加值持续提速、固定资产投资也呈现单月正增长，发电耗煤量回到去年同期水平以上，需求端恢复相对较慢，但也结构上呈现积极的一面，房地产为代表的可选消费，日用消费品、消费电子产品等行业已经重回增长区间，而主要拖累总体消费增速的主要是旅游消费和餐饮消费，因此需求端也并不用太过悲观。外需方面，今年贸易顺差走阔、出口对于 GDP 正向拉动，主要原因在于“衰退式顺差”以及救灾物资。随着二季度末 PMI 数据显示出企业订单持续向好、库存有序去化、工业品原材料价格回升等积极迹象，经济逐渐进入弱复苏阶段。货币信用环境方面，在信贷扩张、债券融资宽松和地方政府专项债下的共振作用下，社会融资余额增速持续高增，上半年新增社融融资规模逾 20 万亿，同时央行上半年累计下调公开市场操作利率 30BP，整体货币政策维持宽松。下半年预计政策面呈现“宽财政、稳货币”的导向。海外方面，上半年疫情的加剧成为海外经济主线，二季度中后期各国陆续复工复产，但美国等地区仍有疫情反复迹象。此外，疫情对于经济造成压力的同时，民粹主义迹象也进一步显露，各国贸易摩擦也一直未平息。下半年美国临近大选，中美两国摩擦博弈预计难以平复。

从国内资本市场的表现来看，上半年债券市场随着疫情变化大幅波动，收益率水平先下后上，而国内 A 股市场在大幅波动之后逐渐走出疫情冲击的影响震荡上行，但市场结构分化严重，食品饮料、医药、科技等行业板块表现突出，金融周期等行业表现低迷，转债市场也出现结构分化，消费科技类等转债跟随正股大幅上涨，周期类转债和低价转债遭到抛售。本基金以债券、新股申

购等低风险资产投资为主，以中小盘为主的权益底仓今年以来表现相对占优，上半年产品净值表现相对市场较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 11 月 11 日正式成立。截止到 2020 年 6 月 30 日，华富华鑫 A 类基金份额净值为 1.2610 元，累计份额净值为 1.2810 元，本报告期的份额累计净值增长率为 15.69%，同期业绩比较基准收益率为 2.64%；华富华鑫 C 基金份额净值为 1.2540 元，累计份额净值为 1.2740 元，本报告期的份额累计净值增长率为 15.58%，同期业绩比较基准收益率为 2.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去的半年我们见证了诸多历史性时刻，新冠疫情造成的超预期冲击以及次生影响，仍然会在未来较长一段时间内对全球的经济活动和人们的行为方式产生影响。目前来看，国内疫情已经得到了有效控制，日韩、欧洲等发达国家和地区的疫情防控也较为出色，虽然疫情在全球范围内仍然未得到有效遏制，但全球复工稳步推进，全球经济已经走出底部。从国内的情况来看，货币政策最宽松的时候可能已经过去，财政政策持续发力，下半年融资和经济活动仍有望持续改善，市场核心关注点已经从疫情转向基本面。从资产配置角度，短期来看国内外基本面逐步复苏共振，无风险利率相对低位，债券资产赔率不足且胜率下降，风险资产赔率较高而胜率在提升，现阶段股票市场相比债券市场仍具有相对明显的性价比。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 21,120,536.67 元,期末可供分配利润为 20,004,091.81 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 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,031,548.38	1,528,869.96
结算备付金		-	40,078.98
存出保证金		3,776.93	54,439.60
交易性金融资产	6.4.7.2	152,574,116.34	141,479,830.00

其中：股票投资		144,920,385.34	134,112,750.00
基金投资		-	-
债券投资		7,653,731.00	7,367,080.00
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		-	33,019.97
应收利息	6.4.7.5	33,815.67	195,573.64
应收股利		-	-
应收申购款		3,440.49	599.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		153,646,697.81	143,332,412.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		59,844.15	356,893.60
应付管理人报酬		72,777.44	70,648.77
应付托管费		18,194.37	17,662.19
应付销售服务费		1,795.64	2,174.96
应付交易费用	6.4.7.7	157,102.51	38,999.49
应交税费		11.02	5.30
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	213,607.08	179,026.17
负债合计		523,332.21	665,410.48
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	121,480,945.65	130,952,242.11
未分配利润	6.4.7.10	31,642,419.95	11,714,759.41
所有者权益合计		153,123,365.60	142,667,001.52
负债和所有者权益总计		153,646,697.81	143,332,412.00

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，华富华鑫灵活配置混合 A 基金份额净值 1.261 元，基金份额总额 112,434,467.34 份；华富华鑫灵活配置混合 C 基金份额净值 1.254 元，基金份额总额 9,046,478.31 份。华富华鑫灵活配置混合份额总额合计为 121,480,945.65 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		22,067,893.35	21,292,811.91
1. 利息收入		106,670.14	97,236.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,068.02	4,553.44
债券利息收入		102,602.12	92,683.21
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）		20,620,202.91	2,301,586.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,548,489.21	1,387,862.77
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	46,902.99	1,778.92
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	1,024,810.71	911,945.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,335,975.89	18,892,985.65
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	5,044.41	1,002.67
减：二、费用		947,356.68	566,983.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	428,101.88	325,529.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	107,025.44	81,382.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,374.75	7,123.97
4. 交易费用	6.4.7.19	296,356.04	31,027.02
5. 利息支出		29.22	-
其中：卖出回购金融资产支出		29.22	-
6. 税金及附加		0.62	-
7. 其他费用	6.4.7.20	104,468.73	121,920.74

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		21,120,536.67	20,725,828.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,120,536.67	20,725,828.71

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	131,618,444.36	-30,640,522.94	100,977,921.42

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,725,828.71	20,725,828.71
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）	-15,603,435.59	1,990,100.43	-13,613,335.16
其中：1. 基金申购款	644,981.34	-7,361.93	637,619.41
2. 基金赎回款	-16,248,416.93	1,997,462.36	-14,250,954.57
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）	116,015,008.77	-7,924,593.80	108,090,414.97

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 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

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

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

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

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

主要税种及税率列示如下:

税 种 计 税 依 据 税 率

增值税 金融服务销售额 3%

城市维护建设税 应缴流转税税额 7%

教育费附加 应缴流转税税额 3%

地方教育附加[注] 应缴流转税税额 1%、2%

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,031,548.38
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	1,031,548.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	132,386,949.31	144,920,385.34	12,533,436.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,673,576.70	7,653,731.00
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	7,673,576.70	7,653,731.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	140,060,526.01	152,574,116.34	12,513,590.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	286.42
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	-
应收债券利息	33,527.55
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	1.70
合计	33,815.67

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	157,102.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	157,102.51

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	71.72
应付证券出借违约金	-
上清账户维护费	4,500.00
应付审计费	24,863.02
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	179,672.34
合计	213,607.08

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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,898,866.76	118,898,866.76
本期申购	419,298.12	419,298.12
本期赎回（以“-”号填列）	-6,883,697.54	-6,883,697.54
-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	112,434,467.34	112,434,467.34

华富华鑫灵活配置混合 C

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,053,375.35	12,053,375.35
本期申购	666,383.43	666,383.43
本期赎回（以“-”号填列）	-3,673,280.47	-3,673,280.47
-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	9,046,478.31	9,046,478.31

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	482,299.58	10,213,757.77	10,696,057.35
本期利润	18,268,548.59	1,154,160.76	19,422,709.35
本期基金份额交易产生的变	-178,711.72	-591,094.89	-769,806.61

动数			
其中：基金申购款	12,209.84	50,303.24	62,513.08
基金赎回款	-190,921.56	-641,398.13	-832,319.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,572,136.45	10,776,823.64	29,348,960.09
华富华鑫灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,627.35	1,028,329.41	1,018,702.06
本期利润	1,516,012.19	181,815.13	1,697,827.32
本期基金份额交易产生的变动数	-74,429.48	-348,640.04	-423,069.52
其中：基金申购款	11,224.55	81,078.38	92,302.93
基金赎回款	-85,654.03	-429,718.42	-515,372.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,431,955.36	861,504.50	2,293,459.86

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	3,849.17
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	59.67
其他	159.18
合计	4,068.02

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	19,548,489.21
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	19,548,489.21

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	98,201,117.61
减：卖出股票成本总额	78,652,628.40
买卖股票差价收入	19,548,489.21

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	46,902.99
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	46,902.99

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,830,726.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,481,291.55
减：应收利息总额	302,532.06
买卖债券差价收入	46,902.99

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
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,024,810.71
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,024,810.71

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	1,335,975.89
股票投资	1,363,181.25
债券投资	-27,205.36
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	1,335,975.89

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	5,044.41
-	-
合计	5,044.41

注：本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	296,356.04
银行间市场交易费用	-
	-
合计	296,356.04

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,333.37
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	104,468.73

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
华安证券	10,453,827.74	5.73	487,693.00	3.11

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华安证券	794,096.39	7.77	100,250.00	0.69

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华安证券	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 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
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华安证券	454.21	3.15	-	-

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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	428,101.88	325,529.24
其中：支付销售机构的客户维护费	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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	107,025.44	81,382.23

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富华鑫灵活配置混合	华富华鑫灵活配置混合	合计
	A	C	
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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富华鑫灵活配置混合 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	0.00
工商银行银行股份有限公司	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

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

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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

基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	华富华鑫灵活配置混合 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）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	0.00	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,031,548.38	3,849.17	1,077,757.89	4,025.75

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(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股流通受限	5.00	6.54	15,361	76,805.00	100,460.94	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	3,459	56,796.78	56,796.78	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128114	正邦转债	2020年6月17日	2020年7月15日	新债未上市	100.00	100.00	229	22,900.00	22,900.00	-

6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
601880	大连港	2020年6月22日	重大事项	1.72	2020年07月08日	2.28	144,601	278,911.38	248,713.72	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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：本基金本报告期末及上年度末未持有信用债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	52,155.60	225,900.00
-	-	-
未评级	0.00	0.00
合计	52,155.60	225,900.00

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、可转债、公募可交换债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,031,548.38	-	-	-	-	-	1,031,548.38
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	3,776.93	-	-	-	-	-	3,776.93
交易性金融资产	-	7,601,575.40	52,155.60	-	-	144,920,385.34	152,574,116.34
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	33,815.67	33,815.67
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	3,440.49	3,440.49
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,035,325.31	7,601,575.40	52,155.60	-	-	144,957,641.50	153,646,697.81
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	59,844.15	59,844.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,777.44	72,777.44
应付托管费	-	-	-	-	-	18,194.37	18,194.37
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,795.64	1,795.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	157,102.51	157,102.51
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	11.02	11.02
其他负债	-	-	-	-	-	213,607.08	213,607.08
负债总计	-	-	-	-	-	523,332.21	523,332.21
利率敏感度缺口	1,035,325.31	7,601,575.40	52,155.60	-	-	144,434,309.29	153,123,365.60

上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,528,869.96	-	-	-	-	-	1,528,869.96
结算备付金	40,078.98	-	-	-	-	-	40,078.98
存出保证金	54,439.60	-	-	-	-	-	54,439.60
交易性金融资产	-	-	7,367,080.00	-	-	134,112,750.00	141,479,830.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	195,573.64	195,573.64
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	599.85	599.85
应收证券清算款	-	-	-	-	-	33,019.97	33,019.97
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,623,388.54	-	7,367,080.00	-	-	134,341,943.46	143,332,412.00
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	356,893.60	356,893.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,648.77	70,648.77
应付托管费	-	-	-	-	-	17,662.19	17,662.19
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,174.96	2,174.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	38,999.49	38,999.49
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	5.30	5.30
其他负债	-	-	-	-	-	179,026.17	179,026.17
负债总计	-	-	-	-	-	665,410.48	665,410.48
利率敏感度缺口	1,623,388.54	-	7,367,080.00	-	-	133,676,532.98	142,667,001.52

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率下降 25 基点	5,360.96	8,108.85
	市场利率上升 25 基点	-5,354.26	-8,098.72

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	144,920,385.34	94.64	134,112,750.00	94.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,653,731.00	5.00	7,367,080.00	5.16
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	152,574,116.34	99.64	141,479,830.00	99.17

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升百分之五	6,298,652.09	6,320,985.92
	沪深 300 指数下降百分之五	-6,298,652.09	-6,320,985.92

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间（95%）		
	2. 观察期（1 年）		
	-		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计		42,868,058.40

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	144,920,385.34	94.32
	其中：股票	144,920,385.34	94.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,653,731.00	4.98
	其中：债券	7,653,731.00	4.98
	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	1,031,548.38	0.67
-	-	-	-
8	其他各项资产	41,033.09	0.03
9	合计	153,646,697.81	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	1,301,196.97	0.85
B	采矿业	3,255,041.07	2.13
C	制造业	84,738,475.03	55.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,350,168.37	2.19
E	建筑业	1,877,930.60	1.23
F	批发和零售业	8,165,833.55	5.33
G	交通运输、仓储和邮政业	3,185,859.72	2.08
H	住宿和餐饮业	497,882.33	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,041,091.91	10.48
J	金融业	7,069,300.36	4.62
K	房地产业	5,159,232.79	3.37
L	租赁和商务服务业	2,924,488.02	1.91
M	科学研究和技术服务业	1,231,843.75	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	1,380,263.84	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	146,986.56	0.10
Q	卫生和社会工作	1,061,659.30	0.69
R	文化、体育和娱乐业	2,283,196.57	1.49
S	综合	1,249,934.60	0.82
	合计	144,920,385.34	94.64

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	300253	卫宁健康	49,435	1,134,038.90	0.74
2	002127	南极电商	49,719	1,052,551.23	0.69
3	002821	凯莱英	4,031	979,533.00	0.64
4	600201	生物股份	34,000	946,560.00	0.62
5	600739	辽宁成大	46,424	878,806.32	0.57
6	002185	华天科技	63,500	859,155.00	0.56
7	600529	山东药玻	14,400	835,200.00	0.55
8	300558	贝达药业	5,800	811,884.00	0.53
9	002439	启明星辰	18,921	796,006.47	0.52
10	300088	长信科技	70,618	790,921.60	0.52
11	600079	人福医药	28,607	778,682.54	0.51
12	002385	大北农	85,000	774,350.00	0.51
13	300012	华测检测	38,500	760,760.00	0.50
14	002131	利欧股份	195,565	754,880.90	0.49
15	300285	国瓷材料	22,300	747,273.00	0.49
16	600521	华海药业	21,957	745,001.01	0.49
17	600298	安琪酵母	14,927	738,587.96	0.48
18	600143	金发科技	54,387	716,276.79	0.47
19	600161	天坛生物	15,779	715,262.07	0.47
20	603444	吉比特	1,302	714,811.02	0.47
21	002465	海格通信	53,441	691,526.54	0.45
22	601099	太平洋	205,800	652,386.00	0.43
23	603517	绝味食品	9,187	649,888.38	0.42
24	002075	沙钢股份	51,074	638,425.00	0.42
25	300496	中科创达	8,200	637,140.00	0.42
26	000009	中国宝安	74,654	635,305.54	0.41
27	002223	鱼跃医疗	17,367	632,158.80	0.41
28	300482	万孚生物	6,000	624,000.00	0.41
29	002212	南洋股份	23,434	622,875.72	0.41
30	601128	常熟银行	82,744	621,407.44	0.41
31	600426	华鲁恒升	35,009	618,959.12	0.40
32	603882	金城医学	6,900	617,550.00	0.40
33	300595	欧普康视	8,800	610,192.00	0.40
34	000636	风华高科	20,711	604,554.09	0.39
35	002273	水晶光电	35,271	604,544.94	0.39
36	300207	欣旺达	31,826	601,511.40	0.39
37	300418	昆仑万维	23,787	593,723.52	0.39
38	300315	掌趣科技	79,819	585,073.27	0.38
39	603939	益丰药房	6,406	582,946.00	0.38
40	002507	涪陵榨菜	16,159	581,885.59	0.38
41	000988	华工科技	23,329	569,927.47	0.37

42	300357	我武生物	9,100	566,475.00	0.37
43	002340	格林美	110,847	550,909.59	0.36
44	002603	以岭药业	17,473	544,982.87	0.36
45	600885	宏发股份	13,490	541,218.80	0.35
46	000975	银泰黄金	34,426	539,799.68	0.35
47	002414	高德红外	18,434	539,747.52	0.35
48	600859	王府井	11,717	533,709.35	0.35
49	600699	均胜电子	22,411	533,605.91	0.35
50	600132	重庆啤酒	7,305	533,265.00	0.35
51	300168	万达信息	24,069	531,202.83	0.35
52	300271	华宇软件	18,800	530,348.00	0.35
53	601799	星宇股份	4,168	529,336.00	0.35
54	300212	易华录	9,400	526,400.00	0.34
55	002373	千方科技	21,582	517,752.18	0.34
56	000513	丽珠集团	10,762	516,683.62	0.34
57	002353	杰瑞股份	16,637	515,747.00	0.34
58	000547	航天发展	37,145	507,772.15	0.33
59	002156	通富微电	20,000	501,000.00	0.33
60	603858	步长制药	17,232	497,143.20	0.32
61	300009	安科生物	27,661	495,131.90	0.32
62	002019	亿帆医药	21,528	494,498.16	0.32
63	300024	机器人	36,100	493,487.00	0.32
64	002797	第一创业	71,004	491,347.68	0.32
65	600801	华新水泥	20,557	487,406.47	0.32
66	600315	上海家化	10,132	485,322.80	0.32
67	002030	达安基因	17,775	484,902.00	0.32
68	603233	大参林	5,944	482,771.68	0.32
69	000750	国海证券	110,354	478,936.36	0.31
70	300017	网宿科技	56,400	478,836.00	0.31
71	600380	健康元	29,388	477,261.12	0.31
72	002557	洽洽食品	8,800	476,872.00	0.31
73	600895	XD 张江高	23,377	476,189.49	0.31
74	002174	游族网络	17,996	469,335.68	0.31
75	600037	歌华有线	30,705	466,716.00	0.30
76	002138	顺络电子	18,700	466,565.00	0.30
77	000021	深科技	21,355	466,179.65	0.30
78	002250	联化科技	21,379	466,062.20	0.30
79	002195	二三四五	165,711	465,647.91	0.30
80	600486	扬农化工	5,613	463,072.50	0.30
81	300316	晶盛机电	18,622	460,708.28	0.30
82	600845	宝信软件	7,772	459,169.76	0.30
83	600667	太极实业	38,629	456,594.78	0.30

84	002152	广电运通	35,259	456,251.46	0.30
85	000050	深天马A	29,700	456,192.00	0.30
86	600410	华胜天成	33,170	451,112.00	0.29
87	300058	蓝色光标	57,729	450,286.20	0.29
88	300070	碧水源	55,000	446,600.00	0.29
89	002572	索菲亚	18,465	446,299.05	0.29
90	000998	隆平高科	26,717	444,838.05	0.29
91	600535	天士力	27,400	444,428.00	0.29
92	603338	浙江鼎力	5,863	444,239.51	0.29
93	300244	迪安诊断	12,581	444,109.30	0.29
94	600155	华创阳安	36,761	440,764.39	0.29
95	000401	冀东水泥	27,360	438,854.40	0.29
96	600642	申能股份	74,145	438,196.95	0.29
97	002500	山西证券	66,563	435,322.02	0.28
98	002078	太阳纸业	44,990	428,304.80	0.28
99	601233	桐昆股份	33,473	427,115.48	0.28
100	300274	阳光电源	29,490	424,361.10	0.28
101	600126	杭钢股份	40,782	424,132.80	0.28
102	000623	吉林敖东	26,954	423,986.42	0.28
103	600879	航天电子	65,674	422,940.56	0.28
104	002511	中顺洁柔	18,900	421,470.00	0.28
105	603707	健友股份	6,507	420,156.99	0.27
106	002382	蓝帆医疗	13,947	419,944.17	0.27
107	002396	星网锐捷	11,800	416,894.00	0.27
108	600153	建发股份	51,356	415,983.60	0.27
109	000630	铜陵有色	214,400	413,792.00	0.27
110	002690	美亚光电	7,846	412,699.60	0.27
111	002013	中航机电	52,200	412,380.00	0.27
112	600884	杉杉股份	34,711	409,242.69	0.27
113	603659	璞泰来	3,942	406,104.84	0.27
114	002926	华西证券	37,995	403,886.85	0.26
115	600167	联美控股	28,044	402,150.96	0.26
116	600415	小商品城	82,200	400,314.00	0.26
117	000739	普洛药业	17,100	398,259.00	0.26
118	600811	东方集团	89,712	396,527.04	0.26
119	600216	浙江医药	20,396	392,826.96	0.26
120	300010	立思辰	20,065	392,672.05	0.26
121	600804	鹏博士	43,243	388,322.14	0.25
122	002281	光迅科技	11,729	385,414.94	0.25
123	600728	XD 佳都科	42,292	385,280.12	0.25
124	001914	招商积余	12,300	377,979.00	0.25
125	600511	国药股份	9,258	376,522.86	0.25

126	300251	光线传媒	34,000	370,940.00	0.24
127	600779	水井坊	5,900	368,278.00	0.24
128	002268	卫士通	17,032	363,462.88	0.24
129	300001	特锐德	17,320	362,680.80	0.24
130	600325	华发股份	51,134	361,006.04	0.24
131	300115	长盈精密	15,774	360,435.90	0.24
132	002028	思源电气	17,575	359,584.50	0.23
133	002294	信立泰	12,100	358,886.00	0.23
134	601689	拓普集团	12,740	355,446.00	0.23
135	600528	中铁工业	40,240	354,916.80	0.23
136	600418	江淮汽车	40,010	353,288.30	0.23
137	600446	金证股份	18,183	352,750.20	0.23
138	603883	老百姓	3,526	352,741.04	0.23
139	300002	神州泰岳	56,819	351,709.61	0.23
140	600827	百联股份	24,219	349,964.55	0.23
141	000581	威孚高科	16,912	349,740.16	0.23
142	600460	士兰微	23,766	348,884.88	0.23
143	600598	北大荒	21,467	345,618.70	0.23
144	000686	东北证券	40,670	343,661.50	0.22
145	002074	国轩高科	12,706	341,029.04	0.22
146	000997	新大陆	21,333	340,901.34	0.22
147	600959	江苏有线	90,581	340,584.56	0.22
148	002387	维信诺	23,789	339,706.92	0.22
149	600733	北汽蓝谷	52,736	339,092.48	0.22
150	601168	西部矿业	57,553	333,807.40	0.22
151	002242	九阳股份	8,932	332,895.64	0.22
152	600256	广汇能源	123,056	332,251.20	0.22
153	603000	人民网	16,690	330,962.70	0.22
154	603806	福斯特	6,626	330,703.66	0.22
155	000999	华润三九	11,293	329,642.67	0.22
156	600497	驰宏锌锗	95,420	328,244.80	0.21
157	603605	珀莱雅	1,823	328,176.46	0.21
158	600260	凯乐科技	24,169	326,764.88	0.21
159	002317	众生药业	18,872	323,843.52	0.21
160	600820	隧道股份	56,951	321,773.15	0.21
161	600704	物产中大	76,412	321,694.52	0.21
162	600839	四川长虹	111,489	319,973.43	0.21
163	600673	东阳光	45,494	314,363.54	0.21
164	002368	太极股份	7,181	313,737.89	0.20
165	000878	云南铜业	29,491	312,899.51	0.20
166	000564	供销大集	69,624	312,611.76	0.20
167	300296	利亚德	51,500	312,605.00	0.20

168	600572	康恩贝	56,367	310,018.50	0.20
169	600008	首创股份	102,984	309,981.84	0.20
170	002670	国盛金控	33,661	307,998.15	0.20
171	300113	顺网科技	12,095	307,213.00	0.20
172	002081	金螳螂	38,900	305,754.00	0.20
173	600549	厦门钨业	25,679	304,039.36	0.20
174	300166	东方国信	24,480	303,796.80	0.20
175	603866	桃李面包	5,967	303,660.63	0.20
176	300630	普利制药	4,100	303,195.00	0.20
177	601179	中国西电	62,504	302,519.36	0.20
178	002124	天邦股份	23,500	301,975.00	0.20
179	600718	东软集团	26,254	301,921.00	0.20
180	002080	中材科技	19,400	300,700.00	0.20
181	600875	东方电气	33,556	296,970.60	0.19
182	600171	上海贝岭	17,006	295,564.28	0.19
183	688268	华特气体	3,181	294,401.55	0.19
184	002221	东华能源	33,461	294,122.19	0.19
185	601966	玲珑轮胎	14,491	292,718.20	0.19
186	600021	上海电力	39,505	292,337.00	0.19
187	300618	寒锐钴业	4,700	291,494.00	0.19
188	002920	德赛西威	4,752	291,440.16	0.19
189	300026	红日药业	52,185	288,061.20	0.19
190	600060	海信视像	23,701	287,967.15	0.19
191	000800	一汽解放	26,700	286,758.00	0.19
192	600567	山鹰纸业	97,115	286,489.25	0.19
193	600094	大名城	48,110	286,254.50	0.19
194	600881	亚泰集团	98,082	285,418.62	0.19
195	600862	中航高科	16,822	284,628.24	0.19
196	002217	合力泰	54,153	284,303.25	0.19
197	600160	巨化股份	40,752	280,781.28	0.18
198	000729	燕京啤酒	40,850	279,822.50	0.18
199	600645	中源协和	9,889	279,364.25	0.18
200	002831	裕同科技	10,139	278,923.89	0.18
201	000877	天山股份	18,213	275,016.30	0.18
202	600597	光明乳业	18,483	274,657.38	0.18
203	603228	景旺电子	7,714	271,455.66	0.18
204	002399	海普瑞	10,814	270,782.56	0.18
205	600026	中远海能	41,863	270,434.98	0.18
206	000060	中金岭南	72,361	269,182.92	0.18
207	600754	锦江酒店	9,684	268,731.00	0.18
208	603712	七一二	6,992	268,352.96	0.18
209	002056	横店东磁	23,808	267,840.00	0.17

210	002709	天赐材料	7,908	267,211.32	0.17
211	603568	伟明环保	11,503	266,869.60	0.17
212	600967	内蒙一机	25,504	264,986.56	0.17
213	600580	卧龙电驱	23,570	264,926.80	0.17
214	600273	嘉化能源	30,277	264,620.98	0.17
215	601005	重庆钢铁	177,100	263,879.00	0.17
216	600392	盛和资源	37,091	261,491.55	0.17
217	000090	天健集团	37,822	261,350.02	0.17
218	002458	益生股份	17,000	259,590.00	0.17
219	600282	南钢股份	80,334	259,478.82	0.17
220	002429	兆驰股份	52,400	259,380.00	0.17
221	600755	厦门国贸	39,097	258,040.20	0.17
222	300133	华策影视	35,552	257,752.00	0.17
223	002004	华邦健康	47,857	257,470.66	0.17
224	600039	四川路桥	67,117	256,386.94	0.17
225	600064	南京高科	26,119	253,876.68	0.17
226	600563	法拉电子	4,076	251,896.80	0.16
227	600737	中粮糖业	32,285	251,177.30	0.16
228	601118	海南橡胶	51,677	251,150.22	0.16
229	600373	中文传媒	21,315	251,090.70	0.16
230	002648	卫星石化	15,400	250,558.00	0.16
231	600566	济川药业	9,841	250,551.86	0.16
232	600166	福田汽车	138,950	250,110.00	0.16
233	000629	攀钢钒钛	124,400	250,044.00	0.16
234	601975	招商南油	104,439	249,609.21	0.16
235	600195	中牧股份	15,345	249,049.35	0.16
236	002233	塔牌集团	20,698	248,996.94	0.16
237	601880	大连港	144,601	248,713.72	0.16
238	000960	锡业股份	28,993	248,180.08	0.16
239	002203	海亮股份	28,300	247,625.00	0.16
240	002807	江阴银行	62,871	247,083.03	0.16
241	002085	万丰奥威	37,989	246,168.72	0.16
242	600466	蓝光发展	45,528	245,395.92	0.16
243	600515	海航基础	47,187	245,372.40	0.16
244	603816	顾家家居	5,449	245,259.49	0.16
245	601098	中南传媒	22,910	242,387.80	0.16
246	000970	中科三环	24,696	241,526.88	0.16
247	600643	爱建集团	30,336	241,171.20	0.16
248	000598	兴蓉环境	51,897	238,726.20	0.16
249	600435	北方导航	31,473	237,935.88	0.16
250	300182	捷成股份	59,608	237,835.92	0.16
251	000690	宝新能源	50,377	237,779.44	0.16

252	000778	新兴铸管	69,285	237,647.55	0.16
253	300324	旋极信息	35,522	236,576.52	0.15
254	002110	三钢闽光	35,501	236,436.66	0.15
255	300474	景嘉微	3,500	235,550.00	0.15
256	601860	紫金银行	55,260	233,749.80	0.15
257	601106	中国一重	82,813	232,704.53	0.15
258	000400	许继电气	17,624	232,636.80	0.15
259	600808	马钢股份	90,081	232,408.98	0.15
260	002925	盈趣科技	4,000	231,760.00	0.15
261	600120	浙江东方	33,630	231,038.10	0.15
262	600633	浙数文化	23,582	230,631.96	0.15
263	002506	协鑫集成	88,307	230,481.27	0.15
264	002183	怡亚通	42,982	230,383.52	0.15
265	601333	广深铁路	102,382	230,359.50	0.15
266	600729	重庆百货	7,364	229,904.08	0.15
267	000402	金融街	34,600	229,744.00	0.15
268	002635	安洁科技	9,205	229,204.50	0.15
269	600258	XD 首旅酒	14,909	229,151.33	0.15
270	002745	木林森	14,811	228,237.51	0.15
271	600056	中国医药	16,128	228,211.20	0.15
272	600376	首开股份	38,938	228,176.68	0.15
273	002038	双鹭药业	17,807	228,107.67	0.15
274	000089	深圳机场	29,680	227,348.80	0.15
275	600388	XD 龙净环	25,819	227,207.20	0.15
276	000967	盈峰环境	27,500	226,875.00	0.15
277	600649	城投控股	38,183	226,807.02	0.15
278	000738	航发控制	16,607	226,685.55	0.15
279	002191	劲嘉股份	25,426	226,545.66	0.15
280	000681	视觉中国	12,156	226,344.72	0.15
281	002595	豪迈科技	11,600	225,736.00	0.15
282	002092	中泰化学	49,699	225,136.47	0.15
283	600675	中华企业	55,211	224,708.77	0.15
284	002048	宁波华翔	14,552	224,682.88	0.15
285	000039	中集集团	30,831	222,908.13	0.15
286	000830	鲁西化工	29,681	221,420.26	0.14
287	000930	中粮科技	32,392	221,237.36	0.14
288	601866	中远海发	119,733	220,308.72	0.14
289	601718	际华集团	66,290	220,082.80	0.14
290	000825	太钢不锈	66,000	219,120.00	0.14
291	600776	东方通信	14,468	218,322.12	0.14
292	000563	陕国投 A	57,855	214,642.05	0.14
293	000415	渤海租赁	71,600	213,368.00	0.14

294	600022	山东钢铁	165,234	213,151.86	0.14
295	002372	伟星新材	18,213	211,817.19	0.14
296	300180	华峰超纤	24,700	211,432.00	0.14
297	603077	和邦生物	159,965	211,153.80	0.14
298	002839	张家港行	36,636	211,023.36	0.14
299	600500	中化国际	41,679	210,895.74	0.14
300	002407	多氟多	19,792	210,586.88	0.14
301	000501	鄂武商 A	13,316	208,794.88	0.14
302	600062	XD 华润双	15,747	208,175.34	0.14
303	002815	崇达技术	10,283	208,025.09	0.14
304	601615	明阳智能	16,661	207,429.45	0.14
305	600266	城建发展	40,874	207,231.18	0.14
306	603486	科沃斯	6,816	205,911.36	0.13
307	600316	洪都航空	12,990	205,242.00	0.13
308	002010	传化智联	37,700	205,088.00	0.13
309	002640	跨境通	31,529	204,623.21	0.13
310	002064	华峰氨纶	40,241	204,021.87	0.13
311	000012	南玻 A	40,488	203,249.76	0.13
312	002583	海能达	26,583	201,764.97	0.13
313	000078	海王生物	48,041	201,291.79	0.13
314	601699	潞安环能	36,123	201,205.11	0.13
315	000932	华菱钢铁	53,252	200,760.04	0.13
316	601000	唐山港	89,450	199,473.50	0.13
317	000883	湖北能源	56,477	198,799.04	0.13
318	002375	亚厦股份	19,368	197,940.96	0.13
319	000959	首钢股份	45,904	197,387.20	0.13
320	000685	中山公用	25,625	197,312.50	0.13
321	000807	云铝股份	45,239	197,242.04	0.13
322	600782	新钢股份	48,133	196,382.64	0.13
323	000028	国药一致	4,330	194,893.30	0.13
324	000301	东方盛虹	35,027	194,750.12	0.13
325	688555	泽达易盛	2,489	194,142.00	0.13
326	000528	柳工	30,595	193,054.45	0.13
327	002936	郑州银行	56,100	192,984.00	0.13
328	000559	万向钱潮	39,825	192,753.00	0.13
329	002244	滨江集团	45,004	192,167.08	0.13
330	000027	深圳能源	41,339	191,812.96	0.13
331	600908	无锡银行	39,058	191,774.78	0.13
332	688222	成都先导	3,534	191,719.50	0.13
333	600640	号百控股	9,609	191,699.55	0.13
334	002155	湖南黄金	24,324	191,673.12	0.13
335	000488	晨鸣纸业	38,671	191,034.74	0.12

336	000519	中兵红箭	20,191	190,199.22	0.12
337	000031	大悦城	37,267	189,689.03	0.12
338	600073	上海梅林	19,817	188,063.33	0.12
339	600777	新潮能源	123,181	187,235.12	0.12
340	000987	越秀金控	15,958	186,070.28	0.12
341	601717	郑煤机	31,471	185,364.19	0.12
342	002444	巨星科技	15,541	184,627.08	0.12
343	002440	闰土股份	19,995	182,754.30	0.12
344	600312	XD 平高电	24,579	182,376.18	0.12
345	002625	光启技术	25,000	181,250.00	0.12
346	002266	浙富控股	46,691	180,694.17	0.12
347	601958	金钼股份	29,223	180,598.14	0.12
348	000156	华数传媒	16,615	179,940.45	0.12
349	601608	中信重工	52,402	179,214.84	0.12
350	600291	西水股份	19,799	179,180.95	0.12
351	002390	信邦制药	38,637	176,184.72	0.12
352	600557	康缘药业	12,599	175,378.08	0.11
353	300072	三聚环保	40,800	174,624.00	0.11
354	600409	三友化工	37,393	174,251.38	0.11
355	002701	奥瑞金	41,416	173,533.04	0.11
356	600765	中航重机	16,911	172,830.42	0.11
357	601228	广州港	56,816	172,720.64	0.11
358	600863	内蒙华电	70,142	172,549.32	0.11
359	600138	中青旅	17,482	172,547.34	0.11
360	000983	西山煤电	45,620	171,075.00	0.11
361	600751	海航科技	54,378	170,203.14	0.11
362	000898	鞍钢股份	69,400	170,030.00	0.11
363	000046	泛海控股	45,100	170,027.00	0.11
364	002424	贵州百灵	20,441	169,660.30	0.11
365	600507	方大特钢	32,562	168,996.78	0.11
366	002434	万里扬	19,368	168,114.24	0.11
367	000758	中色股份	39,957	167,020.26	0.11
368	600158	中体产业	20,377	166,683.86	0.11
369	600970	中材国际	31,510	166,372.80	0.11
370	000887	中鼎股份	21,173	166,208.05	0.11
371	002505	大康农业	73,779	166,002.75	0.11
372	000008	神州高铁	56,386	165,774.84	0.11
373	601200	上海环境	13,788	165,456.00	0.11
374	002563	森马服饰	23,400	164,970.00	0.11
375	600835	上海机电	9,739	164,881.27	0.11
376	600478	科力远	34,938	164,557.98	0.11
377	600639	浦东金桥	10,267	164,066.66	0.11

378	600259	广晟有色	5,467	164,010.00	0.11
379	002589	瑞康医药	30,529	163,635.44	0.11
380	600717	天津港	37,010	163,584.20	0.11
381	000712	锦龙股份	13,000	162,500.00	0.11
382	600545	卓郎智能	34,333	162,395.09	0.11
383	002002	鸿达兴业	44,964	162,320.04	0.11
384	603885	吉祥航空	17,807	162,043.70	0.11
385	000813	德展健康	25,910	160,642.00	0.10
386	600648	外高桥	11,288	159,612.32	0.10
387	603198	迎驾贡酒	7,245	157,723.65	0.10
388	600125	铁龙物流	28,147	157,060.26	0.10
389	601928	凤凰传媒	23,049	156,733.20	0.10
390	300134	大富科技	11,068	154,730.64	0.10
391	601598	中国外运	47,602	153,754.46	0.10
392	000826	启迪环境	20,696	153,564.32	0.10
393	600348	阳泉煤业	36,303	153,198.66	0.10
394	600823	世茂股份	33,974	151,863.78	0.10
395	002503	搜于特	53,722	150,958.82	0.10
396	600329	中新药业	8,646	149,748.72	0.10
397	002249	大洋电机	41,112	148,414.32	0.10
398	601611	中国核建	24,005	148,350.90	0.10
399	600901	江苏租赁	28,298	147,432.58	0.10
400	603377	东方时尚	8,876	146,986.56	0.10
401	000061	农产品	19,793	146,666.13	0.10
402	000732	泰禾集团	28,801	146,597.09	0.10
403	600582	天地科技	49,976	146,429.68	0.10
404	600307	酒钢宏兴	94,543	145,596.22	0.10
405	002665	首航高科	58,842	143,574.48	0.09
406	002901	大博医疗	1,200	143,148.00	0.09
407	600748	上实发展	27,843	142,277.73	0.09
408	002302	西部建设	14,616	140,313.60	0.09
409	603888	新华网	6,268	140,152.48	0.09
410	300376	易事特	26,914	139,952.80	0.09
411	600664	哈药股份	45,411	139,865.88	0.09
412	002867	周大生	6,300	139,671.00	0.09
413	600141	XD 兴发集	15,568	139,333.60	0.09
414	600017	日照港	55,711	138,720.39	0.09
415	601678	滨化股份	32,637	138,380.88	0.09
416	000990	诚志股份	10,842	137,584.98	0.09
417	000869	张裕 A	3,986	136,121.90	0.09
418	000718	苏宁环球	43,887	135,610.83	0.09
419	600277	亿利洁能	41,343	134,778.18	0.09

420	600869	智慧能源	33,500	134,000.00	0.09
421	000717	韶钢松山	35,044	133,167.20	0.09
422	002419	天虹股份	13,917	132,907.35	0.09
423	002544	杰赛科技	10,062	132,315.30	0.09
424	000543	皖能电力	32,817	131,924.34	0.09
425	000062	深圳华强	9,043	131,485.22	0.09
426	000848	承德露露	18,680	130,760.00	0.09
427	300257	开山股份	9,916	129,602.12	0.08
428	002093	国脉科技	14,596	129,174.60	0.08
429	002128	露天煤业	16,665	129,153.75	0.08
430	002416	爱施德	17,959	128,945.62	0.08
431	002408	齐翔腾达	20,513	127,385.73	0.08
432	603328	依顿电子	12,057	125,754.51	0.08
433	002653	海思科	4,700	125,067.00	0.08
434	603515	欧普照明	4,565	124,944.05	0.08
435	603650	彤程新材	5,307	123,493.89	0.08
436	600565	迪马股份	44,124	123,105.96	0.08
437	002948	青岛银行	23,900	121,651.00	0.08
438	300197	铁汉生态	47,598	120,898.92	0.08
439	603766	隆鑫通用	30,997	119,958.39	0.08
440	000553	安道麦 A	13,200	119,064.00	0.08
441	688357	建龙微纳	2,332	118,582.20	0.08
442	601019	山东出版	18,901	118,131.25	0.08
443	000537	广宇发展	16,180	118,114.00	0.08
444	603056	德邦股份	8,695	117,643.35	0.08
445	600053	九鼎投资	3,926	117,151.84	0.08
446	600787	中储股份	26,564	116,615.96	0.08
447	601139	深圳燃气	17,849	116,018.50	0.08
448	600350	山东高速	18,882	115,935.48	0.08
449	603983	丸美股份	1,332	114,591.96	0.07
450	601869	长飞光纤	3,680	113,380.80	0.07
451	600770	综艺股份	23,548	113,030.40	0.07
452	002491	通鼎互联	21,866	111,953.92	0.07
453	603317	天味食品	1,989	110,548.62	0.07
454	600338	西藏珠峰	11,040	110,400.00	0.07
455	600657	信达地产	26,465	109,035.80	0.07
456	601016	节能风电	51,354	108,870.48	0.07
457	002470	*ST 金正	47,607	108,067.89	0.07
458	600694	大商股份	4,434	106,371.66	0.07
459	000600	建投能源	20,718	105,454.62	0.07
460	002051	中工国际	14,355	104,504.40	0.07
461	600985	淮北矿业	13,117	102,181.43	0.07

462	601801	皖新传媒	18,016	100,168.96	0.07
463	603786	科博达	1,329	100,140.15	0.07
464	600428	中远海特	32,403	99,801.24	0.07
465	600707	彩虹股份	21,666	98,796.96	0.06
466	002118	紫鑫药业	22,251	98,794.44	0.06
467	002285	世联行	35,351	98,629.29	0.06
468	300459	金科文化	28,476	98,242.20	0.06
469	600575	淮河能源	46,929	98,081.61	0.06
470	600006	XD 东风汽	24,151	97,328.53	0.06
471	601865	福莱特	4,981	93,642.80	0.06
472	600757	长江传媒	18,320	93,248.80	0.06
473	000937	冀中能源	30,738	92,828.76	0.06
474	600996	XD 贵广网	12,700	90,551.00	0.06
475	600874	创业环保	13,129	87,176.56	0.06
476	600623	华谊集团	16,866	87,028.56	0.06
477	603556	海兴电力	5,922	85,513.68	0.06
478	002941	新疆交建	5,600	79,240.00	0.05
479	600058	五矿发展	12,944	78,181.76	0.05
480	603868	飞科电器	1,447	71,380.51	0.05
481	000785	居然之家	8,800	69,696.00	0.05
482	601003	柳钢股份	15,474	68,549.82	0.04
483	600903	贵州燃气	6,872	67,620.48	0.04
484	002946	新乳业	3,700	64,195.00	0.04
485	601127	小康股份	7,652	63,588.12	0.04
486	000025	特力A	3,394	62,212.02	0.04
487	600335	国机汽车	13,195	60,960.90	0.04
488	603355	莱克电气	2,421	60,258.69	0.04
489	601512	中新集团	5,100	58,650.00	0.04
490	601969	海南矿业	11,802	57,593.76	0.04
491	688377	迪威尔	3,459	56,796.78	0.04
492	603379	三美股份	2,580	55,392.60	0.04
493	002818	富森美	4,332	53,283.60	0.03
494	603225	新凤鸣	5,070	50,598.60	0.03
495	601811	新华文轩	4,781	48,622.77	0.03
496	002423	中粮资本	5,300	46,110.00	0.03
497	001872	招商港口	3,000	43,650.00	0.03
498	600917	重庆燃气	5,699	40,690.86	0.03
499	603025	大豪科技	5,592	40,653.84	0.03
500	603087	甘李药业	387	38,816.10	0.03
501	601068	XD 中铝国	9,273	36,257.43	0.02
502	603256	宏和科技	2,933	33,553.52	0.02
503	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.02

504	002957	科瑞技术	1,200	28,680.00	0.02
505	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.02
506	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.02
507	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
508	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
509	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
510	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
511	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
512	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
513	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
514	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600521	华海药业	1,151,942.00	0.81
2	002185	华天科技	859,728.00	0.60
3	601799	星宇股份	771,027.00	0.54
4	300558	贝达药业	733,881.00	0.51
5	603858	步长制药	728,038.00	0.51
6	600153	建发股份	727,469.23	0.51
7	300012	华测检测	724,396.00	0.51
8	300285	国瓷材料	704,249.00	0.49
9	600667	太极实业	702,769.00	0.49
10	600529	山东药玻	700,407.00	0.49
11	603338	浙江鼎力	688,789.60	0.48
12	600132	重庆啤酒	680,898.00	0.48
13	601233	桐昆股份	657,070.00	0.46
14	601099	太平洋	654,430.00	0.46
15	600535	天士力	635,364.00	0.45
16	603707	健友股份	625,112.00	0.44
17	600728	佳都科技	607,185.00	0.43
18	300482	万孚生物	571,218.00	0.40
19	603882	金域医学	570,724.00	0.40
20	300595	欧普康视	567,260.00	0.40

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	600745	闻泰科技	1,478,558.01	1.04
2	600183	生益科技	1,162,571.04	0.81
3	600872	中炬高新	1,085,429.01	0.76
4	600521	华海药业	1,033,425.84	0.72
5	600584	长电科技	1,024,068.80	0.72
6	603501	韦尔股份	1,016,841.54	0.71
7	002129	中环股份	991,855.02	0.70
8	600763	通策医疗	989,586.26	0.69
9	002463	沪电股份	911,974.45	0.64
10	000860	顺鑫农业	879,582.14	0.62
11	002384	东山精密	859,430.58	0.60
12	002371	北方华创	853,764.16	0.60
13	002049	紫光国微	848,609.54	0.59
14	600536	中国软件	798,392.80	0.56
15	300450	先导智能	786,742.04	0.55
16	002405	四维图新	776,378.25	0.54
17	300383	光环新网	727,260.95	0.51
18	000066	中国长城	717,479.26	0.50
19	002916	深南电路	713,709.50	0.50
20	688020	方邦股份	690,298.10	0.48

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	88,097,082.49
卖出股票收入（成交）总额	98,201,117.61

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	7,601,575.40	4.96
	其中：政策性金融债	7,601,575.40	4.96
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）	52,155.60	0.03
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,653,731.00	5.00

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	108607	开贴 2001	71,570	7,101,175.40	4.64
2	018061	进出 1911	5,000	500,400.00	0.33
3	113583	益丰转债	220	29,255.60	0.02
4	128114	正邦转债	229	22,900.00	0.01

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.11.3 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	3,776.93

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,815.67
5	应收申购款	3,440.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	41,033.09

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	260	432,440.26	105,731,081.49	94.04	6,703,385.85	5.96
华富华鑫灵	58	155,973.76	4,153,681.18	45.91	4,892,797.13	54.09

活配置混合 C						
合计	318	382,015.55	109,884,762.67	90.45	11,596,182.98	9.55

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华富华鑫灵活配置混合 A	10,669.48	0.0095
	华富华鑫灵活配置混合 C	0.00	0.0000
	合计	10,669.48	0.0088

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

§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	118,898,866.76	12,053,375.35
本报告期基金总申购份额	419,298.12	666,383.43
减：本报告期基金总赎回份额	6,883,697.54	3,673,280.47
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以-	-	-

“-” 填列)		
本报告期末基金份额总额	112,434,467.34	9,046,478.31

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

- 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020 年 2 月 27 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020 年 4 月 21 日，华富基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过，因工作需要，聘任邵恒先生担任公司副总经理职务。
- 2020 年 5 月 11 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，倪莉莎女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。
- 2020 年 5 月 11 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陶祺先生为华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
- 2020 年 5 月 11 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陶祺先生为华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理。
- 2020 年 5 月 11 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陶祺先生为华富货币市场基金基金经理。

12. 2020 年 5 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘陶祺先生为华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
13. 2020 年 6 月 28 日, 华富基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过, 因工作需要, 章宏韬先生不再担任公司董事长职务, 聘任赵万利先生担任公司董事长。
14. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内, 本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	86,271,511.14	47.28%	78,619.80	46.74%	-
华西证券	1	83,471,372.07	45.74%	77,736.72	46.21%	-
华安证券	2	10,453,827.74	5.73%	9,728.36	5.78%	-
西南证券	1	2,280,626.77	1.25%	2,123.99	1.26%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

2)本报告期本基金新增海通证券 1 个交易单元。

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

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
安信证券	8,855,706.22	86.63%	100,000.00	33.33%	-	-
华西证券	572,955.90	5.60%	-	-	-	-
华安证券	794,096.39	7.77%	200,000.00	66.67%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

10.8 其他重大事件

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		份 额 比 例 达 到 或 者 超 过 20% 的 时 间 区 间					
机构	1	2020.1.1-2020.6.30	95,600,382.40	0.00	0.00	95,600,382.40	78.70
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媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日