

# 华富天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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41

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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	42
7.11 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华富天鑫灵活配置混合	
基金主代码	003152	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 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	84,749,060.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富天鑫灵活配置混合 A	华富天鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	003152	003153
报告期末下属分级基金的份额总额	69,035,106.93 份	15,713,953.56 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	本基金通过合理灵活的资产配置策略，同时结合行业配置策略、个股精选策略、债券投资策略等投资策略，积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇，在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。
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	《证券日报》
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)		
	华富天鑫灵活配置混合 A	华富天鑫灵活配置混合 C	
本期已实现收益	19,400,621.41	5,484,237.34	
本期利润	36,493,711.29	9,859,891.73	
加权平均基金份额本期利润	0.4930	0.4647	
本期加权平均净值利润率	43.18%	42.02%	
本期基金份额净值增长率	50.21%	49.61%	
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	4,912,048.76	642,857.63
	期末可供分配基金份额利润	0.0712	0.0409
	期末基金资产净值	97,630,729.80	21,614,914.64

期末基金份额净值	1.4142	1.3755
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	41.42%	37.55%

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

华富天鑫灵活配置混合 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	15.72%	1.05%	3.72%	0.45%	12.00%	0.60%
过去三个月	28.81%	1.30%	6.67%	0.45%	22.14%	0.85%
过去六个月	50.21%	1.70%	2.64%	0.75%	47.57%	0.95%
过去一年	77.08%	1.33%	7.54%	0.60%	69.54%	0.73%
过去三年	44.65%	1.13%	15.33%	0.63%	29.32%	0.50%
自基金合同生效起至	41.42%	1.05%	21.93%	0.59%	19.49%	0.46%

华富天鑫灵活配置混合 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	15.64%	1.05%	3.72%	0.45%	11.92%	0.60%
过去三个月	28.55%	1.30%	6.67%	0.45%	21.88%	0.85%
过去六个月	49.61%	1.70%	2.64%	0.75%	46.97%	0.95%
过去一年	75.85%	1.33%	7.54%	0.60%	68.31%	0.73%
过去三年	41.34%	1.13%	15.33%	0.63%	26.01%	0.50%
自基金合同生效起至	37.55%	1.05%	21.93%	0.59%	15.62%	0.46%

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

华富天鑫灵活配置混合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



华富天鑫灵活配置混合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《华富天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 12 月 29 日到 2017 年 6 月 29 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《华富天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		
龚炜	华富竞争力优选混	2017 年 5 月 9 日	2020 年 2 月 27 日	16 年	安徽财经大学金融学硕士，研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行

	<p>合型基金基金经理、华富科技动能混合型证券投资基金基金经理、公司公募投资决策委员会主席、公司副总经理</p>				<p>业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监，2012年9月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理，2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理，2018年7月27日至2018年12月21日任华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理，2012年12月21日至2019年7月17日任华富成长趋势混合型基金基金经理。2017年9月12日至2020年2月27日任华富量子生命力混合型基金基金经理，2014年10月31日至2020年2月27日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理，2015年2月4日至2020年2月27日任华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理，2017年5月9日至2020年2月27日任华富物联世界灵活配置混合型基金基金经理，2017年5月9日至2020年2月27日任华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理，2017年5月9日至2020年2月27日任华富灵活配置混合型基金基金经理。</p>
<p>陈 启 明</p>	<p>华富价值增长灵活配置混合型基金基金经理、华富成长趋势混合型基金基金经理、华富产业升级灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理</p>	<p>2019年1月25日</p>	<p>-</p>	<p>14年</p>	<p>复旦大学会计学硕士，本科学历，历任日盛嘉富证券上海代表处研究员、群益证券上海代表处研究员、中银国际证券产品经理，2010年2月加入华富基金管理有限公司，曾任行业研究员、研究发展部副总监、2013年3月1日至2014年9月25日任华富成长趋势股票型基金基金经理助理，2015年5月11日至2019年7月19日任华富竞争力优选混合型基金基金经理，2015年8月4日至2019年7月19日任华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理。</p>

	理、华富成长企业精选股票型证券投资基金基金经理、公司公募投资决策委员会成员、权益投资部总监				
--	---	--	--	--	--

注：这里的离任职日期均指公司作出决定之日。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 均回升到 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，但在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到增长区间，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提高，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。

国内市场方面，上半年上证、沪深 300、创业板分别录得了-2.15%、1.64%、35.6%的上涨。行业方面，中信一级行业指数涨幅居前 5 位的依次为医药、消费者服务、食品饮料、电子和计算机，涨幅分别为 41.54%、26.32%、25.41%、24.22%和 22.92%；基本可以说医药、消费和科技三驾马车引领市场向上。市场结构化表现仍然较为明显。

2020 年上半年本基金盈利跟随重点配置的科技相关及医药行业获得了一定程度的上行。从 2019 年初至今，以创业板为代表的医药、科技板块获得较大幅度的上涨，基本面持续向上提升、政策大力支持以及风险偏好提升带动的估值上升为三大主要推动因素，从 2020 年中往后观察，行业估值提升空间已经逐步减少，不断深挖基本面有望持续甚至加速上升的子行业及个股是未来获得期望收益的最大盈利来源。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 12 月 29 日正式成立。截止到 2020 年 6 月 30 日，华富天鑫 A 类基金份额净

值为 1.4142 元，累计份额净值为 1.4142 元，本报告期的份额累计净值增长率为 50.21%，同期业绩比较基准收益率为 2.64%；华富天鑫 C 基金份额净值为 1.3755 元，累计份额净值为 1.3755 元，本报告期的份额累计净值增长率为 49.61%，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

中美贸易、技术与产业冲突长期持续，同时新冠疫情短中期全面结束可能性比较渺茫，但考虑到全球经济衰退与货币宽松周期仍然持续。国内方面，中国处于经济转型期，坚持认为政策对自主可控新兴产业的支持力度将长期持续，具体来看，5G 的商业化应用、物联网开拓与智能驾驶进入应用起步阶段等将长期推动半导体、AI、新能源、云计算新经济领域景气度持续向上，长期看好。短中期医药板块经历过大幅上升后，估值达到历史较高状态，但是细分行业的快速发展仍然将会持续，随着时间推移，行业仍然具备深耕的投资机会。

#### 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《华富天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 46,353,603.02 元，期末可供分配利润为 5,554,906.39 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天鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本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天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：华富天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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,443,155.62	14,813,954.34
结算备付金		67,793.09	37,572.29
存出保证金		27,971.96	28,791.58
交易性金融资产	6.4.7.2	100,035,814.42	106,219,855.01
其中：股票投资		99,510,543.42	106,219,855.01
基金投资		-	-
债券投资		525,271.00	-
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		-	205,174.41
应收利息	6.4.7.5	1,996.43	3,576.00
应收股利		-	-
应收申购款		113,610.81	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		120,690,342.33	121,308,923.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019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		347,250.79	-
应付赎回款		771,800.64	2,754.05
应付管理人报酬		129,862.89	153,288.26
应付托管费		12,986.30	15,328.82
应付销售服务费		13,203.33	18,538.98
应付交易费用	6.4.7.7	76,027.36	51,864.49
应交税费		29.72	26.36
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,536.86	129,000.00
负债合计		1,444,697.89	370,800.96
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	84,749,060.49	129,164,032.73
未分配利润	6.4.7.10	34,496,583.95	-8,225,910.06
所有者权益合计		119,245,644.44	120,938,122.67
负债和所有者权益总计		120,690,342.33	121,308,923.63

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 84749060.49 份，其中华富天鑫灵活配置混合 A 基金份额总额 69035106.93 份，基金份额净值 1.4142 元；华富天鑫灵活配置混合 C 基金份额总额 15713953.56 份，基金份额净值 1.3755 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华富天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	2019 年 1 月 1 日至 2019 年

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		47,743,525.37	7,526,194.65
1. 利息收入		36,054.23	249,792.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,953.34	216,601.27
债券利息收入		100.89	86.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	33,104.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		26,177,194.21	1,594,573.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,873,103.99	1,447,863.12
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	304,090.22	146,710.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	21,468,744.27	5,681,346.42
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	61,532.66	482.14
减：二、费用		1,389,922.35	971,976.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	810,666.69	662,940.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	81,066.68	66,294.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	94,161.20	89,254.01
4. 交易费用	6.4.7.19	298,121.58	55,788.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.36	0.32
7. 其他费用	6.4.7.20	105,905.84	97,698.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,353,603.02	6,554,218.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,353,603.02	6,554,218.43

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：华富天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）	129,164,032.73	-8,225,910.06	120,938,122.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,353,603.02	46,353,603.02
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）	-44,414,972.24	-3,631,109.01	-48,046,081.25
其中：1. 基金申购款	19,646,713.77	4,150,240.38	23,796,954.15
2. 基金赎回款	-64,061,686.01	-7,781,349.39	-71,843,035.40
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）	84,749,060.49	34,496,583.95	119,245,644.44
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）	126,038,579.75	-32,310,285.57	93,728,294.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,554,218.43	6,554,218.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-23,019,776.58	4,578,998.14	-18,440,778.44

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	120,354.17	-26,824.97	93,529.20
2. 基金赎回款	-23,140,130.75	4,605,823.11	-18,534,307.64
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)	103,018,803.17	-21,177,069.00	81,841,734.17

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：

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

华富天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] 1199 号）核准，基金合同于 2016 年 12 月 29 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）6-161 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《华富天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	20,443,155.62
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	20,443,155.62

##### 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	61,005,231.82	99,510,543.42	38,505,311.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	525,271.00	130,271.00
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	525,271.00	130,271.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	61,400,231.82	100,035,814.42	38,635,582.60

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,849.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	30.50
应收债券利息	103.89
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	12.60
合计	1,996.43

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	76,027.36
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	76,027.36

#### 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	1.50
应付证券出借违约金	-
信息披露费	59,672.34
审计费	24,863.02
银行间账户维护费	9,000.00
合计	93,536.86

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富天鑫灵活配置混合 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	99,074,440.54	99,074,440.54
本期申购	10,716,241.78	10,716,241.78
本期赎回（以“-”号填列）	-40,755,575.39	-40,755,575.39
-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	69,035,106.93	69,035,106.93

华富天鑫灵活配置混合 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	30,089,592.19	30,089,592.19
本期申购	8,930,471.99	8,930,471.99
本期赎回（以“-”号填列）	-23,306,110.62	-23,306,110.62
-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	15,713,953.56	15,713,953.56

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

华富天鑫灵活配置混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-18,135,375.32	12,334,910.52	-5,800,464.80
本期利润	19,400,621.41	17,093,089.88	36,493,711.29
本期基金份额 交易产生的变 动数	3,646,802.67	-5,744,426.29	-2,097,623.62
其中：基金申 购款	355,511.58	2,652,467.76	3,007,979.34
基金赎 回款	3,291,291.09	-8,396,894.05	-5,105,602.96
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	4,912,048.76	23,683,574.11	28,595,622.87
华富天鑫灵活配置混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,090,320.39	3,664,875.13	-2,425,445.26
本期利润	5,484,237.34	4,375,654.39	9,859,891.73

本期基金份额交易产生的变动数	1,248,940.68	-2,782,426.07	-1,533,485.39
其中：基金申购款	-744,390.54	1,886,651.58	1,142,261.04
基金赎回款	1,993,331.22	-4,669,077.65	-2,675,746.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	642,857.63	5,258,103.45	5,900,961.08

#### 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	35,041.04
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	688.67
其他	223.63
合计	35,953.34

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。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	25,873,103.99
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	25,873,103.99

##### 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	114,934,081.45

减：卖出股票成本总额	89,060,977.46
买卖股票差价收入	25,873,103.99

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 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	304,090.22
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	304,090.22

#### 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	21,468,744.27
股票投资	21,338,473.27
债券投资	130,271.00
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	21,468,744.27

#### 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	60,794.52

基金转换费收入	738.14
合计	61,532.66

#### 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	298,121.58
银行间市场交易费用	-
-	-
合计	298,121.58

#### 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	2,770.48
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	105,905.84

注：其他所列金额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	77,669,034.31	44.79	3,121,554.80	6.97

#### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 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	72,077.83	45.15	10,957.04	14.41
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	2,890.54	7.04	1,155.63	9.99

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	810,666.69	662,940.70
其中：支付销售机构的客户维护费	35,333.39	352,570.91

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.5% 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 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
当期发生的基金应支付的托管费	81,066.68	66,294.13

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		
	华富天鑫灵活配置混合 A	华富天鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	0.00	26,641.93	26,641.93
华安证券股份有限公司	-	0.42	0.42
中国工商银行股份有限公司	-	58,118.13	58,118.13
合计	0.00	84,760.48	84,760.48
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		

	华富天鑫灵活配置混合 A	华富天鑫灵活配置混合 C	合计
华富基金管理有限公司	0.00	0.00	-
华安证券股份有限公司	-	-	-
中国工商银行股份有限公司	-	403,968.27	403,968.27
合计	-	403,968.27	403,968.27

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 0.80% 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：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：报告期内未发生转融通证券出借业务

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

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

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	20,443,155.62	35,041.04	45,837,899.47	210,867.83

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
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	-
688177	百奥泰	2020年2月13日	2020年8月21日	科创板新股锁定	32.76	57.02	4,982	163,210.32	284,073.64	-
688178	万德斯	2020年1月6日	2020年7月14日	科创板新股锁定	25.20	39.90	2,540	64,008.00	101,346.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券	成功	可流通	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注

代码	名称	认购日	日	限类型	价格	值单价	(单 位: 张)	成本总额	额	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

注：本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有信用债券

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券

#### 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	525,271.00	0.00
-	-	-
未评级	0.00	0.00
合计	525,271.00	0.00

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	20,443,155.62	-	-	-	-	-	20,443,155.62
结算备付金	67,793.09	-	-	-	-	-	67,793.09
存出保证金	27,971.96	-	-	-	-	-	27,971.96
交易性金融资产	-	-	525,271.00	-	-	99,510,543.42	100,035,814.42
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,996.43	1,996.43
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	113,610.81	113,610.81
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,538,920.67	-	525,271.00	-	-	99,626,150.66	120,690,342.33
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	771,800.64	771,800.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	129,862.89	129,862.89
应付托管费	-	-	-	-	-	12,986.30	12,986.30
应付证券清算款	-	-	-	-	-	347,250.79	347,250.79
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,203.33	13,203.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	76,027.36	76,027.36
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	29.72	29.72
其他负债	-	-	-	-	-	93,536.86	93,536.86
负债总计	-	-	-	-	-	1,444,697.89	1,444,697.89
利率敏感度缺口	20,538,920.67	-	525,271.00	-	-	98,181,452.77	119,245,644.44
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	14,813,954.34	-	-	-	-	-	14,813,954.34

结算备付金	37,572.29	-	-	-	-	37,572.29
存出保证金	28,791.58	-	-	-	-	28,791.58
交易性金融资产	-	-	-	-	106,219,855.01	106,219,855.01
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	3,576.00	3,576.00
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	205,174.41	205,174.41
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,880,318.21	-	-	-	106,428,605.42	121,308,923.63
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	2,754.05	2,754.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	153,288.26	153,288.26
应付托管费	-	-	-	-	15,328.82	15,328.82
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	18,538.98	18,538.98
应付交易费用	-	-	-	-	51,864.49	51,864.49
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	26.36	26.36
其他负债	-	-	-	-	129,000.00	129,000.00
负债总计	-	-	-	-	370,800.96	370,800.96
利率敏感度缺口	14,880,318.21	-	-	-	106,057,804.46	120,938,122.67

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	7,839.67	0
	市场利率上升 25 基点	-7,839.67	0

注：上期末未持有债券型资产，因此若除利率外其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

#### 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	99,510,543.42	83.45	106,219,855.01	87.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	525,271.00	0.44	-	-
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	100,035,814.42	83.89	106,219,855.01	87.83

##### 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)

	动	本期末（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	3,150,909.21	2,205,760.06
	沪深 300 指数下降百分之五	-3,150,909.21	-2,205,760.06

#### 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	36,128,628.71	31272368.19

#### 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	99,510,543.42	82.45
	其中：股票	99,510,543.42	82.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	525,271.00	0.44
	其中：债券	525,271.00	0.44
	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	20,510,948.71	16.99
-	-	-	-
8	其他各项资产	143,579.20	0.12
9	合计	120,690,342.33	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	43,306.20	0.04
B	采矿业	20,457.30	0.02
C	制造业	43,798,460.26	36.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,829.46	0.09
E	建筑业	55,056.40	0.05
F	批发和零售业	23,121,664.99	19.39
G	交通运输、仓储和邮政业	4,267,200.00	3.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,133,226.53	21.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	23,227.18	0.02
M	科学研究和技术服务业	168,695.35	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	279,819.75	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,489,600.00	1.25
S	综合	-	-
	合计	99,510,543.42	83.45

### 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	603939	益丰药房	118,000	10,738,000.00	9.00
2	603986	兆易创新	39,200	9,247,672.00	7.76
3	002153	石基信息	178,805	6,978,759.15	5.85
4	603233	大参林	82,560	6,705,523.20	5.62
5	300363	博腾股份	188,000	6,497,280.00	5.45
6	300036	超图软件	188,000	4,733,840.00	3.97
7	600588	用友网络	104,000	4,586,400.00	3.85

8	600004	白云机场	280,000	4,267,200.00	3.58
9	300750	宁德时代	22,800	3,975,408.00	3.33
10	300624	万兴科技	47,680	3,838,240.00	3.22
11	603883	老百姓	38,000	3,801,520.00	3.19
12	600195	中牧股份	218,880	3,552,422.40	2.98
13	300037	新宙邦	60,000	3,303,600.00	2.77
14	002812	恩捷股份	50,000	3,290,000.00	2.76
15	000063	中兴通讯	80,000	3,210,400.00	2.69
16	688111	金山办公	8,800	3,005,904.00	2.52
17	002236	大华股份	138,000	2,650,980.00	2.22
18	300073	当升科技	80,000	2,645,600.00	2.22
19	300348	长亮科技	132,000	2,508,000.00	2.10
20	002867	周大生	80,000	1,773,600.00	1.49
21	002601	龙蟠佰利	88,800	1,642,800.00	1.38
22	000681	视觉中国	80,000	1,489,600.00	1.25
23	002460	赣锋锂业	20,000	1,071,400.00	0.90
24	688177	百奥泰	4,982	284,073.64	0.24
25	688300	联瑞新材	3,164	217,619.92	0.18
26	603290	斯达半导	956	200,568.80	0.17
27	688051	佳华科技	1,273	161,658.27	0.14
28	688100	威胜信息	6,005	159,132.50	0.13
29	300832	新产业	882	151,871.58	0.13
30	688089	嘉必优	2,884	149,650.76	0.13
31	688398	赛特新材	2,519	142,953.25	0.12
32	688222	成都先导	2,533	137,415.25	0.12
33	603392	万泰生物	785	129,525.00	0.11
34	688357	建龙微纳	2,332	118,582.20	0.10
35	688078	龙软科技	2,576	106,131.20	0.09
36	688178	万德斯	2,540	101,346.00	0.08
37	688181	八亿时空	1,614	100,423.08	0.08
38	601778	晶科科技	12,349	97,063.14	0.08
39	688081	兴图新科	2,260	96,728.00	0.08
40	300815	玉禾田	716	87,810.24	0.07
41	688228	XD 开普云	978	76,401.36	0.06
42	603893	瑞芯微	810	73,305.00	0.06
43	603719	良品铺子	963	70,645.68	0.06
44	688096	京源环保	2,740	70,198.80	0.06
45	002985	北摩高科	547	68,085.09	0.06
46	601827	三峰环境	6,723	63,801.27	0.05
47	300821	东岳硅材	5,703	59,083.08	0.05
48	002989	中天精装	980	55,056.40	0.05
49	002990	盛视科技	612	53,807.04	0.05

50	601609	金田铜业	4,477	46,829.42	0.04
51	002987	京北方	770	45,853.50	0.04
52	002980	华盛昌	700	44,492.00	0.04
53	002982	湘佳股份	420	43,306.20	0.04
54	300831	派瑞股份	1,716	41,372.76	0.03
55	300829	金丹科技	487	36,374.03	0.03
56	603353	和顺石油	689	32,376.11	0.03
57	002986	宇新股份	630	31,783.50	0.03
58	002983	芯瑞达	660	31,554.60	0.03
59	300825	阿尔特	1,642	31,280.10	0.03
60	603439	贵州三力	797	28,317.41	0.02
61	605001	威奥股份	1,353	27,709.44	0.02
62	002979	雷赛智能	1,005	27,104.85	0.02
63	002973	侨银环保	1,146	26,862.24	0.02
64	300833	浩洋股份	406	26,430.60	0.02
65	300830	金现代	1,671	26,134.44	0.02
66	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.02
67	603087	甘李药业	258	25,877.40	0.02
68	603950	长源东谷	1,081	25,716.99	0.02
69	002981	朝阳科技	490	24,348.10	0.02
70	603682	锦和商业	2,018	23,227.18	0.02
71	002971	和远气体	859	21,483.59	0.02
72	002988	豪美新材	1,097	20,491.96	0.02
73	002978	安宁股份	582	20,457.30	0.02
74	603948	建业股份	860	19,324.20	0.02
75	603095	越剑智能	630	19,000.80	0.02
76	603212	赛伍技术	715	18,954.65	0.02
77	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
78	002976	瑞玛工业	536	18,052.48	0.02
79	603949	雪龙集团	875	17,648.75	0.01
80	603551	奥普家居	888	14,412.24	0.01
81	300817	双飞股份	506	13,505.14	0.01
82	300823	建科机械	453	13,096.23	0.01
83	300819	聚杰微纤	541	12,935.31	0.01
84	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
85	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
86	603221	爱丽家居	769	11,435.03	0.01
87	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
88	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
89	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
90	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	002236	大华股份	5,560,787.90	4.60
2	002153	石基信息	5,245,921.10	4.34
3	300073	当升科技	4,695,094.00	3.88
4	300750	宁德时代	4,309,632.07	3.56
5	603882	金域医学	3,531,654.00	2.92
6	002273	水晶光电	3,376,400.00	2.79
7	000063	中兴通讯	3,111,628.00	2.57
8	300624	万兴科技	3,081,764.00	2.55
9	002601	龙蟠佰利	3,056,056.00	2.53
10	002415	海康威视	2,622,269.00	2.17
11	002867	周大生	2,609,591.82	2.16
12	002174	游族网络	2,552,848.00	2.11
13	002812	恩捷股份	2,499,593.00	2.07
14	300037	新宙邦	2,482,981.00	2.05
15	002555	三七互娱	2,234,292.00	1.85
16	600036	招商银行	2,141,181.00	1.77
17	603026	石大胜华	2,124,663.00	1.76
18	000681	视觉中国	1,462,605.00	1.21
19	002460	赣锋锂业	1,017,890.00	0.84
20	300348	长亮科技	771,824.00	0.64

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	300363	博腾股份	12,643,723.57	10.45
2	603986	兆易创新	9,099,173.94	7.52
3	600900	XD 长江电	6,255,629.65	5.17
4	600584	长电科技	5,503,410.30	4.55
5	603882	金域医学	4,833,955.54	4.00
6	600036	招商银行	3,898,505.00	3.22
7	002142	宁波银行	3,744,869.11	3.10
8	601933	永辉超市	3,702,571.00	3.06
9	603456	九洲药业	3,296,177.00	2.73
10	603939	益丰药房	3,221,270.13	2.66
11	600038	中直股份	3,173,581.20	2.62

12	601318	中国平安	3,127,451.00	2.59
13	002236	大华股份	2,968,734.53	2.45
14	600011	华能国际	2,824,457.60	2.34
15	002415	海康威视	2,807,990.29	2.32
16	002027	分众传媒	2,769,800.00	2.29
17	002273	水晶光电	2,682,665.00	2.22
18	002624	完美世界	2,497,949.00	2.07
19	601166	兴业银行	2,408,400.00	1.99
20	300073	当升科技	2,356,952.00	1.95

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	61,013,192.60
卖出股票收入（成交）总额	114,934,081.45

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	525,271.00	0.44
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	525,271.00	0.44

#### 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	113583	益丰转债	3,950	525,271.00	0.44

**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 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**

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括重庆博腾制药科技股份有限公司。中国证监会重庆监管局于 2020 年 5 月 15 日对重庆博腾制药科技股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

**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	27,971.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,996.43
5	应收申购款	113,610.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	143,579.20

**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(%)
华富天鑫灵活配置混合 A	381	181,194.51	41,010,428.91	59.41	28,024,678.02	40.59
华富天鑫灵活配置混合 C	217	72,414.53	5,969,630.89	37.99	9,744,322.67	62.01
合计	598	141,720.84	46,980,059.80	55.43	37,769,000.69	44.57

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本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	华富天鑫灵活配置混合 A	华富天鑫灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2016 年 12 月 29 日) 基金份额总额	319,692,617.47	116,383,905.17
本报告期期初基金份 额总额	99,074,440.54	30,089,592.19
本报告期基金总申购 份额	10,716,241.78	8,930,471.99
减：本报告期基金总 赎回份额	40,755,575.39	23,306,110.62
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	69,035,106.93	15,713,953.56

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。

5. 2020 年 2 月 27 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作安排, 龚炜先生不再担任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
6. 2020 年 2 月 27 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作安排, 龚炜先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
7. 2020 年 4 月 21 日, 华富基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过, 因工作需要, 聘任邵恒先生担任公司副总经理职务。
8. 2020 年 5 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作安排, 倪莉莎女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。
9. 2020 年 5 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘陶祺先生为华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
10. 2020 年 5 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘陶祺先生为华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理。
11. 2020 年 5 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘陶祺先生为华富货币市场基金基金经理。
12. 2020 年 5 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘陶祺先生为华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
13. 2020 年 6 月 28 日, 华富基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过, 因工作需要, 章宏韬先生不再担任公司董事长职务, 聘任赵万利先生担任公司董事长。
14. 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	81,041,143.18	46.73%	73,852.70	46.26%	-
华安证券	2	77,669,034.31	44.79%	72,077.83	45.15%	-
西南证券	1	12,771,451.85	7.36%	11,893.80	7.45%	-
华西证券	1	1,941,127.00	1.12%	1,807.84	1.13%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	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)本基金本报告期内新增海通证券 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	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
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	《华富天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基金经理变更的公告》	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
6	《华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	中国证监会指定媒介	2020年2月29日
7	《华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）》	中国证监会指定媒介	2020年2月29日
8	《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
9	《华富基金管理有限公司关于推迟披	中国证监会指定媒介	2020年3月26日

	露旗下基金 2019 年年度报告的公告》		
10	《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
11	《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
12	《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
13	《华富天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
14	《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
15	《华富天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
16	《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
17	《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	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

机构	1	2020.1.1-2020.6.30	33,454,890.15	0.00	0.00	33,454,890.15	39.48
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、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富天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