

华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2022 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。本中期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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 06 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	5
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	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45

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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华富价值增长混合
基金主代码	410007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 15 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	336,423,498.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于价值相对低估且能为股东创造持续稳定回报的公司，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用较为灵活的投资策略。在资产配置中，本基金采用自上而下的方式，通过分析证券市场投资环境，预测股票市场和债券市场未来收益和风险，确定资产配置方案；在股票选择中，本基金采用定量分析、定性分析和实地调研等方法，自下而上，精选个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于灵活配置混合型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	平安银行股份有限公司
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	95511-3
传真	021-68887997	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	200120	518001
法定代表人	赵万里	谢永林

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
会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号新湖商贸大厦 6 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-43,396,403.40
本期利润	-163,898,214.47
加权平均基金份额本期利润	-0.3970
本期加权平均净值利润率	-15.30%
本期基金份额净值增长率	-8.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	274,792,793.82
期末可供分配基金份额利润	0.8168
期末基金资产净值	941,331,260.16
期末基金份额净值	2.7981
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	384.91%

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

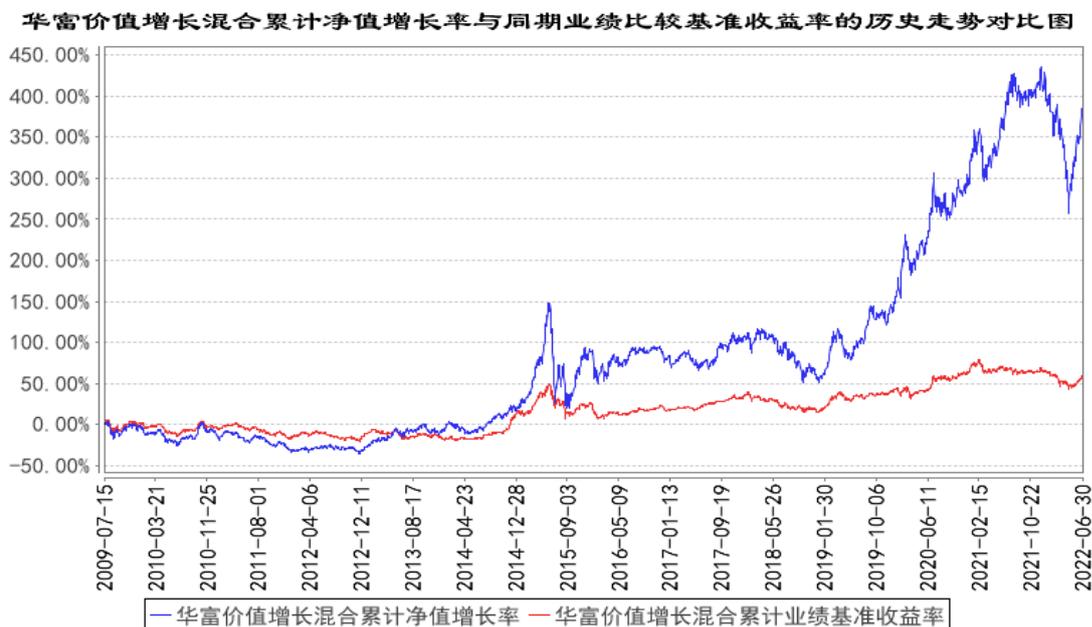
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	12.11%	1.39%	5.69%	0.64%	6.42%	0.75%

过去三个月	10.27%	1.96%	4.30%	0.86%	5.97%	1.10%
过去六个月	-8.18%	1.79%	-4.64%	0.87%	-3.54%	0.92%
过去一年	-3.71%	1.54%	-6.44%	0.75%	2.73%	0.79%
过去三年	148.57%	1.55%	17.65%	0.76%	130.92%	0.79%
自基金合同生效起至今	384.91%	1.59%	58.44%	0.88%	326.47%	0.71%

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%，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



注：根据《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票投资占基金资产的比例为 30%-80%；债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-70%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 7 月 15 日到 2010 年 1 月 15 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富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、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定

期开放债券型发起式证券投资基金和华富安业一年持有期债券型证券投资基金共五十五只基金。

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		
陈启明	本基金基金经理、公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、权益投资部总监	2014年9月26日	-	十六年	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、研究发展部副总监自2014年9月26日起任华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年3月14日起任华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理，自2017年5月8日起任华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年1月25日起任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2020年6月18日起任华富成长企业精选股票型证券投资基金基金经理，自2022年1月13日起任华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2022年3月25日起任华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。

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

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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

2022 年上半年，国内外形势复杂，海外美联储加快加息进程、俄乌冲突加剧大宗商品上涨，国内经济复苏进程被疫情打断，上半年经济下行压力进一步加剧，但随着 6 月以来全国各地疫情陆续平复和复工复产的稳步推进，中国经济正在重回复苏趋势。

宏观经济数据来看，二季度全国 GDP 同比增速下滑 4.4% 至 0.4%，主要仍是受疫情影响，上海 4、5 月经济陷入停滞、北京遭遇两波疫情脉冲，均对经济增长造成制约。6 月份投资、消费、出口均持续好转。投资方面，6 月全国固定资产投资同比增速继续上升至 5.8%，从三大项来看，基建持续发力、制造业回升偏缓、地产拐头向下，分化仍在持续。消费方面，6 月社消零售、限额以上零售同比增速分别由负转正至 3.1%、8.1%，呈现疫后快速复苏状态，其中线下消费已回升转正至 2.6%，活跃度有明显改善。进出口方面，7 月我国出口增速继续维持高位，以美元计价，7 月出口同比增速为 18%，海外发达国家居民收入增速回落速度缓慢，以及全球能源和工业生产困难背景下我国强韧的供给能力提供了较强支撑。

国内市场上半年各大指数呈现先抑后扬的态势，上证指数、沪深 300、创业板指分别下跌 6.63%、9.22%、15.41%。行业表现方面，年初通胀主线、疫后复苏和稳增长主线表现相对较好，上半年中信一级行业指数涨跌幅居前 5 位的依次为煤炭、消费者服务、交通运输、银行、建筑，随着疫情缓解，市场风险偏好明显上升，新能源相关的成长板块强势反弹，前期优势板块遭遇回调，呈现跷跷板效应。基金操作上，坚定看好以下方向，包括新能源（如光伏受益于成本下降预期和欧美需求爆发，车受益于政策支持渗透率加速提升、锂价下跌预期以及油价上涨性价比凸显带来的需求增长）、科技（中美大国博弈背景下国产替代需求长期存在，人口萎缩背景下自动化需求前景明朗）、医药（CXO 受益于新冠药订单为主业发展提供充足现金流，连锁药房集中度提升走出低谷趋势明朗）、其他自下而上（经营性现金流稳健，符合政策长期发展，受益于经济衰退受益的个股）；基金表现上，由于上半年遭遇美国加息，俄乌战争，国内疫情等黑天鹅事件，净值经历

了较大回撤，但是本基金仍然坚持增长速度、空间、确定性与性价比的综合考量，逢低布局，随着上述利空逐步消化后，净值得到了较好的修复。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 2.7981 元，累计份额净值为 3.5981 元。报告期，本基金份额净值增长率为-8.18%，同期业绩比较基准收益率为-4.64 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，随着疫情平复和复工复产稳步推进，中国经济重回复苏这一趋势已在 5、6 月的各项数据中有所印证，未来预计将延续改善趋势。投资方面，预计在中国制造转型升级大背景下，制造业投资，尤其是高技术制造业、医药制造业、计算机、通信和其他电子设备制造业以及汽车制造业继续维持较高韧性。消费方面，尽管中央和地方层面推出多项消费刺激政策，但疫情对于居民消费能力和消费意愿的影响仍不可忽视。出口方面，由于全球通胀高企，外需或面临加速回落，预计对经济增速的负面影响将逐渐显现，但三季度出口仍存在人民币汇率、美国或下调中美关税等因素支撑。金融形势方面，去年底以来我国央行主动应对、靠前发力，密集开展了多项货币政策操作，使得我国与海外主要国家经济与政策周期全面错位，预计三季度往后我国货币政策宽松空间将受到进一步制约。综上，下半年虽然风险重重，但是机遇与挑战并存，本基金将坚持贯彻一直以来的投资策略，寻找有价值的品种，积极为持有人创造收益。

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《华富价值增长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-163,898,214.47 元，期末可供分配利润为 274,792,793.82 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	87,258,884.34	145,805,578.60
结算备付金		84,666.83	1,222,849.20
存出保证金		483,837.96	291,655.17
交易性金融资产	6.4.7.2	844,194,016.66	1,105,975,731.68
其中：股票投资		751,401,190.60	969,721,359.86
基金投资		-	-
债券投资		92,792,826.06	136,254,371.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		11,592,117.21	-
应收股利		-	-
应收申购款		240,103.05	142,078.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	321,934.63
资产总计		943,853,626.05	1,253,759,827.30
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		675,798.39	161,878.14
应付管理人报酬		1,130,202.28	1,360,187.05
应付托管费		188,367.07	226,697.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,110.51	884.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	526,887.64	681,380.36
负债合计		2,522,365.89	2,431,027.39
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	336,423,498.80	410,631,755.56
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	604,907,761.36	840,697,044.35
净资产合计		941,331,260.16	1,251,328,799.91
负债和净资产总计		943,853,626.05	1,253,759,827.30

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.7981 元，基金份额总额 336,423,498.80 份。

6.2 利润表

会计主体：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-154,473,657.55	81,438,393.65
1. 利息收入		411,482.00	184,739.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	406,903.62	159,102.58
债券利息收入		-	25,636.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,578.38	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,010,977.00	21,885,049.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,604,854.29	13,707,012.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-29,017,515.72	6,734,557.85
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,611,393.01	1,443,479.11
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-120,501,811.07	59,274,248.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	627,648.52	94,356.43
减：二、营业总支出		9,424,556.92	3,078,006.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,980,942.62	2,097,732.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,330,157.17	349,622.08
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		478.18	92.31
8. 其他费用	6.4.7.23	112,978.95	630,559.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-163,898,214.47	78,360,386.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-163,898,214.47	78,360,386.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-163,898,214.47	78,360,386.85

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	410,631,755.56	-	840,697,044.35	1,251,328,799.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	410,631,755.56	-	840,697,044.35	1,251,328,799.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-74,208,256.76	-	-235,789,282.99	-309,997,539.75
(一)、综合收	-	-	-163,898,214.47	-163,898,214.47

益总额				
(二)、 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)	-74,208,256.76	-	-71,891,068.52	-146,099,325.28
其中:1.基金申购款	148,652,854.37	-	264,361,866.68	413,014,721.05
2.基金赎回款	-222,861,111.13	-	-336,252,935.20	-559,114,046.33
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	336,423,498.80	-	604,907,761.36	941,331,260.16
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基	95,576,715.51	-	129,125,512.94	224,702,228.45

金净值)				
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前 期差 错 更 正	-	-	-	-
其 他	-	-	-	-
二、本 期 初 净 资 产 (基 金 净 值)	95,576,715.51	-	129,125,512.94	224,702,228.45
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	96,972,235.70	-	237,830,334.66	334,802,570.36
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	78,360,386.85	78,360,386.85
(二)、 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)	96,972,235.70	-	159,469,947.81	256,442,183.51
其中:1. 基 金 申 购 款	131,359,688.19	-	212,141,917.24	343,501,605.43
2 .基 金 赎 回 款	-34,387,452.49	-	-52,671,969.43	-87,059,421.92
(三)、 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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	192,548,951.21	-	366,955,847.60	559,504,798.81

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

华富价值增长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[2009]309号）核准，基金合同于2009年7月15日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健光华（北京）会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健华证验（2009）综字第070003号）。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为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、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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、经营成果和净资产变动等有关信息。

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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则 新金融工具准则

列报项目 计量类别 账面价值 列报项目 计量类别 账面价值

银行存款 摊余成本 145,805,578.60 银行存款 摊余成本 145,829,959.39

结算备付金 摊余成本 1,222,849.20 结算备付金 摊余成本 1,223,454.53
 存出保证金 摊余成本 291,655.17 存出保证金 摊余成本 291,799.49
 交易性金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益 1,105,975,731.68 交易性金融资产
 以公允价值计量且其变动计入当期损益 1,106,272,535.87
 衍生金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益 - 衍生金融资产 以公允价值计量且
 其变动计入当期损益 -
 买入返售金融资产 摊余成本 - 买入返售金融资产 摊余成本 -
 应收利息 摊余成本 321,934.63 其他资产-应收利息 摊余成本 -
 应收证券清算款 摊余成本 - 应收清算款 摊余成本 -
 应收股利 摊余成本 - 应收股利 摊余成本 -
 应收申购款 摊余成本 142,078.02 应收申购款 摊余成本 142,078.02
 其他资产-其他应收款 摊余成本 - 其他资产-其他应收款 摊余成本 -
 交易性金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 - 交易性金融负债 以公允价值计
 量且其变动计入当期损益 -
 衍生金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 - 衍生金融负债 以公允价值计量且
 其变动计入当期损益 -
 卖出回购金融资产款 摊余成本 - 卖出回购金融资产款 摊余成本 -
 应付证券清算款 摊余成本 - 应付清算款 摊余成本
 应付赎回款 摊余成本 161,878.14 应付赎回款 摊余成本 161,878.14
 应付管理人报酬 摊余成本 1,360,187.05 应付管理人报酬 摊余成本 1,360,187.05
 应付托管费 摊余成本 226,697.84 应付托管费 摊余成本 226,697.84
 应付销售服务费 摊余成本 - 应付销售服务费 摊余成本 -
 应付利润 摊余成本 - 应付利润 摊余成本 -
 应付交易费用 摊余成本 486,527.61 其他负债-应付交易费用 摊余成本 486,527.61
 应付税费 摊余成本 884.00 应付税费 摊余成本 884.00
 应付利息 摊余成本 - 其他负债-应付利息 摊余成本 -
 其他负债-其他应付款 摊余成本 194,852.75 其他负债-其他应付款 摊余成本 194,852.75
 于 2021 年 12 月 31 日,“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买
 入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应
 付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日,根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别

转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1 号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85 号)、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2014〕81 号)、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2016〕127 号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101 号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36 号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46 号)、《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56 号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90 号)及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

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

(四) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中

国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

主要税种及税率列示如下:

税种 计税依据 税率

增值税 以按税法规定计算的金融服务销售额 3%

城市维护建设税 实际缴纳的流转税税额 7%

教育费附加 实际缴纳的流转税税额 3%

地方教育附加 实际缴纳的流转税税额 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 2022年6月30日
活期存款	87,258,884.34
等于: 本金	87,238,523.64
加: 应计利息	20,360.70
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
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	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
合计	87,258,884.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	733,979,603.41	-	751,401,190.60	17,421,587.19
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	66,779,153.93	131,807.10	72,864,910.84	5,953,949.81
	银行间市场	19,927,980.00	7,915.22	19,927,915.22	-7,980.00
	合计	86,707,133.93	139,722.32	92,792,826.06	5,945,969.81
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	820,686,737.34	139,722.32	844,194,016.66	23,367,557.00	

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 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,141.97
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	346,266.72
其中：交易所市场	346,066.72
银行间市场	200.00
应付利息	-
应付审计费	109,671.58
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	59,507.37
上清账户维护费	4,800.00
合计	526,887.64

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	410,631,755.56	410,631,755.56
本期申购	148,652,854.37	148,652,854.37
本期赎回 (以“-”号填列)	-222,861,111.13	-222,861,111.13
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	336,423,498.80	336,423,498.80

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	380,410,469.03	460,286,575.32	840,697,044.35
本期利润	-43,396,403.40	-120,501,811.07	-163,898,214.47
本期基金份额交易产生的变动数	-62,221,271.81	-9,669,796.71	-71,891,068.52
其中：基金申购款	135,764,976.37	128,596,890.31	264,361,866.68
基金赎回款	-197,986,248.18	-138,266,687.02	-336,252,935.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	274,792,793.82	330,114,967.54	604,907,761.36

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	394,891.90
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	8,597.95
其他	3,413.77
合计	406,903.62

注：其他所列本期金额为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,604,854.29
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	-10,604,854.29

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	585,515,742.08
减：卖出股票成本总额	594,502,007.90
减：交易费用	1,618,588.47
买卖股票差价收入	-10,604,854.29

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	324,617.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-29,342,133.66
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	-29,017,515.72

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	152,400,052.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	181,197,729.85
减：应计利息总额	538,800.08
减：交易费用	5,656.48
买卖债券差价收入	-29,342,133.66

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,611,393.01
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	4,611,393.01

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-120,501,811.07
股票投资	-114,960,577.72
债券投资	-5,541,233.35
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	-120,501,811.07

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	565,419.32
基金转换费收入	62,229.20
合计	627,648.52

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	13,800.00
合计	112,978.95

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、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	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
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	552,098,001.55	55.94	150,647,336.78	37.71

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	24,099,905.31	17.66	64,941,736.57	68.82

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：本基金本报告期内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 2022年1月1日至2022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	511,172.55	55.90	155,693.16	44.99
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华安证券	140,246.65	38.17	85,464.96	33.33

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,980,942.62	2,097,732.61
其中：支付销售机构的客户维护费	648,451.58	320,995.24

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,330,157.17	349,622.08

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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）。

6.4.10.3 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：本基金本报告期内及上年度可比期间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

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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
基金合同生效日（2009年7月15日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,124,251.05	4,713,904.14
报告期间申购/买入总份额	0.00	2,124,251.05
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,124,251.05	4,713,904.14
报告期末持有的基金份额	0.00	2,124,251.05
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	1.1000%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
上海华富利得资产管理有限 公司	2,551,680.14	0.7600	2,551,680.14	0.6200

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
平安银行股份有限公司	87,258,884.34	394,891.90	103,414,259.05	155,683.81

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(2022 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	受限期	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
002459	晶澳科技	2022 年 5 月 12 日	6 个月	非公开发行流通受限	48.01	73.15	583,160	28,000,020.46	42,658,154.00	-
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	568	31,563.76	17,057.04	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301110	青木股份	2022 年 3 月	6 个月	新股流通	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-

		4 日		受限							
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-	
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-	
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	6 个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-	
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-	
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-	
301135	瑞德智能	2022 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-	
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-	
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	38.46	38.46	5,651	217,337.46	217,337.46	-	
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-	
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-	
301160	翔楼新材	2022 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-	
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08	-	
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-	
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-	
301215	中汽	2022	6 个月	新股	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-	

	股份	年 2 月 28 日		流通受限							
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,087	38,784.16	32,436.08	-	
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	17.27	14.83	3,101	53,554.27	45,987.83	-	
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	96.51	87.82	274	26,444.96	24,062.68	-	
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-	
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-	
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-	
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-	
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流通受限	48.56	31.38	1,091	52,983.76	34,235.58	-	
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-	
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	2,098	40,239.64	67,282.86	-	
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-	
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-	
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-	
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-	

301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
688120	华海清科	2022年5月30日	6个月	新股流通受限	136.66	217.12	2,532	346,023.12	549,747.84	-
688234	天岳先进	2022年1月5日	6个月	新股流通受限	82.79	65.19	4,442	367,753.18	289,573.98	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1-6个月(含)	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688348	昱能科技	2022年5月31日	6个月	新股流通受限	163.00	416.57	3,574	582,562.00	1,488,821.18	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1-6个月(含)	新股流通受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。本报告期间若有除权，认购价格为除权后价格，数量为期末实际持有数量。

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债券正回购交易中作为抵押的债券。

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：本基金本报告期末未持有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：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	0.00	-
AAA 以下	72,733,103.74	106,275,371.82
未评级	0.00	-
合计	72,733,103.74	106,275,371.82

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合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 2022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	87,258,884.34	-	-	-	-	-	87,258,884.34
结算备付金	84,666.83	-	-	-	-	-	84,666.83
存出保证金	483,837.96	-	-	-	-	-	483,837.96
交易性金融资产	28,150,655.67	19,927,915.22	44,714,255.17	-	-	751,401,190.60	844,194,016.66
衍生金融资	-	-	-	-	-	-	-

产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	240,103.05	240,103.05
应收清算款	-	-	-	-	-	11,592,117.21	11,592,117.21
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	115,978,044.80	19,927,915.22	44,714,255.17	-	-	763,233,410.86	943,853,626.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	675,798.39	675,798.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,130,202.28	1,130,202.28
应付托管费	-	-	-	-	-	188,367.07	188,367.07
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1,110.51	1,110.51
其他负债	-	-	-	-	-	526,887.64	526,887.64
负债总计	-	-	-	-	-	2,522,365.89	2,522,365.89
利率敏感度缺口	115,978,044.80	19,927,915.22	44,714,255.17	-	-	760,711,044.97	941,331,260.16
上年度末							
2021 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	145,805,578.60	-	-	-	-	-	145,805,578.60
结算备付金	1,222,849.20	-	-	-	-	-	1,222,849.20
存出保证金	291,655.17	-	-	-	-	-	291,655.17
交易性金融	-	-	136,254,371	-	-	969,721,3	1,105,975,

资产			.82			59.86	731.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	142,078.02	142,078.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	321,934.63	321,934.63
资产总计	147,320,082.97	-	136,254,371.82	-	-	970,185,372.51	1,253,759,827.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	161,878.14	161,878.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,360,187.05	1,360,187.05
应付托管费	-	-	-	-	-	226,697.84	226,697.84
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	884.00	884.00
其他负债	-	-	-	-	-	681,380.36	681,380.36
负债总计	-	-	-	-	-	2,431,027.39	2,431,027.39
利率敏感度缺口	147,320,082.97	-	136,254,371.82	-	-	967,754,345.12	1,251,328,799.91

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	

分析	市场利率下降 25 基点	81,231.42	143,067.09
	市场利率上升 25 基点	-81,156.03	-143,067.09

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	751,401,190.60	79.82	969,721,359.86	77.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	92,792,826.06	9.86	136,254,371.82	10.89
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	844,194,016.66	89.68	1,105,975,731.68	88.38

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	沪深 300 指数上	54,122,155.93	14,975,018.40

	升百分之五		
	沪深 300 指数下 降百分之五	-54,122,155.93	-14,975,018.40

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 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	合计	444,272,633.53	322,817,214.10

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	777,580,047.08	1,073,576,599.47
第二层次	21,054,221.63	30,359,229.35
第三层次	45,559,747.95	2,039,902.86
合计	844,194,016.66	1,105,975,731.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未

发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 06 月 30 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	751,401,190.60	79.61
	其中：股票	751,401,190.60	79.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	92,792,826.06	9.83
	其中：债券	92,792,826.06	9.83
	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	87,343,551.17	9.25
8	其他各项资产	12,316,058.22	1.30
9	合计	943,853,626.05	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	559,411,933.36	59.43

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	117,347,189.34	12.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,499,713.07	5.47
J	金融业	22,555,200.00	2.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	40,699.23	0.00
M	科学研究和技术服务业	63,858.51	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	272,976.40	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	751,401,190.60	79.82

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港股通投资股票。

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	1,588,800	83,936,304.00	8.92
2	002415	海康威视	2,080,000	75,296,000.00	8.00
3	603986	兆易创新	478,708	68,077,064.68	7.23
4	300274	阳光电源	488,800	48,024,600.00	5.10
5	601012	隆基绿能	713,720	47,555,163.60	5.05
6	002459	晶澳科技	583,160	42,658,154.00	4.53
7	002153	石基信息	2,580,000	40,944,600.00	4.35
8	300363	博腾股份	518,000	40,398,820.00	4.29
9	688599	天合光能	618,839	40,379,244.75	4.29
10	603233	大参林	1,065,647	33,354,751.10	3.54
11	300750	宁德时代	55,800	29,797,200.00	3.17
12	688390	固德威	88,000	27,544,880.00	2.93
13	603915	国茂股份	1,180,000	24,768,200.00	2.63
14	002466	天齐锂业	188,000	23,462,400.00	2.49
15	002460	赣锋锂业	154,300	22,944,410.00	2.44
16	300059	东方财富	888,000	22,555,200.00	2.40

17	603501	韦尔股份	128,000	22,147,840.00	2.35
18	000830	鲁西化工	1,280,000	22,131,200.00	2.35
19	300763	锦浪科技	68,800	14,654,400.00	1.56
20	688111	金山办公	51,800	10,210,816.00	1.08
21	603187	海容冷链	147,600	5,394,780.00	0.57
22	688348	昱能科技	3,574	1,488,821.18	0.16
23	688349	三一重能	14,627	596,050.25	0.06
24	688120	华海清科	2,532	549,747.84	0.06
25	688234	天岳先进	4,442	289,573.98	0.03
26	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.03
27	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.03
28	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
29	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
30	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
31	301238	瑞泰新材	2,098	67,282.86	0.01
32	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
33	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.01
34	301217	铜冠铜箔	3,101	45,987.83	0.00
35	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
36	301236	软通动力	1,091	34,235.58	0.00
37	301216	万凯新材	1,087	32,436.08	0.00
38	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
39	301177	迪阿股份	403	29,902.60	0.00
40	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
41	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
42	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
43	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
44	301219	腾远钴业	274	24,062.68	0.00
45	301211	亨迪药业	967	20,964.56	0.00
46	001228	永泰运	383	20,739.45	0.00
47	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
48	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
49	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
50	301221	光庭信息	280	18,152.40	0.00
51	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
52	301096	百诚医药	224	17,696.00	0.00
53	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
54	300834	星辉环材	568	17,057.04	0.00
55	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
56	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
57	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
58	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00

59	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
60	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
61	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
62	301189	奥尼电子	435	14,489.85	0.00
63	301180	万祥科技	654	13,701.30	0.00
64	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
65	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
66	301118	恒光股份	315	13,554.45	0.00
67	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
68	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
69	301199	迈赫股份	402	12,880.08	0.00
70	301093	华兰股份	377	12,776.53	0.00
71	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
72	301179	泽宇智能	295	12,038.95	0.00
73	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
74	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
75	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
76	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
77	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
78	301185	鸥玛软件	578	10,687.22	0.00
79	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
80	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
81	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
82	301092	争光股份	323	10,161.58	0.00
83	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
84	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
85	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
86	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
87	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
88	301193	家联科技	297	8,063.55	0.00
89	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
90	301133	金钟股份	286	7,942.22	0.00
91	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
92	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
93	301182	凯旺科技	290	6,890.40	0.00
94	605555	德昌股份	77	1,961.19	0.00
95	603213	镇洋发展	99	1,482.03	0.00
96	688718	唯赛勃	7	123.34	0.00
97	688283	坤恒顺维	2	95.34	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	688599	天合光能	65,075,556.68	5.20
2	601012	隆基绿能	59,957,931.00	4.79
3	300274	阳光电源	40,346,628.87	3.22
4	002459	晶澳科技	28,000,020.46	2.24
5	300059	东方财富	25,869,097.98	2.07
6	002475	立讯精密	23,437,399.80	1.87
7	002415	海康威视	23,200,660.04	1.85
8	603501	韦尔股份	21,432,723.00	1.71
9	300763	锦浪科技	19,483,987.00	1.56
10	300363	博腾股份	18,922,807.00	1.51
11	300750	宁德时代	16,326,211.60	1.30
12	002466	天齐锂业	15,879,973.00	1.27
13	688032	禾迈股份	13,634,739.19	1.09
14	603233	大参林	13,038,550.84	1.04
15	601111	中国国航	11,217,066.00	0.90
16	688390	固德威	10,998,545.28	0.88
17	300699	光威复材	10,515,093.00	0.84
18	603986	兆易创新	9,172,866.92	0.73
19	002153	石基信息	8,199,581.00	0.66
20	002460	赣锋锂业	7,815,470.00	0.62

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	300763	锦浪科技	52,584,290.00	4.20
2	000830	鲁西化工	37,359,953.76	2.99
3	300363	博腾股份	32,608,076.00	2.61
4	688599	天合光能	31,861,911.90	2.55
5	300699	光威复材	28,578,563.50	2.28
6	601012	隆基绿能	28,140,133.40	2.25
7	300274	阳光电源	25,404,546.00	2.03
8	603799	华友钴业	24,316,675.56	1.94
9	000776	广发证券	24,272,947.00	1.94
10	300896	爱美客	23,024,586.70	1.84
11	300215	电科院	22,236,963.00	1.78

12	688390	固德威	21,677,447.75	1.73
13	300750	宁德时代	18,289,897.00	1.46
14	002466	天齐锂业	17,935,075.00	1.43
15	300416	苏试试验	17,344,834.25	1.39
16	002475	立讯精密	16,785,685.07	1.34
17	300911	亿田智能	16,766,700.78	1.34
18	688032	禾迈股份	14,585,340.25	1.17
19	002727	一心堂	12,559,846.13	1.00
20	603986	兆易创新	12,547,673.58	1.00

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	491,142,416.36
卖出股票收入（成交）总额	585,515,742.08

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	19,927,915.22	2.12
	其中：政策性金融债	19,927,915.22	2.12
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）	72,864,910.84	7.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	92,792,826.06	9.86

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	123060	苏试转债	147,502	28,150,655.67	2.99
2	123071	天能转债	148,000	26,189,001.42	2.78
3	2203679	22 进出 679	200,000	19,927,915.22	2.12

4	113585	寿仙转债	93,130	18,525,253.75	1.97
---	--------	------	--------	---------------	------

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 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股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	483,837.96
2	应收清算款	11,592,117.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	240,103.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,316,058.22

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	------	---------------

1	123060	苏试转债	28,150,655.67	2.99
2	123071	天能转债	26,189,001.42	2.78
3	113585	寿仙转债	18,525,253.75	1.97

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002459	晶澳科技	42,658,154.00	4.53	非公开发行流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
18,026	18,663.24	281,608,737.68	83.71	54,814,761.12	16.29

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	380,179.71	0.1130

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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 7 月 15 日) 基金份额总额	679,121,902.68
本报告期期初基金份额总额	410,631,755.56
本报告期基金总申购份额	148,652,854.37
减：本报告期基金总赎回份额	222,861,111.13

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	336,423,498.80

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。
2. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华安证券	2	552,098,001.55	55.94	511,172.55	55.90	-
申万宏源	1	300,629,365.17	30.46	279,976.03	30.61	-
海通证券	1	80,981,116.21	8.21	73,820.85	8.07	-
华宝证券	1	53,208,573.14	5.39	49,553.09	5.42	-

川财证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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华宝证券一个席位。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华安证券	24,099,905.31	17.66	-	-	-	-
申万宏源	55,409,485.60	40.61	-	-	-	-
海通证券	48,288,930.98	35.39	-	-	-	-
华宝证券	8,630,440.26	6.33	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

注：债券交易的成交金额按净价统计，其中交易所上市实行全价交易的债券成交金额按全价统计。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华富基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定媒介	2022年1月5日
2	华富基金管理有限公司旗下基金2021年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022年1月21日

3	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2022 年 1 月 21 日
4	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	2022 年 1 月 29 日
5	华富基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 31 日
6	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年度报告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 31 日
7	华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2022 年 4 月 22 日
8	华富基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 5 月 13 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富价值增长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

2022 年 8 月 31 日