

# 华富灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 06 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	5
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	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39

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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</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.....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华富灵活配置混合
基金主代码	000398
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 7 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	130,460,899.46 份
基金合同存续期	不定期

### 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×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均预期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	郭明
	联系电话	021-68886996	(010) 66105799
	电子邮箱	manzh@hffund.com	custody@icbc.com.cn
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		赵万里	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	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-625,041.88
本期利润	-30,069,126.51
加权平均基金份额本期利润	-0.2272
本期加权平均净值利润率	-19.74%
本期基金份额净值增长率	-19.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	24,151.32
期末可供分配基金份额利润	0.0002
期末基金资产净值	130,485,050.78
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	48.21%

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。

### 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	-3.01%	1.23%	0.88%	0.52%	-3.89%	0.71%
过去三个月	-16.94%	1.39%	-2.53%	0.49%	-	0.90%
过去六个月	-19.55%	1.34%	0.50%	0.51%	-	0.83%
过去一年	-6.19%	1.55%	-7.25%	0.59%	20.05%	1.06%

过去三年	9.55%	0.99%	0.67%	0.72%	8.88%	0.27%
自基金合同生效起至今	48.21%	0.70%	62.73%	0.86%	14.52%	-0.16%

注：业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×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：1、本基金从 2014 年 8 月 7 日起正式转型为华富灵活配置混合型证券投资基金。

2、根据《华富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票资产占基金资产的 0%-95%；债券、货币市场工具、资产支持证券等固定收益类资产占基金资产的 5%-100%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。其中，基金保留的现金或投资于到期日在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%。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。本基金投资转型期为 2014 年 8 月 7 日到 2015 年 2 月 7 日，投资转型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《华富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

## § 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2023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、华富中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、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、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业50指数增强型证券投资基金、华富吉富30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富匠心领航18个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金共六十只基金。

#### 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		
李孝华	本基金基金经理	2022 年 9 月 5 日	-	十年	南开大学金融学硕士、硕士研究生学历。曾任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰信息技术有限公司量化投资平台设计与开发员、华泰柏瑞基金基金经理助理。2019 年 10 月加入华富基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2021 年 5 月 7 日起任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 28 日起任华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 17 日起任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 5 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任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基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 24 日起任华富永鑫灵活配置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《证券投资基金经营机构董事、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

今年上半年 A 股市场在低位震荡，分月度来看，市场 1 月表现较佳，迎来开门红，随后在接下来几个月出现弱势震荡调整，市场情绪也随之处于底部区域。期间沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板指分别录得-0.75%、2.29%、5.1%和-5.61%的投资收益，中小市值板块相对而言表现较佳，市场似乎又重新回到了以小为美的时代。分行业来看，通信、传媒、计算机、机械及家电等板块表现居前，商贸零售、食品饮料、美容护理、农林牧渔和社会服务等为代表的大消费板块则受市场信心拖累表现落后。由于上半年市场并未在底部走出阴霾，市场热点相对缺乏，“AI”和“中特估”成为为数不多的市场亮点。

本基金聚焦的以旅游板块为代表的出行链在上半年表现不佳，期间中证旅游指数大幅下跌 22.4%，在各主要行业及主题中表现靠后。究其原因，我们认为主要还是受到市场整体环境的拖累，该板块表现不理想的主要时间区间在二季度，其核心原因是投资者对经济复苏的力度存在一定程度的担心。旅游作为大消费中的可选消费板块，在市场对经济预期相对悲观的背景下，资金持续净流出，期间免税、景区、酒店餐饮及航空机场等细分子板块跌幅明显。

具体操作策略上，在刚刚过去的半年度中我们保持着连贯性，在个股选择上注重综合考虑公司基本面及估值匹配度，采用定量选股手段进行相应投资决策，取得了一定的投资效果。

#### 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 1.000 元，累计基金份额净值为 1.445 元。报告期，本基金份额净值增长率为-19.55%，同期业绩比较基准收益率为 0.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，我们对后市保持乐观，目前 A 股市场估值处于历史低位，许多板块及个股投资吸引力凸显。在每一轮的市场底部都会滋生不少悲观情绪，这不足为奇，投资者情绪总是很容易受过去刚经历的行情所影响。面对各类市场主体信心不足的现状，一系列政策措施纷纷出台，投资者的信心有望逐渐得以修复。未来市场什么时候能够回暖可能很难预测，但在底部区域逆市而行，加大对权益资产的配置将在未来大概率为我们带来不错的投资回报。

具体到旅游板块，市场上半年在聚焦过度交易预期的同时，却有意无意忽略了当前旅游板块的持续复苏态势。随着去年年底我国防疫政策优化，场景恢复带来居民出行和企业商务活动明显改善，从而进一步带动服务业需求的快速增长，今年以来，财新服务业 PMI 已经连续六个月处于扩张区间。已完整披露的 2023 年一季报业绩数据显示，不少旅游板块上市公司开始扭亏为盈或者亏损幅度大幅收窄，业绩改善明显；近期不少公司陆续披露了半年度业绩预告或定期报告，基本面修复势头依然强劲。大家日常出行的微观感受也能够证实这一点，该板块并不缺乏基本面，而是受到市场信心拖累导致股价表现不佳。我们认为，未来随着市场情绪的好转，旅游这类表现靠后的板块有望得以率先企稳回升。在投资方向上，鉴于对出行链板块的长期看好，本基金仍将继续保持该主题的定位。

最后，感谢各位持有人的信任，面对变幻莫测的宏观及市场环境，未来我们将继续以对持有人高度负责的态度保持对行业及个股的紧密思考与研究，力争将其转化为更优的净值表现，以回报大家的信任。

#### 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、督察长、副总经理、基金运营部负责人、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《华富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内未进行利润分配，本期利润为-30,069,126.51 元，期末可供

分配利润为 24,151.32 元。滚存至下一期进行分配。

#### 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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本基金的投资运作、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，托管人未发现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

本托管人依法对华富基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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：华富灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,135,135.05	16,655,128.66
结算备付金		48,376.16	40,914.44
存出保证金		63,005.27	3,135.65
交易性金融资产	6.4.7.2	123,676,296.01	176,636,113.70
其中：股票投资		123,676,296.01	176,636,113.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-

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	-	-
应收清算款		282,879.46	-
应收股利		-	-
应收申购款		709,442.38	4,224,985.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		131,915,134.33	197,560,278.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		-	-
应付清算款		221,677.44	4,374,723.75
应付赎回款		917,077.97	6,260,436.41
应付管理人报酬		159,178.57	112,935.85
应付托管费		26,529.75	18,822.66
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		418.97	418.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	105,200.85	338,963.34
负债合计		1,430,083.55	11,106,300.98
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	130,460,899.46	150,009,840.63
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	24,151.32	36,444,136.50
净资产合计		130,485,050.78	186,453,977.13
负债和净资产总计		131,915,134.33	197,560,278.11

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 130,460,899.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-28,712,321.14	872,695.52
1. 利息收入		21,146.34	55,355.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	21,146.34	26,876.25
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	28,478.97
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-932,780.00	595,702.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,006,047.19	-88.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	595,790.18
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	73,267.19	-
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）	6.4.7.16	-29,444,084.63	120,795.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,643,397.15	100,843.02
<b>减：二、营业总支出</b>		1,356,805.37	542,635.95
1. 管理人报酬		1,131,242.28	379,839.74
2. 托管费		188,540.37	63,306.66
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	33.39
8. 其他费用	6.4.7.19	37,022.72	99,456.16

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-30,069,126.51	330,059.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-30,069,126.51	330,059.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-30,069,126.51	330,059.57

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	150,009,840.63	-	36,444,136.50	186,453,977.13
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）	150,009,840.63	-	36,444,136.50	186,453,977.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,548,941.17	-	-36,419,985.18	-55,968,926.35
（一）、综合收益总额	-	-	-30,069,126.51	-30,069,126.51

(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)	-19,548,941.17	-	-6,350,858.67	-25,899,799.84
其中:				
1. 基金申购款	230,776,295.20	-	39,843,889.76	270,620,184.96
2. 基金赎回款	-250,325,236.37	-	-46,194,748.43	-296,519,984.80
(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)	130,460,899.46	-	24,151.32	130,485,050.78
项目	上年度可比期间			
	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	154,239,904.33	-	4,738,718.81	158,978,623.14

净资产 (基金 净值)				
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)	154,239,904.33	-	4,738,718.81	158,978,623.14
三、本 期增减 变动额 (减少 以“-” 号填 列)	-150,374,828.20	-	-4,485,380.51	-154,860,208.71
(一)、 综合收 益总额	-	-	330,059.57	330,059.57
(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)	-150,374,828.20	-	-4,815,440.08	-155,190,268.28
其中： 1. 基金 申购款	992,021.41	-	37,450.63	1,029,472.04
2 . 基金 赎回款	-151,366,849.61	-	-4,852,890.71	-156,219,740.32
(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）	3,865,076.13	-	253,338.30	4,118,414.43

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

华富灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）系由华富恒鑫债券型证券投资基金转型，经中国证监会中国证监会证券投资基金机构监管部《关于华富恒鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（证券投资基金机构监管部部函〔2014〕922号）的确认，基金合同于2014年8月7日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。基金管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人中国工商银行股份有限公司。

根据《华富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票）、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、中小企业私募债等）、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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

##### 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。

(五) 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,135,135.05
等于：本金	7,134,372.59
加：应计利息	762.46
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	7,135,135.05

注：“其他存款”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。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	148,022,031.89	-	123,676,296.01	-24,345,735.88
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	148,022,031.89	-	123,676,296.01	-24,345,735.88

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,533.84
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	79,490.62
其中：交易所市场	79,490.62
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	14,876.39
中债账户维护费	4,500.00
上清账户维护费	4,800.00
合计	105,200.85

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,009,840.63	150,009,840.63
本期申购	230,776,295.20	230,776,295.20
本期赎回（以“-”号填列）	-250,325,236.37	-250,325,236.37
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	130,460,899.46	130,460,899.46

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
上年度末	34,459,776.30	1,984,360.20	36,444,136.50
本期利润	-625,041.88	-29,444,084.63	-30,069,126.51
本期基金份额交易产生的变动数	-4,866,481.52	-1,484,377.15	-6,350,858.67
其中：基金申购款	54,383,260.93	-14,539,371.17	39,843,889.76
基金赎回款	-59,249,742.45	13,054,994.02	-46,194,748.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,968,252.90	-28,944,101.58	24,151.32

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	活期存款利息收入
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	2,718.16
其他	401.35

合计	21,146.34
----	-----------

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。

#### 6.4.7.10 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,006,047.19
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	-1,006,047.19

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	142,223,928.12
减：卖出股票成本总额	142,823,820.98
减：交易费用	406,154.33
买卖股票差价收入	-1,006,047.19

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

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

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	73,267.19
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	73,267.19

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-29,444,084.63
股票投资	-29,444,084.63
债券投资	-
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	-29,444,084.63

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,621,288.90
基金转换费收入	22,108.25
合计	1,643,397.15

#### 6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	3,546.33
账户维护费	18,600.00
合计	37,022.72

#### 6.4.7.20 分部报告

无。

#### 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
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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	71,964,163.53	27.57	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	-	173,341.50	0.54

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

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间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 2023年1月1日至2023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	66,774.69	27.51	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,131,242.28	379,839.74
其中：支付销售机构的客户维护费	464,060.03	12,557.35

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	188,540.37	63,306.66

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 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

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 8 月 7 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	5,943,432.41	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
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	5,943,432.41	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

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

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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 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	7,135,135.05	18,026.83	404,925.46	26,599.09

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

#### 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（2023 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
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	365	2,401.70	2,766.70	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	46	1,195.08	1,128.38	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	83	1,210.14	1,338.79	-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	402	4,864.20	4,852.14	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	1,304	7,419.76	7,054.64	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	92	3,127.08	2,713.08	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	138	5,518.62	5,065.98	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	174	3,683.58	4,089.00	-

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

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债券。

#### 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 2023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	7,135,135.05	-	-	-	-	-	7,135,135.05
结算备付金	48,376.16	-	-	-	-	-	48,376.16
存出保证金	63,005.27	-	-	-	-	-	63,005.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	123,676,296.01	123,676,296.01
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	-	-	-	-	-	709,442.38	709,442.38
应收清算款	-	-	-	-	-	282,879.46	282,879.46
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,246,516.48	-	-	-	-	-124,668,617.85	131,915,134.33
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	917,077.97	917,077.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	159,178.57	159,178.57
应付托管费	-	-	-	-	-	26,529.75	26,529.75
应付清算款	-	-	-	-	-	221,677.44	221,677.44
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	-	-	-	-	-	418.97	418.97
其他负债	-	-	-	-	-	105,200.85	105,200.85
负债总计	-	-	-	-	-	1,430,083.55	1,430,083.55
利率敏感度缺口	7,246,516.48	-	-	-	-	-123,238,534.30	130,485,050.78
上年度末 2022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	16,655,128.66	-	-	-	-	-	16,655,128.66
结算备付金	40,914.44	-	-	-	-	-	40,914.44
存出保证金	3,135.65	-	-	-	-	-	3,135.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-176,636,113.70	176,636,113.70
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	-	-	-	-	-	4,224,985.66	4,224,985.66
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,699,178.75	-	-	-	-	-180,861,099.36	197,560,278.11
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,260,436.41	6,260,436.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	112,935.85	112,935.85
应付托管费	-	-	-	-	-	18,822.66	18,822.66
应付清算款	-	-	-	-	-	4,374,723.75	4,374,723.75

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	-	-	-	-	-	418.97	418.97
其他负债	-	-	-	-	-	338,963.34	338,963.34
负债总计	-	-	-	-	-	11,106,300.98	11,106,300.98
利率敏感度缺口	16,699,178.75	-	-	-	-	-169,754,798.38	186,453,977.13

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 基点	-	-
	市场利率下降 25 基点	-	-

注：未持有债券类资产，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 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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	123,676,296.01	94.78	176,636,113.70	94.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	123,676,296.01	94.78	176,636,113.70	94.73

#### 6.4.13.4.3.2 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 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
分析	沪深 300 指数上升百分之五	5,113,181.82	5,163,179.41
	沪深 300 指数下降百分之五	-5,113,181.82	-5,163,179.41

#### 6.4.13.4.4 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 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
		合计	26,498,466.45

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	123,647,287.30	176,636,113.70
第二层次	-	-
第三层次	29,008.71	-
合计	123,676,296.01	176,636,113.70

##### 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

本基金本报告期及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 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	123,676,296.01	93.75

	其中：股票	123,676,296.01	93.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	7,183,511.21	5.45
8	其他各项资产	1,055,327.11	0.80
9	合计	131,915,134.33	100.00

## 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	124,642.93	0.10
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	3,554,778.70	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	45,887,825.00	35.17
H	住宿和餐饮业	24,355,698.30	18.67
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,305.08	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,057,440.00	1.58
L	租赁和商务服务业	21,203,157.00	16.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,270,129.00	14.00
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	8,206,320.00	6.29
S	综合	-	-
	合计	123,676,296.01	94.78

### 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	601888	中国中免	103,200	11,406,696.00	8.74
2	600009	上海机场	181,700	8,252,814.00	6.32
3	300144	宋城演艺	661,800	8,206,320.00	6.29
4	600754	锦江酒店	192,400	8,146,216.00	6.24
5	601111	中国国航	780,200	6,428,848.00	4.93
6	600258	首旅酒店	326,300	6,183,385.00	4.74
7	600029	南方航空	924,200	5,572,926.00	4.27
8	601021	春秋航空	93,900	5,396,433.00	4.14
9	600004	白云机场	315,300	4,521,402.00	3.47
10	600115	中国东航	931,700	4,434,892.00	3.40
11	600138	中青旅	340,600	4,260,906.00	3.27
12	603885	吉祥航空	271,400	4,187,702.00	3.21
13	601007	金陵饭店	386,990	3,297,154.80	2.53
14	002033	丽江股份	282,000	3,068,160.00	2.35
15	605108	同庆楼	82,030	2,739,802.00	2.10
16	000888	峨眉山 A	238,300	2,730,918.00	2.09
17	301073	君亭酒店	71,250	2,589,937.50	1.98
18	600859	王府井	130,200	2,576,658.00	1.97
19	603136	天目湖	98,500	2,541,300.00	1.95
20	600054	黄山旅游	192,300	2,461,440.00	1.89
21	000524	岭南控股	193,700	2,074,527.00	1.59
22	000069	华侨城 A	467,600	2,057,440.00	1.58
23	002928	华夏航空	241,600	2,041,520.00	1.56
24	000089	深圳机场	290,500	2,018,975.00	1.55
25	600897	厦门空港	86,200	1,783,478.00	1.37
26	603199	九华旅游	47,300	1,634,215.00	1.25
27	002707	众信旅游	174,400	1,313,232.00	1.01
28	600826	兰生股份	127,500	1,309,425.00	1.00
29	002059	云南旅游	181,700	1,146,527.00	0.88
30	000428	华天酒店	243,000	1,015,740.00	0.78
31	000610	西安旅游	59,200	1,003,440.00	0.77
32	600153	建发股份	89,400	975,354.00	0.75
33	300795	米奥会展	20,100	838,371.00	0.64
34	000978	桂林旅游	105,300	792,909.00	0.61
35	600749	西藏旅游	56,800	753,736.00	0.58
36	002159	三特索道	38,800	705,772.00	0.54

37	600706	曲江文旅	34,300	613,627.00	0.47
38	603099	长白山	38,000	487,160.00	0.37
39	603069	海汽集团	23,800	448,154.00	0.34
40	600377	宁沪高速	43,600	428,588.00	0.33
41	000721	西安饮食	31,100	383,463.00	0.29
42	000430	张家界	42,700	330,925.00	0.25
43	603128	华贸物流	35,400	322,494.00	0.25
44	002867	周大生	4,600	81,788.00	0.06
45	002352	顺丰控股	1,100	49,599.00	0.04
46	300782	卓胜微	200	19,326.00	0.01
47	002230	科大讯飞	200	13,592.00	0.01
48	688469	中芯集成	1,304	7,054.64	0.01
49	688484	南芯科技	138	5,065.98	0.00
50	688352	颀中科技	402	4,852.14	0.00
51	688552	航天南湖	174	4,089.00	0.00
52	601061	中信金属	365	2,766.70	0.00
53	688479	友车科技	92	2,713.08	0.00
54	603172	万丰股份	83	1,338.79	0.00
55	603125	常青科技	46	1,128.38	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	601888	中国中免	17,021,854.00	9.13
2	600754	锦江酒店	9,526,663.29	5.11
3	300144	宋城演艺	8,360,996.00	4.48
4	600009	上海机场	6,507,086.92	3.49
5	600258	首旅酒店	4,914,012.00	2.64
6	600859	王府井	4,538,378.00	2.43
7	601007	金陵饭店	3,495,296.00	1.87
8	301073	君亭酒店	3,449,115.00	1.85
9	600004	白云机场	3,394,663.00	1.82
10	601111	中国国航	3,286,733.00	1.76
11	600029	南方航空	3,116,158.00	1.67
12	600138	中青旅	3,011,993.00	1.62
13	605108	同庆楼	2,974,274.70	1.60
14	603136	天目湖	2,737,851.05	1.47
15	601021	春秋航空	2,709,726.00	1.45
16	600115	中国东航	2,671,709.00	1.43
17	000524	岭南控股	2,523,250.00	1.35
18	002928	华夏航空	2,466,121.50	1.32
19	600054	黄山旅游	2,034,563.00	1.09

20	000428	华天酒店	2,028,394.00	1.09
----	--------	------	--------------	------

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	601888	中国中免	6,177,962.00	3.31
2	605108	同庆楼	5,924,674.00	3.18
3	600754	锦江酒店	5,706,130.00	3.06
4	600859	王府井	5,561,172.00	2.98
5	000428	华天酒店	5,502,868.00	2.95
6	300144	宋城演艺	4,676,798.93	2.51
7	600004	白云机场	4,541,661.00	2.44
8	600706	曲江文旅	4,541,074.00	2.44
9	301073	君亭酒店	4,376,677.00	2.35
10	002707	众信旅游	4,359,813.00	2.34
11	600029	南方航空	3,964,638.00	2.13
12	600138	中青旅	3,895,975.00	2.09
13	000524	岭南控股	3,877,897.00	2.08
14	002928	华夏航空	3,859,229.00	2.07
15	603069	海汽集团	3,847,906.00	2.06
16	600009	上海机场	3,753,571.00	2.01
17	300795	米奥会展	3,656,108.00	1.96
18	601111	中国国航	3,651,705.00	1.96
19	600258	首旅酒店	3,543,575.00	1.90
20	603885	吉祥航空	3,523,121.00	1.89

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	119,308,087.92
卖出股票收入（成交）总额	142,223,928.12

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

注：本基金本报告期末无债券投资。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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。

### 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

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 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中，中国国际航空股份有限公司、北京首旅酒店(集团)股份有限公司曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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	63,005.27
2	应收清算款	282,879.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	709,442.38

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,055,327.11

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
13,190	9,890.89	9,659,851.59	7.40	120,801,047.87	92.60

#### 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	140,582.28	0.1078

#### 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	0~10

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2014 年 8 月 7 日) 基金份额总额	41,515,113.95
本报告期期初基金份额总额	150,009,840.63
本报告期基金总申购份额	230,776,295.20
减：本报告期基金总赎回份额	250,325,236.37
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	130,460,899.46
-------------	----------------

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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	

华泰证券	2	82,195,300.15	31.49	76,388.66	31.47	-
华安证券	2	71,964,163.53	27.57	66,774.69	27.51	-
德邦证券	1	45,677,539.44	17.50	42,539.96	17.53	-
长城证券	1	29,476,636.96	11.29	27,451.49	11.31	-
开源证券	2	21,722,976.06	8.32	20,230.78	8.34	-
西南证券	2	5,349,818.00	2.05	4,982.25	2.05	-
天风证券	1	4,655,665.05	1.78	4,335.68	1.79	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金融证券	1	-	-	-	-	-
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)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。

3)本报告期本基金新增开源证券、信达证券等交易单元，退租华泰证券交易单元。

### 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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 证券	-	-	-	-	-	-
中银国	-	-	-	-	-	-

际						
---	--	--	--	--	--	--

## 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	华富灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒 介	2023 年 1 月 10 日
2	华富灵活配置混合型证券投资基金 2022 年度报告	中国证监会指定披露媒 介	2023 年 3 月 31 日
3	华富灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒 介	2023 年 4 月 21 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者 类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额 比例达到或者 超过 20%的时 间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额 占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

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、华富灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富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

2023 年 8 月 30 日