# 华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华富基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2018年8月25日

## §1 重要提示

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华富国泰民安灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 000767 |
| 交易代码 | 000767 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年2月4日 |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 127,951,903.24份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金将从与国泰民安主题相关的证券中精选优质标的进行投资,分享我国国泰民安领域未来发展的红利,力求取得超额收益。 |
| 投资策略 | 本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济、证券市场以及国泰民安相关行业的发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。 |

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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 溥志弘 | 胡婕 |
| | 联系电话 | 021-61618888 | 021-61618888 |
| | 电子邮箱 | marzzh@hffund.com | Hu548@pdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-700-8001 | 95528 |
| 传真 | | 021-68887997 | 021-63602540 |

2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.hffund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的办公场所 |

## §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(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -2,090,909.47 |
| 本期利润 | -16,269,110.78 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1232 |
| 本期基金份额净值增长率 | -11.99% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0308 |
| 期末基金资产净值 | 124,009,780.45 |
| 期末基金份额净值 | 0.969 |

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。

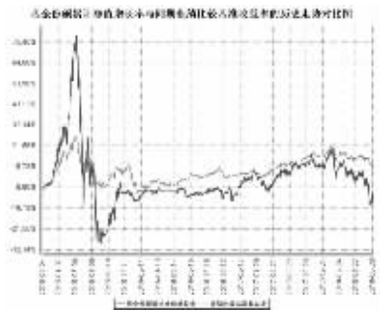
3.2 基金净值表现

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 | -6.10% | 2.18% | -3.54% | 0.64% | -2.56% | 1.54% |
| 过去三个月 | -10.69% | 1.64% | -3.98% | 0.57% | -6.71% | 1.07% |
| 过去六个月 | -11.99% | 1.52% | -4.46% | 0.58% | -7.53% | 0.94% |
| 过去一年 | -7.27% | 1.19% | 0.18% | 0.47% | -7.45% | 0.72% |
| 过去三年 | -28.65% | 1.72% | -4.35% | 0.74% | -24.30% | 0.98% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.10% | 1.83% | 10.90% | 0.80% | -14.00% | 1.03% |

注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*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



注:根据《华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,股票投资占基金资产的比例范围为0-95%,投资于本合同界定的国泰民安相关证券不低于非现金基金资产的80%;其余资产投资于债券、权证、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;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2015年2月4日到2015年8月4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《华富国泰民安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、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股(集团)有限公司。截止2018年6月30日,本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富18个月定期开放债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金、华富富瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒悦定期开放债券型证券投资基金共三十七只基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 龚伟 | 华富国泰民安灵活配置混合型基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金经理、华富竞争力优选混合型基金经理、华富成长趋势混合型基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理、华富恒利债券型基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金经理、华富物联世界灵活配置混合型基金基金经理、华富量子生命力混合型基金基金经理、公司公募投资决策委员会主席、公司副总经理 | 2015年2月4日 | - | 十四年 | 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、天治创新市场投票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资总监,2012年3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17日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。 |
| 张亮 | 华富国泰民安灵活配置混合型基金经理 | 2015年2月27日 | - | 八年 | 上海交通大学材料加工工程学硕士,研究生学历。曾任天治基金管理有限公司行业研究员,2013年7月加入华富基金管理有限公司,先后担任研究发展部行业研究员,华富竞争力优选混合型基金基金经理助理。 |

注:龚伟的任职日期指该基金成立之日,张亮的任职日期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

2018年上半年,宏观经济继续受益上一年供给侧改革、基建地产投资、净出口改善等因素延续了一定韧性,但是在二季度开始出现放缓迹象。2018年上半年全国规模以上工业增加值同比增长6.7%,增速较一季度放缓 0.1个百分点,较去年全年加快0.1个百分点,41个工业大类行业中有38个行业增加值保持同比增长。其中,汽车、烟草、医药、专用设备、计算机、电力等行业增速较快,同比分别增长10.1%、10.7%、10.9%、11.1%、12.4%和10.3%。从数据上看,宏观经济变化很小,但市场的预期变化非常大, 并且比实体经济呈现的数字要悲观很多。尤其在贸易战的威胁下,经济下滑成了市场比较强的预期。

二级市场在上半年经历了一次较大幅度的下跌,其中上证综指-13.9%,深证成指-15.04%,中小板指-14.26%,创业板指-8.33%,沪深300指数-12.9%,呈现出普跌的现象。尤其是2018年二季度,上证综指跌10.14%,沪深300跌9.94%,深圳成指跌13.7%,创业板指跌15.46%,各个指数都呈现明显的跌幅,从下跌幅度看,五月下旬以来的下跌,堪比2015年的股灾和2016年的熔断。经济下滑的预期和贸易战的阴霾主导了市场的走势, 风险偏好不断降低, 从市场抱团消费再到市场全面回调,到二季度末,市场已经没有上涨的行业,所有行业都出现不同程度下跌。

本基金通过自下而上的行业和个股的选择,积极参与市场的结构性机会。上半年重点配置行业包括金融、房地产、机械、计算机、电子、新能源车等。阶段性收益明显。但市场在五月下旬后遭到系统性风险,很多非常有价值的股票遭到集中抛售,除了医药和食品饮料,其余行业跌幅都很大,基金净值也遭受比较大的回撤。

此次中美贸易战也让我们认识到在高端制造业上我们仍然有较大短板, 随着国家对高端制造, 科技创新类企业的支持力越来越大, 更多的投资机会将逐渐浮现。

我们也将从TMT、机械等行业中寻找具备自身技术产品优势的公司深入研究。随着补贴政策的变化、随着新车型的不断推出,新能源车存在进入市场化发展的机会,届时产业链上优势存活企业将有长期发展机会,我们也将持续跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2015年2月4日正式成立。截止2018年6月30日, 本基金份额净值为0.969元,累计份额净值为0.969元。报告期,本基金份额净值增长率为-11.99%,同期业绩比较基准收益率为-4.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,经济可能小幅下滑,市场对经济的悲观预期可能继续维持,但考虑到市场风险偏好仍然在相对低位,市场仍以结构性行情为主,消费仍是全年的主线。国债收益率已经大幅下行,科技类股票将受益这一下行过程,在独角兽回归A股的背景下,科技股可能是三季度的主线。对于蓝筹白马,去年涨幅巨大,一些业绩跟不上的公司可能面临较大的压力,而业绩向好的公司,在前期风险释放以后,价值凸显,需要详细甄别。

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《华富国泰民安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-16,269,110.78元,期末可供分配利润为-3,942,122.79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,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,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

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核, 未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配 。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内, 由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、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:华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 2,218,222.92 | 50,950,306.95 |
| 结算备付金 | | 208,017.76 | 433,286.58 |
| 存出保证金 | | 159,836.72 | 273,694.01 |
| 交易性金融资产 | | 119,984,689.62 | 119,471,707.78 |
| 其中:股票投资 | | 113,969,920.02 | 113,434,019.98 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 6,014,769.60 | 6,037,687.80 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,852,587.37 | - |
| 应收利息 | | 56,883.06 | 179,226.49 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 16,391.62 | 28,812.99 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 124,496,689.07 | 171,337,036.80 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 40,463.94 | 334,756.77 |
| 应付管理人报酬 | | 156,224.77 | 221,994.60 |
| 应付托管费 | | 26,037.44 | 36,999.09 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 114,871.44 | 223,873.29 |
| 应交税费 | | 1.73 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 148,309.30 | 310,025.68 |
| 负债合计 | | 485,908.62 | 1,127,643.43 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 127,951,903.24 | 154,641,984.57 |
| 未分配利润 | | -3,942,122.79 | 15,567,408.80 |
| 所有者权益合计 | | 124,009,780.45 | 170,209,393.37 |
| 负债和所有者权益总计 | | 124,496,689.07 | 171,337,036.80 |

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.969元,基金份额总额127,951,903.24份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -14,199,415.90 | 15,637,065.65 |
| 1.利息收入 | | 264,776.91 | 453,736.54 |
| 其中:存款利息收入 | | 151,333.08 | 453,736.54 |
| 债券利息收入 | | 113,443.83 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | -298,067.43 | 4,171,009.60 |
| 其中:股票投资收益 | | -632,383.36 | 3,505,204.16 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 65,587.58 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 468,728.35 | 665,805.44 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | -14,178,201.31 | 10,989,692.22 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | | 12,073.93 | 22,727.29 |
| 减:二、费用 | | 2,069,694.88 | 2,605,086.80 |
| 1、管理人报酬 | 6.4.8.2.1 | 1,087,385.44 | 1,462,742.10 |
| 2、托管费 | 6.4.8.2.2 | 181,230.94 | 243,790.34 |
| 3、销售服务费 | | - | - |
| 4、交易费用 | | 642,125.48 | 734,349.12 |
| 5、利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6、其他费用 | | 158,952.84 | 164,205.24 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | -16,269,110.78 | 13,031,978.85 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | -16,269,110.78 | 13,031,978.85 |

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:华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 154,641,984.57 | 15,567,408.80 | 170,209,393.37 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | -16,269,110.78 | -16,269,110.78 |
| 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) | -26,690,081.33 | -3,240,420.81 | -29,930,502.14 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,317,642.06 | 161,464.36 | 2,479,106.41 |
| 2.基金赎回款 | -29,007,723.38 | -3,401,885.17 | -32,409,608.55 |
| 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) | 127,951,903.24 | -3,942,122.79 | 124,009,780.45 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 185,040,384.25 | -4,948,363.56 | 180,092,020.69 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 13,031,978.85 | 13,031,978.85 |
| 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) | 28,174,794.93 | 1,592,124.16 | 29,766,919.09 |
| 其中:1.基金申购款 | 55,422,526.50 | 2,462,881.71 | 57,885,408.21 |
| 2.基金赎回款 | -27,247,731.57 | -870,757.55 | -28,118,489.12 |
| 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) | 213,215,179.18 | 9,675,739.45 | 222,890,918.63 |

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

_____章宏韬_____ _____余海春_____ ____陈大毅____

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

华富国泰民安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[2014]793号)核准,基金合同于2015年2月4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(2015)6-14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, 基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富国泰民安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,包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及法律法规或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的规定)。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。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

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

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

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

(三) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

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

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华富基金管理有限公司 | 基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构 |
| 华安证券股份有限公司("华安证券") | 基金管理人的股东、代销机构 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 华安证券 | 64,467,947.73 | 14.94% | 52,075,400.38 | 10.65% |

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 华安证券 | 1,085,094.00 | 12.61% | - | - |

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华安证券 | 59,362.88 | 15.01% | 27,346.53 | 23.81% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华安证券 | 47,708.37 | 10.61% | - | - |

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,087,385.44 | 1,462,742.10 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 348,722.59 | 493,677.24 |

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×年管理费率÷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)。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 181,230.94 | 243,790.34 |

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×年托管费率÷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)。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 2,218,222.92 | 146,419.41 | 81,057,556.13 | 448,068.79 |

注:本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末( 2018年6月30日 )本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 | 113,969,920.02 | 91.56 |
| | 其中:股票 | 113,969,920.02 | 91.56 |
| 2 | 固定收益投资 | 6,014,769.60 | 4.83 |
| | 其中:债券 | 6,014,769.60 | 4.83 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,426,240.68 | 1.95 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,084,758.77 | 1.67 |
| 8 | 合计 | 124,495,689.07 | 100.00 |

注:本表列示的其他各项资产详见7.12.3 期末其他各项资产构成。7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 5,454,960.00 | 4.40 |
| B | 采矿业 | 2,704,692.00 | 2.18 |
| C | 制造业 | 66,102,576.31 | 53.30 |
| 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 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 5,794,847.52 | 4.67 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,611,469.05 | 17.43 |
| J | 金融业 | 5,088,025.14 | 4.10 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,213,360.00 | 5.82 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 113,969,920.02 | 91.90 |

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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600845 | 宝信软件 | 260,321 | 6,859,468.35 | 5.53 |
| 2 | 000977 | 浪潮信息 | 296,900 | 6,842,568.00 | 5.52 |
| 3 | 600754 | 锦江股份 | 156,767 | 5,794,847.52 | 4.67 |
| 4 | 002458 | 益生股份 | 311,712 | 5,454,960.00 | 4.40 |
| 5 | 600195 | 中牧股份 | 263,682 | 5,128,614.90 | 4.14 |
| 6 | 601009 | 南京银行 | 658,218 | 5,088,025.14 | 4.10 |
| 7 | 002008 | 大族激