华富安福保本混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富安福保本混合
交易代码	002412
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月23日
报告期末基金份额总额	159,068,820.83份
投资目标	本基金采取恒定比例组合保险策略CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance),通过动态调整资产组合,在确保本金安全的前提下,力争实现保本周期内基金资产的稳定增值。
投资策略	根据恒定比例组合保险原理,本基金将根据市场的波动、组合安全垫(即基金净资产超过基金价值底线的数额)的大小动态调整保本资产与风险资产投资的比例,通过对保本资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全,通过对收益资产的投资寻求保本周期间资产的稳定增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	241,000.63
2.本期利润	2,105,883.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0126
4.期末基金资产净值	161,312,163.52
5.期末基金份额净值	1.014

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、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

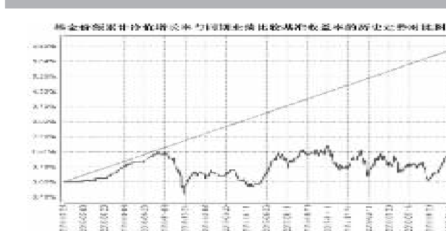
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	1.20%	0.05%	0.65%	0.01%	0.55%	0.04%

注:业绩比较基准收益率=三年期银行定期存款收益率(税后),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《华富安福保本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、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或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%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为2016年3月23日到2016年9月23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《华富安福保本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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张惠	华富安福保本混合型基金基金经理、华富星玉衡一年定期开放混合型基金基金经理、华富安享债券型基金基金经理、华富恒利债券型基金基金经理、华富保本混合型基金基金经理、华富益鑫灵活配置混合型基金基金经理	2018年8月28日	-	十一年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历,2007年6月加入华富基金管理有限公司,先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员,2012年5月21日至2014年3月19日任华富策略精选混合型基金基金经理助理,2014年3月20日至2014年11月18日任华富保本混合型基金基金经理助理,2016年6月28日至2017年7月5日任华富灵活配置混合型基金基金经理,2015年3月16日至2018年5月31日任华富旺财保本混合型基金基金经理,2016年11月17日至2018年6月19日任华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理,2016年8月26日至2018年8月1日任华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理。
胡伟	-	2016年3月23日	2018年9月14日	十四年	中南财经政法大学经济学学士、本科学历,曾任珠海市商业银行资金营运部交易员,从事债券研究及债券交易工作,2006年11月加入华富基金管理有限公司,曾任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监,2009年10月19日至2014年11月17日任华富货币市场基金基金经理、2013年12月18日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金(原为华富恒鑫)基金经理,2016年6月28日至2017年7月4日任华富灵活配置混合型基金基金经理、2015年3月16日至2018年5月31日任华富旺财保本混合型基金基金经理、2013年4月24日至2018年9月14日任华富保本混合型基金基金经理、2014年5月7日至2018年9月26日任华富恒财定期开放债券型基金基金经理、2017年11月22日至2018年9月26日任华富恒富18个月定期开放债券型基金基金经理、2014年12月17日至2018年9月7日任华富恒稳纯债债券型基金基金经理、2011年10月10日至2018年9月14日任华富收益增强债券型基金基金经理、2015年8月31日至2018年9月14日任华富恒利债券型基金基金经理、2016年3月23日至2018年9月14日任华富安福保本混合型基金基金经理、2016年11月28日至2018年9月7日任华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理、2017年1月25日至2018年9月7日任华富天益货币市场基金基金经理、2017年3月3日至2018年9月7日任华富天盈货币市场基金基金经理、2017年12月13日至2018年9月26日任华富星玉衡一年定期开放混合型基金基金经理、2018年5月21日至2018年9月26日任华富可转债债券型基金基金经理。

注:胡伟的任职日期是指该基金成立之日,张惠的任职日期、胡伟的离任日期是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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度,国内经济随着需求放缓开始出现回落。根据已经公布的经济数据来看,9月制造业 PMI 为 50.8%,处于历年同期中等偏低水平,指向制造业景气转弱。主要分项指标中,需求、生产、库存回落,价格上升,反映供需扩张双双放缓,同时9月以来地产、汽车销量以及发电耗煤增速均趋于下行,后续经济依然承压。出口方面,由于三季度贬值压力加大,虽然短期贸易战的影响还未体现,但是未来受到中美贸易摩擦愈演愈烈,抑制作用即将显现。固定资产投资方面,1-8月投资增速继续下滑至 5.3%,虽然8月略反弹至 4.1%,但难阻投资增速趋势性下行。三大类投资中:制造业投资复苏偏弱,基建投资仍在探底,房地产投资仍处高位,但是随着未来土地购置费增速放缓,房地产投资增速将面临较大下行压力。消费方面,高房价对消费的挤出效应日渐明显,虽然8月社消零售增速较7月反弹,但仍处低位。金融数据方面,在降杠杆过程中,金融严监管效应持续增强,非标融资规模出现负增长,同时违约事件频发也导致债券融资规模也出现下滑,社会融资额持续下滑。海外方面,三季度美国经济依旧强劲,美元进一步走强,美联储进一步加息,美债出现上行。

三季度,债券市场在内外多重因素的影响下出现一定反复。主要制约因素包括:一、受到天气、疫情等影响,食品价格短期反弹,通胀预期抬升。二、地方债发行加速,使得8-9月利率债供给压力较大,收紧了货币市场流动性,挤占银行表内其他债券额度。三、7月底的政治局会议明确提出实施积极的财政政策和稳健的货币政策,其中积极财政政策放在首位,要在扩大内需和结构调整上发挥更大的作用,并提出加大基建补短板力度,使得市场对于下半年宽信用的预期有所上升。四、9月美联储加息后美债上行较快,市场担心中美利差降至低位。总的来说,上半年的去杠杆政策取得了一定成效,但也带来了社融增速的大幅下滑和信用违约事件的频繁爆发。下半年宏观政策有所调整,去杠杆阶段性转向稳杠杆,宽信用预期有所升温。

三季度,权益市场表现出现一定分化。7、8月份在贸易战关税加征、人民币贬值压力增大、通胀预期加强、A股中报整体业绩低于预期的影响下,各主要股指均出现下行。但是9月份,随着宏观政策有所调整,积极财政政策发力,宽信用预期升温,金融地产基建等白马龙头股带动上证指数出现反弹,而计算机、电子等为代表的中小板和创业板个股在关税落地,苹果产业链预期下行的带动下出现进一步下跌。

三季度,转债市场由于前期下跌较多,多数个券跌至债性保护,加上金融个券受到权益市场的上涨提振,转债指数出现小幅上涨。

三季度,本基金继续严格执行CPPI的投资策略,配置与剩余期限相匹配的AAA存单和公司债作为稳健资产,通过稳健资产进一步积累了安全垫,同时对于风险资产择机波段操作,以期获取超额收益。二季度以来资金面持续宽松,本基金大幅提升了组合杠杆,但是由于受制于避险策略的约束,产品持仓久期难以拉长,基本维持了短久期高杠杆的票息投资策略。二季度以来,考虑到组合安全垫以及权益市场风险并未完全释放,本基金一直保持零仓位权益资产,本季度净值小幅上涨。

展望四季度,我们预计GDP名义增速将持续回落。出口方面,随着中美贸易摩擦加剧,出口增速进一步承压。投资方面,制造业投资回升力度偏弱,地产投资增速将大概率下滑,基建投资可能出现反弹,但只是部分对冲经济下滑的手段。消费方面,居民收入增速下滑、财富效应减弱、居民举债买房透支购买力等导致消费增速持续下滑,消费下行趋势难以改变。 因此,我们认为债牛行情并未走完,长期依然向好,以利率债和高等级企业债为标志的债券牛市仍未结束,3季度的短期调整将提供投资机会。

从中长期看,愈发积极的财政政策和较松的理财新规可对基建投资形成一定支撑,但是政策传导至项目落地并最终反映到数据上需要一定时间,基建数据修复预计将在四季度下半段才能看到,宏观经济下行仍将持续,债市长期向好态势不变;央行货币政策宽松持续,平衡偏松的资金面较为确定,但是继续放松的幅度不会很大;监管政策上,在以稳为主的工作基调下,金融监管政策对债市的影响将较为温和;因此基本面、政策面对债市影响是偏多的。

权益资产方面,虽然10月份市场仍然面临中美关系、美元上行带来的风险资产风险等较多不确定,但是从A股内生来看,经历8个多月的剧烈调整后,当前市场整体估值处于历史低位,市场底部特征比较明显。特别关注即将公布的三季报,关注下调预期和上调预期的板块与个股,积极寻找布局的机会。

从本基金配置角度看,我们依然将按照CPPI的投资策略,配置不低于80%的稳健资产积累产品安全垫,对于风险资产及时做好波段操作和结构调整,努力实现本金的保值增值。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位,在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,发挥管理人的综合优势,积极稳健地做好配置策略,均衡投资,力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2016年3月23日正式成立。截止2018年9月30日,本基金份额净值为1.014元,累计份额净值为1.014元。报告期,本基金份额净值增长率为1.20%,同期业绩比较基准收益率为0.65%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	204,521,579.40	94.24
	其中:债券	204,521,579.40	94.24
	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	7,000,000.00	3.23
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,124,608.65	0.52
8	其他资产	4,366,071.11	2.01
9	合计	217,012,259.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 报告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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,990,000.00	6.19
	其中:政策性金融债	9,990,000.00	6.19
4	企业债券	54,927,579.40	34.05
5	企业短期融资券	100,787,000.00	62.48
6	中期票据	10,092,000.00	6.26
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	28,725,000.00	17.81
9	其他	-	-
10	合计	204,521,579.40	126.79

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111814038	18江苏银行CD038	200,000	19,172,000.00	11.89
2	122295	13川投01	99,990	10,124,987.40	6.28
3	041800095	18首开CP001	100,000	10,118,000.00	6.27
4	101569034	15环球租赁MTN001	100,000	10,092,000.00	6.26
5	011800044	18鲁钢铁SCP001	100,000	10,087,000.00	6.25

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本报告期末本基金无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,251.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,346,423.02
5	应收申购款	396.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,366,071.11

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	172,319,932.41
报告期期间基金总申购份额	22,348.81
减:报告期期间基金总赎回份额	13,273,460.39
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	159,068,820.83

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、华富安福保本混合型证券投资基金基金合同

2、华富安福保本混合型证券投资基金托管协议

3、华富安福保本混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富安福保本混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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。

华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富智慧城市灵活配置混合
交易代码	000757
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月31日
报告期末基金份额总额	102,747,550.18份
投资目标	本基金通过深入研究并积极投资与智慧城市相关的优质上市公司,分享其发展和成长的机会,力求获取超额收益与长期资本增值。
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、证券市场以及智慧城市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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,561,410.29
2.本期利润	-10,546,451.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1002
4.期末基金资产净值	74,709,612.53
5.期末基金份额净值	0.727

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、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

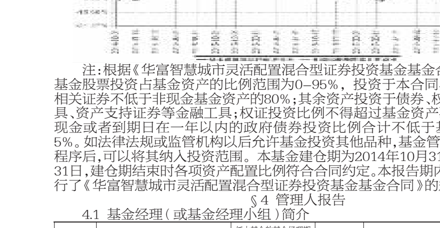
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-12.20%	1.71%	-0.21%	0.67%	-11.99%	1.04%

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《华富智慧城市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范围为0-95%,投资于本合同界定的智慧城市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2014年10月31日到2015年4月31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《华富智慧城市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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龚炜	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、华富成长趋势混合型基金基金经理、华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理、华富灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、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、华富元鑫灵活配置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	2014年10月31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、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监,2012年9月加入华富基金管理有限公司,曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理,2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。
高靖瑜	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理	2017年5月9日	-	十八年	复旦大学金融学硕士,本科学历。历任金鼎综合证券(维京)股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员,2007年7月加入华富基金管理有限公司,任行业研究员,2013年3月1日至2014年12月14日任华富价值增长混合型基金基金经理助理,2014年12月15日至2016年1月12日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理。

注:龚炜的任职日期指该基金成立之日,高靖瑜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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,国内经济放缓迹象逐渐显现。9月制造业PMI下滑至51以下,尤其是PMI新出口订单下行显著。作为实体经济的前瞻指标,8月社融存量增速整体下降至10.1%,9月仍难企稳,体现金融机构对经济的预期尚较悲观,信用扩张意愿仍在低位。通胀方面,8月CPI与PPI同比高于预期,CPI同比上升至2.3%,但仍处于可控区间,滞胀预期在大类资产价格方面显现,股票债券均有一定调整而商品价格攀升。政策方面,货币政策基本确定了实质性转向,银行间市场流动性保持着合理充裕,财政政策保持着相对积极的预期但尚需等待降税减费的具体政策落地进度。

2018年三季度,沪深300指数累计下跌2.05%,创业板指累计下跌12.16%。从三季度看,市场走势仍然偏弱,其中创业板指创下年内新低,并跌破2015年低点,沪深300指数略强,但也在不断震荡向下,不断走出年内新低。从行业层面看,市场风格轮动还是比较明显,二季度表现相对较好的大消费板块普遍回撤较多,而大周期板块在三季度反弹较为明显。三季度看,经济增速缓慢下行,经济政策不断向支持稳定国内经济转向,中美贸易摩擦仍然悬而未决并未有明显改善,在这种背景下,市场风险偏好不断下降,整体表现低迷。

本基金三季度重点配置行业包括生物医药、计算机、机械、电子、新能源车等,结构相对均衡。随着我国城镇化率的不断提高,城市科技化程度、节能环保化、便捷性、安全性都在不断提升,本基金持续关注其中投资机会,对相关计算机、电子、通信、新能源车等行业做了相关投资;另外,科技影响也在个人生活中不断体现,娱乐日益丰富,医疗服务多样化、出行不断便捷,个人需求的日益丰富多样化同时推动个人生活智能化以及城市智能化,我们也将对相关传媒、医药、社服等各个行业做深入研究并投资;打造制造强国是我们的国策,机械行业受益良多,且我国相关优势企业目前已经开始接近世界先进水平,我们也看好其中的机会,也将有所重点投资。

展望2018年四季度,中美之间贸易纠纷如何演化仍是影响市场的重要不确定因素,国内经济增速实际回落幅度的表现是另一个不确定因素,预计市场风险偏好仍将受抑制,在此大背景下,行情仍将以结构性为主。但同时市场积极因素也在不断累积,政策端对国内经济的支持力度不断加码,对后期进一步加大减税降费力度的预期也在不断增加,如果能够一一落实,市场也将积极对之反应。从板块看,目前行业轮动还是比较明显,从内生增长动力来看,我们对于医药、计算机等这类行业自发性需求相对较好的板块还是持续看好,看好其中拥有技术优势、研发优势、市场优势的龙头企业,我们将重点选择其中业绩保持向上趋势的公司做深入研究和投资,期望获得超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同2014年10月31日生效,截止2018年9月30日,本基金份额净值为0.727元,累计份额净值为0.927元。本报告期,本基金份额净值增长率为-12.20%,同期业绩比较基准收益率为-0.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,870,990.55	87.68
	其中:股票	65,870,990.55	87.68
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	9,210,783.48	12.26
8	其他资产	43,463.37	0.06
9	合计	75,125,237.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	41,496,141.25	55.54
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	7,194,300.00	9.63
G	交通运输、仓储和邮政业	2,445,000.00	3.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,700,149.30	15.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,625,400.00	2.18
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	1,410,000.00	1.89
S	综合	-	-
	合计	65,870,990.55	88.17

5.2.2 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。

5.3 报告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

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	90,000	5,170,500.00	6.92
2	000977	浪潮信息	202,100	4,866,568.00	6.51
3	601100	恒立液压	150,000	3,349,500.00	4.48
4	002422	科伦药业	120,000	3,200,400.00	4.28
5	002821	凯莱英	40,000	2,887,600.00	3.87
6	002747	埃斯顿	240,000	2,803,200.00	3.75
7	603986	兆易创新	29,000	2,573,170.00	3.44
8	600845	宝信软件	101,430	2,486,049.30	3.33
9	601111	中国国航	300,000	2,445,000.00	3.27
10	300036	超图软件	100,000	2,215,000.00	2.96

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本报告期末本基金无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,442.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,870.39
5	应收申购款	11,150.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,463.37

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	108,319,029.12
报告期期间基金总申购份额	1,182,771.82
减:报告期期间基金总赎回份额	6,754,250.76
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	102,747,550.18

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金合同

2、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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。

华富灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富灵活配置混合
交易代码	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
报告期末基金份额总额	22,594,188.20份
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-790,988.09
2.本期利润	-961,559.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0425
4.期末基金资产净值	20,360,615.65
5.期末基金份额净值	0.901

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、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

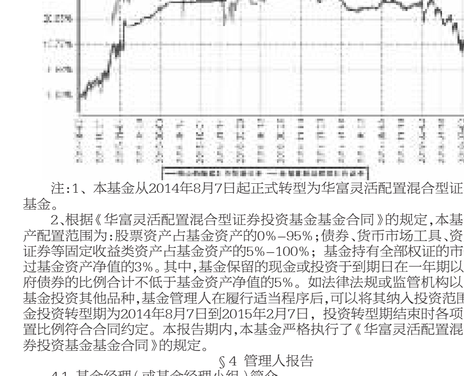
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-4.56%	0.68%	-0.75%	0.82%	-3.81%	-0.14%

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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龚炜	华富灵活配置混合型基金基金经理、华富竞争力优选混合型基金基金经理、华富成长趋势混合型基金基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、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、华富元鑫灵活配置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	2017年5月9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、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监,2012年9月加入华富基金管理有限公司,曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理,2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。
翁海波	华富灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富物联世界灵活配置混合型基金基金经理	2017年7月5日	-	九年	清华大学工程学硕士,研究生学历,曾任华安证券(维京)股份有限公司证券投资部研究员。2012年2月加入华富基金管理有限公司,先后担任助理行业研究员、行业研究员,2014年8月1日至2015年12月24日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理助理、2015年12月25日至2017年5月9日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理、2016年2月24日至2017年5月9日任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理。

注:这里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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度,国内宏观经济数据总体平稳,延续了一定韧性,但已出现放缓迹象;美国经济数据强劲,美联储释放"鹰派"信号,中美货币政策出现分化。年初以来,央行三次定向降准,但受到影子银行萎缩、信用违约事件频发等因素影响,国内货币金融环境仍偏紧,小微企业和民营企业融资问题依然突出。国庆节的全面降准是对经济及金融市场的风险对冲,总体稳健偏中性货币政策的基调未改。中美贸易摩擦升级是三季度市场的主要影响因素,叠加信用债违约事件增多,人民币贬值等多重负面因素环境下,市场延续弱势格局,股指持续震荡下行。对贸易摩擦的担忧使得市场关注自主可控、补短板的方向,5G、半导体、油气、及作为稳经济抓手的建筑等偏主题的板块表现较好;出于对未来宏观的担忧,医药、消费白马、蓝筹逐步进入调整。本基金三季度操作延续稳健风格,未增加权益仓位,并及时参与相关主题的阶段性机会,但由于权重不高贡献有限。行业配置方面相对均衡,标的选择上秉承自下而上精选个股的投资策略,侧重配置细分行业龙头;策略上由于热点变幻频繁,适当增强了主题轮动的配置方式。大类行业配置上全面减持了航空、工程机械等版块,加强了对TMT、高端制造、食品饮料的配置。综合的策略目标期望能够匹配市场节奏,在有效控制风险的基础上争取回报。

展望第四季度,贸易摩擦的不确定性继续存在,而中美关税提高对经济带来的影响逐步显现、高油价开始引发输入性通胀的担忧、中美利差的缩小使得汇率的波动性加大;季末美股出现的调整,使得全球对于权益资产的风险偏好降低,总体不确定性因素依然较多。国内已启动稳经济的相关措施,基建、消费、减税等相关政策陆续出台,降准、资管新规细则发布也在进一步稳定流动性;因此我们对于全年宏观经济稳增长具有信心,但未来带动国内经济持续增长的动因需要继续观察。海外方面,美国金融市场下跌、及中期选举有望使得贸易摩擦短期缓解,但中长期的走向仍是市场重要关注因素,总体大扰动的风险在下降。

第四季度市场环境或有所改善,但如发生超预期的风险事件,在熊市环境下会加大投资者的忧虑,策略上仍需耐心观察与等待时机。当前市场整体估值水平较低,部分优势龙头企业显现中长期投资价值。本基金第四季度的投资策略仍将淡化风格,强化基本面,重点在于自下而上筛选盈利与估值匹配的个股,期望以此能够持续为持有人获得低风险的回报。未来将重点布局TMT、高端智能制造、消费、资源等行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同2014年8月7日生效,截止2018年9月30日,本基金份额净值为0.901元,累计份额净值为1.126元。本报告期,本基金份额净值增长率为-4.56%,同期业绩比较基准收益率为-0.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从2017年5月25日起至本报告期末(2018年9月30日),本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于五千万元的情形,至本报告期期末(2018年9月30日)基金资产净值仍低于5000万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》,积极采取相关措施,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,125,742.15	39.64
	其中:股票	8,125,742.15	39.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,013,097.90	29.34
	其中:债券	6,013,097.90	29.34
	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	6,294,545.29	30.71
8	其他资产	64,574.00	0.32
9	合计	20,497,959.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,488,204.80	22.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	426,852.00	2.10
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	417,652.00	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,151,642.55	5.66
J	金融业	713,250.00	3.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	402,944.00	1.98
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	525,196.80	2.58
S	综合	-	-
	合计	8,125,742.15	39.91

5.2.2 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。

5.3 报告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

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	601128	常熟银行	112,500	713,250.00	3.50
2	600887	伊利股份	25,800	662,544.00	3.25
3	300182	捷成股份	93,120	525,196.80	2.58
4	600845	宝信软件	17,700	433,827.00	2.13
5	300037	新宙邦	18,300	432,429.00	2.12
6	601800	中国交建	33,400	426,852.00	2.10
7	600018	上港集团	77,200	417,652.00	2.05
8	000039	中集集团	34,800	412,032.00	2.02
9	300073	当升科技	16,200	409,698.00	2.01
10	603018	中设集团	25,600	402,944.00	1.98

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,970,388.00	9.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,042,709.90	19.86
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,013,097.90	29.53

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132009	17中油EB	19,640	2,032,740.00	9.98
2	123002	国祯转债	19,405	2,009,969.90	9.87
3	122124	11中化02	19,600	1,970,388.00	9.68

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本报告期末本基金无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,749.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	53,824.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,574.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132009	17中油EB	2,032,740.00	9.98
2	123002	国祯转债	2,009,969.90	9.87

5.11.5 报告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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	22,683,279.90
报告期期间基金总申购份额	71,884.18
减:报告期期间基金总赎回份额	160,975.88
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	22,594,188.20

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	7.1-9.30	17,996,685.86	0.00	0.00	17,996,685.86	79.65%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

§9 备查文件目录

9.1 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报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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。