

华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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 2024 年 07 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| 基金简称 | 华富益鑫灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 002728 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 月 7 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 114,662,378.84 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×50%+上证国债指数收益率×50% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中等收益风险特征的基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华富益鑫灵活配置混合 A | 华富益鑫灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002728 | 002729 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 77,932,191.77 份 | 36,730,187.07 份 |

§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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 华富益鑫灵活配置混合 A | 华富益鑫灵活配置混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -93,781.11 | 15,626.90 |
| 2. 本期利润 | -237,737.13 | 129,064.96 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0051 | 0.0132 |
| 4. 期末基金资产净值 | 92,203,001.52 | 41,667,559.59 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.183 | 1.134 |

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 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富益鑫灵活配置混合 A

| 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 | 0.96% | 0.14% | -0.08% | 0.37% | 1.04% | -0.23% |
| 过去六个月 | 2.63% | 0.17% | 2.53% | 0.44% | 0.10% | -0.27% |
| 过去一年 | 1.04% | 0.18% | -2.23% | 0.43% | 3.27% | -0.25% |
| 过去三年 | 0.34% | 0.21% | -11.97% | 0.52% | 12.31% | -0.31% |
| 过去五年 | 26.96% | 0.25% | 7.90% | 0.57% | 19.06% | -0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | 64.19% | 0.24% | 21.74% | 0.57% | 42.45% | -0.33% |

华富益鑫灵活配置混合 C

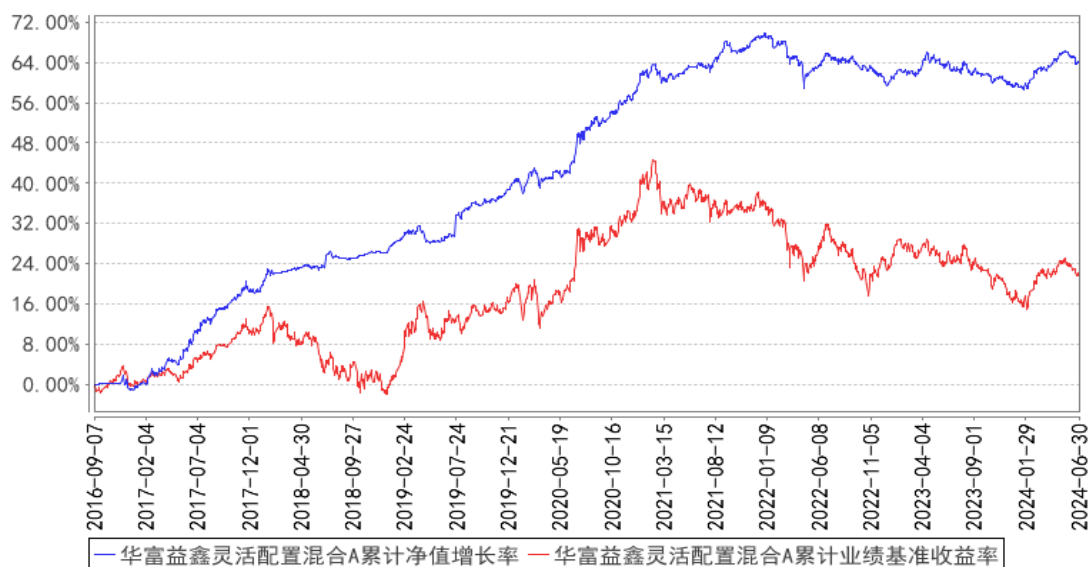
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.91% | 0.13% | -0.08% | 0.37% | 0.99% | -0.24% |

| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去六个月 | 2.48% | 0.17% | 2.53% | 0.44% | -0.05% | -0.27% |
| 过去一年 | 0.83% | 0.18% | -2.23% | 0.43% | 3.06% | -0.25% |
| 过去三年 | -0.24% | 0.21% | -11.97% | 0.52% | 11.73% | -0.31% |
| 过去五年 | 25.65% | 0.25% | 7.90% | 0.57% | 17.75% | -0.32% |
| 自基金合同 生效起至今 | 58.71% | 0.24% | 21.74% | 0.57% | 36.97% | -0.33% |

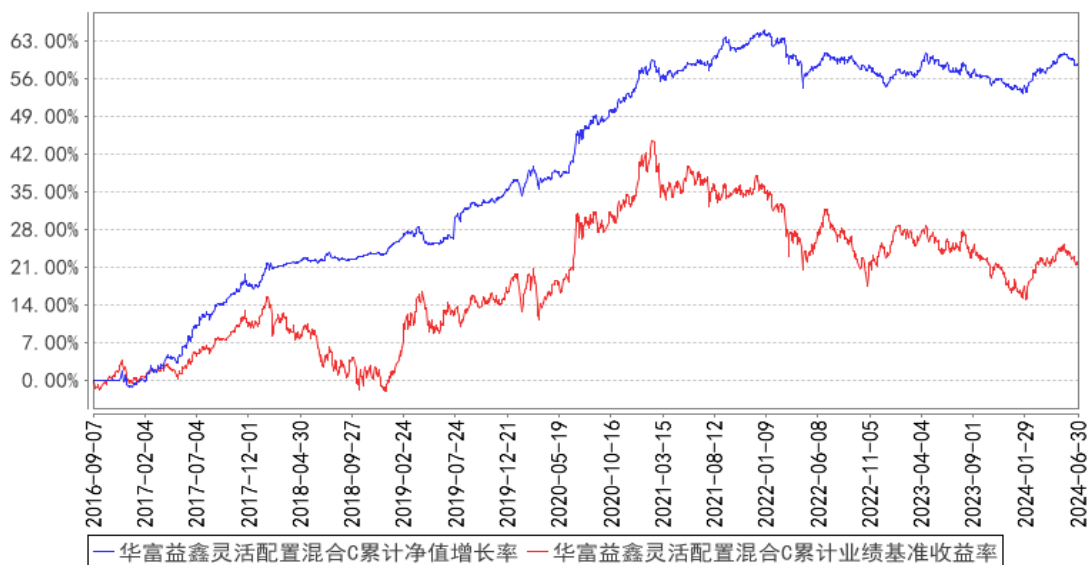
注：本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华富益鑫灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华富益鑫灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为 2016 年 9 月 7 日到 2017 年 3 月 7 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《华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（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 | 本基金基金经理、固定收益部副总监 | 2016年9月7日 | - | 十七年 | 合肥工业大学经济学硕士、硕士研究生学历。2007年6月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部助理行业研究员、行业研究员，固定收益部固收研究员、基金经理助理、总监助理，自2015年8月31日起任华富恒利债券型证券投资基金基金经理，自2016年9月7日起任华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年1月30日起任华富安享债券型证券投资基金基金经理，自2019年4月2日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，自2019年4月15日起任华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2021年8月16日起任华富63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，自2023年9月12日起任华富富鑫一年定期开放债券型发起式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合规守信情况的说明

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

4.3 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年二季度宏观经济延续复苏，但是复苏力度有所放缓，4-6 月，国内制造业 PMI 分别为 50.4%、49.5%和 49.5%，回落至荣枯线以下；4-5 月国内规模以上工业增加值同比分别增长 6.7%和 5.6%，延续较强增长势头。需求方面，同期社会消费零售总额分别增长 2.3%和 3.7%，消费需求较弱；出口金额分别增长 1.4%和 7.6%，延续年初以来好于去年的复苏态势；国内固定资产投资完成额分别增长 4.2%和 4.0%，较 3 月略有回落。总体来看，二季度国内制造业投资和出口均维持了年初以来的复苏态势，但消费、基建有所回落，尤其是房地产行业的下滑对于国内经济的影响较大，由于需求偏弱叠加经济结构转型，二季度社融数据出现明显下滑，未来货币供应或将更偏

重质优于量的过程。4 月禁止手工补息以后，存款利率下行，理财规模持续增长，非银机构资金面较为宽松，二季度整体资金面运行较为平稳。

海外方面，2024 年二季度美国经济数据和通胀有所反复，美联储降息预期多次起伏，10 年美债收益率在 4.2-4.7% 的区间内震荡，同时由于大选即将开始，市场对年内降息预期有所下降；其他经济体欧洲方面的降息已开启，日本央行的加息一直不及预期，叠加地缘政治局势的变化，美元指数整体波动上行。

2024 年二季度，在宏观经济放缓同时资金偏宽松的背景下，债券市场整体表现较好，收益率持续下行，具有代表性的十年期国债收益率下行 8BP 至 2.22%，三十年国债收益率下行至 2.5% 以内，十年以内各期限下行幅度更大。信用债方面，二季度信用债整体表现强势，除四月末跟随利率有所调整外，收益率整体下行，且信用利差、期限利差和等级利差均继续收窄。可转债方面，4-5 月的可转债市场延续了前两个月的反弹态势，但随着 5 月下旬以来受权益市场回调、交易所对部分个股问询函增多、新制度下退市政策收紧、转债评级下调事件增多等多重负面冲击的影响，6 月份的可转债市场出现了快速调整，二季度中证转债指数累计上涨 0.75%，万得可转债等权指数则下跌 1.06%。从结构上看，金融、公用事业等大盘高等级可转债延续了年初以来的较好表现，二季度仍有较好的正收益，而低等级的中小盘转债则有明显的负收益。权益市场方面，二季度呈现先扬后抑。4 月至 5 月上旬在经济数据改善，地产新政刺激等多重利好之下，顺周期相关板块涨幅明显，但随后由于社融等经济数据走弱后，市场风险偏好下行，全季度仅红利指数录得正收益，其他主要指数均出现下跌，市场整体赚钱效应较差。

回顾 2024 年二季度，本基金继续以追求绝对收益为目标，在大类资产配置上优先配置了高等级信用债，以票息为主杠杆为辅的债券策略给组合贡献了正向的票息和杠杆收益。同时随着债券市场的超涨和权益市场的超跌，股债性价比开始出现明显左侧的偏移，组合用超跌的可转债资产部分代替原先的纯债票息策略，特别是高 YTM 的转债配置价值凸显后我们加大了对这类资产的增配。在风险资产上，基于偏弱的基本面定价，我们保持了中性仓位，主要优选了部分估值低位，长期 ROE 稳定且股息中性的稳健价值成长类个股，主要聚焦于食品饮料、银行、煤炭、汽车、消费电子等行业。跟随权益资产和转债资产的先扬后抑，本季度组合净值小幅上涨。

展望 2024 年三季度，内需偏弱的环境下，政策发力仍然值得期待。结构上，前期增发国债项目继续施工，三季度地方专项债加速发行进一步促开工，政府支出可能仍然是三季度宏观经济最重要的拉动因素。此外，地产“517”新政后，多地城市跟进，政策出台的节奏之快，超出市场预期，目前二手房销售已经出现企稳迹象，未来我们将继续关注房地产行业的走势。

在资产配置上，对于债券来说，虽然赔率不高但是基于经济发展阶段和持续偏宽松的货币环

境胜率依然在，我们尽量在波动中择机进行配置；对于权益来说，各项估值和比价指标均显示赔率较高，但是胜率的改善需要持续观察并积极应对，当下的市场值得我们多一份耐心等待信心的进一步修复；对于可转债来说，债券的胜率提供了安全边际，权益的胜率改善有望带来资产弹性，依然是 2024 年值得重视和挖掘的资产。

债券市场方面，展望 2024 年三季度，财政政策或更加积极，预计政府债和地方专项债供给将加速，或使利率债供需更加平衡。从赔率角度看，当前利率债绝对收益率及期限利差均处于历史低位，历史维度下，利率债赔率偏低。但考虑到当前经济企稳回升的动力还不突出，货币政策仍需要为经济企稳回升提供协助，预计一段时间内低利率的环境可能还将持续。对于收益率而言，只要货币政策处于偏宽松的状态，倾向于潜在的政府债供给压力或将是脉冲式的，不会对利率趋势产生影响。但在绝对收益率低位之下，债券波动可能有所放大。从中长期维度看，我们正处于经济结构转型之中，此背景下利率继续下行的长趋势未改变。

权益市场方面，展望 2024 年三季度，复杂的国内外环境下，我们认为目前市场依然处于存量博弈阶段，资金不再一味追逐高 ROE（尤其以高杠杆维持的高 ROE），转而追求稳定回报，即自由现金流为正且长期稳定或改善，负债率低或有息负债下降或增速低的行业，我们也将重点在这些行业中找到有确定性收益回报的个股。行业配置上，我们将主要在以下几个方面去重点研究和找寻超额收益：1、我们将继续跟踪海外经济再通胀的风险，在供给约束下找寻需求边际改善的资源品涨价景气投资；2、在内需偏弱的环境下，我们将继续寻找具有全球优势生产力的行业和公司，分享“出海”红利；3、我们将继续找寻估值风险释放充分后，长期 ROE 稳定且未来有望盈利回升的消费品优秀上市公司；4、我们将继续关注红利因子，关注稳定价值类高股息资产的投资机会。

可转债市场方面，展望 2024 年三季度，6 月下跌后转债的信用违约率定价处于历史高位，低价券定价水平处于不合理区间，未来随着转债市场流动性恢复，理性定价或将逐步回归。从股债配置和权益角度看，转债资产整体进可攻退可守的期权属性依然明显，从中期维度看，可转债资产胜率较大。我们将立足转债基本面，一方面重视高 YTM 转债的纯债替代策略；另一方面，也从正股业绩出发，找寻业绩增长确定的优秀公司做正股替代策略。

本基金仍将坚持在较低风险程度下，认真研究各个投资领域潜在的机会，相对积极地做好配置策略，均衡投资，降低业绩波动，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

截止本期末，华富益鑫灵活配置混合 A 份额净值为 1.183 元，累计份额净值为 1.591 元。报告期，华富益鑫灵活配置混合 A 份额净值增长率为 0.96%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%。截止本期末，华富益鑫灵活配置混合 C 份额净值为 1.134 元，累计份额净值为 1.540 元。报告期，

华富益鑫灵活配置混合 C 份额净值增长率为 0.91%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2024 年 02 月 20 日起至 2024 年 05 月 08 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形，从 2024 年 05 月 09 日起至本报告期末（2024 年 06 月 30 日），本基金基金资产净值已不存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形。

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 | 7,201,379.40 | 4.69 |
| | 其中：股票 | 7,201,379.40 | 4.69 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 115,328,747.20 | 75.09 |
| | 其中：债券 | 115,328,747.20 | 75.09 |
| | 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 | 8,000,000.00 | 5.21 |
| | 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 | 21,245,391.96 | 13.83 |
| 8 | 其他资产 | 1,814,956.16 | 1.18 |
| 9 | 合计 | 153,590,474.72 | 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 | 876,591.00 | 0.65 |
| C | 制造业 | 4,063,826.40 | 3.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 397,305.00 | 0.30 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 400,165.00 | 0.30 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 185,832.00 | 0.14 |
| J | 金融业 | 1,014,620.00 | 0.76 |
| 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 | - | - |
| 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 | 263,040.00 | 0.20 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 7,201,379.40 | 5.38 |

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 601899 | 紫金矿业 | 20,400 | 358,428.00 | 0.27 |
| 2 | 000726 | 鲁泰 A | 51,900 | 343,578.00 | 0.26 |
| 3 | 600132 | 重庆啤酒 | 5,600 | 339,920.00 | 0.25 |
| 4 | 600901 | 江苏金租 | 60,300 | 304,515.00 | 0.23 |
| 5 | 601989 | 中国重工 | 59,900 | 295,307.00 | 0.22 |
| 6 | 601857 | 中国石油 | 26,800 | 276,576.00 | 0.21 |
| 7 | 002001 | 新和成 | 14,000 | 268,800.00 | 0.20 |
| 8 | 601006 | 大秦铁路 | 37,500 | 268,500.00 | 0.20 |
| 9 | 601928 | 凤凰传媒 | 24,000 | 263,040.00 | 0.20 |
| 10 | 600150 | 中国船舶 | 6,400 | 260,544.00 | 0.19 |

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 | 6,871,041.04 | 5.13 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 69,220,753.60 | 51.71 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,086,054.79 | 7.53 |
| 4 | 企业债券 | 9,816,589.87 | 7.33 |
| 5 | 企业短期融资券 | 8,033,304.00 | 6.00 |
| 6 | 中期票据 | 3,073,455.74 | 2.30 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 18,313,602.95 | 13.68 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------|-------|
| 10 | 合计 | 115,328,747.20 | 86.15 |
|----|----|----------------|-------|

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 | 2120089 | 21 北京银行永续债 01 | 100,000 | 10,790,409.84 | 8.06 |
| 2 | 2128025 | 21 建设银行二级 01 | 100,000 | 10,588,753.42 | 7.91 |
| 3 | 2128022 | 21 交通银行永续债 | 100,000 | 10,394,687.12 | 7.76 |
| 4 | 240210 | 24 国开 10 | 100,000 | 10,086,054.79 | 7.53 |
| 5 | 232380008 | 23 广州农商行二级资本债 01 | 60,000 | 6,583,063.56 | 4.92 |

**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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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，中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、国家开发银行、北京银行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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 10,310.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | 840.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,803,805.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,814,956.16 |

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 | 128129 | 青农转债 | 3,062,921.36 | 2.29 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 2,776,733.81 | 2.07 |
| 3 | 113042 | 上银转债 | 2,738,394.78 | 2.05 |
| 4 | 113056 | 重银转债 | 1,803,676.13 | 1.35 |
| 5 | 113037 | 紫银转债 | 1,014,581.62 | 0.76 |
| 6 | 113033 | 利群转债 | 647,567.92 | 0.48 |
| 7 | 110064 | 建工转债 | 625,984.24 | 0.47 |
| 8 | 113021 | 中信转债 | 532,871.33 | 0.40 |
| 9 | 118034 | 晶能转债 | 524,236.17 | 0.39 |
| 10 | 113048 | 晶科转债 | 484,820.14 | 0.36 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 11 | 123127 | 耐普转债 | 442,531.52 | 0.33 |
| 12 | 127083 | 山路转债 | 435,730.92 | 0.33 |
| 13 | 110047 | 山鹰转债 | 353,528.38 | 0.26 |
| 14 | 110068 | 龙净转债 | 214,544.92 | 0.16 |
| 15 | 118031 | 天 23 转债 | 191,273.54 | 0.14 |
| 16 | 113047 | 旗滨转债 | 175,443.07 | 0.13 |
| 17 | 127025 | 冀东转债 | 174,891.29 | 0.13 |
| 18 | 127022 | 恒逸转债 | 174,776.66 | 0.13 |
| 19 | 111017 | 蓝天转债 | 164,485.62 | 0.12 |
| 20 | 110086 | 精工转债 | 135,482.81 | 0.10 |
| 21 | 123201 | 纽泰转债 | 129,353.72 | 0.10 |
| 22 | 128144 | 利民转债 | 124,913.89 | 0.09 |
| 23 | 123171 | 共同转债 | 122,878.42 | 0.09 |
| 24 | 128063 | 未来转债 | 81,214.19 | 0.06 |
| 25 | 123063 | 大禹转债 | 78,486.44 | 0.06 |
| 26 | 123076 | 强力转债 | 76,507.51 | 0.06 |
| 27 | 123100 | 朗科转债 | 76,500.79 | 0.06 |
| 28 | 128125 | 华阳转债 | 76,177.26 | 0.06 |
| 29 | 128071 | 合兴转债 | 75,780.96 | 0.06 |
| 30 | 113545 | 金能转债 | 75,583.03 | 0.06 |
| 31 | 128116 | 瑞达转债 | 73,785.83 | 0.06 |
| 32 | 110083 | 苏租转债 | 71,234.14 | 0.05 |
| 33 | 118000 | 嘉元转债 | 65,219.58 | 0.05 |
| 34 | 110082 | 宏发转债 | 33,515.75 | 0.03 |
| 35 | 113043 | 财通转债 | 17,784.79 | 0.01 |
| 36 | 113634 | 珀莱转债 | 10,820.75 | 0.01 |
| 37 | 123108 | 乐普转 2 | 9,668.36 | 0.01 |
| 38 | 113633 | 科沃转债 | 9,607.22 | 0.01 |
| 39 | 113655 | 欧 22 转债 | 1,080.12 | 0.00 |

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

| 项目 | 华富益鑫灵活配置混合 A | 华富益鑫灵活配置混合 C |
|-------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 18,508,240.22 | 9,714,260.43 |

| | | |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 62,355,238.12 | 29,154,827.42 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,931,286.57 | 2,138,900.78 |
| 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 | 77,932,191.77 | 36,730,187.07 |

§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

单位:份

| 项目 | 华富益鑫灵活配置混合 A | 华富益鑫灵活配置混合 C |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 | 1,021,276.60 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 | 1,021,276.60 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.00 | 0.00 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|----|------|------------|--------------|---------------|---------|
| 1 | 赎回 | 2024-05-16 | 1,021,276.60 | -1,221,446.81 | 0.00 |
| 合计 | | | 1,021,276.60 | -1,221,446.81 | |

注:

§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 | 20240627-20240630 | 0.00 | 28,053,018.19 | 0.00 | 28,053,018.19 | 24.47 |
| | 2 | 20240509-20240630 | 0.00 | 25,149,384.08 | 0.00 | 25,149,384.08 | 21.93 |
| | 3 | 20240509-20240630 | 0.00 | 24,095,582.33 | 0.00 | 24,095,582.33 | 21.01 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |

| |
|--------|
| 产品特有风险 |
| 无 |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

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。

华富基金管理有限公司

2024 年 7 月 19 日