

华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资
基金
2017 年第 4 季度报告

2017 年 12 月 31 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：2018 年 1 月 22 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 1 月 19 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 2017 年 10 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日。

§2 基金产品概况

转型后：

| | | |
|-------------|---|--------------------|
| 基金简称 | 华富恒富 18 个月定期开放债券 | |
| 基金主代码 | 000502 | |
| 交易代码 | 000502 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 11 月 22 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 314,350,146.00 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。 | |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中偏低风险品种。其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华富恒富 18 个月定期开放债券 A | 华富恒富 18 个月定期开放债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000502 | 000501 |

| | | |
|-----------------|---------------------|--------------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 297, 400, 232. 55 份 | 16, 949, 913. 45 份 |
|-----------------|---------------------|--------------------|

注：本基金于 2017 年 11 月 22 日由原华富恒富分级债券型证券投资基金转型而来。

转型前：

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华富恒富分级债券 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 000500 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 3 月 19 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 168, 140, 576. 68 份 |
| 投资目标 | 在控制风险并保持资产流动性的基础上，满足恒富 A 份额持有人的稳健收益及流动性需求，同时满足恒富 B 份额持有人在承担适当风险的基础上，获取更多收益的需求。 |
| 投资策略 | 本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中偏低风险品种。其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

注：下属分级基金 A 份额（000501）总额：17, 175, 451. 82

下属分级基金 B 份额（000502）总额：150, 965, 124. 86

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2017 年 11 月 22 日 — 2017 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|--|--------------------|
| | 华富恒富 18 个月定期开放债券 A | 华富恒富 18 个月定期开放债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 878, 045. 00 | 47, 628. 14 |
| 2. 本期利润 | 557, 468. 64 | 19, 838. 06 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0021 | 0. 0012 |
| 4. 期末基金资产净值 | 298, 467, 935. 56 | 16, 986, 716. 34 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 0036 | 1. 0022 |

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、所列数据截止到 2017 年 12 月 31 日。华富恒富分级债券型证券投资基金从 2017 年 11 月 22 日转型为华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2017 年 10 月 1 日 — 2017 年 11 月 21 日） |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | 966,747.53 |
| 2. 本期利润 | 952,423.94 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0050 |
| 4. 期末基金资产净值 | 168,495,072.97 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0020 |

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、所列数据截止到 2017 年 11 月 22 日。华富恒富分级债券型证券投资基金从 2017 年 11 月 22 日转型为华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

华富恒富 18 个月定期开放债券 A

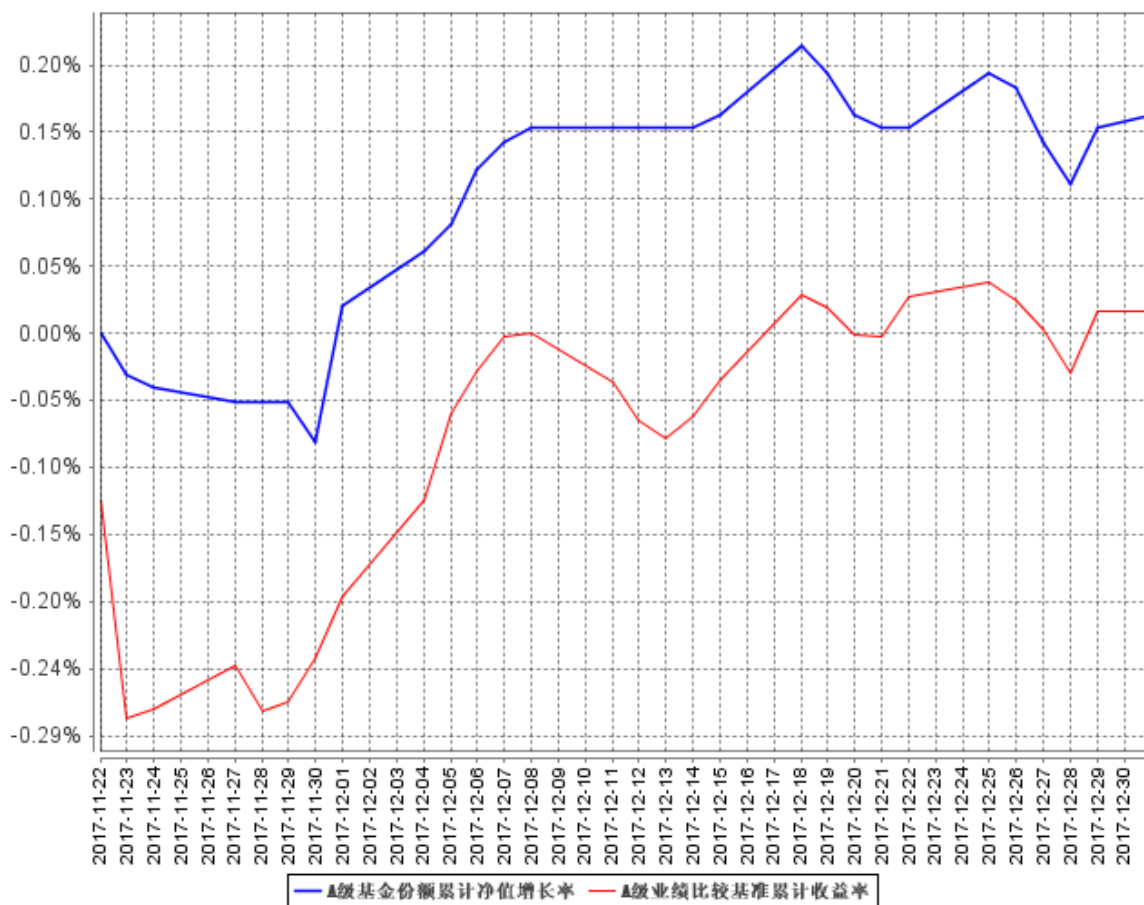
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.16% | 0.03% | 0.02% | 0.05% | 0.14% | -0.02% |

华富恒富 18 个月定期开放债券 C

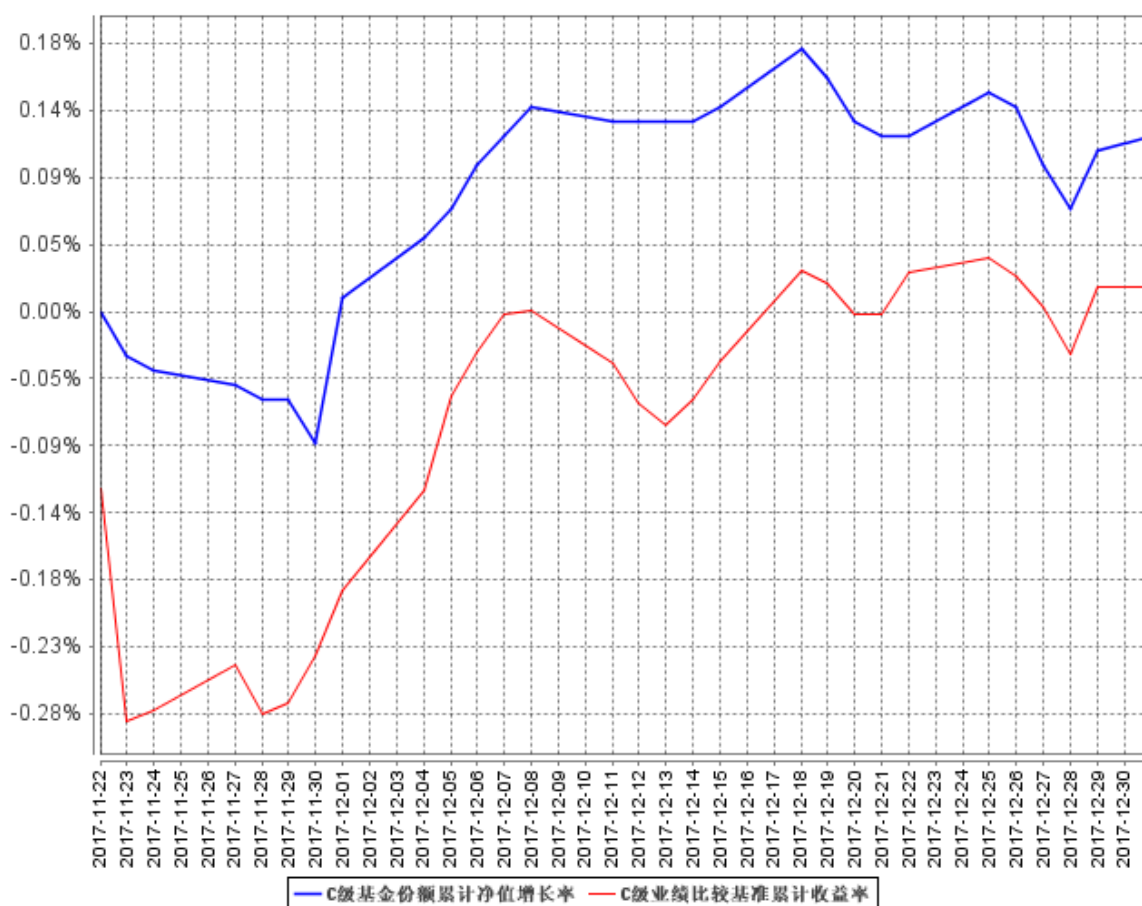
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.12% | 0.03% | 0.02% | 0.05% | 0.10% | -0.02% |

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

A级基金份额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



C级基金份额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：本基金转型前为富恒富分级债券型证券投资基金。根据《华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产投资比例不高于基金资产的 20%，其中本基金在开放期、封闭期前一个月以及封闭期最后一个月不受上述投资比例限制。本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。但在开放期本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，封闭期不受上述 5% 的限制。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2017 年 11 月 22 日到 2018 年 5 月 22 日。本报告期内，本基金仍在建仓期。

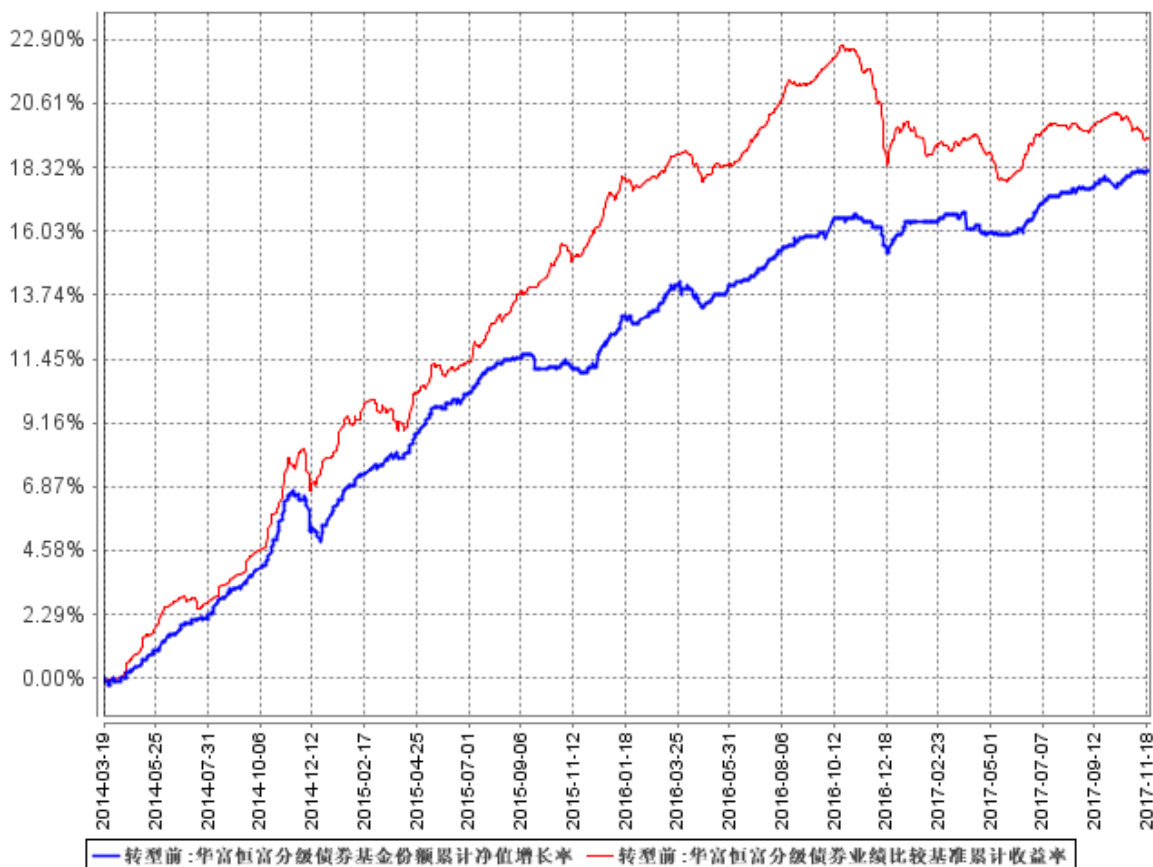
3.2 基金净值表现（转型前）

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 | 0.30% | 0.06% | -0.71% | 0.05% | 1.01% | 0.01% |

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

华富恒富分级债券基金份额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：本基金转型前为富恒富分级债券型证券投资基金。根据《华富恒富分级债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（基金份额分级运作存续期内任一开放日、开放期前二十个工作日至开放日、开放期后二十个工作日内可不受此比例限制）；股票、权证等权益类资产投资比例不高于基金资产的 20%，其中本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。在开放日、开放期本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金建仓期为 2014 年 3 月 19 日到 2014 年 9 月 19 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《华富恒富分级债券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（转型前）

| 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 | | |
| 胡伟 | 华富恒富分级债券型基金基金经理、华富收益增强债券型基金基金经理、华富保本混合型基金经理、华富恒财分级债券型基金基金经理、华富恒稳纯债债券型基金基金经理、华富旺财保本混合型基金经理、华富恒利债券型基金基金经理、华富安福保本混合型基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金经理、华富天益货币市场基金经理、华富天盈货币市场基金经理、公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、固定收益部总监 | 2014 年 3 月 19 日 | - | 十三年 | 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、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经理。 |
| 姚姣姣 | 华富恒富分 | 2017 年 9 月 | - | 五年 | 复旦大学金融学研究 |

| | | | | | |
|--|---|------|--|--|--|
| | 级债券型基金基金经理、华富货币市场基金基金经理、华富天益货币市场基金基金经理、华富天盈货币市场基金基金经理、华富恒稳纯债债券型基金基金经理 | 12 日 | | | 生学历、硕士学位。先后任职于广发银行股份有限公司、上海农商银行股份有限公司，2016 年 11 月加入华富基金管理有限公司。 |
|--|---|------|--|--|--|

注：胡伟的任职日期指该基金成立之日，姚姣姣的任职日期指公司决定之日。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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

| 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 | | |
| 胡伟 | 华富恒富 18 个月定期开放债券型基金基金经理、华富收益增强债券型基金基金经理、华富保本混合型基金基金经理、华富恒财分级债券型基金基金经理、华富恒稳纯债债券型基金基金经理、华富旺财保本混合型基金基金经理、华富恒利债券型基金基金经理、华富安福保本混合型基金基金经理、华富 | 2017 年 11 月 22 日 | - | 十三年 | 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、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，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。 |

| | | | | | |
|-----|--|------------------|---|----|---|
| | 弘鑫灵活配置混合型基金经理、华富天益货币市场基金经理、华富天盈货币市场基金经理、华富星玉衡一年定期开放混合型基金经理、公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、固定收益部总监 | | | | |
| 姚姣姣 | 华富恒富 18 个月定期开放债券型基金经理、华富货币市场基金基金经理、华富天益货币市场基金基金经理、华富天盈货币市场基金基金经理、华富恒稳纯债债券型基金经理 | 2017 年 11 月 22 日 | - | 五年 | 复旦大学金融学研究生学历、硕士学位。先后任职于广发银行股份有限公司、上海农商银行股份有限公司，2016 年 11 月加入华富基金管理有限公司。 |

注：这里的任职日期指该基金成立之日。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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年 4 季度，经济表现好于预期，年末制造业 PMI 有所放缓，但依然处于全年均值以上，非制造业 PMI 表现亮眼，此外进出口数据也显示制造业外贸持续向好。

四季度债券市场出现超大幅度上行，远超投资者预期。10 月 9 日国庆节后至 11 月 20 日，利率阶段性上行，总的上行幅度达到 70BP。11 月 21 日至年终，债市利率进入平台整理，高位震荡。这波利率的大幅上行始于 9 月 30 日晚间央行发布的定向降准公告，在市场一致预期利好的情况下，债市确开始了四季度的大幅调整。之后在全球经济持续向好、全球通胀预期升温的基本面背景下，加之国内债市的监管升级，包括 11 月 17 日一行三会等联合发布的资管新规征求意见稿，以及 12 月 6 日银监会发布的《商业银行流动性风险管理办法》等，在各种接踵而至的利空冲击下，债市利率大幅调整，至 12 月下旬美国税改法案出台，海外利率上行时，国内债市反而已经对利空消息有所钝化，利率水平高位震荡。

本基金于 12 月 1 日起转型为 18 个月定开债基，并进入 18 个月的封闭期。在债市绝对收益率处于历史高位，但是利空风险没有明显释放的背景下，主要配置短久期高票息信用债为主，谨慎参与长久期波段操作。

展望 2018 年，虽然 2017 年中国经济在外需的大幅改善和房地产市场的超预期强韧下，稳中向好，但是中国经济仍处于结构调整的初期，新经济的体量不足以抵消传统经济收缩的趋势，GDP 在现有增速平台上的企稳，仍主要来自中国经济的传统驱动力——出口、基建、地产对总需求的有效托底。一旦全球流动性紧缩进入全面加速期，中国货币政策的独立性将受到很大的挑战。基于此，我们认为 2018 年，财政政策不会加码刺激，货币政策将继续突出“强监管+稳货币”的组合。经济可能的阶段性失速，可能对债券市场带来缓和，但金融强监管的压力将继续贯穿至 2018 年，给长端利率的下行造成压力。

在经历了 2017 年的监管大年之后，预期 2018 年监管环境依然较为严峻，金融防风险将贯穿至 2018 年整年，金融去杠杆的节奏和力度预计将视其效果而定，所以在 2018 年上半年，利率上行趋势不改，经济基本面韧性还在的情况下，本基金还是以短久期适当杠杆的防御策略为主，静待市场机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金（转型后）于 2017 年 11 月 22 日正式成立。截止到 2017 年 12 月 31 日，华富恒富 18 个月定期开放债券 A 基金份额净值为 1.0036 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.16%；截至本报告期末华富恒富 18 个月定期开放债券 C 基金份额净值为 1.0022 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.12%；同期业绩比较基准收益率为 0.02%。

华富恒富分级债券型证券投资基金（转型前）于 2014 年 3 月 19 日正式成立。截止到 2017 年 11 月 21 日，华富恒富分级债券 A 类基金份额参考净值为 1.001 元，华富恒富分级债券 B 类基金份额参考净值为 1.002 元。本报告期内本基金净值增长率为 0.30%，累计份额净值为 1.201 元，同期业绩比较基准收益率为-0.71%。

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

转型后:

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 | 446,068,956.90 | 96.51 |
| | 其中：债券 | 446,068,956.90 | 96.51 |
| | 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 | 7,078,000.89 | 1.53 |
| 8 | 其他资产 | 9,045,942.89 | 1.96 |
| 9 | 合计 | 462,192,900.68 | 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：无。

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 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 277,249,956.90 | 87.89 |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,045,000.00 | 19.03 |
| 6 | 中期票据 | 40,950,000.00 | 12.98 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 67,824,000.00 | 21.50 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 446,068,956.90 | 141.41 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 111710633 | 17 兴业银行 CD633 | 500,000 | 48,750,000.00 | 15.45 |
| 2 | 136865 | 16 新燃 01 | 300,000 | 28,983,000.00 | 9.19 |
| 3 | 101460007 | 14 南宁城建 MTN001 | 200,000 | 20,636,000.00 | 6.54 |
| 4 | 101453008 | 14 鲁能源 MTN001 | 200,000 | 20,314,000.00 | 6.44 |
| 5 | 041756022 | 17 陕交建 CP001 | 200,000 | 20,004,000.00 | 6.34 |

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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 8,395.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,037,547.60 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,045,942.89 |

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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。

转型前：

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 | 216,551,318.04 | 96.22 |
| | 其中：债券 | 216,551,318.04 | 96.22 |
| | 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 | 3,406,898.46 | 1.51 |
| 8 | 其他资产 | 5,105,637.44 | 2.27 |

| | | | |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 225,063,853.94 | 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：无。

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 | 8,773,600.00 | 5.21 |
| | 其中：政策性金融债 | 8,773,600.00 | 5.21 |
| 4 | 企业债券 | 168,537,014.04 | 100.02 |
| 5 | 企业短期融资券 | 20,070,000.00 | 11.91 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 82,704.00 | 0.05 |
| 8 | 同业存单 | 19,088,000.00 | 11.33 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 216,551,318.04 | 128.52 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 111795443 | 17 广州农村商业银行 CD069 | 200,000 | 19,088,000.00 | 11.33 |
| 2 | 122366 | 14 武钢债 | 150,000 | 14,932,500.00 | 8.86 |
| 3 | 1380011 | 13 泉州城投债 | 200,000 | 12,290,000.00 | 7.29 |
| 4 | 122049 | 10 营口港 | 102,870 | 10,308,602.70 | 6.12 |
| 5 | 122756 | 12 甘农垦 | 100,000 | 10,125,000.00 | 6.01 |

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 | 8,334.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,097,303.24 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,105,637.44 |

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：本基金本报告期末未持有股票。

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（转型后）

单位：份

| 项目 | 华富恒富 18 个月定期开放债券 A | 华富恒富 18 个月定期开放债券 C |
|------------------------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2017 年 11 月 22 日）基金份额总额 | 150,965,124.86 | 17,175,451.82 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 161,751,990.34 | 999.60 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 15,316,882.65 | 226,537.97 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 297,400,232.55 | 16,949,913.45 |

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| |
|----|
| 项目 |
|----|

报告期期初基金份额总额

报告期期间基金总申购份额

减:报告期期间基金总赎回份额

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 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

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（转型后）

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

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（转型前）

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 | 11.29-12.31 | 0.00 | 99,849,226.16 | 0.00 | 99,849,226.16 | 31.76% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 无 | | | | | | | |

§9 备查文件目录

备查文件目录

- 1、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

10.3 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。