

# 华富中证 100 指数证券投资基金 2018 年半年度报告 摘要

2018 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	华富中证 100 指数
基金主代码	410008
交易代码	410008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 30 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	76,845,645.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资约束和数量化风险控制，力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%和年跟踪误差不超过 4%，以实现对中证 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，本基金的标的指数为中证 100 指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略，即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率 $\times$ 95% + 一年期银行定期存款收益率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下，其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	陆志俊
	联系电话	021-68886996	95559
	电子邮箱	manzh@hffund.com	luzj@bankcomm.com

客户服务电话	400-700-8001	95559
传真	021-68887997	021-62701216

## 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	2,126,623.41
本期利润	-9,499,134.44
加权平均基金份额本期利润	-0.1244
本期基金份额净值增长率	-9.18%
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	0.2213
期末基金资产净值	93,854,827.59
期末基金份额净值	1.2213

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) 期末可供分配利润指标的计算方法为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期末余额的孰低数，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	-5.40%	1.18%	-6.40%	1.19%	1.00%	-0.01%

过去三个月	-6.56%	1.10%	-8.21%	1.12%	1.65%	-0.02%
过去六个月	-9.18%	1.14%	-11.15%	1.16%	1.97%	-0.02%
过去一年	5.62%	0.95%	-0.07%	0.96%	5.69%	-0.01%
过去三年	-2.10%	1.39%	-9.75%	1.36%	7.65%	0.03%
自基金合同生效起至今	22.13%	1.41%	7.50%	1.39%	14.63%	0.02%

注：业绩比较基准收益率=中证 100 指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×5%，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

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：根据基金合同的规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，本基金投资于中证 100 指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的 90%~95%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2009 年 12 月 30 日至 2010 年 6 月 30 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《华富中证 100 指数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		
高靖瑜	华富中证 100 指数基金基金经理、华	2017 年 9 月 12 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

	富智慧城市灵活配置混合型基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金经理、华富策略精选灵活配置混合型基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理				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经理。
郜哲	华富中证 100 指数基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金经理	2018 年 2 月 23 日	-	四年	北京大学理学博士，研究生学历，先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员，2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司。

注：任职日期为公司作出决定之日。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、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

回顾 2018 年上半年，国内宏观环境复杂多变，2 月份风格切换至创业板反弹，自 3 月份起，中美贸易争端开始对市场产生脉冲式影响。从货币政策来看，年初的普惠金融提前实施等信号开始，至 4 月份和 6 月份两次定向降准，确立了宽货币的大环境。在今年上半年，一直延续紧信用的大环境，国家维持去杠杆政策的总体导向不变。从几个月的 PMI 数据来看，经济仍有韧性，我们的宏观经济周期模型切换至扩张期。从 2018 年 1 季报盈利增速来看，创业板相对主板形成了盈利上的相对优势。

但自 3 月底贸易争端开始以来，不断对市场形成冲击。整体对于科创板十分不利。同时外延并购对创业板影响仍在，权重行业的内生增速提升不明显，因此创业板的相对盈利优势的持续性尚且存疑。

华富中证 100 指数基金为完全复制的指数基金，在本季度中，我们实现了对业绩基准的有效跟踪，并通过打新策略，优化了基金的成本收益。

今年二季度，中证 100 基金收益为-6.56%，业绩基准为-8.21%，跟踪偏离为 1.65%，年化跟踪误差为 0.73%。基金的正偏离主要来自于打新收益和成分股分红。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现



本基金于 2009 年 12 月 30 日正式成立。截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2213 元，累计基金份额净值为 1.2213 元。本基金本报告期份额净值增长率为-9.18%，同期业绩比较基准收益率为-11.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自 7 月起，央行、人民日报、国常会纷纷释放明确的宽财政宽信用的信号，国常会强调积极的财政政策要更加积极，稳健的货币政策松紧适度。明确了宽信用宽货币的大环境。结合前期股市跌幅较大，相对利好股市反弹。中证 100 由于主要是大盘股，相对在宽信用格局下，具有更高的投资价值。

在 2018 年三季度内我们将继续通过严格的投资约束和数量化风险控制，力争实现对业绩基准的有效跟踪。同时叠加打新策略，在严格控制基金跟踪误差的前提下，适当优化基金的成本收益。为投资者提供有效跟踪中证 100 指数的投资工具。

#### 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投资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《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-9,499,134.44 元，期末可供分配利润为 17,009,181.94 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

2018 年上半年度，基金托管人在华富中证 100 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2018 年上半年度，华富基金管理有限公司在华富中证 100 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 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

2018 年上半年度，由华富基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华富中证 100 指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：华富中证 100 指数证券投资基金  
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
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
银行存款		7,522,450.31	706,423.01
结算备付金		1,190.22	143,906.56
存出保证金		3,205.64	4,577.73
交易性金融资产		86,368,734.15	100,762,030.06
其中：股票投资		86,368,734.15	95,620,532.46
基金投资		-	-
债券投资		-	5,141,497.60
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		-	-
应收利息		1,458.46	124,406.20
应收股利		-	-
应收申购款		238,800.65	60,047.08
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		94,135,839.43	101,801,390.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		129,051.63	78,100.79
应付管理人报酬		40,283.57	43,067.07
应付托管费		12,085.09	12,920.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		10,091.38	11,317.71
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		89,500.17	125,275.72
负债合计		281,011.84	270,681.42
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		76,845,645.65	75,502,599.10
未分配利润		17,009,181.94	26,028,110.12
所有者权益合计		93,854,827.59	101,530,709.22
负债和所有者权益总计		94,135,839.43	101,801,390.64

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2213 元，基金份额总额 76,845,645.65 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：华富中证 100 指数证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-9,052,641.12	10,666,092.62
1.利息收入		67,845.82	73,404.25
其中：存款利息收入		15,944.43	14,891.16
债券利息收入		51,503.74	31,198.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		397.65	27,314.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,497,041.18	2,548,298.07
其中：股票投资收益		1,409,656.35	1,789,704.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益		15,634.70	1,977.22
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		1,071,750.13	756,616.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-11,625,757.85	8,042,382.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		8,229.73	2,007.45
<b>减：二、费用</b>		446,493.32	391,963.54
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	253,615.18	159,624.16
2. 托管费	6.4.8.2.2	76,084.56	47,887.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		27,461.62	102,572.09
5. 利息支出		-	19,844.75
其中：卖出回购金融资产支出		-	19,844.75
6. 其他费用		89,331.96	62,035.26
<b>三、利润总额（亏损总额以</b>		<b>-9,499,134.44</b>	<b>10,274,129.08</b>

“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,499,134.44	10,274,129.08

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：华富中证 100 指数证券投资基金

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）	75,502,599.10	26,028,110.12	101,530,709.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-9,499,134.44	-9,499,134.44
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）	1,343,046.55	480,206.26	1,823,252.81
其中：1. 基金申购款	9,308,489.36	3,477,717.30	12,786,206.66
2. 基金赎回款	-7,965,442.81	-2,997,511.04	-10,962,953.85
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）	76,845,645.65	17,009,181.94	93,854,827.59
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）	32,634,574.05	137,535.52	32,772,109.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	10,274,129.08	10,274,129.08

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）	46,538,144.59	1,961,830.05	48,499,974.64
其中：1. 基金申购款	50,751,719.43	2,289,866.12	53,041,585.55
2. 基金赎回款	-4,213,574.84	-328,036.07	-4,541,610.91
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）	79,172,718.64	12,373,494.65	91,546,213.29

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：

<u>章宏韬</u>	<u>余海春</u>	<u>陈大毅</u>
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

华富中证 100 指数型证券投资基金（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【2009】1158 号）核准，基金合同于 2009 年 12 月 30 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健光华（北京）会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健光华验（2009）综字第 070007 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》的规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本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
交通银行股份有限公司	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	17,865,777.31	98.68%	56,046,763.91	68.44%

##### 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	-	-	4,299,434.80	37.77%

##### 6.4.8.1.3 债券回购交易



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	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华安证券	2,200,000.00	100.00%	58,400,000.00	56.02%

#### 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无通过关联方交易单元发生的权证交易。

#### 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	16,577.25	98.70%	10,091.38	100.00%
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	52,196.24	68.91%	17,501.44	55.15%

#### 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	253,615.18	159,624.16
其中：支付销售机构的客户维护费	32,562.37	27,680.51

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.50% 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）。

##### 6.4.8.2.2 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	76,084.56		47,887.28

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率逐日计提，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）。

### 6.4.8.3 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。

### 6.4.8.4 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自有资金投资本基金的情况

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

#### 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
	交通银行股份有限 公司	7,522,450.31	12,483.93	86,384.01

注：1) 本表仅列示活期存款余额及产生利息。

2) 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。本期末和上年度末的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

### 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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,553	20,328.77	20,328.77	-
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	4.83	4.83	3,300	15,939.00	15,939.00	-

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	重大事项停牌	7.47	2018 年 8 月 20 日	7.25	70,182	547,719.61	524,259.54	-
002252	上海莱士	2018 年 2 月 23 日	重大事项停牌	21.48	-	-	18,677	365,454.04	401,181.96	-
601727	上海电气	2018 年 6 月 6 日	重大事项停牌	6.34	2018 年 8 月 7 日	5.71	44,243	399,973.58	280,500.62	-
002739	万达电影	2017 年 7 月 4 日	重大事项停牌	37.99	-	-	6,027	422,259.44	228,965.73	-
600485	信威集团	2016 年 12 月	重大事项停牌	14.59	-	-	7,924	217,414.82	115,611.16	-

		26 日							
--	--	------	--	--	--	--	--	--	--

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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	86,368,734.15	91.75
	其中：股票	86,368,734.15	91.75
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	7,523,640.53	7.99
7	其他各项资产	243,464.75	0.26
8	合计	94,135,839.43	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 期末指数投资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	-	-
B	采矿业	3,069,142.62	3.27
C	制造业	31,535,295.79	33.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供	2,627,027.09	2.80

	应业		
E	建筑业	3,140,398.48	3.35
F	批发和零售业	1,006,581.76	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	2,452,651.21	2.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,477,339.56	1.57
J	金融业	35,675,459.12	38.01
K	房地产业	4,005,731.56	4.27
L	租赁和商务服务业	837,355.86	0.89
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	85,826,983.05	91.45

注：本基金本报告期指数投资部分含拟于 2018 年 7 月 1 日调入中证 100 指数的备选成分股，具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

### 7.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	162,774.46	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,784.77	0.07
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	81,226.14	0.09

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	228,965.73	0.24
S	综合	-	-
	合计	541,751.10	0.58

## 7.3 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

### 7.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	131,028	7,675,620.24	8.18
2	600519	贵州茅台	6,092	4,456,054.32	4.75
3	600036	招商银行	124,846	3,300,928.24	3.52
4	000333	美的集团	54,973	2,870,690.06	3.06
5	000651	格力电器	57,344	2,703,769.60	2.88
6	601166	兴业银行	148,611	2,139,998.40	2.28
7	600887	伊利股份	72,491	2,022,498.90	2.15
8	600276	恒瑞医药	26,347	1,996,048.72	2.13
9	601288	农业银行	578,064	1,988,540.16	2.12
10	600016	民生银行	281,812	1,972,684.00	2.10

注：本基金本报告期指数投资部分含拟于 2018 年 7 月 1 日调入中证 100 指数的备选成分股，具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

### 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002739	万达电影	6,027	228,965.73	0.24
2	600485	信威集团	7,924	115,611.16	0.12
3	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.09
4	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.05
5	603650	彤程新材	1,455	31,224.30	0.03

## 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	600309	万华化学	920,296.00	0.91
2	603288	海天味业	745,870.00	0.73
3	600009	上海机场	643,960.00	0.63
4	601318	中国平安	612,813.00	0.60
5	000568	泸州老窖	600,931.00	0.59
6	601229	上海银行	573,300.00	0.56
7	601933	永辉超市	379,848.00	0.37
8	600519	贵州茅台	300,192.00	0.30
9	600000	浦发银行	237,195.00	0.23
10	600036	招商银行	194,518.00	0.19
11	601360	三六零	174,456.00	0.17
12	002027	分众传媒	170,410.00	0.17
13	603156	养元饮品	166,828.87	0.16
14	600901	江苏租赁	155,843.75	0.15
15	601166	兴业银行	147,596.00	0.15
16	600690	青岛海尔	136,985.00	0.13
17	601111	中国国航	130,171.00	0.13
18	000166	申万宏源	120,533.00	0.12
19	000651	格力电器	114,964.00	0.11
20	000333	美的集团	110,904.00	0.11

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	601318	中国平安	710,773.54	0.70
2	601939	建设银行	595,241.87	0.59
3	603259	药明康德	512,040.00	0.50

4	600519	贵州茅台	355,024.96	0.35
5	601901	方正证券	305,824.89	0.30
6	601788	光大证券	293,599.29	0.29
7	600637	东方明珠	279,573.10	0.28
8	600901	江苏租赁	278,773.30	0.27
9	000625	长安汽车	242,765.77	0.24
10	600036	招商银行	225,143.12	0.22
11	601166	兴业银行	207,283.22	0.20
12	002797	第一创业	195,845.28	0.19
13	603156	养元饮品	195,733.46	0.19
14	000651	格力电器	184,620.44	0.18
15	600663	陆家嘴	161,717.26	0.16
16	000333	美的集团	147,223.80	0.15
17	600887	伊利股份	141,479.52	0.14
18	600016	民生银行	135,717.95	0.13
19	300104	乐视网	132,751.92	0.13
20	601288	农业银行	130,069.36	0.13

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	10,027,241.60
卖出股票收入（成交）总额	9,056,960.49

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：本基金本报告期末未持有债券。

### 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。

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

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。

### 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	3,205.64

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,458.46
5	应收申购款	238,800.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	243,464.75

#### 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

##### 7.12.5.1 期末指数投资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。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002739	万达电影	228,965.73	0.24	重大事项停牌
2	600485	信威集团	115,611.16	0.12	重大事项停牌
3	603693	江苏新能	48,456.00	0.05	新股流通受限

#### 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

2,429	31,636.74	47,910,118.82	62.35%	28,935,526.83	37.65%
-------	-----------	---------------	--------	---------------	--------

## 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	0.00	0.0000%

注：本期末本基金管理人所有从业人员未持有本开放式基金。

## 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的情况

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

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年12月30日）基金份额总额	337,421,352.99
本报告期期初基金份额总额	75,502,599.10
本报告期基金总申购份额	9,308,489.36
减：本报告期基金总赎回份额	7,965,442.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	76,845,645.65

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、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘张娅女士为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
- 2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，王翔先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
- 7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理。
- 8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郜哲先生为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。
- 9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，张惠女士不再担任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 10、本报告期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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

## 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	
华安证券	2	17,865,777.31	98.68%	16,577.25	98.70%	-
国信证券	1	239,370.79	1.32%	218.16	1.30%	-

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。

### 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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华安证券	-	-	2,200,000.00	100.00%	-	-
国信证券	71,122.19	100.00%	-	-	-	-

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

## § 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	1	1.1-6.30	47,910,118.82	0.00	0.00	47,910,118.82	62.35%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---