

# 华富中证 100 指数证券投资基金 2018 年半年度报告

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 重要提示及目录

### 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
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.....	53

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富中证 100 指数证券投资基金
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×95%+一年期银行定期存款收益率（税后）×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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		章宏韬	彭纯

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层

### § 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
本期加权平均净值利润率	-9.28%
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)
期末可供分配利润	17,009,181.94
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	22.13%

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%

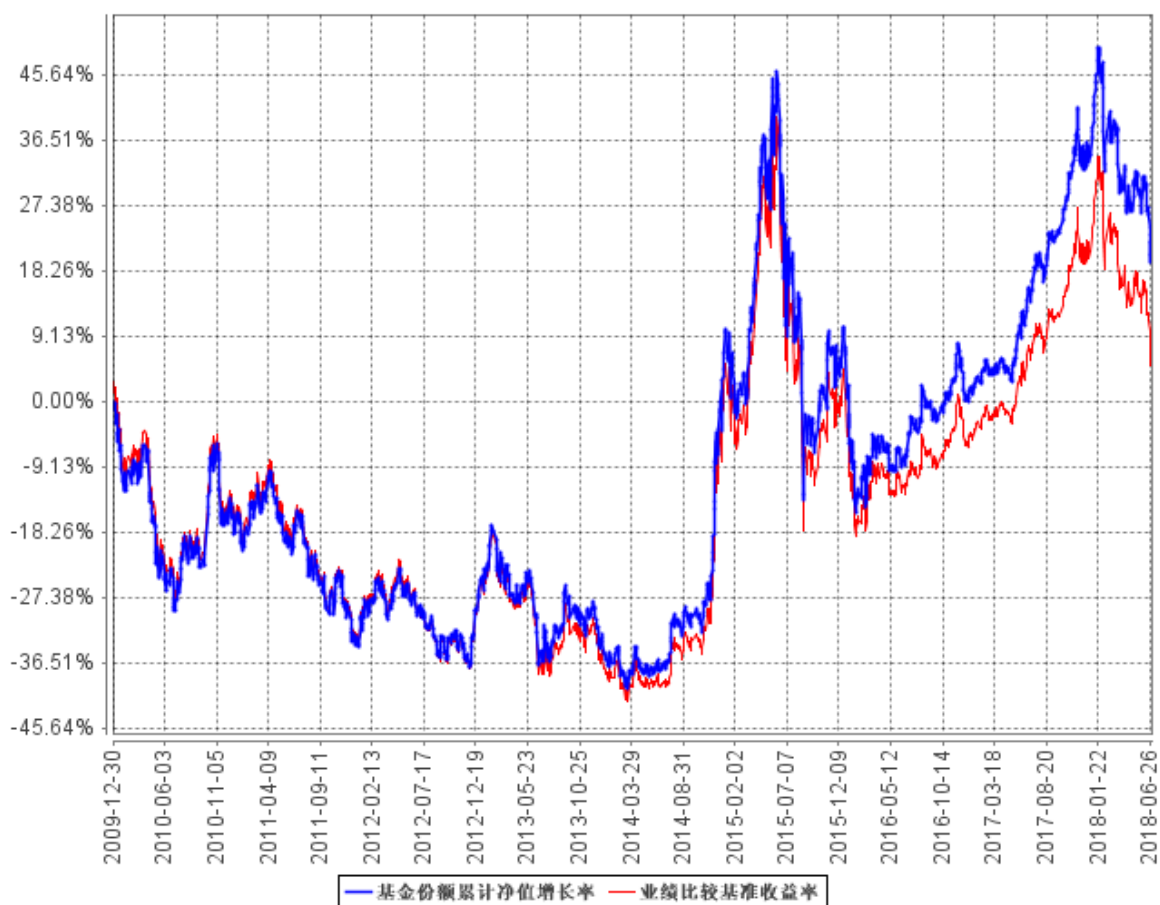


自基金合同生效起至今	22.13%	1.41%	7.50%	1.39%	14.63%	0.02%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

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	2017 年 9 月 12 日	-	十八年	复旦大学金融学硕士，本科学历。历任

	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				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经理。
郜哲	华富中证100指数基金基金经理、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

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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
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	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	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	6.4.7.9	76,845,645.65	75,502,599.10
未分配利润	6.4.7.10	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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	1,409,656.35	1,789,704.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	15,634.70	1,977.22
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,071,750.13	756,616.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-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）	6.4.7.18	8,229.73	2,007.45
<b>减：二、费用</b>		446,493.32	391,963.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	253,615.18	159,624.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	76,084.56	47,887.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	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. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	89,331.96	62,035.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,499,134.44	10,274,129.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-9,499,134.44	10,274,129.08

注：后附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：

          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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	7,522,450.31
定期存款	-
其中:存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	7,522,450.31

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	78,018,042.64	86,368,734.15	8,350,691.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	78,018,042.64	86,368,734.15	8,350,691.51

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,456.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.50
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.50
合计	1,458.46

注：本表列示的其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	10,091.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,091.38

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	238.21
预提信息披露费	64,466.77
预提审计费	24,795.19
合计	89,500.17

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,502,599.10	75,502,599.10
本期申购	9,308,489.36	9,308,489.36
本期赎回(以“-”号填列)	-7,965,442.81	-7,965,442.81
本期末	76,845,645.65	76,845,645.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,587,519.63	6,440,590.49	26,028,110.12
本期利润	2,126,623.41	-11,625,757.85	-9,499,134.44
本期基金份额交易产生的变动数	351,682.00	128,524.26	480,206.26
其中：基金申购款	2,467,169.83	1,010,547.47	3,477,717.30
基金赎回款	-2,115,487.83	-882,023.21	-2,997,511.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,065,825.04	-5,056,643.10	17,009,181.94

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,483.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,432.06
其他	28.44
合计	15,944.43

注：其他所列本期金额包括权证保证金利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,056,960.49
减：卖出股票成本总额	7,647,304.14
买卖股票差价收入	1,409,656.35

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元



项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	15,634.70
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	15,634.70

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,338,796.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,147,475.52
减：应收利息总额	175,685.97
买卖债券差价收入	15,634.70

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,071,750.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,071,750.13

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,625,757.85
——股票投资	-11,631,735.77
——债券投资	5,977.92
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-11,625,757.85

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	8,211.58
转换费收入	18.15
合计	8,229.73

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	27,461.62
银行间市场交易费用	-
合计	27,461.62

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	64,466.77
银行汇划费用	70.00
合计	89,331.96

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

##### 6.4.9.2 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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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%

#### 6.4.10.1.2 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%

#### 6.4.10.1.3 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%

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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%
------	-----------	--------	-----------	--------

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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）。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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）。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		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	6,937.33

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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	-

### 6.4.12.2 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26日	重大事项停牌	14.59	-	-	7,924	217,414.82	115,611.16	-

### 6.4.12.3 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。



**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.00	60,700.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	60,700.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

**6.4.13.3 流动性风险****6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,522,450.31	-	-	-	-	-	7,522,450.31
结算备付金	1,190.22	-	-	-	-	-	1,190.22
存出保证金	3,205.64	-	-	-	-	-	3,205.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-86,368,734.15	86,368,734.15
应收利息	-	-	-	-	-	1,458.46	1,458.46
应收申购款	-	-	-	-	-	238,800.65	238,800.65
资产总计	7,526,846.17	-	-	-	-	-86,608,993.26	94,135,839.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	129,051.63	129,051.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,283.57	40,283.57
应付托管费	-	-	-	-	-	12,085.09	12,085.09
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,091.38	10,091.38
其他负债	-	-	-	-	-	89,500.17	89,500.17
负债总计	-	-	-	-	-	281,011.84	281,011.84
利率敏感度缺口	7,526,846.17	-	-	-	-	-86,327,981.42	93,854,827.59
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	706,423.01	-	-	-	-	-	706,423.01
结算备付金	143,906.56	-	-	-	-	-	143,906.56
存出保证金	4,577.73	-	-	-	-	-	4,577.73
交易性金融资产	-	-	-5,141,497.60	-	-	-95,620,532.46	100,762,030.06

应收利息	-	-	-	-	124,406.20	124,406.20
应收申购款	-	-	-	-	60,047.08	60,047.08
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	854,907.30	-5,141,497.60	-	-	-95,804,985.74	101,801,390.64
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	78,100.79	78,100.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	43,067.07	43,067.07
应付托管费	-	-	-	-	12,920.13	12,920.13
应付交易费用	-	-	-	-	11,317.71	11,317.71
其他负债	-	-	-	-	125,275.72	125,275.72
负债总计	-	-	-	-	270,681.42	270,681.42
利率敏感度缺口	854,907.30	-5,141,497.60	-	-	-95,534,304.32	101,530,709.22

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	0.00	4,501.54
市场利率上升 25 基点	0.00	-4,496.08	

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产-股票投资	86,368,734.15	92.02	95,620,532.46	94.18
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	5,141,497.60	5.06
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	86,368,734.15	92.02	100,762,030.06	99.24

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 100 指数外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	中证 100 指数上升百分之五	4,088,519.56	4,515,142.11
	中证 100 指数下降百分之五	-4,088,519.56	-4,515,142.11

#### 6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 95%		
	2. 观察期 1 年		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	合计	18,894,959.85	14,821,339.01

#### 6.4.14 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	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	7,523,640.53	7.99
8	其他各项资产	243,464.75	0.26
9	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（元）	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、燃气及水生产和供应业	2,627,027.09	2.80
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（元）	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

### 7.2.3 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所有股票投资明细

### 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所有股票投资明细

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
11	000858	五粮液	23,110	1,756,360.00	1.87
12	600000	浦发银行	182,500	1,744,700.00	1.86
13	002415	海康威视	44,054	1,635,725.02	1.74
14	600030	中信证券	93,821	1,554,613.97	1.66
15	600104	上汽集团	41,793	1,462,337.07	1.56
16	000002	万科 A	57,945	1,425,447.00	1.52
17	601398	工商银行	260,987	1,388,450.84	1.48
18	601668	中国建筑	250,250	1,366,365.00	1.46
19	601988	中国银行	355,782	1,284,373.02	1.37
20	600900	长江电力	78,714	1,270,443.96	1.35
21	601601	中国太保	37,508	1,194,629.80	1.27
22	601818	光大银行	291,569	1,067,142.54	1.14
23	601169	北京银行	176,388	1,063,619.64	1.13
24	600048	保利地产	84,758	1,034,047.60	1.10

25	000725	京东方 A	282,466	999,929.64	1.07
26	002304	洋河股份	7,208	948,572.80	1.01
27	000001	平安银行	102,281	929,734.29	0.99
28	600837	海通证券	96,403	912,936.41	0.97
29	600309	万华化学	19,600	890,232.00	0.95
30	600019	宝钢股份	110,983	864,557.57	0.92
31	600028	中国石化	131,932	856,238.68	0.91
32	600518	康美药业	37,283	853,035.04	0.91
33	600585	海螺水泥	25,145	841,854.60	0.90
34	600690	青岛海尔	43,660	840,891.60	0.90
35	002027	分众传媒	87,498	837,355.86	0.89
36	601229	上海银行	46,510	732,997.60	0.78
37	603288	海天味业	9,700	714,308.00	0.76
38	601766	中国中车	91,580	705,166.00	0.75
39	000538	云南白药	6,513	696,630.48	0.74
40	601211	国泰君安	47,160	695,138.40	0.74
41	002024	苏宁易购	46,747	658,197.76	0.70
42	600009	上海机场	11,500	638,020.00	0.68
43	601857	中国石油	81,321	626,984.91	0.67
44	601688	华泰证券	40,998	613,740.06	0.65
45	601006	大秦铁路	74,594	612,416.74	0.65
46	600015	华夏银行	80,427	599,181.15	0.64
47	300059	东方财富	45,235	596,197.30	0.64
48	600703	三安光电	30,666	589,400.52	0.63
49	001979	招商蛇口	29,747	566,680.35	0.60
50	600050	中国联通	113,861	560,196.12	0.60
51	600919	江苏银行	86,974	557,503.34	0.59
52	601009	南京银行	70,799	547,276.27	0.58
53	002594	比亚迪	11,391	543,122.88	0.58
54	000568	泸州老窖	8,700	529,482.00	0.56
55	601390	中国中铁	70,182	524,259.54	0.56
56	002142	宁波银行	31,831	518,526.99	0.55
57	601186	中国铁建	57,783	498,089.46	0.53
58	601088	中国神华	24,791	494,332.54	0.53
59	000776	广发证券	37,181	493,391.87	0.53
60	601628	中国人寿	20,896	470,577.92	0.50
61	601899	紫金矿业	130,198	470,014.78	0.50
62	601989	中国重工	114,850	463,994.00	0.49
63	601336	新华保险	10,513	450,797.44	0.48



64	601225	陕西煤业	50,193	412,586.46	0.44
65	002252	上海莱士	18,677	401,181.96	0.43
66	600999	招商证券	28,733	393,067.44	0.42
67	600958	东方证券	42,667	389,549.71	0.42
68	000063	中兴通讯	29,843	388,854.29	0.41
69	600795	国电电力	147,937	387,594.94	0.41
70	600340	华夏幸福	14,829	381,846.75	0.41
71	000166	申万宏源	80,534	351,933.58	0.37
72	601933	永辉超市	45,600	348,384.00	0.37
73	600011	华能国际	52,618	334,650.48	0.36
74	601985	中国核电	58,611	331,152.15	0.35
75	000895	双汇发展	12,400	327,484.00	0.35
76	600115	东方航空	49,265	326,134.30	0.35
77	601111	中国国航	35,655	316,972.95	0.34
78	601669	中国电建	57,642	308,961.12	0.33
79	600606	绿地控股	45,855	299,891.70	0.32
80	000069	华侨城 A	41,192	297,818.16	0.32
81	601727	上海电气	44,243	280,500.62	0.30
82	002736	国信证券	30,823	280,489.30	0.30
83	600010	包钢股份	171,592	265,967.60	0.28
84	600893	航发动力	11,310	252,439.20	0.27
85	601998	中信银行	38,455	238,805.55	0.25
86	600023	浙能电力	51,166	238,433.56	0.25
87	600018	上港集团	37,822	225,419.12	0.24
88	601618	中国中冶	67,230	223,875.90	0.24
89	601800	中国交建	19,214	218,847.46	0.23
90	603993	洛阳钼业	33,225	208,985.25	0.22
91	601018	宁波港	49,610	208,858.10	0.22
92	002558	巨人网络	7,663	182,226.14	0.19
93	601633	长城汽车	15,115	148,429.30	0.16
94	601360	三六零	4,800	138,720.00	0.15
95	002352	顺丰控股	2,774	124,830.00	0.13
96	601881	中国银河	15,315	124,510.95	0.13
97	601238	广汽集团	7,700	85,778.00	0.09
98	600025	华能水电	21,300	64,752.00	0.07

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 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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
6	603706	东方环宇	1,553	20,328.77	0.02
7	603105	芯能科技	3,300	15,939.00	0.02

### 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所有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

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

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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华富中证 100 指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 1 月 22 日
2	关于华富基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与北京展恒基金销售股份有限公司费率优惠活动的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 2 月 8 日
3	华富中证 100 指数证券投资基金招募说明书更新及摘要（17 年 2 号）	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 2 月 13 日
4	华富基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 2 月 24 日
5	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 2 月 28 日
6	关于华富基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与珠海盈米财富管理有限公司费率优惠活动的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 2 月 28 日
7	华富中证 100 指数证券投资基金 2017 年度报告及摘要	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 3 月 28 日
8	关于华富基金管理有限公司根据流动性风险管理规定修订基金合同及托管协议并调整旗下部分基金赎回费率的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 3 月 28 日
9	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东海证券基金费率优惠活动的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 3 月 30 日
10	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费费率优惠的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 3 月 30 日
11	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证	2018 年 3 月 30 日

	行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	券时报》上公告	
12	华富中证 100 指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 4 月 21 日
13	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 5 月 23 日
14	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加银河证券基金费率优惠活动的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 6 月 1 日
15	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 6 月 16 日
16	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行基金申购费率优惠的公告	在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上公告	2018 年 6 月 30 日

## § 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
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华富中证 100 指数型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富中证 100 指数型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富中证 100 指数型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富中证 100 指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 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。