

华富强化回报债券型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 28 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富强化回报债券
场内简称	华富强债
基金主代码	164105
基金运作方式	契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易，基金合同生效满三年后，转为上市开放式基金（LOF）
基金合同生效日	2010 年 9 月 8 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	362,166,330.69 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 10 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素，研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险，以确定各类金融资产的配置比例。
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低风险品种，预期风险和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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	田青
	联系电话	021-68886996	010-67595096
	电子邮箱	manzh@hffund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853

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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	16,588,023.77
本期利润	25,725,801.17
加权平均基金份额本期利润	0.0798
本期基金份额净值增长率	6.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.3262
期末基金资产净值	492,384,868.93
期末基金份额净值	1.360

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，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

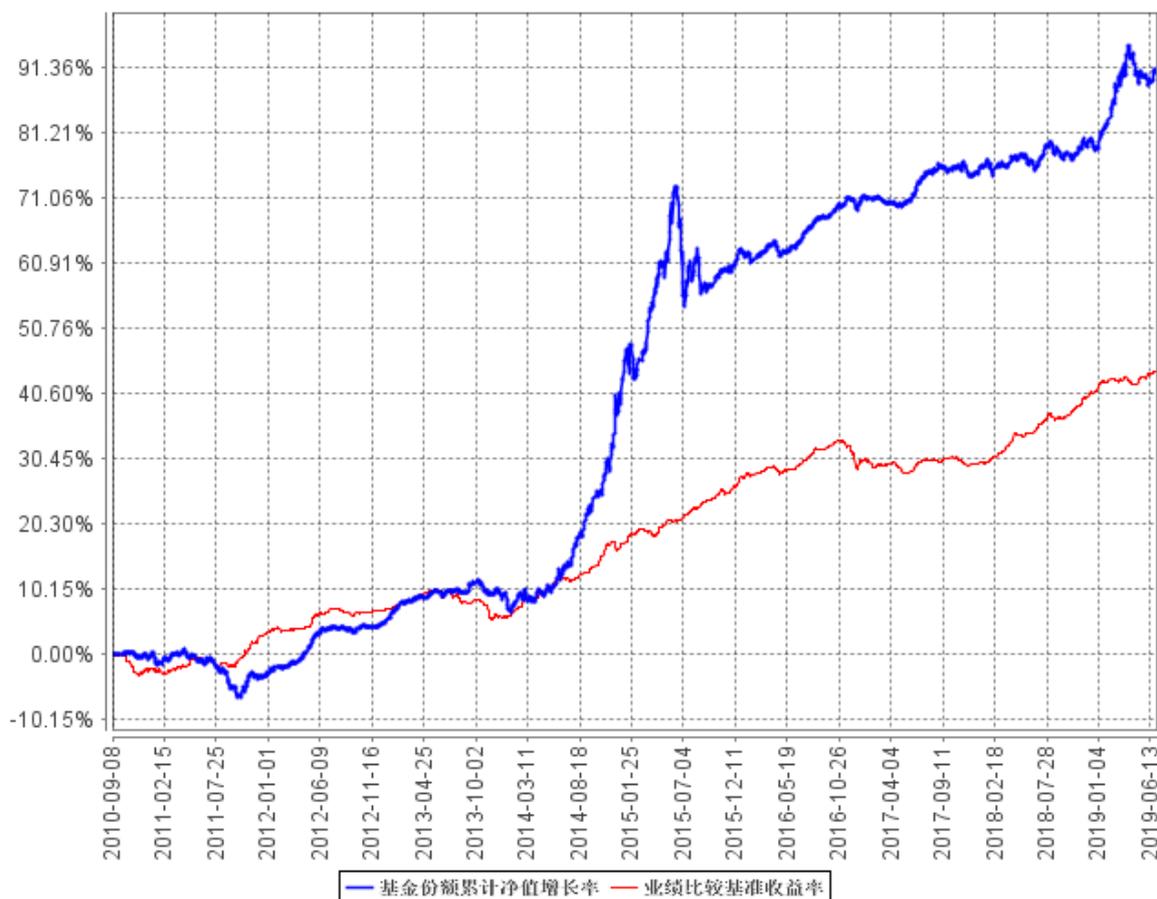
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.82%	0.20%	0.57%	0.03%	0.25%	0.17%
过去三个月	-0.29%	0.30%	0.63%	0.06%	-0.92%	0.24%
过去六个月	6.83%	0.32%	2.07%	0.06%	4.76%	0.26%
过去一年	8.45%	0.25%	6.46%	0.06%	1.99%	0.19%
过去三年	16.16%	0.18%	11.13%	0.08%	5.03%	0.10%
自基金合同生效起至今	91.15%	0.29%	44.14%	0.09%	47.01%	0.20%

注：业绩比较基准收益率=中证全债指数，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《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%。本基金还可以参与新股申购、股票增发和要约收购类股票投资，并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于非固定收益类证券的比例不超过基金资产的 20%。在封闭期结束后，本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 2010 年 9 月 8 日到 2011 年 3 月 8 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《华富强化回报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 2019 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、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、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、华富安福债券型证券投资基金、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、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、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、华富恒财定期开放债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债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		
尹培俊	华富强化回报债券型基金基金经理、华富安享债券	2014 年 3 月 6 日	-	十三年	兰州大学工商管理硕士，研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析

	型基金 基金经 理、华富 华鑫灵 活配置 混合型 基金基 金基金 经理、 华富收 益增强 债券型 基金基 金基金 经理、 华富可 转债债 券型基 金基金 经理、固 定收益 部总监、 公司公 募投资 决策委 员会委 员			师、上海新世纪资信评估 投资服务有限公司高级分 析师、德邦证券有限责任 公司固定收益部高级经 理。2012 年加入华富基金 管理有限公司，曾任固定 收益部信用研究员、固定 收益部总监助理、固定收 益部副总监，2016 年 5 月 5 日至 2018 年 9 月 4 日任 华富诚鑫灵活配置混合型 基金基金经理、2014 年 3 月 6 日至 2019 年 6 月 20 日任华富货币市场基金基 金经理。
--	--	--	--	---

注：这里的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、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

从基本面来看，2019 年上半年以来宏观数据继续在低位徘徊，金融数据表现逐步趋于平淡，市场对于经济企稳复苏的预期逐步被证伪。政策层面货币宽松基调边际有所收紧，但包商事件引发市场短期冲击，信用分层趋势渐成，货币政策短期重回宽松。外部来看，中美贸易摩擦出现反复，从预期达成协议到暂停对话，再到日本 G20 峰会重启对话，对市场风险偏好产生持续干扰。从资本市场的表现来看，上半年市场风险偏好有较好的修复，但由于基本面复苏预期被证伪，叠加政策基调边际收紧和中美贸易摩擦，股票市场出现冲高回落的走势；而债券市场受益于基本面支撑，虽然有利率债供给压力、包商事件冲击等因素影响，但整体表现仍然较为平稳。相比而言利率债和中高等级信用债走势更为平稳，低等级信用债仍然面临利差走阔的压力。本基金在年初加仓可转债仓位，在二季度逐步降低股票和可转债仓位，债券仓位以中高等级信用债为主，长久期利率债波段操作，上半年产品净值有较好的增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2010 年 9 月 8 日正式成立。截止 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.360 元，累计份额净值为 1.811 元。本报告期，本基金净值增长率为 6.83%，同期业绩比较基准收益率为 2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基本面难有大幅改观，无风险利率和风险偏好对市场影响的影响作用将更为显著。长期来看，市场所担心的中美关系问题、内部改革和债务杠杆问题、人口问题等仍将持续存在，仍然需要相当的时间和空间才可能得以解决。去年过度地把长期问题短期化的情绪得到了明显的纠偏，今年以来市场风险偏好和估值水平已经得到了较好的修复，“核心资产”表现突出。后续我们倾向于认为基本面仍会在低位徘徊，但在政策托底的情况下经济失速的风险在显著下降。在货币政策仍然偏松，且在各种打破刚兑的预期和“房住不炒”的政策基调下，长端利率仍有进一步下行的空间，无风险利率有望继续下行。从资产配置角度，基本面和货币政策仍对债券市场形成支撑，但由于绝对收益率水平仍处在较低位置，性价比继续下降。风险资产仍面临基本面改善不足的掣肘，但中美贸易摩擦对市场的影响在逐步弱化，无风险利率和风险偏好可能是下半年

影响市场的更为重要的变量。本基金仍将坚持在较低风险程度下，认真研究各个潜在投资领域的机会，稳健地做好配置策略，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。

4.6 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《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 25,725,801.17 元，期末可供分配利润为 118,140,935.74 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：华富强化回报债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,571,617.30	10,194,783.82
结算备付金		6,298,918.58	12,284,154.04
存出保证金		28,839.92	19,338.63
交易性金融资产	6.4.7.2	512,084,731.30	436,211,810.83
其中：股票投资		9,007,084.05	14,757,994.78
基金投资		-	-
债券投资		503,077,647.25	421,453,816.05
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		-	793,508.06
应收利息	6.4.7.5	5,307,193.69	8,549,405.79
应收股利		-	-
应收申购款		54,540.11	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		534,345,840.90	468,053,001.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
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		31,000,000.00	105,500,000.00
应付证券清算款		10,453,174.98	10,012,745.09
应付赎回款		1,118.80	12,120.43
应付管理人报酬		219,793.03	175,441.58
应付托管费		73,264.34	58,480.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	26,827.64	2,232.81
应交税费		44,960.15	26,779.80

应付利息		-	-30,291.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	141,833.03	389,006.72
负债合计		41,960,971.97	116,146,515.26
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	362,166,330.69	276,446,476.27
未分配利润	6.4.7.10	130,218,538.24	75,460,009.64
所有者权益合计		492,384,868.93	351,906,485.91
负债和所有者权益总计		534,345,840.90	468,053,001.17

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.360 元，基金份额总额 362,166,330.69 份。

后附表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富强化回报债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		28,360,997.72	6,072,047.80
1.利息收入		8,072,149.64	11,210,868.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,378.93	65,505.92
债券利息收入		8,007,770.71	11,145,362.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,127,848.18	-4,639,313.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	333,484.63	49,530.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	10,774,363.55	-4,708,843.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	20,000.00	20,000.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,137,777.40	-507,046.90
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	23,222.50	7,538.87
减：二、费用		2,635,196.55	3,611,532.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,285,484.28	1,208,969.33

2. 托管费	6.4.10.2.2	428,494.81	402,989.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	63,783.94	7,700.96
5. 利息支出		679,948.34	1,704,034.83
其中：卖出回购金融资产支出		679,948.34	1,704,034.83
6. 税金及附加		21,143.05	35,079.21
7. 其他费用	6.4.7.20	156,342.13	252,757.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,725,801.17	2,460,515.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,725,801.17	2,460,515.77

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：华富强化回报债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	276,446,476.27	75,460,009.64	351,906,485.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,725,801.17	25,725,801.17
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）	85,719,854.42	29,032,727.43	114,752,581.85
其中：1.基金申购款	154,416,044.16	53,059,843.91	207,475,888.07
2.基金赎回款	-68,696,189.74	-24,027,116.48	-92,723,306.22
五、期末所有者权益（基金净值）	362,166,330.69	130,218,538.24	492,384,868.93
项目	上年度可比期间 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)	326,602,088.47	80,523,652.03	407,125,740.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,460,515.77	2,460,515.77
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)	-2,155,773.93	-487,613.58	-2,643,387.51
其中：1.基金申购款	25,813,224.87	6,560,397.91	32,373,622.78
2.基金赎回款	-27,968,998.80	-7,048,011.49	-35,017,010.29
五、期末所有者权益(基金净值)	324,446,314.54	82,496,554.22	406,942,868.76

注：后附报表附注为本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 曹华玮 邵恒
 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

华富强化回报债券型证券投资基金(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【2010】989号)2010年7月23日核准,基金合同于2010年9月8日生效。本基金为创新型封闭式,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金(LOF)。设立时募集资金到位情况经天健正信会计师事务所审验,并出具《验资报告》(天健正信验(2010)综字第020119号)。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人为华富基金管理有限公司,基金份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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 重要会计政策和会计估计

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) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(三) 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。

主要税种及税率列示如下：

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	金融服务销售额	3%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加[注]	应缴流转税税额	2%、1%

[注]：接地方税务局通知，自 2018 年 7 月 1 日起下调地方教育附加税税率，由原来的 2% 下调为 1%。

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	基金管理人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	27,069,604.61	100.00%	87,320.00	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	279,295,697.48	73.22%	235,745,595.54	62.05%

注：本表中“当期债券成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券交易成交总额。

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	5,735,200,000.00	100.00%	9,996,620,000.00	100.00%

注：本表中“当期债券回购成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券回购成交总额。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间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 2019年1月1日至2019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	25,163.08	100.00%	23,017.14	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	80.77	100.00%	44.80	100.00%

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,285,484.28	1,208,969.33

其中：支付销售机构的客户维护费	24,261.22	29,768.98
-----------------	-----------	-----------

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.6% 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	428,494.81	402,989.76

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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。

6.4.8.4.2 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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
中国建设银行股份有限公司	10,571,617.30	15,633.57	276,844.08	9,016.44

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

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（2019 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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 31,000,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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	9,007,084.05	1.69
	其中：股票	9,007,084.05	1.69
3	固定收益投资	503,077,647.25	94.15
	其中：债券	503,077,647.25	94.15
7	银行存款和结算备付金合计	16,870,535.88	3.16
8	其他各项资产	5,390,573.72	1.01
9	合计	534,345,840.90	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.11.3 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 报告期末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 (%)
B	采矿业	10,650.00	0.00
C	制造业	4,394,000.00	0.89
J	金融业	4,602,434.05	0.93
	合计	9,007,084.05	1.83

7.2.2 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	601336	新华保险	83,635	4,602,434.05	0.93
2	600031	三一重工	200,000	2,616,000.00	0.53
3	002241	歌尔股份	200,000	1,778,000.00	0.36
4	600968	海油发展	3,000	10,650.00	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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	603668	天马科技	6,646,440.64	1.89
2	601233	桐昆股份	4,465,419.40	1.27
3	002548	金新农	2,476,728.90	0.70
4	600968	海油发展	6,120.00	0.00
5	002948	青岛银行	2,260.00	0.00

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	601233	桐昆股份	12,240,622.96	3.48
2	603668	天马科技	6,838,181.54	1.94
3	600031	三一重工	5,635,992.85	1.60
4	002548	金新农	2,351,064.10	0.67
5	002948	青岛银行	3,755.00	0.00

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	13,596,968.94
卖出股票收入（成交）总额	27,069,616.45

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
3	金融债券	46,138,500.00	9.37
	其中：政策性金融债	46,138,500.00	9.37
4	企业债券	176,979,300.00	35.94
5	企业短期融资券	20,035,000.00	4.07
6	中期票据	113,784,000.00	23.11

7	可转债（可交换债）	146,140,847.25	29.68
10	合计	503,077,647.25	102.17

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1480451	14 沪南汇债	350,000	21,745,500.00	4.42
2	180206	18 国开 06	200,000	21,106,000.00	4.29
3	101800321	18 陕煤化 MTN002	200,000	21,050,000.00	4.28
4	101760025	17 深业集 MTN001	200,000	20,454,000.00	4.15
5	112247	15 华东债	200,000	20,192,000.00	4.10

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投资

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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.11.3 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	28,839.92
4	应收利息	5,307,193.69

5	应收申购款	54,540.11
9	合计	5,390,573.72

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132011	17 浙报 EB	16,462,416.00	3.34
2	127006	敖东转债	13,368,327.03	2.72
3	110046	圆通转债	12,498,840.00	2.54
4	132007	16 凤凰 EB	8,901,000.00	1.81
5	132006	16 皖新 EB	8,374,400.00	1.70
6	113020	桐昆转债	8,104,712.20	1.65
7	113011	光大转债	7,104,536.00	1.44
8	113015	隆基转债	6,993,765.00	1.42
9	113519	长久转债	6,001,782.70	1.22
10	113516	吴银转债	5,372,000.00	1.09
11	113014	林洋转债	5,222,894.70	1.06
12	128044	岭南转债	2,603,915.00	0.53
13	113525	台华转债	2,458,712.40	0.50
14	113518	顾家转债	1,661,550.00	0.34
15	113019	玲珑转债	1,131,415.60	0.23
16	110033	国贸转债	1,114,500.00	0.23
17	113522	旭升转债	1,038,000.00	0.21
18	128014	永东转债	950,026.26	0.19
19	110048	福能转债	741,790.80	0.15
20	132013	17 宝武 EB	599,640.00	0.12
21	113521	科森转债	576,139.00	0.12
22	113515	高能转债	394,930.20	0.08
23	128042	凯中转债	318,158.10	0.06

7.11.5 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情况。

7.11.6 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。

§ 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
813	445,469.04	342,740,992.70	94.64%	19,425,337.99	5.36%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	中意人寿保险有限公司一分 红-团体年金	18,023,355.00	72.07%
2	国家电网公司东北分部企业 年金计划-招商银行股份有 限公司	5,074,200.00	20.29%
3	李宁	300,000.00	1.20%
4	华中电网有限公司企业年金 计划-中国建设银行股份有 限公司	295,000.00	1.18%
5	许剑虹	128,000.00	0.51%
6	林建勇	107,000.00	0.43%
7	蒋家亮	92,011.00	0.37%
8	明中行	73,860.00	0.30%
9	朱红	69,709.00	0.28%
10	郑丽华	55,500.00	0.22%

注：本表所列的持有份额为持有人持有的本基金可在深圳证券交易所上市交易部分的份额。

8.3 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	79,381.47	0.0219%

8.4 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	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2010 年 9 月 8 日 ）基金份额总额	1,999,206,694.42
本报告期期初基金份额总额	276,446,476.27
本报告期期间基金总申购份额	154,416,044.16
减：本报告期期间基金总赎回份额	68,696,189.74
本报告期期末基金份额总额	362,166,330.69

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，增聘陈启明先生为华富天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，翁海波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，翁海波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，翁海波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，增聘张惠女士为华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
- 6、经华富基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，因工作需要，余海春先生不再担任公司总经理职务，聘任曹华玮先生担任公司总经理。
- 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，增聘张亮先生为华富灵活配置混合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，增聘倪莉莎女士为华富货币市场基金基金经理。
- 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，增聘郦彬先生为华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理。
- 10、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，尹培俊先生、姚姣姣女士不再担任华富货币市场基金基金经理的职务。
- 11、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，姚姣姣女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。
- 12、托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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	27,069,604.61	100.00%	25,163.08	100.00%	-
国联证券	2	-	-	-	-	-

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) 本报告期本基金无交易单元变更。

3) 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	279,295,697.48	73.22%	5,735,200,000.00	100.00%	-	-
国联证券	102,150,114.24	26.78%	-	-	-	-

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	111,519,377.42	0.00	0.00	111,519,377.42	30.79%
	2	1.1-6.30	85,391,222.57	0.00	0.00	85,391,222.57	23.58%
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。
