

华富中小板指数增强型证券投资基金 2019 年半年度报告

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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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.....	13
§5 托管人报告	15
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
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.....	49

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富中小板指数增强型证券投资基金
基金简称	华富中小板指数增强
基金主代码	410010
交易代码	410010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 9 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	26,021,609.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，以被动跟踪标的指数为主，力争控制本基金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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础上，力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	作为指数增强型基金，本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上，采用适度的主动投资辅助提高收益，降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法，按照标的指数的成分股组成及其权重构建指数化投资组合，并按照标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股，在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。
业绩比较基准	中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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	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
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	章宏韬	田国立

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》
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

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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-918,597.35
本期利润	-83,682.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0045
本期加权平均净值利润率	-0.42%
本期基金份额净值增长率	17.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	1,390,522.10
期末可供分配基金份额利润	0.0534
期末基金资产净值	27,412,131.74
期末基金份额净值	1.0534
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.34%

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

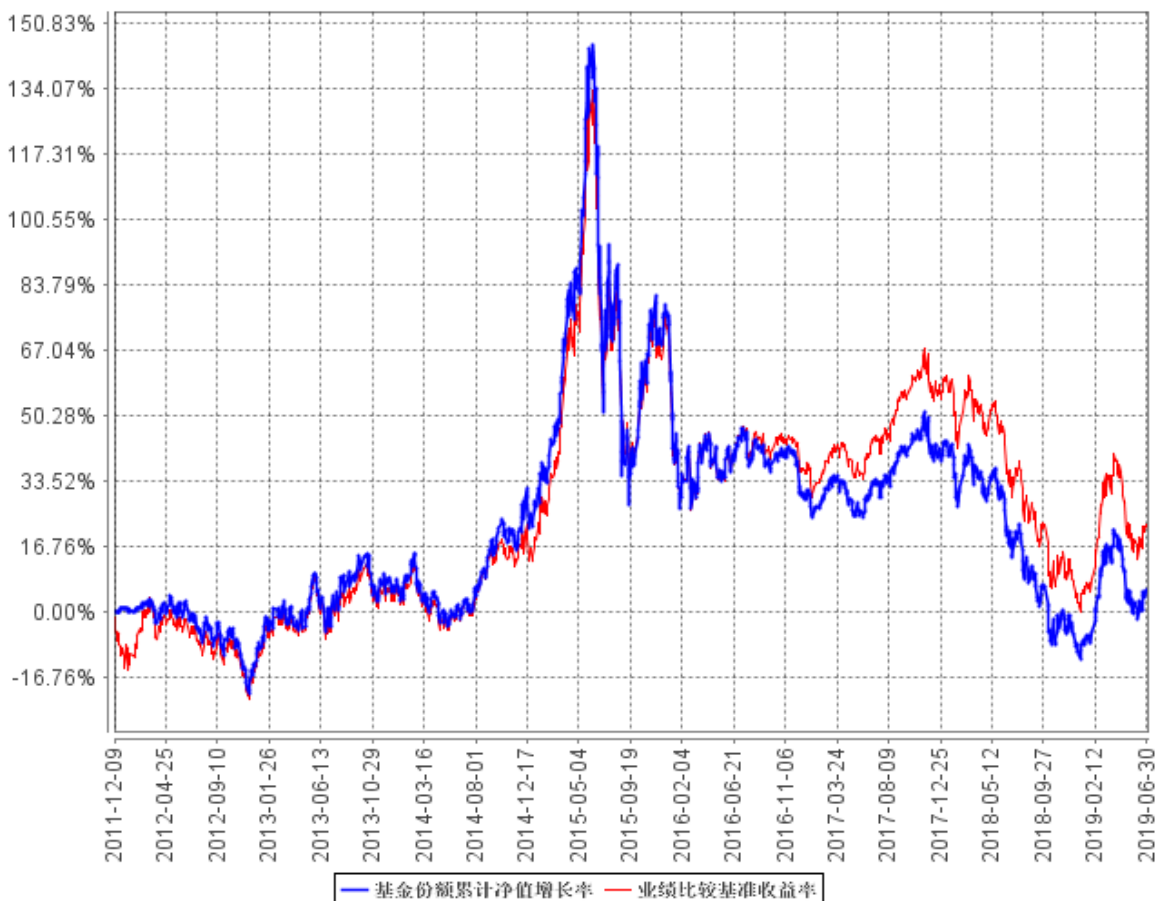
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.48%	1.27%	3.38%	1.29%	0.10%	-0.02%
过去三个月	-9.80%	1.64%	-9.83%	1.65%	0.03%	-0.01%
过去六个月	17.02%	1.61%	18.79%	1.64%	-1.77%	-0.03%
过去一年	-12.62%	1.61%	-10.72%	1.61%	-1.90%	0.00%
过去三年	-26.34%	1.22%	-15.10%	1.22%	-11.24%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.34%	1.57%	21.83%	1.53%	-16.49%	0.04%

注：业绩比较基准收益率=中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%，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《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：投资于股票资产占基金资产的比例为 85%–95%，其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为 2011 年 12 月 9 日到 2012 年 6 月 9 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《华富中小板指数增强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		
高靖瑜	华富中小板指数增强型基金基金经理、华富中证 100	2017 年 9 月 12 日	-	十九年	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、上海天相投资咨询有限公司

	指数基金基金经理、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				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基金经理。
郜哲	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、华富中证 100 指数基金基金经理、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型基金基金经理	2018 年 2 月 23 日	-	五年	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：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

2019 年上半年，股市在一季度大幅上涨后，二季度呈现下跌态势，上半年沪深 300 上涨 27.07%、中证 100 上涨 28.81%、中小板上涨 20.75%、创业板上涨 20.87%。

一季度随着社融数据改善，1 月天量信贷投放，PMI 数据企稳，风险偏好逐渐修复，同时外资持续流入，以及贸易战的缓和，市场出现快速上涨行情，而快速上涨使得市场赚钱效应越来越强，进一步推高了涨幅。

但国内工业增加值从 3 月份的 8.5% 之后，该指标在 4、5 月大幅下滑至 5.5% 和 5%，PMI 2 季度下滑至荣枯线下，国内经济景气度在短暂回升后再度转为下降。同时货币政策也从出现了边际收紧。再加上贸易战的反复导致国际环境和国内经济都出现了较大波动，市场风险偏好下降，股市出现了明显的震荡向下。

依据我们的市场环境划分模型，当前市场状态已经由牛市转为震荡市。

本基金在上半年，基于对科创蓝筹结构行情可能出现的判断，鉴于本基金科创蓝筹属性较强，进行了持续营销，基金规模有所增长。

基金操作方面，鉴于 1 季度处于牛市环境，而 2 季度市场环境较差，多数时间处于调整，且有贸易冲突等对本板块影响较大的事件出现，因此，首先主要以复制指数为主，其次，1 季度在出现大量申购时，提前利用已有现金仓位，在 T+1 日将 T 申购款中的一部分买入股票，部分降低了牛市中的现金拖累；2 季度出现大量申购时，采取正常操作方式，维持 T+3 日才将申购款建仓。

最后，阶段性进行基本面因子增强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2011 年 12 月 9 日正式成立。截止 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0534 元，累计份额净值为 1.0534 元。报告期，本基金份额净值增长率为 17.02%，同期业绩比较基准收益率为 18.79%。

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 2019 年的 3 季度，当前处于收缩期，市场环境处于震荡市，宏观因子方面，伴随金融供给和支持科创行业的持续预期，市场对核心资产的抱团预期在逐渐形成。

因此在 2019 年三季度中：

本基金将以跟踪指数为主，当前行情多为对未来的预期，因子基于历史数据，对未来信息的反应比较有限，因此将尽量减少因子增强的频率。在依据核心资产的核心财务指标的筛选后，对于排名靠前同时也符合市场认知的科创蓝筹类成分股，适当进行权重的加大。

本基金将维持仓位在基准水平。

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《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 -83,682.57 元，期末可供分配利润为 1,390,522.10 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

从 2014 年 9 月 4 日起至本报告期末（2019 年 6 月 30 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于五千万元的情形，至本报告期期末（2019 年 6 月 30 日）基金资产净值仍低于五千万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将

严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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：华富中小板指数增强型证券投资基金

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	2,873,839.44	1,643,987.32
结算备付金		7,792.23	4,110.14
存出保证金		5,417.04	521.88
交易性金融资产	6.4.7.2	25,006,785.14	7,282,691.90
其中：股票投资		25,006,785.14	7,282,691.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	608.05	365.47
应收股利		-	-
应收申购款		7,869.89	19,619.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		27,902,311.79	8,951,296.34
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		-	-
应付证券清算款		-	4,301.39
应付赎回款		93,952.39	3,798.16
应付管理人报酬		22,070.01	7,407.87
应付托管费		3,310.49	1,111.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,111.91	1,574.97
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	362,735.25	380,014.31
负债合计		490,180.05	398,207.87
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	26,021,609.64	9,501,282.81
未分配利润	6.4.7.10	1,390,522.10	-948,194.34
所有者权益合计		27,412,131.74	8,553,088.47
负债和所有者权益总计		27,902,311.79	8,951,296.34

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0534 元，基金份额总额 26,021,609.64 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：华富中小板指数增强型证券投资基金

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		167,451.23	-1,193,444.05
1.利息收入		9,905.53	10,009.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,905.53	3,969.94
债券利息收入		-	4,311.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,728.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-690,047.76	122,023.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-880,378.82	68,218.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	4,042.79
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	190,331.06	49,762.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	834,914.78	-1,327,274.52
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	12,678.68	1,797.02
减：二、费用		251,133.80	194,499.81

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	97,574.44	45,181.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,636.12	6,777.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	25,779.69	2,583.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	113,143.55	139,956.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-83,682.57	-1,387,943.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-83,682.57	-1,387,943.86

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：华富中小板指数增强型证券投资基金

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）	9,501,282.81	-948,194.34	8,553,088.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-83,682.57	-83,682.57
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）	16,520,326.83	2,422,399.01	18,942,725.84
其中：1. 基金申购款	22,233,963.48	2,979,038.23	25,213,001.71
2. 基金赎回款	-5,713,636.65	-556,639.22	-6,270,275.87
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）	26,021,609.64	1,390,522.10	27,412,131.74

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）	6,319,352.22	2,550,502.27	8,869,854.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,387,943.86	-1,387,943.86
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）	1,023,460.66	347,378.89	1,370,839.55
其中：1.基金申购款	2,255,967.48	806,441.70	3,062,409.18
2.基金赎回款	-1,232,506.82	-459,062.81	-1,691,569.63
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）	7,342,812.88	1,509,937.30	8,852,750.18

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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>曹华玮</u>	<u>邵恒</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

华富中小板指数增强型证券投资基金（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[2011]1352号）核准，基金合同于2011年12月9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正信会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健正信验（2011）综字第020175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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华富中小板指数增强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（其中包括创业板、中小板股票及其他经中

国证监会核准上市的股票)、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(但须符合中国证监会的相关规定)。

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%的征税率缴纳增值税。

(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% 调为 1%。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,873,839.44
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：	2,873,839.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	26,694,371.96	25,006,785.14	-1,687,586.82
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	26,694,371.96	25,006,785.14	-1,687,586.82

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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	601.54
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	3.50
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	0.61
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.40
合计	608.05

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 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	8,111.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,111.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	338.56
应付指数使用许可费	100,000.00
预提费用	-
应付信息披露费	-
应付审计费	12,396.69
合计	362,735.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,501,282.81	9,501,282.81
本期申购	22,233,963.48	22,233,963.48
本期赎回(以“-”号填列)	-5,713,636.65	-5,713,636.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	26,021,609.64	26,021,609.64

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	7,784,766.84	-8,732,961.18	-948,194.34
本期利润	-918,597.35	834,914.78	-83,682.57
本期基金份额交易产生的变动数	12,657,380.55	-10,234,981.54	2,422,399.01
其中：基金申购款	17,024,850.19	-14,045,811.96	2,979,038.23

基金赎回款	-4,367,469.64	3,810,830.42	-556,639.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,523,550.04	-18,133,027.94	1,390,522.10

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	9,622.41
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	259.37
其他	23.75
合计	9,905.53

注：其他为结算保证金利息收入。

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	2,518,787.28
减：卖出股票成本总额	3,399,166.10
买卖股票差价收入	-880,378.82

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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 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

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	190,331.06
基金投资产生的股利收益	-
合计	190,331.06

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	834,914.78
——股票投资	834,914.78
——债券投资	-
——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	834,914.78

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,649.82
转换费收入	28.86
合计	12,678.68

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	25,779.69
银行间市场交易费用	-

交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	25,779.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	-
银行汇划费用	746.86
指数使用许可费	100,000.00
银行账户维护费	-
合计	113,143.55

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	基金管理人、注册登记人、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

6.4.10 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 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	22,804,871.84	100.00%	1,987,396.66	100.00%

6.4.10.1.2 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	-	-	24,985.04	100.00%

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 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	-	-	9,900,000.00	100.00%

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 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	21,238.18	100.00%	8,111.91	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	1,852.43	100.00%	211.63	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 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	97,574.44	45,181.96
其中：支付销售机构的客户维护费	43,100.08	20,157.59

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.0% 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 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托管费	14,636.12	6,777.37

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：本报告期内本基金管理人未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：本基金本报告期末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 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	
	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	2,873,839.44	9,622.41	1,563,455.48	3,807.35

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

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（2019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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括短期融资券等债券基金可投资的短期信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。信用等级按期末评级结果列示。

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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、可转债、公募可交换债、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 2019 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	2,873,839.44	-	-	-	-	-	2,873,839.44
结算备付金	7,792.23	-	-	-	-	-	7,792.23
存出保证金	5,417.04	-	-	-	-	-	5,417.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,006,785.14	25,006,785.14
应收利息	-	-	-	-	-	608.05	608.05
应收申购款	-	-	-	-	-	7,869.89	7,869.89
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,887,048.71	-	-	-	-	25,015,263.08	27,902,311.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	93,952.39	93,952.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,070.01	22,070.01
应付托管费	-	-	-	-	-	3,310.49	3,310.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,111.91	8,111.91
其他负债	-	-	-	-	-	362,735.25	362,735.25
负债总计	-	-	-	-	-	490,180.05	490,180.05
利率敏感度缺口	2,887,048.71	-	-	-	-	24,525,083.03	27,412,131.74
上年度末 2018 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	1,643,987.32	-	-	-	-	-	1,643,987.32

结算备付金	4,110.14	-	-	-	-	4,110.14
存出保证金	521.88	-	-	-	-	521.88
交易性金融资产	-	-	-	-	7,282,691.90	7,282,691.90
应收利息	-	-	-	-	365.47	365.47
应收申购款	-	-	-	-	19,619.63	19,619.63
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,648,619.34	-	-	-	7,302,677.00	8,951,296.34
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	4,301.39	4,301.39
应付赎回款	-	-	-	-	3,798.16	3,798.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	7,407.87	7,407.87
应付托管费	-	-	-	-	1,111.17	1,111.17
应付交易费用	-	-	-	-	1,574.97	1,574.97
其他负债	-	-	-	-	380,014.31	380,014.31
负债总计	-	-	-	-	398,207.87	398,207.87
利率敏感度缺口	1,648,619.34	-	-	-	6,904,469.13	8,553,088.47

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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降25基点	0.00	0.00
	市场利率上升25基点	0.00	0.00

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 2019年6月30日	上年度末 2018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	25,006,785.14	91.23	7,282,691.90	85.15
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	25,006,785.14	91.23	7,282,691.90	85.15

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中小板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 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	中小板指数上升百分之五	1,097,050.32	331,102.44
	中小板指数下降百分之五	-1,097,050.32	-331,102.44

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 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	合计	9,702,362.69	2,562,513.51

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	25,006,785.14	89.62
	其中：股票	25,006,785.14	89.62
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	2,881,631.67	10.33
8	其他各项资产	13,894.98	0.05
9	合计	27,902,311.79	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	733,306.40	2.68
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,041,780.16	54.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	81,888.00	0.30
E	建筑业	412,622.23	1.51
F	批发和零售业	778,548.72	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	595,670.78	2.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,076,111.99	11.22
J	金融业	2,254,716.02	8.23
K	房地产业	236,487.15	0.86
L	租赁和商务服务业	1,070,105.25	3.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	144,165.00	0.53
Q	卫生和社会工作	382,231.44	1.39
R	文化、体育和娱乐业	199,152.00	0.73
S	综合	-	-
	合计	25,006,785.14	91.23

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未有积极投资按行业分类的境内股票投资组合。

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	002415	海康威视	51,095	1,409,200.10	5.14
2	002304	洋河股份	8,143	989,863.08	3.61
3	002475	立讯精密	35,478	879,499.62	3.21
4	002027	分众传媒	161,067	852,044.43	3.11
5	002142	宁波银行	34,151	827,820.24	3.02
6	002230	科大讯飞	22,939	762,492.36	2.78
7	002594	比亚迪	12,080	612,697.60	2.24
8	002024	苏宁易购	50,064	574,734.72	2.10
9	002714	牧原股份	9,760	573,790.40	2.09
10	002202	金风科技	38,215	475,012.45	1.73
11	002008	大族激光	12,731	437,691.78	1.60
12	002736	国信证券	31,708	417,277.28	1.52
13	002422	科伦药业	13,531	402,276.63	1.47
14	002044	美年健康	30,726	382,231.44	1.39
15	002007	华兰生物	11,760	358,562.40	1.31
16	002410	广联达	10,634	349,752.26	1.28
17	002236	大华股份	24,003	348,523.56	1.27
18	002001	新和成	16,975	327,447.75	1.19
19	002311	海大集团	10,541	325,716.90	1.19
20	002271	东方雨虹	13,379	303,168.14	1.11
21	002405	四维图新	18,784	302,422.40	1.10

22	002352	顺丰控股	8,328	282,818.88	1.03
23	002049	紫光国微	6,166	271,982.26	0.99
24	002466	天齐锂业	10,559	266,931.52	0.97
25	002673	西部证券	26,310	265,204.80	0.97
26	002179	中航光电	7,866	263,196.36	0.96
27	002460	赣锋锂业	11,096	259,979.28	0.95
28	002241	歌尔股份	28,294	251,533.66	0.92
29	002129	中环股份	25,614	249,992.64	0.91
30	002195	二三四五	63,248	246,034.72	0.90
31	002340	格林美	51,662	243,328.02	0.89
32	002439	启明星辰	8,904	239,517.60	0.87
33	002465	海格通信	24,810	236,687.40	0.86
34	002146	荣盛发展	25,185	236,487.15	0.86
35	002456	欧菲光	28,762	225,494.08	0.82
36	002507	涪陵榨菜	7,300	222,650.00	0.81
37	002223	鱼跃医疗	8,813	216,976.06	0.79
38	002120	韵达股份	6,995	215,585.90	0.79
39	002081	金螳螂	20,273	209,014.63	0.76
40	002384	东山精密	14,320	208,642.40	0.76
41	002371	北方华创	3,000	207,750.00	0.76
42	002555	三七互娱	15,203	206,000.65	0.75
43	002739	万达电影	10,800	199,152.00	0.73
44	002065	东华软件	28,416	198,627.84	0.72
45	002385	大北农	37,500	198,375.00	0.72
46	002268	卫士通	8,100	198,045.00	0.72
47	002493	荣盛石化	16,400	197,784.00	0.72
48	002821	凯莱英	2,000	196,160.00	0.72
49	002500	山西证券	24,093	195,153.30	0.71
50	002797	第一创业	30,410	192,799.40	0.70
51	002508	老板电器	7,031	190,821.34	0.70
52	002050	三花智控	18,066	190,596.30	0.70
53	002926	华西证券	18,000	189,000.00	0.69
54	002153	石基信息	5,029	181,999.51	0.66
55	002032	苏泊尔	2,400	181,992.00	0.66
56	002252	上海莱士	26,027	180,887.65	0.66
57	002092	中泰化学	22,706	180,739.76	0.66
58	002013	中航机电	25,723	176,974.24	0.65
59	002916	深南电路	1,660	169,187.20	0.62
60	002602	世纪华通	15,200	165,984.00	0.61

61	002572	索菲亚	8,786	163,068.16	0.59
62	002299	圣农发展	6,300	159,516.00	0.58
63	002217	合力泰	28,789	159,203.17	0.58
64	002624	完美世界	6,114	157,802.34	0.58
65	002600	领益智造	25,500	151,215.00	0.55
66	002038	双鹭药业	6,400	150,784.00	0.55
67	002075	沙钢股份	19,200	150,528.00	0.55
68	002078	太阳纸业	22,004	149,847.24	0.55
69	002074	国轩高科	11,093	145,429.23	0.53
70	002607	中公教育	10,500	144,165.00	0.53
71	002601	龙蟠佰利	9,571	141,937.93	0.52
72	002110	三钢闽光	15,150	140,895.00	0.51
73	002281	光迅科技	5,300	140,344.00	0.51
74	002019	亿帆医药	11,365	139,221.25	0.51
75	002180	纳思达	6,100	137,860.00	0.50
76	002085	万丰奥威	17,135	124,742.80	0.46
77	002294	信立泰	5,566	124,567.08	0.45
78	002558	巨人网络	6,843	124,337.31	0.45
79	002310	东方园林	20,400	122,400.00	0.45
80	002010	传化智联	15,411	116,044.83	0.42
81	002589	瑞康医药	15,000	113,850.00	0.42
82	002368	太极股份	3,600	109,080.00	0.40
83	002773	康弘药业	3,300	108,636.00	0.40
84	002152	广电运通	15,802	108,243.70	0.39
85	002938	鹏鼎控股	3,600	105,696.00	0.39
86	002583	海能达	12,566	105,428.74	0.38
87	002399	海普瑞	5,000	104,950.00	0.38
88	002183	怡亚通	21,387	102,015.99	0.37
89	002468	申通快递	3,900	97,266.00	0.35
90	002151	北斗星通	4,100	95,243.00	0.35
91	002563	森马服饰	8,300	91,798.00	0.33
92	002640	跨境通	10,800	89,964.00	0.33
93	002670	国盛金控	6,800	85,680.00	0.31
94	002841	视源股份	1,100	85,261.00	0.31
95	002608	江苏国信	9,600	81,888.00	0.30
96	002939	长城证券	4,900	81,781.00	0.30
97	002051	中工国际	7,080	81,207.60	0.30
98	002366	台海核电	7,563	70,789.68	0.26
99	002925	盈趣科技	1,800	70,218.00	0.26

100	002745	木林森	4,400	51,568.00	0.19
-----	--------	-----	-------	-----------	------

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

注：无。

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	002415	海康威视	1,231,788.40	14.40
2	002027	分众传媒	743,667.67	8.69
3	002304	洋河股份	677,998.00	7.93
4	002475	立讯精密	565,915.00	6.62
5	002230	科大讯飞	562,374.00	6.58
6	002142	宁波银行	503,751.00	5.89
7	002594	比亚迪	443,678.00	5.19
8	002024	苏宁易购	426,980.00	4.99
9	002202	金风科技	402,370.00	4.70
10	002044	美年健康	386,567.00	4.52
11	002714	牧原股份	369,970.00	4.33
12	002008	大族激光	362,378.00	4.24
13	002736	国信证券	276,328.00	3.23
14	002352	顺丰控股	265,512.82	3.10
15	002456	欧菲光	264,693.00	3.09
16	002236	大华股份	264,411.00	3.09
17	002466	天齐锂业	261,870.00	3.06
18	002195	二三四五	251,608.00	2.94
19	002602	世纪华通	243,473.20	2.85
20	002001	新和成	237,382.00	2.78
21	002422	科伦药业	237,130.00	2.77
22	002007	华兰生物	227,917.00	2.66
23	002460	赣锋锂业	216,858.00	2.54
24	002179	中航光电	213,609.00	2.50
25	002493	荣盛石化	202,162.00	2.36
26	002673	西部证券	197,963.44	2.31

27	002405	四维图新	195,580.00	2.29
28	002340	格林美	194,499.00	2.27
29	002410	广联达	194,262.00	2.27
30	002507	涪陵榨菜	192,744.00	2.25
31	002241	歌尔股份	192,133.03	2.25
32	002926	华西证券	189,150.00	2.21
33	002271	东方雨虹	187,452.00	2.19
34	002916	深南电路	183,029.00	2.14
35	002146	荣盛发展	182,175.00	2.13
36	002311	海大集团	179,309.00	2.10
37	002120	韵达股份	173,328.00	2.03

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	002450	*ST 康得	190,348.00	2.23
2	002415	海康威视	142,206.00	1.66
3	002221	东华能源	139,772.00	1.63
4	002185	华天科技	127,647.90	1.49
5	002273	水晶光电	119,887.28	1.40
6	002142	宁波银行	106,595.00	1.25
7	002176	江特电机	90,553.28	1.06
8	002304	洋河股份	89,213.00	1.04
9	002497	雅化集团	85,140.32	1.00
10	002168	惠程科技	84,710.40	0.99
11	002470	金正大	79,023.96	0.92
12	002573	清新环境	69,908.20	0.82
13	002195	二三四五	66,906.00	0.78
14	002230	科大讯飞	60,969.00	0.71
15	002602	世纪华通	56,854.00	0.66
16	002179	中航光电	53,731.24	0.63
17	002411	延安必康	48,541.35	0.57
18	002635	安洁科技	46,768.00	0.55
19	002024	苏宁易购	45,959.00	0.54

20	002475	立讯精密	45,550.00	0.53
----	--------	------	-----------	------

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	20,288,344.56
卖出股票收入（成交）总额	2,518,787.28

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 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

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。

7.12.3 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	5,417.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	608.05
5	应收申购款	7,869.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,894.98

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：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

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
1,490	17,464.17	0.00	0.00%	26,021,609.64	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本期末本公司的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（2011 年 12 月 9 日）基金份额总额	674,571,640.23
本报告期期初基金份额总额	9,501,282.81
本报告期期间基金总申购份额	22,233,963.48
减:本报告期期间基金总赎回份额	5,713,636.65
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	26,021,609.64

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	22,804,871.84	100.00%	21,238.18	100.00%	-

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) 本报告期本基金交易单元没有发生变化。

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	-	-	-	-	-	-

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	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告》	中证报及公司网站	2019 年 1 月 21 日
2	《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年第 2 号）》	公司网站	2019 年 1 月 23 日
3	《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2018 年第 2 号）》	中证报及公司网站	2019 年 1 月 23 日
4	《华富基金管理有限公司关于旗下所有基金在直销渠道面向养老金客户开展费率优惠的公告》	中证报及公司网站	2019 年 3 月 15 日
5	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告》	公司网站	2019 年 3 月 26 日
6	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告摘要》	中证报及公司网站	2019 年 3 月 26 日
7	《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》	中证报及公司网站	2019 年 3 月 30 日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与奕丰基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
10	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰基金销售有限公司为代销机构的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
11	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 17 日
12	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 17 日
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳农村商业银行股份有限公司手机银行基金申购及定投费率优惠活动的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 17 日

	公告》		
14	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华安证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 18 日
15	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 20 日
16	《华富基金管理有限公司关于变更总经理的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 23 日
17	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 23 日
18	《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》	中证报及公司网站	2019 年 5 月 7 日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告》	中证报及公司网站	2019 年 5 月 7 日
20	《华富基金管理有限公司澄清公告》	中证报及公司网站	2019 年 5 月 14 日
21	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中投证券费率优惠的公告》	中证报及公司网站	2019 年 5 月 16 日
22	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加徽商银行股份有限公司基金费率优惠活动的公告》	中证报及公司网站	2019 年 6 月 20 日
23	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告》	中证报及公司网站	2019 年 6 月 21 日
24	《华富基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告》	中证报及公司网站	2019 年 6 月 29 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	3.27-6.30	0.00	6,844,647.52	0.00	6,844,647.52	26.30%
-	-	-	-	-	-	-	-
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、华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同
- 2、华富中小板指数增强型证券投资基金托管协议
- 3、华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富中小板指数增强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。