

华富安鑫债券型证券投资基金证券投资基金
基金（原华富保本混合型证券投资基金基金
转型）

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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
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、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	11
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	20
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	23
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	42
6.1 资产负债表.....	42
6.2 利润表.....	43
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	44
6.4 报表附注.....	45
§7 投资组合报告（转型后）	62
7.1 期末基金资产组合情况.....	62
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	62
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63

7.5 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	63
7.6 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	63
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
7.8 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	63
7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.10 投资组合报告附注	64
§7 投资组合报告（转型前）	66
7.1 期末基金资产组合情况	66
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	66
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	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	68
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	68
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	68
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息（转型后）	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§8 基金份额持有人信息（转型前）	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
§9 开放式基金份额变动(转型后)	72
§9 开放式基金份额变动(转型前)	73
§10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	76
10.9 其他重大事件（转型后）	78
10.9 其他重大事件（转型前）	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息	81
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（转型后）	81
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（转型前）	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§12 备查文件目录	82

12.1 备查文件目录.....	82
12.2 存放地点.....	82
12.3 查阅方式.....	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	华富安鑫债券型证券投资基金
基金简称	华富安鑫债券
基金主代码	000028
交易代码	000028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	88,471,011.93 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华富保本混合型证券投资基金
基金简称	华富保本混合
基金主代码	000028
交易代码	000028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 24 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	107,228,241.96 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种，在严格管理投资风险的基础上，追求资产的长期稳定增值。
投资策略	以宏观面分析和信用分析为基础，根据经济发展的不同阶段的特点，选择高质量的债券类固定收益资产构建组合，以期通过研究获得长期稳定、高于业绩基准的收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于一般混合型基金和股票型基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金采取恒定比例组合保险策略 CPPI (Constant
------	--------------------------------

	Proportion Portfolio Insurance), 通过动态调整资产组合, 在确保本金安全的前提下, 力争实现保本周期内基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金遵循长期投资的基本原则, 融合国际化的风险管理工具与本土化的价值投资实践, 利用避险技术进行风险跨期管理, 在此基础上, 坚持以价值发现为核心的投资研究理念, 寻找中国经济成长和资本市场发展过程中的中长期投资机遇, 最大限度地追求本金安全与财富增值的动态平衡。
业绩比较基准	本基金在保本周期内的业绩比较基准为: 三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品, 属证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构, 保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	胡波
	联系电话	021-68886996	021-61618888
	电子邮箱	manzh@hffund.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95528
传真		021-68887997	021-63602540
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层	上海市中山东一路12号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层	上海市北京东路689号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		章宏韬	高国富

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
本期已实现收益	107,139.79
本期利润	5,328.62
加权平均基金份额本期利润	0.0001
本期加权平均净值利润率	0.01%
本期基金份额净值增长率	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年 6 月 30 日
期末可供分配利润	625,851.15
期末可供分配基金份额利润	0.0071
期末基金资产净值	89,233,941.39
期末基金份额净值	1.0086
3.1.3 累计期末指标	2019 年 6 月 30 日
基金份额累计净值增长率	0.00%

注：1) 本基金合同生效未满一年。

2) 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。

3) 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。

4) 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。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 11 日
本期已实现收益	5,630,786.32
本期利润	4,296,093.13
加权平均基金份额本期利润	0.0134
本期加权平均净值利润率	1.31%
本期基金份额净值增长率	1.38%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年 6 月 11 日
期末可供分配利润	752,419.60
期末可供分配基金份额利润	0.0070
期末基金资产净值	108,149,448.76
期末基金份额净值	1.009
3.1.3 累计期末指标	2019 年 6 月 11 日

基金份额累计净值增长率	41.16%
-------------	--------

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) 所列数据截止到 2019 年 6 月 11 日。华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日起转型为华富安鑫债券型证券投资基金。

3.2 基金净值表现（转型后）

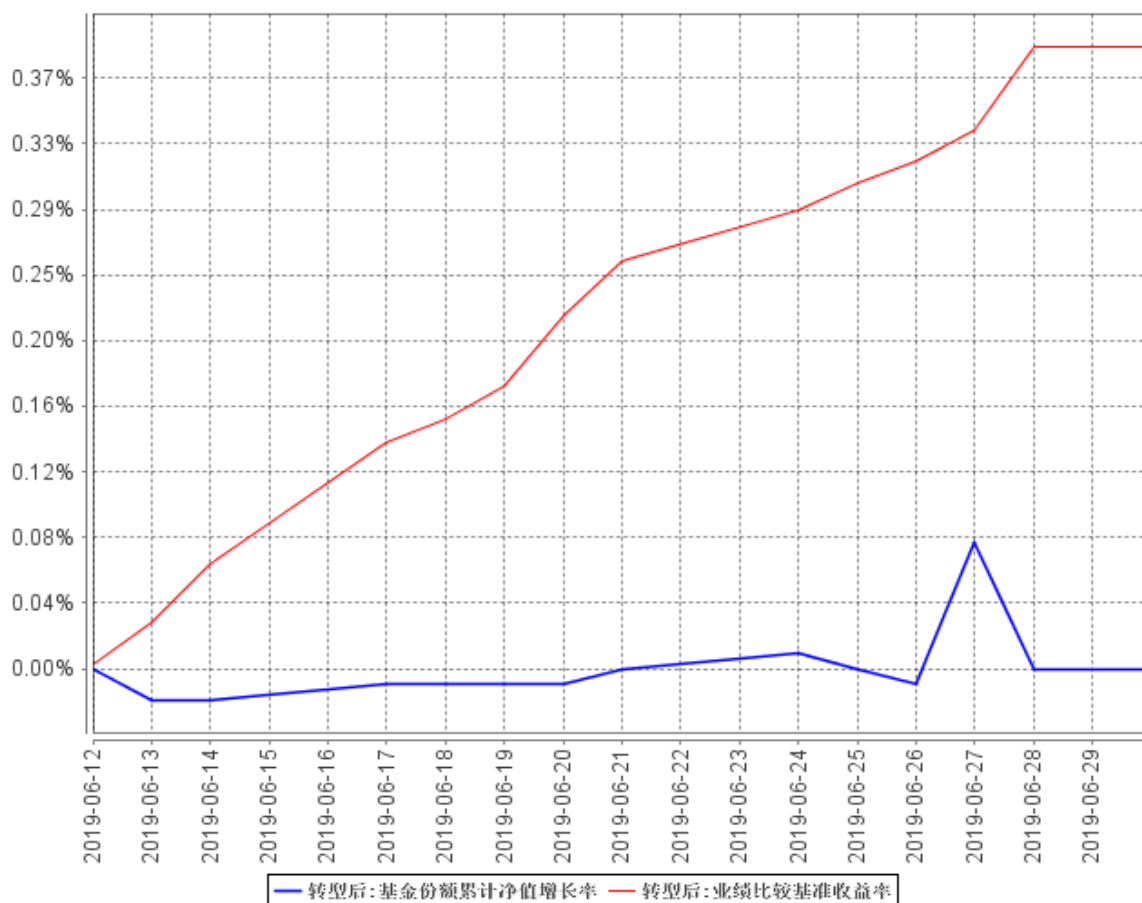
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合同生效起至今	0.00%	0.03%	0.39%	0.02%	-0.39%	0.01%

注：本基金业绩比较基准=中证全债指数收益率。

3.2.2 自基金转型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：本基金转型前为华富保本混合型证券投资基金。根据《华富安鑫债券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：债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2019 年 6 月 12 日到 2019 年 12 月 12 日。本报告期，本基金仍在建仓期内。

3.2 基金净值表现（转型前）

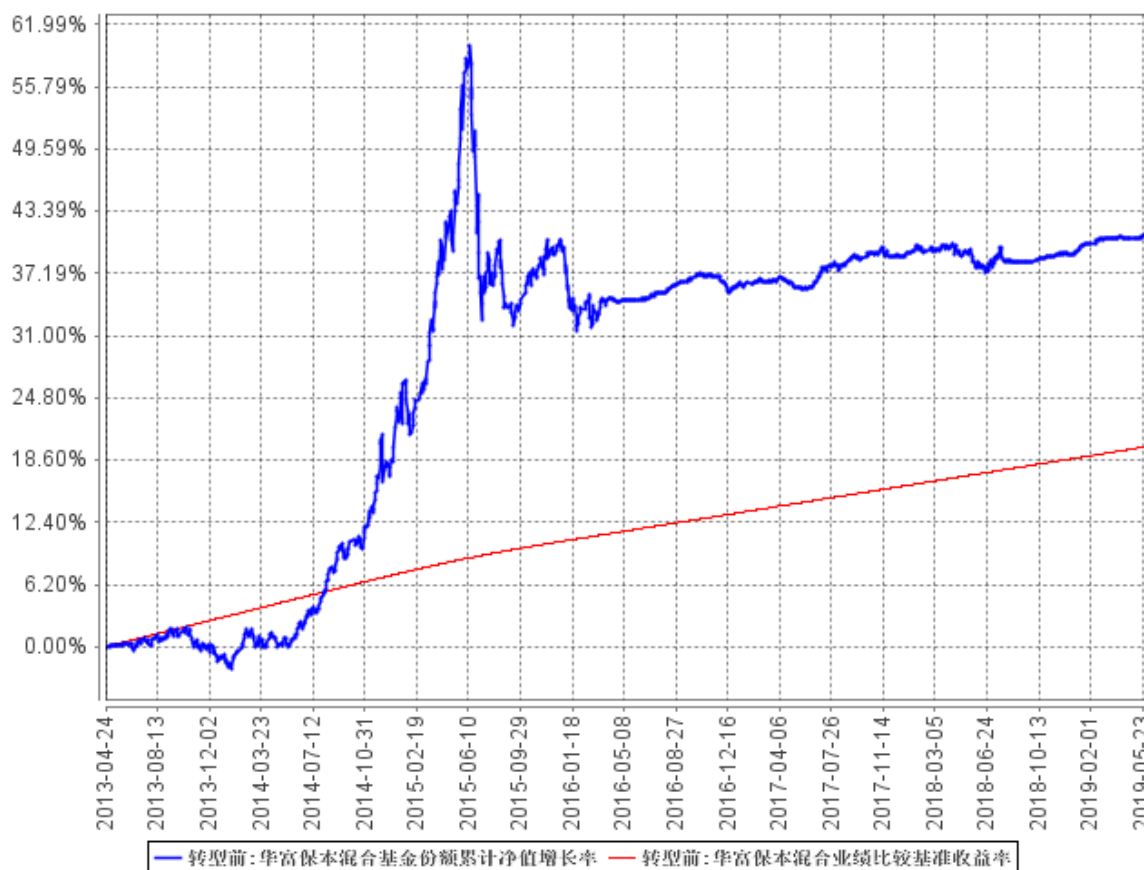
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.10%	0.07%	0.07%	0.01%	0.03%	0.06%
过去三个月	0.30%	0.05%	0.45%	0.01%	-0.15%	0.04%
过去六个月	1.38%	0.05%	1.03%	0.01%	0.35%	0.04%
过去一年	2.19%	0.10%	2.22%	0.01%	-0.03%	0.09%
过去三年	4.83%	0.10%	7.25%	0.01%	-2.42%	0.09%
自基金合同 生效起至今	41.16%	0.41%	20.00%	0.01%	21.16%	0.40%

注：本基金在保本周期内的业绩比较基准=三年期银行定期存款税后收益率。

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

华富保本混合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《华富保本混合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：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或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%；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 2013 年 4 月 24 日到 2013 年 10 月 24 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《华富保本混合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（转型后）

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		
张惠	华富安鑫债券型基金基金经理、华富恒利债券型基金基金经理、华富安享债券型基	2019 年 6 月 12 日	-	十二年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历，2007 年 6 月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员，2012 年 5 月 21

	金基金经理、华富安福债券型基金基金经理、华富星玉衡一年定期开放混合型基金基金经理、华富益鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理			日至 2014 年 3 月 19 日任华富策略精选混合型基金基金经理助理, 2014 年 3 月 20 日至 2014 年 11 月 18 日任华富保本混合型基金基金经理助理, 2016 年 6 月 28 日至 2017 年 7 月 5 日任华富灵活配置混合型基金基金经理, 2015 年 3 月 16 日至 2018 年 3 月 22 日任华富旺财保本混合型基金基金经理, 2016 年 11 月 17 日至 2018 年 6 月 19 日任华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理, 2016 年 8 月 26 日至 2018 年 8 月 1 日任华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理。
--	--	--	--	---

注：这里的任职日期指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
张惠	华富保本混合型基金基金经理、华富恒利债券型基金基金经理、华富安享债券型基金基金经理、华富安福保本混合型基金基金经理、华富星玉衡一年定期开放混合型基金基金经理、华富益鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理	2014 年 11 月 19 日	-	十二年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历，2007 年 6 月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员，2012 年 5 月 21 日至 2014 年 3 月 19 日任华富策略精选混合型基金基金经理助理，2014 年 3 月 20 日至 2014 年 11 月 18 日任华富保本混合型基金基金经理助理，2016 年 6 月 28 日至 2017 年 7 月 5 日任华富灵活配置混合型基金基金经理，2015 年 3 月 16 日至 2018 年 3 月 22 日任华富旺财保本混合型基金基金经理，2016 年 11 月 17 日至 2018 年 6 月 19 日任华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理，2016 年 8 月 26 日至 2018 年 8 月 1 日任华富

					元鑫灵活配置混合型基金基金经理。
--	--	--	--	--	------------------

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，国内经济在寻底的过程中低位徘徊。1 月社融数据见底回升，2-3 月一线城市地产销售复苏、基建投资增速回升，一系列减税降费后消费出现反弹，3 月 PMI 重新回到 50 以上，但 4-5 月制造业 PMI 和工业增速再度下滑，经济走势再度趋弱。总体来看，一季度关于经济基本面复苏的预期在二季度被证伪。年初以来，央行通过降准等一系列宽松的货币政策继续引导资金流入实体经济，宽货币向宽信用的转换在路上。虽然在 1 季度货币政策例会上，央行表示下一步稳健的货币政策要松紧适度，把好货币供给总闸门，但是在二季度经济数据再次走弱、包商银行事件爆发后，央行对银行间市场流动性加大呵护，货币政策宽松周期依然延续。国际方面，一季度经济韧性超预期的美国在二季度末开始频繁出现经济数据低于预期的情况，6 月美联储 FOMC 会议明确释放出鸽派信号，美联储进入降息周期的脚步渐行渐近，全球宽松环境预计可以持续。中美贸易战方面，5 月中美贸易谈判突然出现明显恶化，而在 6 月底 G20 峰会上则再次出现

边际缓和迹象。资本市场改革政策方面，6 月科创板企业陆续开始招股询价，科创板注册制拉开序幕。

2019 年上半年，债券市场跟随经济波动也出现了先抑后扬的行情。一季度，超预期的经济数据叠加市场风险偏好的提升，债券收益率曲线持续陡峭化，短端利率下行，长端利率震荡向上。受益于风险偏好的提升，可转债市场成为一季度债券市场里最亮眼的收益来源，转债整体估值大幅提升，多数个券收益明显。二季度，由于经济数据短期被证伪，经济下行压力凸显，同时叠加中美贸易摩擦阶段性升温市场风险偏好急剧下行，债券市场整体表现较好。虽然 4 月份专项债供给压力加大、6 月初包商银行事情冲击等不利因素影响，长端利率阶段性出现回调，但是全季度来看，长短端均出现不同程度下行，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。受到权益市场向下波动的影响，可转债市场二季度出现较大调整，大部分个券出现了一波快速的估值下行，跌幅较大。

2019 年上半年，权益市场在去年以来市场担心的经济失速、改革停滞、中美贸易战持续升级等因素被逐一证伪后，开启了一轮估值修复行情，市场出现普涨，1-3 月沪深 300 指数累计上涨 28.62%，创业板指累计上涨 35.43%。随后二季度，由于经济数据再次下行，叠加货币政策边际收紧和中美贸易摩擦升温，风险偏好出现大幅下行，市场大幅波动，开始震荡，在下跌的过程中，受到内外资青睐的各行业龙头公司表现较好，所谓“核心资产”大幅跑赢其他资产。

2019 年上半年，本基金继续严格执行 CPPI 的投资策略，配置与剩余期限相匹配的 AAA 存单和公司债作为稳健资产，在二季度末，本基金第二个保本周期顺利到期，产品转型为债券型基金。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2013 年 4 月 24 日正式成立，2019 年 6 月 12 日转型。截止 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0086 元，累计份额净值为 1.3866 元。转型前，本基金份额净值增长率为 1.38%，同期业绩比较基准收益率为 1.03%，转型后，本基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.39%。

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，经济数据显示基本面仍处底部区域，经济企稳动能较为薄弱；通胀虽仍在上升趋势，但对货币政策的制约可控；包商事件后央行呵护流动性，货币环境较为宽松；中美贸易摩擦难以短期解决，全球贸易体系不断受到冲击，主要经济体增长预期较差。去年以来的减税降费会在微观层面逐渐体现效果，上市公司的季度业绩变化值得期待与跟踪。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。权益资产在基本面改善不明显的情况下，更关注风险偏好以及政策扰动，三季度业绩表现持续良好以及在各种政策刺激下业绩转好明显的行业和板块将有望得到市场认可，精选个股更为重要。

从资产配置角度，我们认为短期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。经过二季度下跌后的可转债市场和权益资产更值得关注。本基金将继续保持债券偏中短久期的组合，以获取票息收入为主的策略，风险资产仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念进行配置。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位，在较低风险程度下，认真研究各个潜在投资领域的机会，发挥管理人的综合优势，积极稳健地做好配置策略，均衡投资，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《华富安鑫债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内共实施一次利润分配，分配金额为 5,906,419.00 元，符合基金合同所要求的收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50% 的约定；本期利润为 4,301,421.75 元，期末可供分配的利润共 625,851.15 元。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富保本混合型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金（由“华富保本混合型证券投资基金”转型而来）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富保本混合型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金（由“华富保本混合型证券投资基金”转型而来）的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配，金额 5,906,419 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：华富安鑫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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	39,330,663.84
结算备付金		1,241,011.53
存出保证金		21,683.42
交易性金融资产	6.4.7.2	32,460,573.70
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		32,460,573.70
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	19,512,229.27
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	238,677.61
应收股利		-
应收申购款		2,083.36
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		92,806,922.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 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		1,789,930.66
应付赎回款		1,583,728.14
应付管理人报酬		63,311.62
应付托管费		14,736.94
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	8,839.26

应交税费		348.25
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	112,086.47
负债合计		3,572,981.34
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	88,608,090.24
未分配利润	6.4.7.10	625,851.15
所有者权益合计		89,233,941.39
负债和所有者权益总计		92,806,922.73

- 注：1. 华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。
2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。
3. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0086 元，基金份额总额 88,471,011.93 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：华富安鑫债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年6月12日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
一、收入		61,611.67
1. 利息收入		98,372.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	61,585.71
债券利息收入		7,811.81
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		28,974.92
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		64,986.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	64,986.72
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.17	-101,811.17

填列)		
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	63.68
减: 二、费用		56,283.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	35,153.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,044.01
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	325.99
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		25.12
7. 其他费用	6.4.7.20	10,733.94
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		5,328.62
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		5,328.62

注: 1. 华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。
 2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效, 报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日, 无上年度可比期间。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: 华富安鑫债券型证券投资基金

本报告期: 2019 年 6 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 6 月 12 日 (基金合同生效日) 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)	107,397,029.16	752,419.60	108,149,448.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	5,328.62	5,328.62
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)	-18,788,938.92	-131,897.07	-18,920,835.99
其中: 1. 基金申购款	82,313.96	572.71	82,886.67
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-18,871,252.88	-132,469.78	-19,003,722.66
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)	88,608,090.24	625,851.15	89,233,941.39
-----------------	---------------	------------	---------------

- 注：1. 华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。
2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。
3. 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

华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。华富保本混合型证券投资基金（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）（[2015]2908 号）核准。基金合同于 2016 年 1 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（天健验（2016）6-9 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华富安鑫债券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：债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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

本基金于 2019 年 6 月 12 日由原华富保本混合型证券投资基金转型而来，报告期为 2019 年 6

月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 6 月 30 日。本期会计报表的实际编制期间为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计

入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于特殊事项停牌股票, 本基金根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告〔2008〕38号), 参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》进行估值。

2) 对于在锁定期内的非公开发行股票, 根据中国证监会《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》(基金部通知〔2006〕37号), 若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本, 按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值; 若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本, 按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3) 在银行间同业市场交易的债券品种, 根据中国证监会《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(证监会计字〔2007〕21号)采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值, 具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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 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	39,330,663.84
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:	39,330,663.84

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	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	31,919,109.87	541,463.83
	银行间市场	-	-
	合计	31,919,109.87	541,463.83
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	31,919,109.87	32,460,573.70	541,463.83

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

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	19,512,229.27	-
合计	19,512,229.27	-

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	24,052.94
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	558.50
应收债券利息	185,081.45

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	28,974.92
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9.80
合计	238,677.61

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	6,015.00
银行间市场应付交易费用	2,824.26
合计	8,839.26

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	-
应付赎回费	7.03
应付审计费	29,752.78
应付信息披露费	73,326.66
上清账户维护费	4,500.00
中债账户维护费	4,500.00
合计	112,086.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年6月12日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	107,228,241.96	107,397,029.16
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-

本期申购	82,183.42	82,313.96
本期赎回（以“-”号填列）	-18,839,413.45	-18,871,252.88
本期末	88,471,011.93	88,608,090.24

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

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	5,466,233.09	-4,713,813.49	752,419.60
本期利润	107,139.79	-101,811.17	5,328.62
本期基金份额交易产生的变动数	-959,715.42	827,818.35	-131,897.07
其中：基金申购款	4,211.21	-3,638.50	572.71
基金赎回款	-963,926.63	831,456.85	-132,469.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,613,657.46	-3,987,806.31	625,851.15

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2019年6月12日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	60,506.13
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	1,061.14
其他	18.44
合计	61,585.71

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

注：本基金本报告期无股票投资收益。

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 2019年6月12日至2019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	64,986.72
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	64,986.72

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
	2019年6月12日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	811,395.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	741,000.00
减：应收利息总额	5,408.28
买卖债券差价收入	64,986.72

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

注：本基金本报告期内无股利收益。

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6月12日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-101,811.17
——股票投资	-
——债券投资	-101,811.17
——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	-101,811.17

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年6月12日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
基金赎回费收入	63.68
合计	63.68

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年6月12日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
交易所市场交易费用	325.99
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	325.99

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年6月12日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
审计费用	3,123.22
信息披露费	4,819.54
银行汇划费用	911.98
债券帐户维护费	1,879.20
合计	10,733.94

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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、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

本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，无上年度可比期间。

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 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	35,153.99
其中：支付销售机构的客户维护费	30,037.66

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 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 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,044.01

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）。

6.4.10.3 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。本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，无上年度可比期间。

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：本基金本报告期本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，无上年度可比期间。

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：本基金本报告期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，无上年度可比期间。

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 6 月 12 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	39,330,663.84	60,506.13

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。本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，无上年度可比期间。

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

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

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的流通受限证券。

6.4.12.17 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。

6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.18.1 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。

6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 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。
2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：1. 本基金本报告期末未持有资产支持证券。
2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：1. 本基金本报告期末未持有同业存单。
2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

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
AAA	15,870,653.90
AAA 以下	16,589,919.80
其中低于 AA 以下	2,786,735.80
未评级	0.00
合计	32,460,573.70

注：1. 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。

2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：1. 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：1. 本基金本报告期末未持有同业存单。

2. 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，报告期为 2019 年 6 月 12 日至 2019 年 6 月 30 日，无上年度可比期间。

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

金额单位：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	39,330,663.84	-	-	-	-	-	-39,330,663.84
结算备付金	1,241,011.53	-	-	-	-	-	-1,241,011.53
存出保证金	21,683.42	-	-	-	-	-	-21,683.42
交易性金融资产	-	571,001.40	14,877,565.20	17,012,007.10	-	-	-32,460,573.70
买入返售金融资产	19,512,229.27	-	-	-	-	-	-19,512,229.27
应收利息	-	-	-	-	-	238,677.61	238,677.61
应收申购款	-	-	-	-	-	2,083.36	2,083.36
资产总计	60,105,588.06	571,001.40	14,877,565.20	17,012,007.10	-	240,760.97	92,806,922.73
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,789,930.66	1,789,930.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,583,728.14	1,583,728.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,311.62	63,311.62
应付托管费	-	-	-	-	-	14,736.94	14,736.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,839.26	8,839.26
应交税费	-	-	-	-	-	348.25	348.25
其他负债	-	-	-	-	-	112,086.47	112,086.47
负债总计	-	-	-	-	-	3,572,981.34	3,572,981.34
利率敏感度缺口	60,105,588.06	571,001.40	14,877,565.20	17,012,007.10	-	-3,332,220.37	89,233,941.39

注：1) 本基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效，无上年度可比期间。

2) 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	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

析		影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2019 年 6 月 30 日）
	市场利率下降 25 基点	289,262.26
	市场利率上升 25 基点	-288,535.95

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	32,460,573.70	36.38
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	32,460,573.70	36.38

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2019 年 6 月 30 日，股票类权益资产占基金资产净值的比例为 0%，因此若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

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	1,335,937.31	-
--	----	--------------	---

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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：华富保本混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 11 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 11 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	123,424,727.10	155,641.60
结算备付金		1,241,011.53	145,075.96
存出保证金		21,683.42	63,997.80
交易性金融资产	6.4.7.2	7,393,275.00	473,584,917.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,393,275.00	473,584,917.00
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		-	1,007,236.87
应收利息	6.4.7.5	163,572.83	10,360,638.97
应收股利		-	-
应收申购款		-	2,966.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		132,244,269.88	485,320,474.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 11 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		-	133,349,431.47
应付证券清算款		-	699,819.99
应付赎回款		23,949,837.91	426,708.09
应付管理人报酬		28,157.63	359,450.86
应付托管费		4,692.93	59,908.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,609.99	9,722.96
应交税费		94.75	18,116.00
应付利息		-	126,037.25

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,427.91	400,492.98
负债合计		24,094,821.12	135,449,688.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	107,397,029.16	345,078,703.42
未分配利润	6.4.7.10	752,419.60	4,792,083.20
所有者权益合计		108,149,448.76	349,870,786.62
负债和所有者权益总计		132,244,269.88	485,320,474.71

注：报告截止日 2019 年 6 月 11 日，华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。基金份额净值 1.009 元，基金份额总额 107228241.96 份。后附表报附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 11 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 11 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		7,539,924.36	4,024,451.12
1. 利息收入		7,965,391.24	10,605,334.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	128,313.51	73,410.30
债券利息收入		7,536,554.79	10,505,326.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		300,522.94	26,597.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		807,739.19	-4,876,332.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-248,970.00	-4,886,168.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,056,709.19	-419,839.41
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	-	429,675.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,334,693.19	-2,019,039.82
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	101,487.12	314,488.78

减：二、费用		3,243,831.23	5,707,703.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,693,109.61	2,657,920.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	282,184.92	442,986.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	11,808.13	373,601.78
5. 利息支出		1,124,832.14	1,995,732.63
其中：卖出回购金融资产支出		1,124,832.14	1,995,732.63
6. 税金及附加		14,632.33	9,719.62
7. 其他费用	6.4.7.20	117,264.10	227,742.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,296,093.13	-1,683,252.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,296,093.13	-1,683,252.21

注：报告截止日 2019 年 6 月 11 日，华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。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：华富保本混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 11 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 11 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）	345,078,703.42	4,792,083.20	349,870,786.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,296,093.13	4,296,093.13
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）	-237,681,674.26	-2,429,337.73	-240,111,011.99
其中：1. 基金申购款	3,719,337.14	78,760.19	3,798,097.33
2. 基金赎回款	-241,401,011.40	-2,508,097.92	-243,909,109.32
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）	-	-5,906,419.00	-5,906,419.00
五、期末所有者权益（基金净值）	107,397,029.16	752,419.60	108,149,448.76
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）	511,243,524.55	5,434,675.50	516,678,200.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,683,252.21	-1,683,252.21
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）	-121,905,640.08	-1,664,706.31	-123,570,346.39
其中：1. 基金申购款	3,357,241.49	44,234.48	3,401,475.97
2. 基金赎回款	-125,262,881.57	-1,708,940.79	-126,971,822.36
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）	389,337,884.47	2,086,716.98	391,424,601.45

注：报告截止日 2019 年 6 月 11 日，华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。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：

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

华富保本混合型投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（中国证监会）（证监许可[2013]69号）核准，基金合同于 2013 年 4 月 24 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会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2013）6-3 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金为保本混合型基金，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各类股票（包含中小板、创业板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 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 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 11 日
活期存款	123,424,727.10
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:	123,424,727.10

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 11 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,393,275.00	643,275.00
	银行间市场	-	-

	合计	6,750,000.00	7,393,275.00	643,275.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,750,000.00	7,393,275.00	643,275.00

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 2019年6月11日
应收活期存款利息	114,883.51
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	3,385.70
应收债券利息	45,271.23
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	32.39
合计	163,572.83

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11日
交易所市场应付交易费用	6,015.00

银行间市场应付交易费用	2,594.99
合计	8,609.99

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月11日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,170.43
应付信息披露	68,507.12
应付审计费	26,629.56
上清账户维护费	3,560.40
中债账户维护费	3,560.40
合计	103,427.91

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11日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	344,550,555.65	345,078,703.42
本期申购	3,713,645.56	3,719,337.14
本期赎回（以“-”号填列）	-241,035,959.25	-241,401,011.40
- 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	107,228,241.96	107,397,029.16

金额单位：人民币元

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	18,354,907.88	-13,562,824.68	4,792,083.20
本期利润	5,630,786.32	-1,334,693.19	4,296,093.13
本期基金份额交易产生的变动数	-12,613,042.11	10,183,704.38	-2,429,337.73
其中：基金申购款	223,984.63	-145,224.44	78,760.19
基金赎回款	-12,837,026.74	10,328,928.82	-2,508,097.92
本期已分配利润	-5,906,419.00	-	-5,906,419.00
本期末	5,466,233.09	-4,713,813.49	752,419.60

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11日
活期存款利息收入	122,828.78
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	5,332.43
其他	152.30
合计	128,313.51

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11日
卖出股票成交总额	3,104,864.00
减：卖出股票成本总额	3,353,834.00
买卖股票差价收入	-248,970.00

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
	2019年1月1日至2019年6月11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	1,056,709.19
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	1,056,709.19

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
	2019年1月1日至2019年6月11日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	543,606,017.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	525,400,594.45
减：应收利息总额	17,148,713.94
买卖债券差价收入	1,056,709.19

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

注：本基金本报告期内无股利收益。

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11日
1. 交易性金融资产	-1,334,693.19
——股票投资	-
——债券投资	-1,334,693.19
——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	-1,334,693.19

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11日
基金赎回费收入	101,203.75
转换费收入	283.37
合计	101,487.12

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11日
交易所市场交易费用	10,755.63

银行间市场交易费用	1,052.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	11,808.13

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11日
审计费用	26,629.56
信息披露费	68,507.12
银行汇划费用	5,406.62
债券帐户维护费	16,120.80
其他	600.00
合计	117,264.10

注：其他所列金额为上清所查询服务费。

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
上海浦东发展银行股份有限公司	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11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	-	-	42,098,795.74	16.53%

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元发生的债券交易。

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11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	141,800,000.00	16.46%	550,100,000.00	20.46%

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未通过关联方交易单元进行权证交易。

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11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	-	-	-	-
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	38,879.40	16.55%	27,120.44	30.29%

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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 11 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管理费	1,693,109.61	2,657,920.09
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	614,957.24	893,535.66

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.2% 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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 11 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	282,184.92	442,986.73

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）。

6.4.10.3 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：本基金本报告期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	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 11 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

上海浦东发展银行股份有限公司	123,424,727.10	122,828.78	16,178,469.30	48,227.88
----------------	----------------	------------	---------------	-----------

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

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2019年5月27日	-	2019年5月27日	0.2000	5,906,419.00	-	5,906,419.00	
合计	-	-	-	0.2000	5,906,419.00	-	5,906,419.00	

6.4.12 期末（2019年6月11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的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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 11 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00	20,178,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	60,361,000.00
合计	0.00	80,539,000.00

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

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
AA+	0.00	0.00
未评级	0.00	124,805,000.00
合计	0.00	124,805,000.00

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11日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	271,864,269.00
AAA 以下	7,393,275.00	37,740,668.00
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	7,393,275.00	309,604,937.00

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

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	115,203,000.00
AAA 以下	0.00	9,602,000.00
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
AA+	0.00	9,602,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	124,805,000.00

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

金额单位：人民币元

本期末 2019年6 月11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	123,424,727.10	-	-	-	-	-	123,424,727.10
结算备付金	1,241,011.53	-	-	-	-	-	1,241,011.53
存出保证金	21,683.42	-	-	-	-	-	21,683.42
交易性金融资产	-	-	-	7,393,275.00	-	-	7,393,275.00
应收利息	-	-	-	-	-	163,572.83	163,572.83

资产总计	124,687,422.05	-	-	7,393,275.00	-	163,572.83	132,244,269.88
负债							
应付赎回款						23,949,837.91	23,949,837.91
应付管理人报酬						28,157.63	28,157.63
应付托管费						4,692.93	4,692.93
应付交易费用						8,609.99	8,609.99
应交税费						94.75	94.75
其他负债						103,427.91	103,427.91
负债总计						24,094,821.12	24,094,821.12
利率敏感度缺口	124,687,422.05			7,393,275.00		-23,931,248.29	108,149,448.76
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	155,641.60						155,641.60
结算备付金	145,075.96						145,075.96
存出保证金	63,997.80						63,997.80
交易性金融资产	20,763,565.50	59,355,709.00	239,471,242.50	153,994,400.00			473,584,917.00
应收证券清算款						1,007,236.87	1,007,236.87
应收利息						10,360,638.97	10,360,638.97
应收申购款						2,966.51	2,966.51
其他资产							
资产总计	21,128,280.86	59,355,709.00	239,471,242.50	153,994,400.00		11,370,842.35	485,320,474.71
负债							
卖出回购金融资产款	133,349,431.47						133,349,431.47
应付证券清算款						699,819.99	699,819.99
应付赎回款						426,708.09	426,708.09
应付管理人报酬						359,450.86	359,450.86

应付托管费	-	-	-	-	59,908.49	59,908.49
应付交易费用	-	-	-	-	9,722.96	9,722.96
应付利息	-	-	-	-	126,037.25	126,037.25
应交税费	-	-	-	-	18,116.00	18,116.00
其他负债	-	-	-	-	400,492.98	400,492.98
负债总计	133,349,431.47	-	-	-	2,100,256.62	135,449,688.09
利率敏感度缺口	-112,221,150.61	59,355,709.00	239,471,242.50	153,994,400.00	9,270,585.73	349,870,786.62

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11日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	0.00	1,055,028.80
	市场利率上升 25 基点	0.00	-1,052,424.08

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 2019年6月11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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,393,275.00	6.84	473,584,917.00	135.36
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	7,393,275.00	6.84	473,584,917.00	135.36

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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 11 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升百分之五	0.00	0.00
	沪深 300 指数下降百分之五	0.00	0.00

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	0.00	55,921,506.64

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（转型后）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,460,573.70	34.98
	其中：债券	32,460,573.70	34.98
	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	19,512,229.27	21.02
	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	40,571,675.37	43.72
8	其他各项资产	262,444.39	0.28
9	合计	92,806,922.73	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.10.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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。

7.2.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

7.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

7.4 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 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,038,209.90	4.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	28,422,363.80	31.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,460,573.70	36.38

7.5 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	120002	18 中原 EB	60,090	6,535,388.40	7.32
2	155036	18 电投 12	40,000	4,037,200.00	4.52
3	113011	光大转债	24,820	2,690,488.00	3.02
4	132013	17 宝武 EB	18,810	1,879,871.40	2.11
5	132011	17 浙报 EB	19,630	1,853,072.00	2.08

7.6 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。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	21,683.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	238,677.61
5	应收申购款	2,083.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	262,444.39

7.10.4 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	113011	光大转债	2,690,488.00	3.02
2	132013	17 宝武 EB	1,879,871.40	2.11
3	132011	17 浙报 EB	1,853,072.00	2.08
4	132007	16 凤凰 EB	1,798,002.00	2.01
5	128010	顺昌转债	1,350,483.90	1.51
6	113519	长久转债	930,400.30	1.04
7	132015	18 中油 EB	906,461.40	1.02
8	113020	桐昆转债	892,338.20	1.00
9	128016	雨虹转债	571,001.40	0.64
10	113525	台华转债	303,610.50	0.34
11	110034	九州转债	273,621.60	0.31
12	132008	17 山高 EB	1,002.00	0.00

7.10.5 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。

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告（转型前）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,393,275.00	5.59
	其中：债券	7,393,275.00	5.59
	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	124,665,738.63	94.27
8	其他资产	185,256.25	0.14
9	合计	132,244,269.88	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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

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所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	600030	中信证券	3,353,834.00	0.96

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	600030	中信证券	3,104,864.00	0.89

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	3,353,834.00
卖出股票收入（成交）总额	3,104,864.00

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（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,393,275.00	6.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,393,275.00	6.84

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	120002	18 中原 EB	67,500	7,393,275.00	6.84

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

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。

7.12.2 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	21,683.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	163,572.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	185,256.25

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

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 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（转型后）

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
3,042	29,083.17	217,513.79	0.25%	88,253,498.14	99.75%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	17,903.34	0.0202%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

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
3,211	33,394.03	217,513.79	0.20%	107,010,728.17	99.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	17,903.34	0.0167%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	107,228,241.96
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	82,183.42
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	18,839,413.45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	88,471,011.93

§ 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	526,218,773.24
本报告期期初基金份额总额	344,550,555.65
本报告期期间基金总申购份额	3,713,645.56
减:本报告期期间基金总赎回份额	241,035,959.25
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	107,228,241.96

§ 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、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（转型后）

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	
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

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
国盛证券	19,383,877.02	72.47%	-	-	-	-
华创证券	7,362,790.19	27.53%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

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	
中泰证券	1	3,353,834.00	51.93%	3,123.46	51.93%	-
国盛证券	2	3,104,864.00	48.07%	2,891.54	48.07%	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

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
中泰证券	1,690,177.00	0.98%	84,900,000.00	9.85%	-	-
国盛证券	-	-	135,000,000.00	15.67%	-	-
民生证券	151,415,697.83	88.18%	-	-	-	-
浙商证券	3,528,377.39	2.05%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	6,648,835.50	3.87%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	3,312,754.18	1.93%	126,400,000.00	14.67%	-	-
华安证券	-	-	141,800,000.00	16.46%	-	-
光大证券	5,110,615.50	2.98%	373,400,000.00	43.34%	-	-

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。

10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《华富基金管理有限公司关于华富保本混合型证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》	上证报及公司网站	2019年6月12日
2	《关于华富安鑫债券型证券投资基金基金合同》	公司网站	2019年6月12日
3	《关于华富安鑫债券型证券投资基金托管协议》	公司网站	2019年6月12日
4	《关于华富安鑫债券型证券投资基金招募说明书》	公司网站	2019年6月12日
5	《关于华富安鑫债券型证券投资基金增加代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019年6月12日
6	《华富安鑫债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定投业务的公告》	上证报及公司网站	2019年6月12日
7	《关于华富安鑫债券型证券投资基金增加建设银行为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019年6月21日
8	《关于华富安鑫债券型证券投资基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019年6月26日
9	《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》	上证报及公司网站	2019年6月29日

10.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《华富保本混合型证券投资基金2018年第4季度报告》	上证报及公司网站	2019年1月21日

2	《华富保本混合型证券投资基金 2018 年度报告》	公司网站	2019 年 3 月 26 日
3	《华富保本混合型证券投资基金 2018 年度报告摘要》	上证报及公司网站	2019 年 3 月 26 日
4	《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》	上证报及公司网站	2019 年 3 月 30 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奕丰基金销售有限公司为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
6	《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》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
7	《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》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 17 日
8	《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》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 18 日
9	《华富保本混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 20 日
10	《华富基金管理有限公司关于变更总经理的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 23 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阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 23 日
12	《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》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 7 日
13	《华富基金管理有限公司澄清公告》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 14 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中投证券费率优惠的公告》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 16 日
15	《关于华富保本混合型证券投资基金 2019 年分红公告》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 24 日
16	《华富基金管理有限公司关于系统暂停网上交易服务的通知》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 25 日

17	《华富保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为华富安鑫债券型证券投资基金相关业务规则的公告》	上证报及公司网站	2019 年 5 月 30 日
18	《华富保本混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2019 年第 1 号)》	公司网站	2019 年 6 月 6 日
19	《华富保本混合型证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)(2019 年第 1 号)》	上证报及公司网站	2019 年 6 月 6 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（转型后）

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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（转型前）

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、华富安鑫债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富安鑫债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富安鑫债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富安鑫债券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。