

# 华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券 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：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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.11 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金	
基金简称	华富中证 5 年恒定久期国开债指数	
基金主代码	006451	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 28 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	864,225,333.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C
下属分级基金的交易代码:	006451	006452
报告期末下属分级基金的份额总额	863,928,570.15 份	296,763.71 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的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 0.25%，年跟踪误差不超过 3%。	
投资策略	本基金为指数基金，将采用代表性分层抽样复制法对标的指数进行跟踪。分层抽样复制法指的是采用一定的抽样方法从构成指数的成份债券及备选成份券中抽取若干成份券，或必要时选择非成份券作为替代，构成用于复制指数跟踪组合的方法。采取该方法可以在控制跟踪误差的基础上，有效减少组合维护及再平衡的所需的费用。	
业绩比较基准	中证 5 年恒定久期国开债指数收益率	
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C

### 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
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	manzh@hffund.com
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	《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	<a href="http://www.hffund.com">http://www.hffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 28 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 28 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	26,964,729.66	2,880.00
本期利润	29,373,779.83	2,281.47
加权平均基金份额本期利润	0.0130	0.0245
本期加权平均净值利润率	1.29%	2.43%
本期基金份额净值增长率	1.96%	1.90%
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	9,631,884.02	3,143.91
期末可供分配基金份额利润	0.0111	0.0106
期末基金资产净值	874,347,787.25	300,178.15
期末基金份额净值	1.0121	1.0115
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	1.96%	1.90%

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

华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A

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	0.79%	0.07%	0.67%	0.04%	0.11%	0.03%
过去三个月	1.53%	0.07%	0.80%	0.09%	0.73%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.96%	0.06%	1.27%	0.08%	0.69%	-0.02%

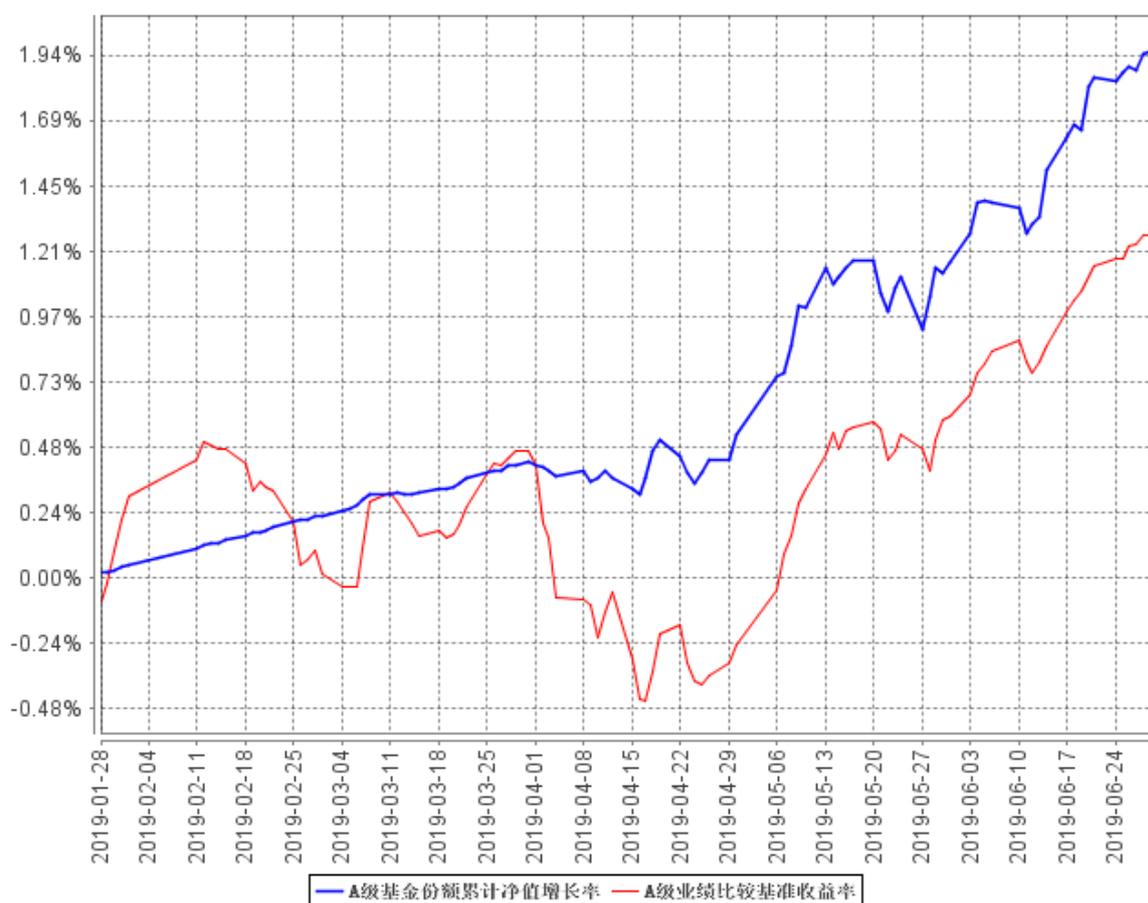
华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C

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	0.77%	0.07%	0.67%	0.04%	0.10%	0.03%
过去三个月	1.48%	0.07%	0.80%	0.09%	0.68%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.06%	1.27%	0.08%	0.63%	-0.02%

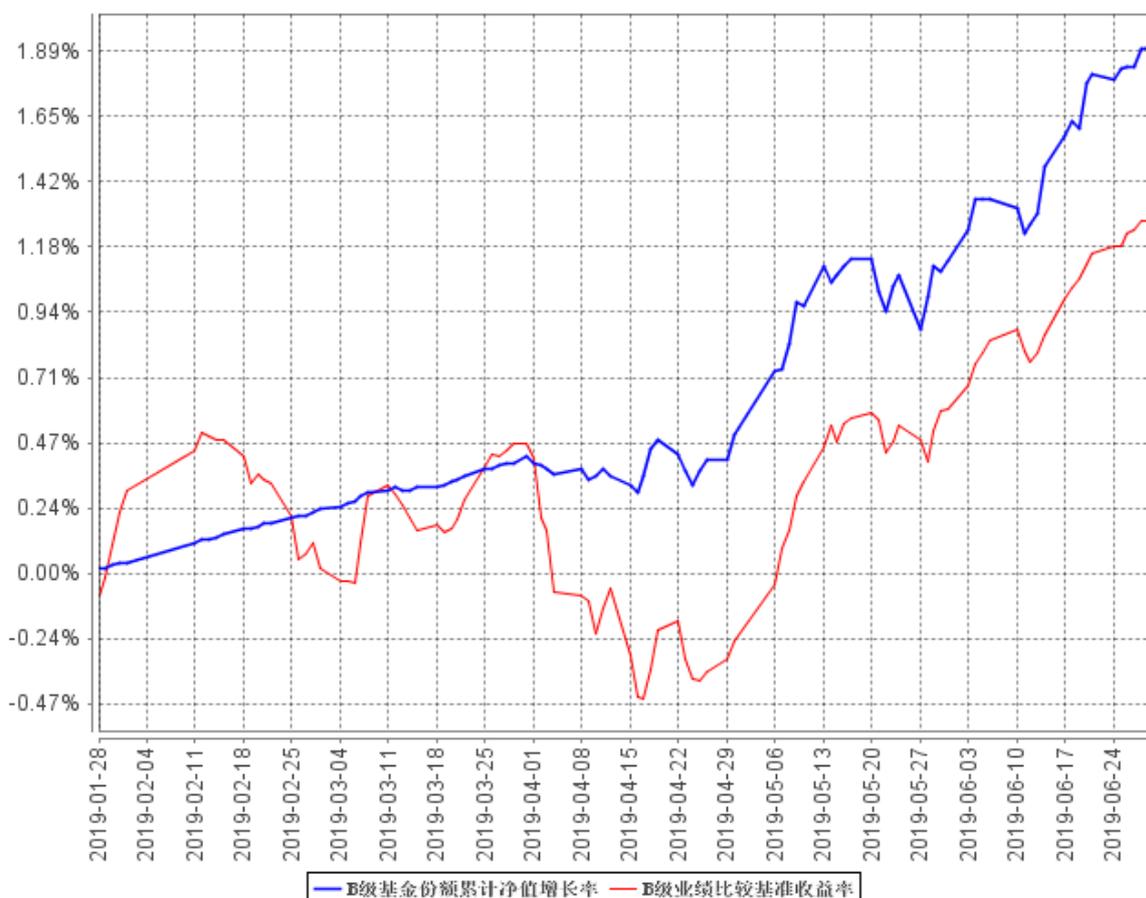
注：业绩比较基准收益率=中证 5 年恒定久期国开债指数收益率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

### 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

A 级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



B级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《华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金持有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 1 月 28 日到 2019 年 7 月 28 日。本报告期，本基金仍在建仓期内。

## § 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		
张娅	华富中证5年恒定久期国开债指数型基金基金经理	2019年1月28日	-	十四年	美国肯特州立大学金融工程硕士，研究生学历，曾先后担任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部总监兼基金经理、上海同安投资管理有限公司副总经理兼宏观量化中心总经理

	理、华富永鑫灵活配置混合型基金经理、公司公募投资决策委员会委员、公司总经理助理、创新业务部总监				理。2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司。
郜哲	华富中证 5 年恒定久期国开债指数型基金基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金经理、华富中证 100 指数基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理	2019 年 1 月 28 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：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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年一季度，在政府第二次贯彻宽信用的政策期间，经济逐渐呈现出企稳的趋势，随着 1 月天量信贷的投放，3 月 PMI 显示了一定的量价齐升的态势。但在宽信用政策刺激停止后，5、6 月 PMI 显示了较明显的下滑，也显示当前投资拉动的老路的边际作用越来越弱。

2 季度的社融数据结构来看，显示实体需求并未虽刺激政策起来，无论是量还是结构质量均较一季度明显下滑。

上半年 CPI 在猪周期的影响以及鲜果价格大幅攀升的情况下，通胀预期有所上升，但非食品项持续走弱与内需一致。预计鲜果价格持续性不强，猪肉是未来通胀单一风险，CPI 将控制在 3 以内。

资金方面，1 季度政府在刺激经济的同时，维持了相对较为宽松的货币政策，资金面平稳，跨季期间，银行间回购利率也未出现特别的超季节性紧张。2 季度政府在启动金融供改后，对中小银行开始打破刚兑，由于已有之前的经验，为了避免对市场造成较大冲击，央行同步释放了大量的流动性。上半年流动性整体宽松。

本基金在 2019.1.29 日成立，随后进入封闭建仓期，至 4 月 1 日打开，我们为了达到绝对收益以及打开后，具有一定仓位的目的，采取了如下的建仓措施：

- 1、在封闭期内，我们建仓的成分券久期不超过 5 年，仓位不超过 16%-20%。该仓位上限主要

处于建仓期绝对收益保本的考虑，参考历史上最为近似的极端行情下，净价波动仍可被货币工具利息和成分券利息所覆盖推导而得。

2、建仓期间的利多和利空消息主要如下：

1) 期间主要利空因素相对明显：

政府对于放社融信用的态度仍保持积极

银保监会表态（实体）结构性去杠杆取得阶段性成果（另一面意味着政府持续放社融放信用的冲动仍有）

其他：股市情绪好转，贸易战阶段性休战，风险情绪有所释放。

2) 期间主要利多因素：

社融信用放下去的钱大概率空转，经济长期趋势预期仍然较差。

春节期间的 2、3 月 PMI 数据可参考性差，不太容易证实经济企稳。

其他：2 月底开始查银行票据空转事宜、1+2 月份社融整体增速相较于去年同期持平（而非持续上涨）的概率较大，一定程度上利于缓解市场对于社融信用大幅释放的持续预期。

2 季度在判断收信用预期已经形成后，在 5 月中旬完成了建仓，基金紧密跟踪标的指数，成为投资配置 5 年期国开债的工具。也因此抓住了利率下行的主要区间，在整体建仓区间，实现了绝对收益的基本目标，并相对跟踪指数有可观的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2019 年 1 月 28 日正式成立。截止到 2019 年 6 月 30 日，华富国开债 A 类基金份额净值为 1.0121 元，累计份额净值为 1.0196 元，本报告期的份额累计净值增长率为 1.96%，同期业绩比较基准收益率为 1.27%；华富国开债 C 基金份额净值为 1.0115 元，累计份额净值为 1.0190 元，本报告期的份额累计净值增长率为 1.90%，同期业绩比较基准收益率为 1.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济重回收缩区间，而为了支持金融供改，预期央行会持续注入流动性，同时海外大概率进入普遍降息区间，利差角度，国内也有跟随进一步宽松的空间，因此，在 3 季度本基金将继续维持当前跟踪指数的仓位，并秉承谨慎性原则，在保证资金成本可被票息覆盖，并且行情特别确定之时进行不超过 40%的杠杆操作。

#### 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《证券投资基金运作管理办法》和《华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内进行一次利润分配，分配金额为 10,272,596.90 元。本报告期末尚存可供分配利润为 9,635,027.93 元，滚存至下一期进行分配。

#### **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 2019 年 4 月 16 日至本报告期末（2019 年 6 月 30 日），基金份额持有人数量连续二十个工作日不满两百人的情形，至本报告期期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有人数仍低于两百人。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”）在对华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金的托管过程中，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，对华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金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一次利润分配，分配金额为 10,272,596.90 元。

### 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、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	33,032,988.59	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	532,811,000.00	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		532,811,000.00	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	9,324,927.66	-
应收股利		-	-
应收申购款		299,998,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		875,166,916.25	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20.22	-
应付管理人报酬		202,970.47	-
应付托管费		40,594.09	-
应付销售服务费		20.28	-
应付交易费用	6.4.7.7	37,240.70	-
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	238,105.09	-
负债合计		518,950.85	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	864,225,333.86	-
未分配利润	6.4.7.10	10,422,631.54	-
所有者权益合计		874,647,965.40	-
负债和所有者权益总计		875,166,916.25	-

注：本基金合同于2019年1月28日生效，报告期为2019年1月28日至2019年6月30日，无上年度可比期间。报告截止日2019年6月30日，华富中证5年恒定久期国开债指数A基金份额净值1.0121元，基金份额总额863,928,570.15份；华富中证5年恒定久期国开债指数C基金份额净值1.0115元，基金份额总额296,763.71份。华富中证5年恒定久期国开债指数份额总额合计为864,225,333.86份。

## 6.2 利润表

会计主体：华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金

本报告期：2019年1月28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1月28日(基金合同生效日)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
<b>一、收入</b>		32,632,914.01	-
1.利息收入		27,629,123.23	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,002,031.16	-
债券利息收入		9,579,276.06	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,047,816.01	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		2,595,323.73	-
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	2,595,323.73	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以	6.4.7.17	2,408,451.64	-

“-”号填列)			
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	15.41	-
<b>减:二、费用</b>		3,256,852.71	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,375,617.09	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	475,123.38	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	37.68	-
4. 交易费用	6.4.7.19	25,050.00	-
5. 利息支出		124,325.91	-
其中: 卖出回购金融资产支出		124,325.91	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	256,698.65	-
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		29,376,061.30	-
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		29,376,061.30	-

注: 本基金合同于2019年1月28日生效, 报告期为2019年1月28日至2019年6月30日, 无上年度可比期间。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金

本报告期: 2019年1月28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1月28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)	3,365,112,247.02	-	3,365,112,247.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,376,061.30	29,376,061.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,500,886,913.16	-8,680,832.86	-2,509,567,746.02

其中：1.基金申购款	594,159,748.72	6,166,026.08	600,325,774.80
2.基金赎回款	-3,095,046,661.88	-14,846,858.94	-3,109,893,520.82
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）	-	-10,272,596.90	-10,272,596.90
五、期末所有者权益（基金净值）	864,225,333.86	10,422,631.54	874,647,965.40
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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金合同于2019年1月28日生效，报告期为2019年1月28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。

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

华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监

督管理委员会（以下简称中国证监会）（[2018]1432 号）核准。基金合同于 2019 年 1 月 28 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（2019）6-2 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《华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金》的规定，基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金持有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

本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，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 1 月 28 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》（证监会会计〔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	33,032,988.59
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：	33,032,988.59

### 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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	530,402,548.36	532,811,000.00

	合计	530,402,548.36	532,811,000.00	2,408,451.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		530,402,548.36	532,811,000.00	2,408,451.64

### 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30日
应收活期存款利息	15,576.77
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	-
应收债券利息	9,309,350.89
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	-
合计	9,324,927.66

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	-
银行间市场应付交易费用	37,240.70
合计	37,240.70

#### 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	-
审计费	36,450.26
信息披露费—中证报	50,117.76
预提中债账户维护费	4,500.00
预提上清账户维护费	4,500.00
应付指数使用费	142,537.07
合计	238,105.09

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A		
项目	本期 2019 年 1 月 28 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	3,365,085,674.21	3,365,085,674.21
本期申购	593,857,214.67	593,857,214.67
本期赎回(以“-”号填列)	-3,095,014,318.73	-3,095,014,318.73
- 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	863,928,570.15	863,928,570.15

金额单位：人民币元

华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C	
项目	本期 2019 年 1 月 28 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	26,572.81	26,572.81
本期申购	302,534.05	302,534.05
本期赎回(以“-”号填列)	-32,343.15	-32,343.15
- 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	296,763.71	296,763.71

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

华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A			
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	-	-	-
本期利润	26,964,729.66	2,409,050.17	29,373,779.83
本期基金份额交易产生的变动数	-7,062,021.18	-1,621,717.09	-8,683,738.27
其中：基金申购款	6,005,246.99	157,643.95	6,162,890.94
基金赎回款	-13,067,268.17	-1,779,361.04	-14,846,629.21
本期已分配利润	-10,270,824.46	-	-10,270,824.46
本期末	9,631,884.02	787,333.08	10,419,217.10

单位：人民币元

华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C			
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	-	-	-
本期利润	2,880.00	-598.53	2,281.47
本期基金份额交易产生的变动数	2,036.35	869.06	2,905.41
其中：基金申购款	2,215.93	919.21	3,135.14
基金赎回款	-179.58	-50.15	-229.73
本期已分配利润	-1,772.44	-	-1,772.44
本期末	3,143.91	270.53	3,414.44

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年1月28日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	3,415,881.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	10,583,150.00
结算备付金利息收入	3,000.00
其他	-
合计	14,002,031.16

注：其他存款利息收入所列金额为基金投资于有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。

#### 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1月28日(基金合同生效日)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	2,595,323.73
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	2,595,323.73

##### 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28日(基金合同生效日)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	1,544,070,387.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,506,041,476.27
减：应收利息总额	35,433,587.01
买卖债券差价收入	2,595,323.73

### 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

#### 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

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 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,408,451.64
——股票投资	-
——债券投资	2,408,451.64
——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	2,408,451.64

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15.41
合计	15.41

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	25,050.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	25,050.00

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	36,450.26
信息披露费	50,117.76
银行汇划费用	15,093.56
债券帐户维护费	12,000.00
指数使用费	142,537.07
其他	500.00
合计	256,698.65

注：其他所列金额为上清所查询服务费 100 元，股东账户开户费 400 元。

## 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

本报告期内本基金无通过关联方交易单元进行的交易。本基金合同于2019年1月28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1月28日(基金合同生效日)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	2,375,617.09	-
其中：支付销售机构的客户维护费	95.44	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值0.25%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）。本基金合同于2019年1月28日生效，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月28日(基金合同生效日)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	475,123.38	-

的托管费		
------	--	--

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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）。本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，无上年度可比期间。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 28 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销售服务费		
	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C	合计
华安证券股份有限公司	-	-	-
上海浦东发展银行股份有限公司	-	3.46	3.46
华富基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	3.46	3.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C	合计

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.1% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的 C 类基金销售服务费，E 为前一日 C 类基金资产净值）。本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，无上年度可比期间。

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

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A
---------------------

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华安证券股份 有限公司	50,000,000.00	5.7900%	-	-

注：本基金合同于2019年1月28日生效，无上年度可比期间。关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

#### 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28日(基金合同生效日)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
上海浦东发展银 行股份有限公司	33,032,988.59	3,415,881.16	-	-

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。本基金合同于2019年1月28日生效，无上年度可比期间。

#### 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

华富中证5年恒定久期国开债指数 A

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6 月5日	-	2019年6 月5日	0.0750	10,270,824.46	-	10,270,824.46	
合计	-	-	-	0.0750	10,270,824.46	-	10,270,824.46	

华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C

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 6 月 5 日	-	2019 年 6 月 5 日	0.0750	1,771.96	0.48	1,772.44	
合计	-	-	-	0.0750	1,771.96	0.48	1,772.44	

#### 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。

##### 6.4.12.2 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

###### 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**

注：本基金本报告期末未持有信用债。本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，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：本基金本报告期末未持有同业存单。本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，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**

注：本基金本报告期末未持有信用债。本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，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：本基金本报告期末未持有同业存单。本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，无上年度可比期间。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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	33,032,988.59	-	-	-	-	-	33,032,988.59
交易性金融资产	-	-	-	-242,072,000.00	290,739,000.00	-	532,811,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	9,324,927.66	9,324,927.66
应收申购款	-	-	-	-	-	-299,998,000.00	299,998,000.00
资产总计	33,032,988.59	-	-	-242,072,000.00	290,739,000.00	309,322,927.66	875,166,916.25
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20.22	20.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	202,970.47	202,970.47
应付托管费	-	-	-	-	-	40,594.09	40,594.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20.28	20.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	37,240.70	37,240.70
其他负债	-	-	-	-	-	238,105.09	238,105.09

负债总计	-	-	-	-	-	518,950.85	518,950.85
利率敏感度缺口	33,032,988.59	-	-	-242,072,000.00	290,739,000.00	308,803,976.81	874,647,965.40
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							
负债							

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。本基金合同于2019年1月28日生效，无上年度可比期间。

#### 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	6,490,070.89	-
	市场利率上升25基点	-6,430,595.86	

注：本基金合同于2019年1月28日生效，无上年度可比期间。

#### 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	532,811,000.00	60.92	-	-
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	532,811,000.00	60.92	-	-

注：本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，无上年度可比期间。

#### 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	27,300,475.78	-

注：本基金合同于 2019 年 1 月 28 日生效，无上年度可比期间。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	532,811,000.00	60.88
	其中：债券	532,811,000.00	60.88
	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	33,032,988.59	3.77
8	其他各项资产	309,322,927.66	35.34
9	合计	875,166,916.25	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票

### 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

### 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	532,811,000.00	60.92
	其中：政策性金融债	532,811,000.00	60.92
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）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	532,811,000.00	60.92

## 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	170210	17 国开 10	900,000	91,260,000.00	10.43
2	160210	16 国开 10	800,000	77,264,000.00	8.83
3	180211	18 国开 11	700,000	70,840,000.00	8.10
4	180208	18 国开 08	600,000	61,056,000.00	6.98
5	190203	19 国开 03	600,000	59,616,000.00	6.82

## 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。

## 7.11 投资组合报告附注

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

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

### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,324,927.66
5	应收申购款	299,998,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	309,322,927.66

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
华富中证5年恒定久期国开债指数A	37	23,349,420.81	863,831,165.08	99.99%	97,405.07	0.01%
华富中证5年恒定久期国开债指数C	143	2,075.27	0.00	0.00%	296,763.71	100.00%
合计	180	4,801,251.85	863,831,165.08	99.95%	394,168.78	0.05%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华富中证5年恒定久期国开债指数A	11,058.35	0.0013%
	华富中证5年恒定久期国开债指数C	420.02	0.1415%
	合计	11,478.37	0.0013%

### **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

项目	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 A	华富中证 5 年恒定久期国开债指数 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 28 日）基金份额总额	3,365,085,674.21	26,572.81
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	593,857,214.67	302,534.05
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,095,014,318.73	32,343.15
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	863,928,570.15	296,763.71

## § 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，增聘郇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

### 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	
民生证券	2	-	-	-	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2) 本报告期本基金新增民生证券 2 个交易单元。

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
民生证券	-	-	500,000,000.00	100.00%	-	-

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

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	《华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金合同生效公告》	中证报及公司网站	2019 年 1 月 29 日
2	《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
3	《华富基金管理有限公司关于调整旗下华富中证 5 年恒定久期国开债指数基金申购、赎回、转换、最低持有份额和定投数额限制的公告》	中证报及公司网站	2019 年 3 月 28 日
4	《华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》	中证报及公司网站	2019 年 3 月 28 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》	中证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
6	《关于华富基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与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
7	《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
8	《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
9	《关于华富基金管理有限公司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
10	《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
11	《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
12	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加	中证报及公司网站	2019 年 4 月 23 日

	阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告》		
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海利得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 29 日
14	《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
15	《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
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》	中证报及公司网站	2019 年 5 月 25 日
17	《关于华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金 2019 年分红公告》	中证报及公司网站	2019 年 6 月 4 日
18	《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	1	1.28-6.30	200,000,000.00	0.00	0.00	200,000,000.00	23.14%
	2	6.25-6.30	0.00	197,842,516.57	0.00	197,842,516.57	22.89%
	3	6.27-6.30	0.00	197,744,710.30	0.00	197,744,710.30	22.88%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。