

# 华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资 基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.11 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</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.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	华富恒玖3个月定期开放债券	
基金主代码	005694	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年3月23日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	64,795,186.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华富恒玖3个月定期开放债券A	华富恒玖3个月定期开放债券C
下属分级基金的交易代码:	005694	006770
报告期末下属分级基金的份额总额	38,814,838.56份	25,980,347.99份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过合理灵活的资产配置策略,同时结合固定收益资产投资策略等积极把握中国经济增长和债券市场发展机遇,在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
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,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	石立平
	联系电话	021-68886996	010-63639180
	电子邮箱	manzh@hffund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-700-8001	95595
传真		021-68887997	010-63639132
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		章宏韬	李晓鹏

## 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	华富恒玖 3 个月定期开放债券 A	华富恒玖 3 个月定期开放债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	786,583.74	497,367.39
本期利润	690,728.33	376,004.44
加权平均基金份额本期利润	0.0164	0.0117
本期加权平均净值利润率	1.62%	1.15%
本期基金份额净值增长率	1.50%	1.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,040,958.66	305,140.45
期末可供分配基金份额利润	0.0268	0.0117
期末基金资产净值	39,855,797.22	26,285,488.44
期末基金份额净值	1.0268	1.0117
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	4.22%	1.17%

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

华富恒玖 3 个月定期开放债券 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	0.29%	0.01%	0.57%	0.03%	-0.28%	-0.02%
过去三个月	0.89%	0.03%	0.63%	0.06%	0.26%	-0.03%
过去六个月	1.50%	0.04%	2.07%	0.06%	-0.57%	-0.02%



过去一年	3.22%	0.03%	6.46%	0.06%	-3.24%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.22%	0.03%	9.24%	0.07%	-5.02%	-0.04%

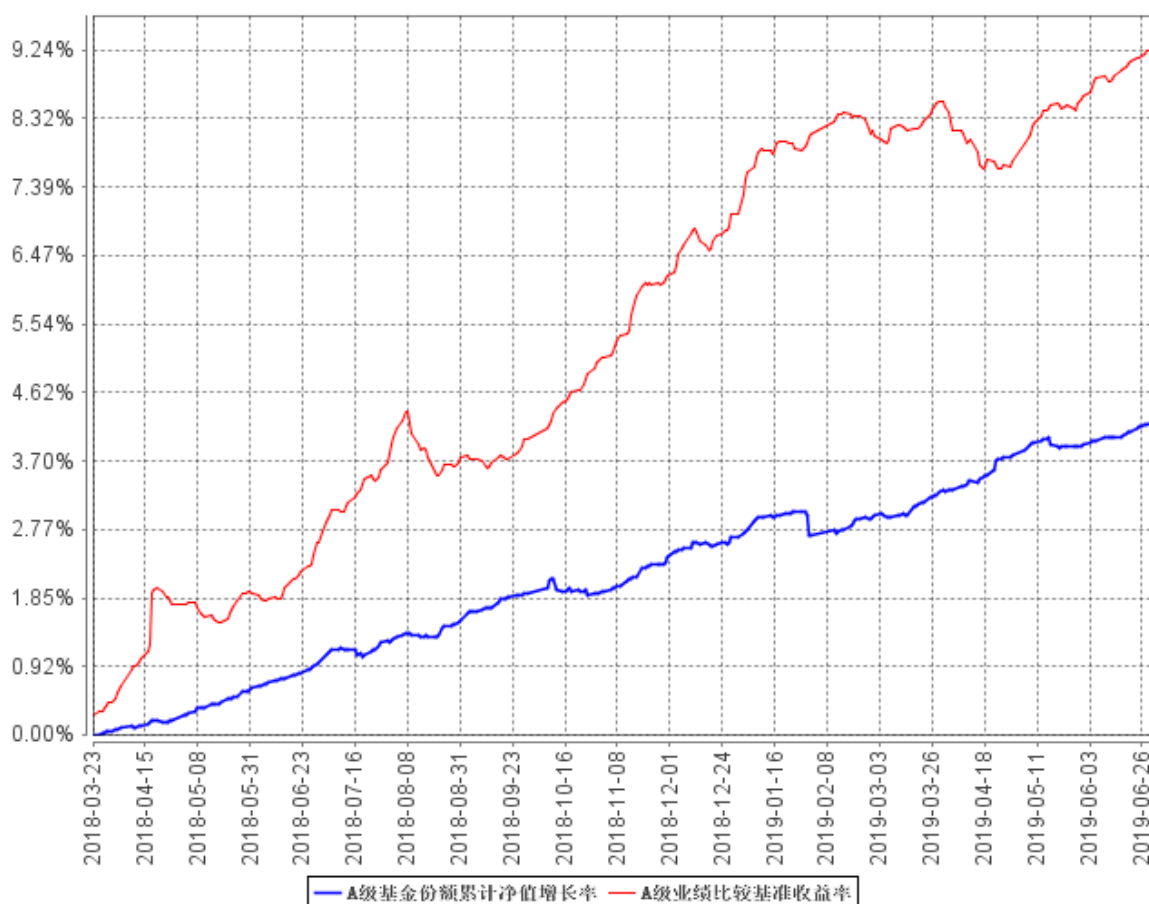
华富恒玖3个月定期开放债券C

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	0.28%	0.01%	0.57%	0.03%	-0.29%	-0.02%
过去三个月	0.88%	0.03%	0.63%	0.06%	0.25%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.17%	0.04%	1.14%	0.06%	0.03%	-0.02%

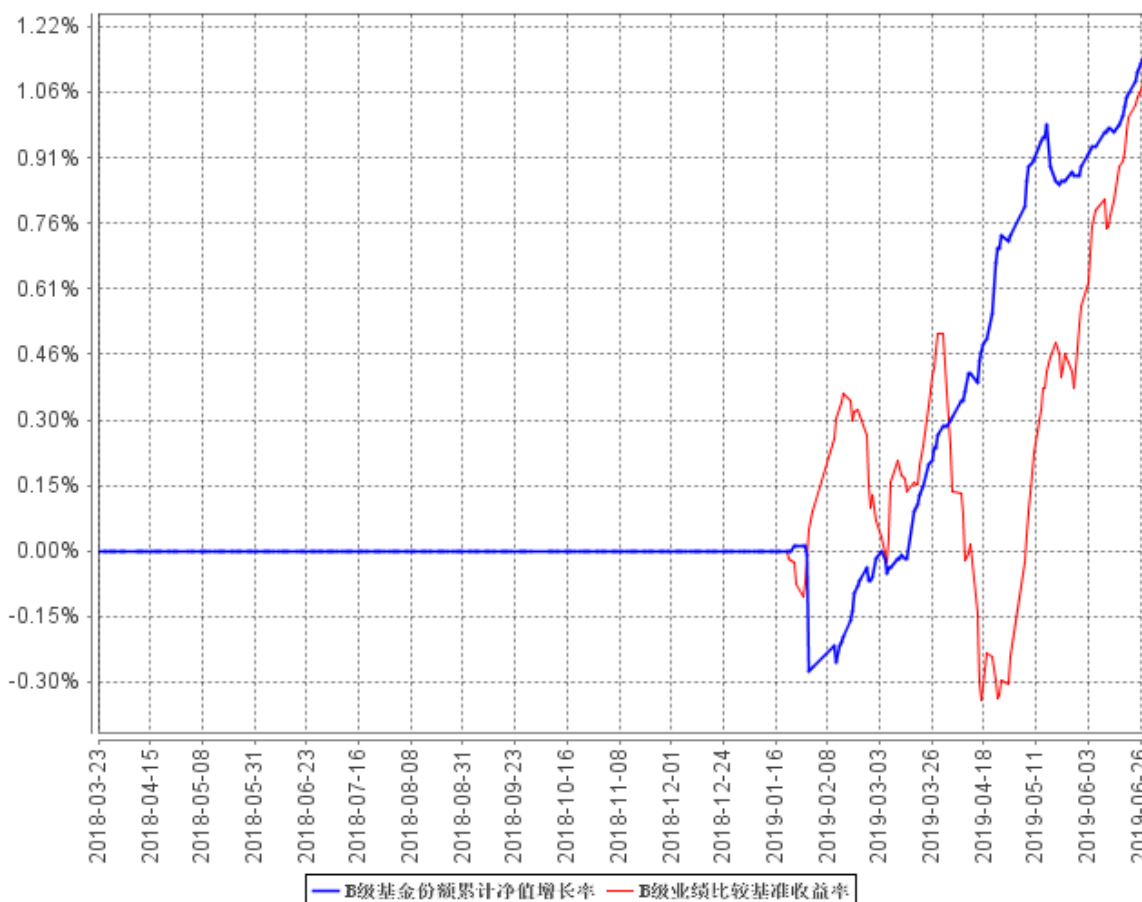
注：业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

### 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《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金建仓期为 2018 年 3 月 23 日到 2018 年 9 月 23 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《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 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		
倪莉莎	华富恒玖 3 个月定期开放债券型基金基金经理、华富天盈货币市场基金基金经	2018 年 3 月 23 日	-	五年	英国曼彻斯特大学管理学硕士，研究生学历。2014 年 2 月加入华富基金管理有限公司，先后担任集中交易部助理交易员、交易员，固定收益部华富货币市场基金、华富天益货币

	理、华富恒财定期开放债券型基金基金经理、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式基金基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金经理、华富恒盛纯债债券型基金基金经理、华富货币市场基金基金经理			市场基金、华富益鑫灵活配置混合型基金、华富恒财分级债券型基金的基金经理助理，2018 年 6 月 25 日至 2019 年 3 月 28 日任华富恒悦定期开放债券型基金基金经理。
--	--	--	--	---

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。

#### 4.2 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，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

#### 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

今年上半年，国内经济处于持续寻底的过程中。出口进入下行周期，但受抢出口以及衰退式顺差的影响，净出口对 GDP 的拖累并未完全显现；固定资产投资整体平稳，基建投资仍是稳内需关键；需求与消费支出持续走弱，政策提振作用有待观察。CPI 持续上行，PPI 环比于 3 月由负转正后，5 月再度转负，制造业仍有下行压力。一季度宏观数据好于预期，后市对货币政策边际收紧有所担忧，但二季度并未见信用持续扩张信号，货币政策将继续维持稳健的可能性大，并且配合财政政策继续积极与托底。

上半年全球经济同步放缓趋势得到确认。特别是二季度中美贸易纠纷再度升级，加之此前的短期季节因素褪去，导致全球经济于二季度再次快速下滑，至 5 月全球综合 PMI 指数骤跌至 51.2，服务业 PMI 指数降至 51.6，而制造业 PMI 指数更跌破荣枯线至 49.4。全球贸易、商业投资和制造业仍将持续承压，拖累全球 GDP 增速由 2018 年的 3.6%放缓至 2019 年的 3.1%。美国国债收益率曲线的倒挂也反应了市场对美国经济衰退的忧虑。今年上半年全球央行的政策方向出现了显著的变化，包括新西兰、澳大利亚、印度等数十个国家的央行率先降息，全球性的货币宽松正在路上。

债券市场方面，1 月初央行降准后，债券市场收益率快速下行至低位。随后受宏观数据向好影响，债券市场维持区间震荡走势。特别是受 3 月份基本面数据向好，叠加市场对货币政策因通货膨胀水平而预期收紧的担忧，债券收益率震荡上行，4 月中下旬收益率达到高点。行至 5 月中旬，收益率回归震荡下行，中高等级信用债下行幅度加大。5 月下旬因某银行被接管事件，引发银行信用打破刚兑与流动性紧张担忧，收益率再度阶段性上行。6 月央行考虑到季末流动性紧张与地方债发行缴款相叠加，频频实行逆回购和中期借贷便利操作，向市场投放大量流动性支持。6 月债券市场流动性出现分化，质押市场高等级信用债以及规模大机构受市场接受度高，融资成本低，而低等级信用债以及私募等小机构融资成本高，融出方稀少。受此影响，6 月信用利差与期限利差走扩。

华富恒玖债券基金，坚持以高等级债券为主要配置对象，同时谨慎使用杠杆，利用流动性分层带来的波段机会，积极配置个券。本基金通过择时与择券相结合，合理使用不同期限的融资品种，提高再投资与杠杆收益，增强组合的票息收益。选择资质良好，盈利优势明显的信用债券为目标债券，同时结合资金面灵活平衡地选择久期，为持有人获取适当收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类份额于 2018 年 3 月 23 日正式成立，截至 2019 年 6 月 30 日，华富恒玖 A 类基金

份额净值为 1.0268 元，累计基金份额净值为 1.0418 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 1.50%，同期业绩比较基准收益率为 2.07%。本基金 C 类份额于 2019 年 1 月 22 日成立，华富恒玖 C 类基金份额净值为 1.0117 元，累计基金份额净值为 1.0117 元，本报告期 C 类份额净值增长率为 1.17%，同期业绩比较基准收益率为 1.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，新一轮全球货币宽松可能性增大。预计下半年财政政策将继续发力、托底经济。专项债撬动基建投资的作用值得期待。货币政策在保持疏通信用渠道的基础上，持续优化金融供给结构，降低企业融资成本。供给侧结构性改革深入推进、破立结合，鼓励经济新动能，加强补短板，稳定宏观杠杆率。值得关注的是，政策可能需要为明年以及更复杂的外部环境预留空间，同时供给侧改革金融防风险的主题方向仍需要坚持，因此下半年大概率不会重走老路，供给侧改革与需求端配合的政策创新仍值得期待。

三季度影响市场预期的主要因素对债券市场较为利好。根据经济的趋势惯性以及前期贸易摩擦积累的影响可能于三季度得到显现，国内债券市场在三季度面临的因素好于二季度，同时海外货币宽松的环境也有利于国内债券市场。但同时仍应注意到，国内减税刺激消费与地方债撬动基础建设的力度是否超出市场预期，信用利差与期限利差仍有空间反应市场对此轮经济周期的不确定性预期仍较高。

三季度，在疏通货币宽松向信用宽松的大方向下，资质优良、效率较高特别是在区域经中影响较大的企业在融资方面可能受惠，同时我们预计资金面走势较二季度有所缓和，市场对信用利差的预期也可能出现分歧。管理人将谨慎选择久期，合理运用杠杆，利用预判资金面与挖掘调研的信用债券相结合，主动择时，为持有人合理增加收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 1,066,732.77 元，期末可供分配利润为 1,346,099.11 元。本报告期内未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。本基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2019 年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、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。



## § 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：华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	95,561.00	4,330,554.23
结算备付金		292,714.20	873,120.12
存出保证金		16,088.08	40,807.12
交易性金融资产	6.4.7.2	101,886,366.40	131,729,300.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		101,886,366.40	131,729,300.00
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	2,462,573.26	2,693,582.72
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		104,753,302.94	139,667,364.19
<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		38,474,568.08	33,081,770.03
应付证券清算款		3,902.35	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		16,281.50	27,008.04
应付托管费		5,427.17	9,002.69
应付销售服务费		2,156.90	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,071.27	11,706.47
应交税费		10,388.49	16,531.85

应付利息		38,426.33	35,161.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	53,795.19	350,000.00
负债合计		38,612,017.28	33,531,180.76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	64,795,186.55	104,913,981.12
未分配利润	6.4.7.10	1,346,099.11	1,222,202.31
所有者权益合计		66,141,285.66	106,136,183.43
负债和所有者权益总计		104,753,302.94	139,667,364.19

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，华富恒玖债券 A 的基金份额净值 1.0268 元，基金份额 38,814,838.56 份；华富恒玖债券 C 的基金份额净值 1.0117 元，基金份额 25,980,347.99 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：华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年3月23日(基金 合同生效日)至2018年6 月30日
<b>一、收入</b>		1,639,967.14	11,055,575.31
1.利息收入		2,210,604.57	12,902,461.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,608.49	2,477,982.61
债券利息收入		2,128,702.29	7,830,437.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		55,293.79	2,594,041.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-353,465.06	-2,314,972.39
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	-353,465.06	-2,314,972.39
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“-”号填列）	6.4.7.17	-217,218.36	468,086.30
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	45.99	-
<b>减：二、费用</b>		573,234.37	1,632,707.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	100,165.28	807,741.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,388.45	269,247.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	12,584.50	-
4. 交易费用	6.4.7.19	6,487.12	11,804.75
5. 利息支出		341,394.21	397,957.14
其中：卖出回购金融资产支出		341,394.21	397,957.14
6. 税金及附加		6,819.62	22,318.33
7. 其他费用	6.4.7.20	72,395.19	123,639.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,066,732.77	9,422,867.49
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,066,732.77	9,422,867.49

注：后附表附注为本财务报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	104,913,981.12	1,222,202.31	106,136,183.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,066,732.77	1,066,732.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-40,118,794.57	-942,835.97	-41,061,630.54
其中：1.基金申购款	93,893,554.85	871,130.30	94,764,685.15
2.基金赎回款	-134,012,349.42	-1,813,966.27	-135,826,315.69
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）	64,795,186.55	1,346,099.11	66,141,285.66
项目	上年度可比期间 2018 年 3 月 23 日(基金合同生效日)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）	1,000,301,246.62	-	1,000,301,246.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,422,867.49	9,422,867.49
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）	-380,178,963.26	-3,383,593.08	-383,562,556.34
其中：1.基金申购款	5.98	0.02	6.00
2.基金赎回款	-380,178,969.24	-3,383,593.10	-383,562,562.34
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）	-	-3,720,733.87	-3,720,733.87
五、期末所有者权益（基金净值）	620,122,283.36	2,318,540.54	622,440,823.90

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）《关于准予华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】234 号）准予募集注册，基金合同于 2018 年 3 月 23 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业经天健会计师事务所有限责任公司审验，

并由其出具《验证报告》（天健字〔2018〕6-5 号）。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、可分离交易可转债的纯债部分、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本报告期本基金会计政策无变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本报告期本基金会计估计无变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本报告期本基金无重大会计差错。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1 号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85 号）、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2015〕101 号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36 号）、《关于进一步明确全面推开营改增试点

金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46 号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56 号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90 号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

(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。

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	95,561.00
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:	95,561.00

### 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	31,115,091.40	30,904,985.40
	银行间市场	71,042,005.14	70,981,381.00
	合计	102,157,096.54	101,886,366.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	102,157,096.54	101,886,366.40	-270,730.14

### 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	19.91
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	131.70
应收债券利息	2,462,414.35
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	7.30
合计	2,462,573.26

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	7,071.27
合计	7,071.27

#### 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	-
预提费用	-
应付账户维护费	9,000.00
应付审计费	24,795.19
应付信息披露费	20,000.00
合计	53,795.19

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富恒玖 3 个月定期开放债券 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	104,913,981.12	104,913,981.12
本期申购	39,143,080.06	39,143,080.06
本期赎回(以“-”号填列)	-105,242,222.62	-105,242,222.62



- 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	38,814,838.56	38,814,838.56

金额单位：人民币元

华富恒玖 3 个月定期开放债券 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	54,750,474.79	54,750,474.79
本期赎回(以“-”号填列)	-28,770,126.80	-28,770,126.80
- 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	25,980,347.99	25,980,347.99

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

华富恒玖 3 个月定期开放债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,304,501.05	-82,298.74	1,222,202.31
本期利润	786,583.74	-95,855.41	690,728.33
本期基金份额交易产生的变动数	-858,812.67	-13,159.31	-871,971.98
其中：基金申购款	729,084.94	-44,696.22	684,388.72
基金赎回款	-1,587,897.61	31,536.91	-1,556,360.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,232,272.12	-191,313.46	1,040,958.66

单位：人民币元

华富恒玖 3 个月定期开放债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	497,367.39	-121,362.95	376,004.44
本期基金份额交易	-73,041.04	2,177.05	-70,863.99

产生的变动数			
其中：基金申购款	251,078.38	-64,336.80	186,741.58
基金赎回款	-324,119.42	66,513.85	-257,605.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	424,326.35	-119,185.90	305,140.45

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	22,792.51
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,603.65
其他	212.33
合计	26,608.49

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1月1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	-353,465.06
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	-353,465.06

##### 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30日
----	----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	209,770,564.47
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	205,322,198.37
减：应收利息总额	4,801,831.16
买卖债券差价收入	-353,465.06

#### 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30日
1. 交易性金融资产	-217,218.36
——股票投资	-
——债券投资	-217,218.36
——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	-217,218.36

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	45.99
合计	45.99

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,144.62
银行间市场交易费用	5,342.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	6,487.12

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	20,000.00
债券帐户维护费	27,000.00
其他	600.00
银行汇划费用	-
合计	72,395.19

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

无

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、销售机构
中国光大银行股份有限公司	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

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)至 2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华安证券	135,902,889.87	100.00%	202,347,622.61	100.00%

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)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	373,200,000.00	100.00%	646,700,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

#### 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 30 日	2018 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	100,165.28	807,741.45
其中：支付销售机构的客户维护费	21,444.27	95.08

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.3% 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 30 日	2018 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,388.45	269,247.15

注：基金托管费按前一日基金资产净值 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）。

##### 6.4.10.2.3 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 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富恒玖 3 个月定期开放债券 A	华富恒玖 3 个月定期开放债券 C	合计
华富基金管理有限公司	-	61.60	61.60
中国建设银行股份有限公司	-	1,193.79	1,193.79

合计	-	1,255.39	1,255.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富恒玖 3 个月定期开放债券 A	华富恒玖 3 个月定期开放债券 C	合计
华富基金管理有限公司	-	-	-
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
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 类基金资产净值的 0.20% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式  $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	95,561.00	22,792.51	852,017.24	110,892.26

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

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。

##### 6.4.12.2 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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011900337	19 鲁钢铁 SCP001	2019 年 7 月 2 日	100.29	50,000	5,014,500.00
071900046	19 渤海证券 CP006	2019 年 7 月 3 日	100.12	16,000	1,601,920.00
041900084	19 天安煤业 CP001	2019 年 7 月 2 日	100.34	50,000	5,017,000.00
011802217	18 比亚迪 SCP005	2019 年 7 月 2 日	100.58	50,000	5,029,000.00
101454053	14 粤珠江 MTN002	2019 年 7 月 3 日	101.50	50,000	5,075,000.00
合计				216,000	21,737,420.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无交易所债券正回购交易余额。

#### 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	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	20,106,000.00	10,014,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	18,050,300.00	77,344,200.00
合计	38,156,300.00	87,358,200.00

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	上年度末
--------	-----	------

	2019 年 6 月 30 日	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	9,676,000.00
合计	0.00	9,676,000.00

#### 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 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	39,705,819.00	83,765,000.00
AAA 以下	62,180,547.40	28,191,300.00
其中低于 AA 以下	5,006,000.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	101,886,366.40	111,956,300.00

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	9,676,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
其中低于 AA 以下	0.00	0.00
AA+	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	9,676,000.00

### 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

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	95,561.00	-	-	-	-	-	95,561.00
结算备付金	292,714.20	-	-	-	-	-	292,714.20
存出保证金	16,088.08	-	-	-	-	-	16,088.08
交易性金融资产	15,079,600.00	21,628,306.40	56,155,981.00	9,022,479.00	-	-	101,886,366.40
应收利息	-	-	-	-	-	2,462,573.26	2,462,573.26
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,483,963.28	21,628,306.40	56,155,981.00	9,022,479.00	-	2,462,573.26	104,753,302.94

负债							
卖出回购金融资产款	38,474,568.08	-	-	-	-	-	38,474,568.08
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,902.35	3,902.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,281.50	16,281.50
应付托管费	-	-	-	-	-	5,427.17	5,427.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,156.90	2,156.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,071.27	7,071.27
应付利息	-	-	-	-	-	38,426.33	38,426.33
应交税费	-	-	-	-	-	10,388.49	10,388.49
其他负债	-	-	-	-	-	53,795.19	53,795.19
负债总计	38,474,568.08	-	-	-	-	137,449.20	38,612,017.28
利率敏感度缺口	-22,990,604.80	21,628,306.40	56,155,981.00	9,022,479.00	-	-2,325,124.06	66,141,285.66
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	4,330,554.23	-	-	-	-	-	4,330,554.23
结算备付金	873,120.12	-	-	-	-	-	873,120.12
存出保证金	40,807.12	-	-	-	-	-	40,807.12
交易性金融资产	83,655,600.00	19,005,300.00	14,995,000.00	14,073,400.00	-	-	131,729,300.00
应收利息	-	-	-	-	-	-2,693,582.72	2,693,582.72
资产总计	88,900,081.47	19,005,300.00	14,995,000.00	14,073,400.00	-	-2,693,582.72	139,667,364.19
负债							
卖出回购金融资产款	33,081,770.03	-	-	-	-	-	33,081,770.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,008.04	27,008.04
应付托管费	-	-	-	-	-	9,002.69	9,002.69
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,706.47	11,706.47
应付利息	-	-	-	-	-	35,161.68	35,161.68
应交税费	-	-	-	-	-	16,531.85	16,531.85
其他负债	-	-	-	-	-	350,000.00	350,000.00
负债总计	33,081,770.03	-	-	-	-	449,410.73	33,531,180.76
利率敏感度缺口	55,818,311.44	19,005,300.00	14,995,000.00	14,073,400.00	-	-2,244,171.99	106,136,183.43

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 基点	168,192.10	105,543.99
	市场利率上升 25 基点	-168,032.91	-105,222.89

点		
---	--	--

#### 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	101,886,366.40	154.04	131,729,300.00	124.11
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	101,886,366.40	154.04	131,729,300.00	124.11

##### 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	2,006,853.24	26,969,401.71

**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	101,886,366.40	97.26
	其中：债券	101,886,366.40	97.26
	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	388,275.20	0.37
8	其他各项资产	2,478,661.34	2.37
9	合计	104,753,302.94	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港股通投资股票投资组合。

### 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

#### 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	58,655,066.40	88.68
5	企业短期融资券	38,156,300.00	57.69
6	中期票据	5,075,000.00	7.67
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	101,886,366.40	154.04

## 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	1280472	12 诸暨债	300,000	6,132,000.00	9.27
2	136561	16 老百姓	60,000	6,000,000.00	9.07
3	112481	16 广联 01	54,000	5,394,060.00	8.16
4	122934	09 南山 2	53,000	5,347,700.00	8.09
5	1280329	12 港航债	129,830	5,284,081.00	7.99

## 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投资。

## 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	16,088.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,462,573.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,478,661.34

### 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
华富恒玖 3 个月定期开放债券 A	231	168,029.60	29,524,008.15	76.06%	9,290,830.41	23.94%
华富恒玖 3 个月定期开放债券 C	91	285,498.33	1,500,150.02	5.77%	24,480,197.97	94.23%
合计	322	201,227.29	31,024,158.17	47.88%	33,771,028.38	52.12%

### 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	华富恒玖 3 个月定期开放债券 A	63,570.88	0.1638%
	华富恒玖 3 个月定期开放债券 C	0.00	0.0000%
	合计	63,570.88	0.0981%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

**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	份额级别	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	华富恒玖 3 个月定期开放债券 A	0~10
	华富恒玖 3 个月定期开放债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华富恒玖 3 个月定期开放债券 A	0~10
	华富恒玖 3 个月定期开放债券 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富恒玖 3 个月定期开放债券 A	华富恒玖 3 个月定期开放债券 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 23 日）基金份额总额	1,000,301,246.62	-
本报告期期初基金份额总额	104,913,981.12	-
本报告期期间基金总申购份额	39,143,080.06	54,750,474.79
减：本报告期期间基金总赎回份额	105,242,222.62	28,770,126.80
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	38,814,838.56	25,980,347.99

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陈启明先生为华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，翁海波先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，翁海波先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，翁海波先生不再担任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。

5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘张惠女士为华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、经华富基金管理有限公司第六届董事会第一次会议审议通过，因工作需要，余海春先生不再担任公司总经理职务，聘任曹华玮先生担任公司总经理。

7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘张亮先生为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘倪莉莎女士为华富货币市场基金基金经理。

9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘郦彬先生为华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理。

10、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，尹培俊先生、姚姣姣女士不再担任华富货币市场基金基金经理的职务。

11、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，姚姣姣女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。

12、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	2	-	-	-	-	-

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) 本报告期本基金没有新增交易单元。

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
华安证券	135,902,889.87	100.00%	373,200,000.00	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	《华富基金管理有限公司关于华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金增加 C 类基金份额并相应修改基金合同的公告》	上证报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
2	《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》	上证报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
3	《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》	上证报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
4	《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金开放第三次申购、赎回及转换业务的公告》	上证报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
5	《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告》	上证报及公司网站	2019 年 1 月 21 日
6	《关于华富恒玖 3 个月定期开放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 1 月 25 日
7	《关于华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金延长开放期的公告》	上证报及公司网站	2019 年 1 月 30 日
8	《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》	上证报及公司网站	2019 年 3 月 15 日
9	《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2018 年年度报告》	公司网站	2019 年 3 月 26 日
10	《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2018 年年度报告摘要》	上证报及公司网站	2019 年 3 月 26 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
12	《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》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
13	《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
14	《关于华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金增加浦发银行为代销机构的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 17 日
15	《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
16	《关于华富基金管理有限公司旗下部	上证报及公司网站	2019 年 4 月 17 日

	《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》		
17	《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
18	《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 20 日
19	《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
20	《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
21	《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金开放第四次申购、赎回及转换业务的公告》	上证报及公司网站	2019 年 4 月 30 日
22	《华富恒玖 3 个月定期开放债券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 4 月 30 日
23	《华富恒玖 3 个月定期开放债券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 4 月 30 日
24	《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
25	《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
26	《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
27	《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



## § 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	1.31-6.30	0.00	24,641,695.42	0.00	24,641,695.42	38.03%
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、《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富恒玖 3 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富恒玖 3 个月定期开放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。