

# 华富中小板指数增强型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 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 2020 年 4 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
8.6 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.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.8 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.....	51

8.9 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 .....	51
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
8.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
9.3 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 .....	53
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
11.2 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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
11.4 基金投资策略的改变 .....	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
12.1 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 .....	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
13.1 备查文件目录 .....	62
13.2 存放地点 .....	62
13.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富中小板指数增强型证券投资基金
基金简称	华富中小板指数增强
基金主代码	410010
交易代码	410010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 9 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,493,242.16 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，以被动跟踪标的指数为主，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不得超过 7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础之上，力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	作为指数增强型基金，本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上，采用适度的主动投资辅助提高收益，降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法，按照标的指数的成分股组成及其权重构建指数化投资组合，并按照标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股，在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。
业绩比较基准	中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下，其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	田青
	联系电话	021-68886996	010-67595096
	电子邮箱	manzh@hffund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096

传真	021-68887997	010-66275853
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	章宏韬	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	浙江省杭州市钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 层
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

### § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-913,120.58	-483,773.04	-498,193.37
本期利润	3,742,024.73	-3,848,620.84	776,168.20
加权平均基金份额本期利润	0.1683	-0.5122	0.1236
本期加权平均净值利润率	15.38%	-43.63%	9.14%
本期基金份额净值增长率	33.74%	-35.88%	8.67%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	4,383,193.30	-948,194.34	2,550,502.27
期末可供分配基金份额利润	0.2039	-0.0998	0.4036
期末基金资产净值	25,876,435.46	8,553,088.47	8,869,854.49
期末基金份额净值	1.2039	0.9002	1.404
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	20.39%	-9.98%	40.40%

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 12 月 31 日。

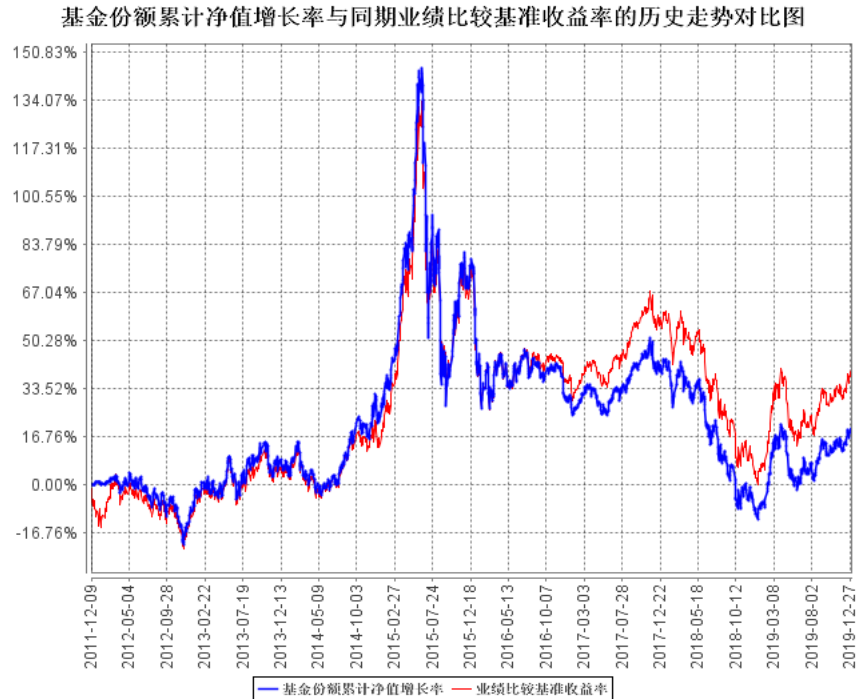
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.81%	0.88%	9.55%	0.88%	-0.74%	0.00%
过去六个月	14.29%	1.03%	15.17%	1.02%	-0.88%	0.01%
过去一年	33.74%	1.34%	36.81%	1.35%	-3.07%	-0.01%
过去三年	-6.82%	1.24%	3.35%	1.24%	-10.17%	0.00%
过去五年	-2.75%	1.72%	22.31%	1.62%	-25.06%	0.10%
自基金合同生效起至今	20.39%	1.54%	40.31%	1.50%	-19.92%	0.04%

注：业绩比较基准收益率 = 中小板指数收益率 \* 90% + 一年期银行定期存款利率 (税后) \* 10%。

### 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

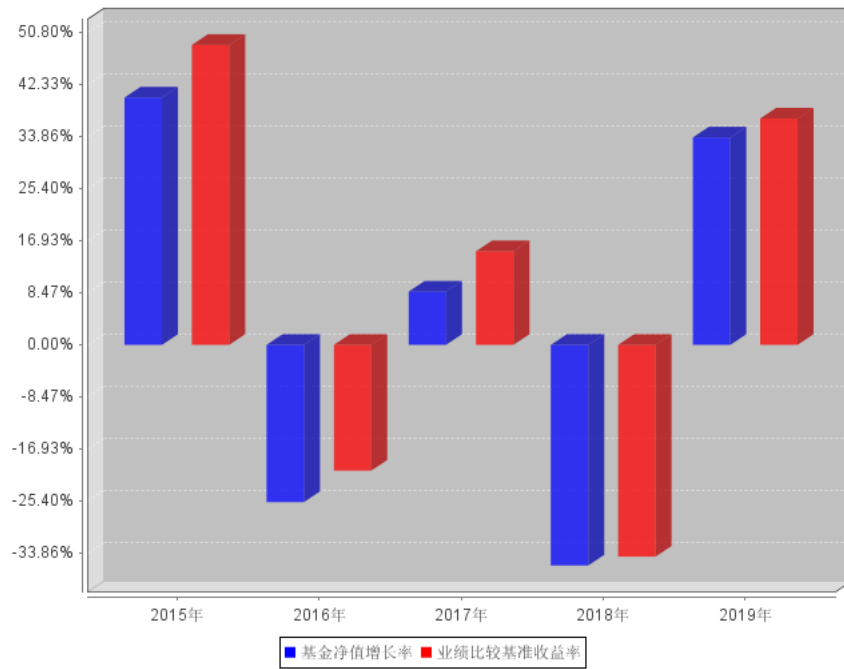


注：根据《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：投资于股票资产占基金资产的比例为 85%–95%，其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为 2011 年 12 月 9 日到 2012 年 6 月 9 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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 12 月 31 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、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金共三十九只基金。

#### 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		
郜哲	华富中小板指数增强型基金经理、华富永鑫灵活配置	2018 年 2 月 23 日	-	五年	北京大学理学博士，研究生学历，先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司

	混合型基金基金经理、华富中证 100 指数基金基金经理、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型基金基金经理、华富中证人工智能产业交易型开放式指数基金基金经理				高级研究员，2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司。
高靖瑜	华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理	2017 年 9 月 12 日	2019 年 7 月 17 日	十九年	复旦大学金融学硕士，本科学历。历任金鼎综合证券（维京）股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员，2007 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任行业研究员、华富价值增长混合型基金基金经理助理、华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理、华富中证 100 指数基金基金经理、华富中小板指数增强基金基金经理。

注：这里的任职日期、离任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 公平交易制度和控制方法

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》，公司制定了《华富基金管

理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监察稽核力度，公司集中交易部、监察稽核部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交监察稽核部备案。公司监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

#### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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 年初天量信贷投放，PMI 数据企稳，风险偏好逐渐修复，同时外资持续流入，股市在一季度大幅上涨。但随着经济数据走弱，PMI 下滑至荣枯线下，国内经济景气度在短暂回升后再度转为下降。再加上中美贸易战的反复，以及货币政策也从出现了边际收紧，股市出现了的震荡向下。四季度随着中美贸易协议逐步达成以及美联储连续降息，国内加大了逆周期调节力度，银行间短期利率下行明显，经济数据企稳，PMI 重回 50 以上。2019 年全年沪深 300 上涨 36.07%，中证 100 上涨 35.54%、中小板上涨 41.03%、创业板上涨 43.79%。

在上半年股市普涨后，年中震荡行情下，资金一方面继续寻找盈利相对稳定的板块，另一方面对既有业绩增长预期，又有实际边际增长印证的科创板也十分青睐，因此，复苏早期中小板指相对表现一般，而 12 月份，随着对新能源车、半导体、电子的未来预期市场空间的扩大市场逐渐形成稳定预期，中小板指表现明显转好。

基金操作方面，本基金以复制指数成分为主。在经济复苏后，以及观察到中小板中占比较高的电子等科创行业的业绩有明显改善，因此本基金首先在仓位上，逐渐提升至合同约定的上限，因子增强方面，更加偏重成长因子和动量的结合。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2039 元；本报告期基金份额净值增长率为 33.74%，业绩比较基准收益率为 36.81%。

## 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 2020 年，我们判断科创板业绩有较大概率继续改善，国家对科创行业的支持，也将是 2020 年的主基调。因此在 2020 年本基金将维持仓位在合同约定的上限附近。本基金在增强时，主要采取成长及动量因子，对市场一致预期较强，且有基本面边际改善相印证的股票，适当增加权重。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期

向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、加强内部控制制度建设，完善内部控制环境。2019 年，公司结合现行法规条例与公司业务等实际情况，为加强公司反洗钱和反恐怖融资工作，有效预防洗钱及相关违法犯罪活动，制定了《华富基金管理有限公司洗钱和恐怖融资风险管理制度》；为规范公司公开募集证券投资基金信息披露管理工作，保障基金份额持有人及相关当事人的合法权益，修订了《华富基金管理有限公司基金信息披露制度》；为规范公司开展私募资产管理业务，保护私募资产管理计划委托人及公司利益，制定了《华富基金管理有限公司私募资产管理计划风险等级评价办法》、《华富基金管理有限公司私募资产管理业务投资顾问机构管理办法》、《华富基金管理有限公司私募资产管理业务信息披露管理办法》；为规范公司信息技术治理方面的议事和决策程序，充分发挥公司信息技术治理决策机构的作用，有效落实公司信息技术治理工作，实现信息技术的有效管理和控制，制定了《华富基金管理有限公司信息技术治理委员会议事规则》。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，每月定时向风险控制委员会报告，进行及时的风险揭示。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### **4.7 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。报告期内相关基金估值政策由天健会计师事务所（特殊普通合伙）进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。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。

#### **4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 3,742,024.73 元，期末可供分配利润为 4,383,193.30 元。本报告期内未进行利润分配。

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

从 2014 年 9 月 4 日起至本报告期末（2019 年 12 月 31 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于五千万元的情形，至本报告期期末（2019 年 12 月 31 日）基金资产净值仍低于五千万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。



## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审（2020）6-54 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富中小板指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华富中小板指数增强型证券投资基金（以下简称华富中小板基金）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、持有人权益（基金净值）变动表，以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华富中小板基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况，以及 2019 年度的经营成果和持有人权益（基金净值）变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华富中小板基金及其管理人华富基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层（以下简称管理层）负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估华富中小板基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督华富中小板基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错</p>

	<p>报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华富中小板基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华富中小板基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	曹小勤   义国兵
会计师事务所的地址	浙江省杭州市钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 层
审计报告日期	2020 年 4 月 23 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华富中小板指数增强型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,988,412.12	1,643,987.32
结算备付金		305.98	4,110.14
存出保证金		476.47	521.88
交易性金融资产	7.4.7.2	23,334,335.77	7,282,691.90
其中：股票投资		23,334,335.77	7,282,691.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	755.31	365.47
应收股利		-	-
应收申购款		9,327.12	19,619.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		26,333,612.77	8,951,296.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	4,301.39
应付赎回款		45,219.72	3,798.16
应付管理人报酬		24,566.30	7,407.87
应付托管费		3,684.92	1,111.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	8,561.61	1,574.97
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	375,144.76	380,014.31
负债合计		457,177.31	398,207.87
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	21,493,242.16	9,501,282.81
未分配利润	7.4.7.10	4,383,193.30	-948,194.34
所有者权益合计		25,876,435.46	8,553,088.47
负债和所有者权益总计		26,333,612.77	8,951,296.34

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2039 元，基金份额总额 21,493,242.16 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华富中小板指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		4,290,487.56	-3,460,655.74
1.利息收入		21,610.38	15,821.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	21,610.38	9,782.08
债券利息收入		-	4,311.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,728.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-411,415.74	-114,615.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-700,898.95	-193,352.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	4,042.79
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	289,483.21	74,694.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,655,145.31	-3,364,847.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	25,147.61	2,985.36
<b>减：二、费用</b>		548,462.83	387,965.10
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	241,878.04	88,064.36

2. 托管费	7.4.10.2.2	36,281.61	13,209.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	44,391.32	6,031.00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	225,911.86	280,660.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,742,024.73</b>	<b>-3,848,620.84</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,742,024.73</b>	<b>-3,848,620.84</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富中小板指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,501,282.81	-948,194.34	8,553,088.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,742,024.73	3,742,024.73
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）	11,991,959.35	1,589,362.91	13,581,322.26
其中：1. 基金申购款	26,639,106.81	3,452,520.77	30,091,627.58
2. 基金赎回款	-14,647,147.46	-1,863,157.86	-16,510,305.32
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	21,493,242.16	4,383,193.30	25,876,435.46
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	6,319,352.22	2,550,502.27	8,869,854.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,848,620.84	-3,848,620.84
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）	3,181,930.59	349,924.23	3,531,854.82
其中：1. 基金申购款	5,322,468.79	829,903.15	6,152,371.94
2. 基金赎回款	-2,140,538.20	-479,978.92	-2,620,517.12
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）	9,501,282.81	-948,194.34	8,553,088.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华富中小板指数增强型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2011]1352号）核准，基金合同于2011年12月9日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健正信会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健正信验（2011）综字第020175号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（其中包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 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。

### 7.4.4 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。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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

1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证券监督管理委员会公告(2017)13号)规定,在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下:

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

② 对不存在活跃市场的投资品种,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公允价值。采用估值技术确定公允价值时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

③ 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),根据中国证券投资基金业协会《关于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》(中基协发(2017)6号),估值处理如下:

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值:  $FV=S \times (1-LoMD)$

其中: FV: 估值日该流通受限股票的价值; S: 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值; LoMD: 该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。  $LoMD=P/S$ , P 是估值日看跌期权的价值。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权的价值。

### 7.4.4.6 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

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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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；

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 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及红利再投资形式分配。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。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

### 7.4.6 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统治》(财税〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2018〕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〔2018〕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	1%、2%

[注]：接地方税务局通知，自 2019 年 7 月 1 日起调整地方教育附加税税率，由原来的 1%调整为 2%。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	活期存款	2,988,412.12	1,643,987.32	
定期存款	-	-		
其中：存款期限 1 个月以内	-	-		
存款期限 1-3 个月	-	-		
存款期限 3 个月以上	-	-		
其他存款	-	-		
合计：	2,988,412.12	1,643,987.32		

注：“其他存款”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。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,201,692.06	23,334,335.77	2,132,643.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	21,201,692.06	23,334,335.77	2,132,643.71

项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,805,193.50	7,282,691.90	-2,522,501.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,805,193.50	7,282,691.90	-2,522,501.60

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末和上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末和上年度末无期末买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	754.37	362.66
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	0.11	1.98
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.61	0.61
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	0.22	0.22
合计	755.31	365.47

注：本表列示的“其他”为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末和上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	8,561.61	1,574.97
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	8,561.61	1,574.97

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	144.76	14.31
应付证券出借违约金	-	-
应付指数使用许可费	100,000.00	50,000.00
预提费用	-	-
应付信息披露费	-	50,000.00
应付审计费	25,000.00	30,000.00
合计	375,144.76	380,014.31

#### 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,501,282.81	9,501,282.81
本期申购	26,639,106.81	26,639,106.81
本期赎回(以“-”号填列)	-14,647,147.46	-14,647,147.46
- 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	21,493,242.16	21,493,242.16

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,784,766.84	-8,732,961.18	-948,194.34
本期利润	-913,120.58	4,655,145.31	3,742,024.73
本期基金份额交易产生的变动数	9,305,907.28	-7,716,544.37	1,589,362.91
其中：基金申购款	20,321,299.44	-16,868,778.67	3,452,520.77
基金赎回款	-11,015,392.16	9,152,234.30	-1,863,157.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,177,553.54	-11,794,360.24	4,383,193.30

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	21,262.04	9,586.69
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	297.65	188.75
其他	50.69	6.64
合计	21,610.38	9,782.08

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。“其他”所列金额为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	10,555,855.98	1,009,681.82
减：卖出股票成本总额	11,256,754.93	1,203,034.77
买卖股票差价收入	-700,898.95	-193,352.95

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31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	-	4,042.79
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	-	4,042.79

#### 7.4.7.13.2 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 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	465,682.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	446,937.00
减：应收利息总额	-	14,702.25
买卖债券差价收入	-	4,042.79

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内和上年度期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内和上年度期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内和上年度期间无衍生工具收益。



## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	289,483.21	74,694.99
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	289,483.21	74,694.99

## 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	4,655,145.31	-3,364,847.80
——股票投资	4,655,145.31	-3,365,422.00
——债券投资	-	574.20
——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	4,655,145.31	-3,364,847.80

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	25,091.48	2,981.66
转换费收入	56.13	3.70

合计	25,147.61	2,985.36
----	-----------	----------

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	44,391.32	6,031.00
银行间市场交易费用	-	-
合计	44,391.32	6,031.00

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	25,000.00	30,000.00
信息披露费	-	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	911.86	660.00
指数使用许可费	200,000.00	200,000.00
银行账户维护费	-	-
合计	225,911.86	280,660.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股（集团）有限公司	基金管理人的股东
华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31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	33,171,803.22	100.00%	4,920,164.82	100.00%

##### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
华安证券	-	-	24,985.04	100.00%

##### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华安证券	-	-	9,900,000.00	100.00%

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本报告期内和上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.5 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12月31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	30,892.90	100.00%	8,561.61	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31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	4,583.68	100.00%	1,574.97	100.00%

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

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	241,878.04
其中：支付销售机构的客户维护费	106,837.17	32,304.39

注：基金管理费按前一日基金资产净值1%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）。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	36,281.61

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内和上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金本报告期末和上年度末基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

### 7.4.10.6 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12月31日		2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,988,412.12	21,262.04	1,643,987.32	9,586.69

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

### 7.4.10.7 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和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 3 日	增发流通受限	8.75	30.18	2,867	25,086.25	86,526.06	股票配股

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 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 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有债券。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

**7.4.13.2.6 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 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末和上年度末未持有同业存单。

**7.4.13.3 流动性风险****7.4.13.3.1 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 7.4.12 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约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。

**7.4.13.4 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。

**7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	2,988,412.12	-	-	-	-	-	2,988,412.12
结算备付金	305.98	-	-	-	-	-	305.98
存出保证金	476.47	-	-	-	-	-	476.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	23,334,335.77	23,334,335.77
应收利息	-	-	-	-	-	755.31	755.31
应收申购款	-	-	-	-	-	9,327.12	9,327.12
资产总计	2,989,194.57	-	-	-	-	23,344,418.20	26,333,612.77
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	45,219.72	45,219.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,566.30	24,566.30
应付托管费	-	-	-	-	-	3,684.92	3,684.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,561.61	8,561.61
其他负债	-	-	-	-	-	375,144.76	375,144.76
负债总计	-	-	-	-	-	457,177.31	457,177.31
利率敏感度缺口	2,989,194.57	-	-	-	-	-22,887,240.89	25,876,435.46
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,643,987.32	-	-	-	-	-	1,643,987.32
结算备付金	4,110.14	-	-	-	-	-	4,110.14
存出保证金	521.88	-	-	-	-	-	521.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,282,691.90	7,282,691.90
应收利息	-	-	-	-	-	365.47	365.47
应收申购款	-	-	-	-	-	19,619.63	19,619.63
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,648,619.34	-	-	-	-	7,302,677.00	8,951,296.34
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,301.39	4,301.39
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,798.16	3,798.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,407.87	7,407.87

应付托管费	-	-	-	-	1,111.17	1,111.17
应付交易费用	-	-	-	-	1,574.97	1,574.97
其他负债	-	-	-	-	380,014.31	380,014.31
负债总计	-	-	-	-	398,207.87	398,207.87
利率敏感度缺口	1,648,619.34	-	-	-	6,904,469.13	8,553,088.47

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 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12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	0.00	0.00
	市场利率上升 25 基点	0.00	0.00

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	23,334,335.77	90.18	7,282,691.90	85.15
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	23,334,335.77	90.18	7,282,691.90	85.15
----	---------------	-------	--------------	-------

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除中小板指数外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	中小板指数上升百分之五	1,030,888.18	331,102.44
中小板指数下降百分之五	-1,030,888.18	-331,102.44	

#### 7.4.13.4.3 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12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	合计	7,607,966.72	2,562,513.51

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据“财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好 2010 年年报工作的通知（财会〔2010〕25 号）”（以下简称“通知”）要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

类别	2019 年 12 月 31 日公允价值	2018 年 12 月 31 日公允价值
第一层次	23,247,809.71	7,241,675.03
第二层次	86,526.06	41,016.87
第三层次	-	-
合计	23,334,335.77	7,282,691.90

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品

种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)的要求,本基金自2015年3月30日起,对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值(估值标准另有规定的除外),本报告期末本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	23,334,335.77	88.61
	其中：股票	23,334,335.77	88.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,988,718.10	11.35
8	其他各项资产	10,558.90	0.04
9	合计	26,333,612.77	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 8.12.3 其他各项资产构成。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	814,375.40	3.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,398,908.16	55.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	141,141.00	0.55
E	建筑业	200,713.86	0.78
F	批发和零售业	374,717.04	1.45
G	交通运输、仓储和邮政业	605,814.82	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,781,407.13	10.75
J	金融业	2,114,330.82	8.17
K	房地产业	186,622.55	0.72
L	租赁和商务服务业	1,053,860.20	4.07
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	107,280.00	0.41
Q	卫生和社会工作	408,149.79	1.58
R	文化、体育和娱乐业	147,015.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	23,334,335.77	90.18

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 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

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	34,221	1,249,066.50	4.83
2	002415	海康威视	37,795	1,237,408.30	4.78
3	002142	宁波银行	28,951	814,970.65	3.15
4	002027	分众传媒	120,867	756,627.42	2.92
5	002714	牧原股份	8,060	715,647.40	2.77
6	002304	洋河股份	6,043	667,751.50	2.58
7	002230	科大讯飞	16,839	580,608.72	2.24
8	002241	歌尔股份	23,194	462,024.48	1.79
9	002594	比亚迪	9,280	442,377.60	1.71
10	002044	美年健康	27,411	408,149.79	1.58
11	002008	大族激光	9,431	377,240.00	1.46
12	002466	天齐锂业	12,426	375,016.68	1.45
13	002024	苏宁易购	37,064	374,717.04	1.45
14	002352	顺丰控股	10,028	372,941.32	1.44
15	002236	大华股份	17,603	349,947.64	1.35
16	002555	三七互娱	12,503	336,705.79	1.30
17	002202	金风科技	27,615	329,999.25	1.28
18	002456	欧菲光	20,662	322,327.20	1.25
19	002007	华兰生物	8,760	307,914.00	1.19
20	002736	国信证券	23,608	296,280.40	1.14

21	002460	赣锋锂业	8,296	288,949.68	1.12
22	002001	新和成	12,375	287,842.50	1.11
23	002384	东山精密	12,420	287,523.00	1.11
24	002463	沪电股份	12,900	286,509.00	1.11
25	002624	完美世界	6,214	274,285.96	1.06
26	002311	海大集团	7,541	271,476.00	1.05
27	002410	广联达	7,834	266,199.32	1.03
28	002600	领益智造	23,500	254,975.00	0.99
29	002157	正邦科技	14,900	241,380.00	0.93
30	002422	科伦药业	10,231	240,326.19	0.93
31	002271	东方雨虹	8,979	236,237.49	0.91
32	002179	中航光电	5,966	233,031.96	0.90
33	002050	三花智控	13,166	228,166.78	0.88
34	002129	中环股份	19,014	224,555.34	0.87
35	002439	启明星辰	6,604	223,215.20	0.86
36	002049	紫光国微	4,366	221,967.44	0.86
37	002493	荣盛石化	17,900	221,781.00	0.86
38	002405	四维图新	13,484	217,092.40	0.84
39	002797	第一创业	25,210	208,738.80	0.81
40	002065	东华软件	20,216	208,629.12	0.81
41	002340	格林美	42,562	207,276.94	0.80
42	002127	南极电商	18,600	202,926.00	0.78
43	002371	北方华创	2,300	202,400.00	0.78
44	002821	凯莱英	1,500	194,250.00	0.75
45	002673	西部证券	19,710	193,158.00	0.75
46	002465	海格通信	17,710	191,799.30	0.74
47	002146	荣盛发展	18,985	186,622.55	0.72
48	002508	老板电器	5,231	176,860.11	0.68
49	002120	韵达股份	5,295	176,323.50	0.68
50	002601	龙蟠佰利	11,171	171,921.69	0.66
51	002926	华西证券	15,300	168,453.00	0.65
52	002916	深南电路	1,160	164,836.00	0.64
53	002180	纳思达	4,800	158,016.00	0.61
54	002268	卫士通	6,000	154,740.00	0.60
55	002602	世纪华通	13,400	153,162.00	0.59
56	002195	二三四五	47,248	152,611.04	0.59
57	002252	上海莱士	20,527	152,310.34	0.59
58	002078	太阳纸业	15,204	149,607.36	0.58
59	002739	万达电影	8,100	147,015.00	0.57

60	002373	千方科技	8,100	146,124.00	0.56
61	002500	山西证券	17,593	145,845.97	0.56
62	002939	长城证券	10,500	145,530.00	0.56
63	002385	大北农	29,200	145,416.00	0.56
64	002507	涪陵榨菜	5,400	144,342.00	0.56
65	002812	恩捷股份	2,800	141,400.00	0.55
66	002032	苏泊尔	1,800	138,204.00	0.53
67	002572	索菲亚	6,386	133,786.70	0.52
68	002153	石基信息	3,429	133,731.00	0.52
69	002013	中航机电	19,223	133,407.62	0.52
70	002081	金螳螂	15,073	132,943.86	0.51
71	002223	鱼跃医疗	6,413	130,312.16	0.50
72	002019	亿帆医药	7,765	126,181.25	0.49
73	002152	广电运通	12,702	122,066.22	0.47
74	002773	康弘药业	3,300	122,001.00	0.47
75	002938	鹏鼎控股	2,700	121,230.00	0.47
76	002217	合力泰	21,389	118,708.95	0.46
77	002110	三钢闽光	12,550	117,468.00	0.45
78	002074	国轩高科	7,993	116,298.15	0.45
79	002281	光迅科技	3,900	116,142.00	0.45
80	002092	中泰化学	16,606	112,754.74	0.44
81	002607	中公教育	6,000	107,280.00	0.41
82	002075	沙钢股份	17,100	106,533.00	0.41
83	002299	圣农发展	4,100	98,728.00	0.38
84	002010	传化智联	13,511	94,306.78	0.36
85	002670	国盛金控	7,100	90,241.00	0.35
86	002085	万丰奥威	12,735	89,145.00	0.34
87	002038	双鹭药业	6,700	88,105.00	0.34
88	002558	巨人网络	4,843	87,464.58	0.34
89	003816	中国广核	24,000	86,400.00	0.33
90	002925	盈趣科技	1,800	79,110.00	0.31
91	002294	信立泰	3,866	77,088.04	0.30
92	002583	海能达	9,066	76,245.06	0.29
93	002372	伟星新材	5,600	73,752.00	0.29
94	002399	海普瑞	3,600	70,236.00	0.27
95	002841	视源股份	800	68,560.00	0.26
96	002310	东方园林	13,500	67,770.00	0.26
97	002563	森马服饰	6,300	62,181.00	0.24
98	002468	申通快递	2,900	56,550.00	0.22



99	002608	江苏国信	7,100	54,741.00	0.21
100	002958	青农商行	7,900	51,113.00	0.20

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	1,305,556.40	15.26
2	002027	分众传媒	774,268.67	9.05
3	002304	洋河股份	698,338.00	8.16
4	002475	立讯精密	592,745.00	6.93
5	002230	科大讯飞	589,254.00	6.89
6	002142	宁波银行	573,731.00	6.71
7	002594	比亚迪	463,210.00	5.42
8	002024	苏宁易购	426,980.00	4.99
9	002352	顺丰控股	421,066.82	4.92
10	002714	牧原股份	405,126.00	4.74
11	002202	金风科技	402,370.00	4.70
12	002044	美年健康	386,567.00	4.52
13	002463	沪电股份	372,564.00	4.36
14	002008	大族激光	362,378.00	4.24
15	002466	天齐锂业	286,956.25	3.36
16	002736	国信证券	276,328.00	3.23
17	002493	荣盛石化	272,371.68	3.18
18	002456	欧菲光	264,693.00	3.09
19	002236	大华股份	264,411.00	3.09
20	002195	二三四五	251,608.00	2.94
21	002157	正邦科技	248,121.00	2.90
22	002179	中航光电	245,033.00	2.86
23	002602	世纪华通	243,473.20	2.85
24	002127	南极电商	241,015.00	2.82
25	002001	新和成	237,382.00	2.78
26	002422	科伦药业	237,130.00	2.77
27	002007	华兰生物	227,917.00	2.66
28	002241	歌尔股份	227,278.03	2.66

29	002460	赣锋锂业	216,858.00	2.54
30	002624	完美世界	200,748.00	2.35
31	002673	西部证券	197,963.44	2.31
32	002405	四维图新	195,580.00	2.29
33	002340	格林美	194,499.00	2.27
34	002410	广联达	194,262.00	2.27
35	002507	涪陵榨菜	192,744.00	2.25
36	002926	华西证券	189,150.00	2.21
37	002271	东方雨虹	187,452.00	2.19
38	002916	深南电路	183,029.00	2.14
39	002373	千方科技	182,990.00	2.14
40	002146	荣盛发展	182,175.00	2.13
41	002311	海大集团	179,309.00	2.10
42	002384	东山精密	178,897.00	2.09
43	002120	韵达股份	173,328.00	2.03

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	002415	海康威视	643,083.00	7.52
2	002475	立讯精密	490,983.00	5.74
3	002304	洋河股份	335,062.00	3.92
4	002142	宁波银行	333,343.00	3.90
5	002027	分众传媒	299,147.00	3.50
6	002230	科大讯飞	293,334.50	3.43
7	002594	比亚迪	192,134.00	2.25
8	002450	*ST 康得	190,348.00	2.23
9	002024	苏宁易购	177,911.00	2.08
10	002008	大族激光	168,241.00	1.97
11	002714	牧原股份	162,927.00	1.90
12	002179	中航光电	157,722.24	1.84
13	002241	歌尔股份	152,117.00	1.78
14	002202	金风科技	151,441.00	1.77
15	002368	太极股份	147,498.00	1.72

16	002044	美年健康	147,176.00	1.72
17	002456	欧菲光	141,308.00	1.65
18	002236	大华股份	141,252.00	1.65
19	002221	东华能源	139,772.00	1.63
20	002185	华天科技	127,647.90	1.49

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。

#### 8.4.3 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	22,653,253.49
卖出股票收入（成交）总额	10,555,855.98

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、债转股及行权等获得的股票。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 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投资国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	476.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	755.31
5	应收申购款	9,327.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,558.90

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,489	14,434.68	0.00	0.00%	21,493,242.16	100.00%

### 9.2 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	432.95	0.0020%

### 9.3 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：本报告期末基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 12 月 9 日）基金份额总额	674,571,640.23
本报告期期初基金份额总额	9,501,282.81
本报告期基金总申购份额	26,639,106.81
减:本报告期基金总赎回份额	14,647,147.46
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	21,493,242.16

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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、2019 年 1 月 25 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，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。

2、2019 年 1 月 25 日，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。

3、2019 年 1 月 25 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，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。

4、2019 年 1 月 25 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，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。

5、2019 年 4 月 15 日，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、2019 年 4 月 22 日，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、2019 年 6 月 5 日，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。

8、2019 年 6 月 5 日，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。

9、2019 年 6 月 10 日，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、2019 年 6 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，尹培俊先生、姚姣女士不再担任华富货币市场基金基金经理。

11、2019 年 6 月 20 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，姚姣女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理。

12、2019 年 7 月 26 日，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，聘任束庆斌先生担任公司首席信息官。

13、2019 年 7 月 17 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，

龚炜先生不再担任华富成长趋势混合型证券投资基金基金经理。

14、2019 年 7 月 17 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，高靖瑜女士不再担任华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理。

15、2019 年 7 月 17 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，高靖瑜女士不再担任华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。

16、2019 年 7 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陈启明先生不再担任华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

17、2019 年 7 月 19 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，陈启明先生不再担任华富竞争力优选混合型证券投资基金基金经理。

18、2019 年 9 月 23 日，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，增聘陶祺先生为华富恒欣纯债债券型证券投资基金基金经理。

19、2019 年 9 月 23 日，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，增聘陶祺先生为华富天盈货币市场基金基金经理。

20、2019 年 10 月 16 日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，倪莉莎女士不再担任华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

21、2019 年 10 月 21 日，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，增聘陈奇先生为华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

22、2019 年 6 月 4 日，托管人中国建设银行发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 2.5 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。



**11.6 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。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 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	33,171,803.22	100.00%	30,892.90	100.00%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

**11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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），我公司重新修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，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几家券商租用了基金专用交易单元。本报告期本基金新增交易单元的情况是：国泰君安证券新增1个席位。

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

**11.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告》	中国证监会指定媒介	2019 年 1 月 21 日
2	《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年第 2 号）》	中国证监会指定媒介	2019 年 1 月 23 日
3	《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2018 年第 2 号）》	中国证监会指定媒介	2019 年 1 月 23 日

4	《华富基金管理有限公司关于旗下所有基金在直销渠道面向养老金客户开展费率优惠的公告》	中国证监会指定媒介	2019年3月15日
5	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告》	中国证监会指定媒介	2019年3月26日
6	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告摘要》	中国证监会指定媒介	2019年3月26日
7	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行基金申购费率优惠的公告》	中国证监会指定媒介	2019年3月30日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与奕丰基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2019年4月11日
9	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定媒介	2019年4月11日
10	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰基金销售有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定媒介	2019年4月11日
11	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定媒介	2019年4月17日
12	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2019年4月17日
13	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳农村商业银行股份有限公司手机银行基金申购及定投费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2019年4月17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华安证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2019年4月18日
15	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》	中国证监会指定媒介	2019年4月20日
16	《华富基金管理有限公司关于变更总经理的公告》	中国证监会指定媒介	2019年4月23日
17	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加阳光人寿	中国证监会指定媒介	2019年4月23日

	保险股份有限公司为代销机构的公告》		
18	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2019年5月7日
19	《华富基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告》	中国证监会指定媒介	2019年5月7日
20	《华富基金管理有限公司澄清公告》	中国证监会指定媒介	2019年5月14日
21	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中投证券费率优惠的公告》	中国证监会指定媒介	2019年5月16日
22	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加徽商银行股份有限公司基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定媒介	2019年6月20日
23	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告》	中国证监会指定媒介	2019年6月21日
24	《华富基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告》	中国证监会指定媒介	2019年6月29日
25	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告》	中国证监会指定媒介	2019年7月17日
26	《华富基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》	中国证监会指定媒介	2019年7月20日
27	《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书更新摘要(2019 年第 1 号)》	中国证监会指定媒介	2019年7月24日
28	《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书更新(2019 年第 1 号)》	中国证监会指定媒介	2019年7月24日
29	《华富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	中国证监会指定媒介	2019年7月27日
30	《华富基金管理有限公司关于解除与浙江金观诚基金销售有限公司基金代理销售关系的公告》	中国证监会指定媒介	2019年7月30日
31	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2019 年半年度报告》	中国证监会指定媒介	2019年8月29日
32	《华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁(杭州)基金销售有限公司费率优惠活	中国证监会指定媒介	2019年9月28日

	动的公告》		
33	《关于华富基金管理有限公司系统暂停服务的通知》	中国证监会指定媒介	2019 年 9 月 30 日
34	《华富基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、最低持有份额和定投数额限制的公告》	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 10 日
35	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第三季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 22 日
36	《华富中小板指数增强型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告》	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 22 日
37	《华富基金管理有限公司关于办公地址变更的公告》	中国证监会指定媒介	2019 年 10 月 24 日
38	《关于华富基金管理有限公司系统暂停服务的通知》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 14 日
39	《关于华富基金管理有限公司旗下部分基金修改基金合同及托管协议的公告》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 21 日
40	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金基金合同的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 21 日
41	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书（更新）的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 21 日
42	《华富中小板指数增强型证券投资基金按信息披露办法修改后的基金合同、托管协议修订对照表》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 21 日
43	《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 21 日
44	《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 21 日
45	《华富中小板指数增强型证券投资基金托管协议》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 21 日
46	《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 21 日
47	《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及定期定额投资费率优惠的公告》	中国证监会指定媒介	2019 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	3.27-12.31	0.00	6,844,647.52	0.00	6,844,647.52	31.85%
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同
- 2、华富中小板指数增强型证券投资基金托管协议
- 3、华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富中小板指数增强型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 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。

华富基金管理有限公司

2020 年 4 月 29 日