

华富恒利债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.11 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	44
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
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	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富恒利债券型证券投资基金	
基金简称	华富恒利债券	
基金主代码	001086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 8 月 31 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	350,072,396.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C
下属分级基金的交易代码	001086	001087
报告期末下属分级基金的份额总额	349,985,049.50 份	87,346.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。
业绩比较基准	中证全债指数
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	招商银行股份有限公司
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	95555
传真	021-68887997	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040

法定代表人	赵万里	缪建民
-------	-----	-----

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)		
	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C	
本期已实现收益	3,627,900.72	1,522.80	
本期利润	3,833,579.54	-709.09	
加权平均基金份额本期利润	0.0097	-0.0045	
本期加权平均净值利润率	0.84%	-0.40%	
本期基金份额净值增长率	0.96%	0.71%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		
	期末可供分配利润	32,562,462.48	5,575.66
	期末可供分配基金份额利润	0.0930	0.0638
	期末基金资产净值	405,125,407.78	98,410.86
	期末基金份额净值	1.158	1.127

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	20.33%	14.85%

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

华富恒利债券 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	-0.52%	0.21%	0.18%	0.04%	-0.70%	0.17%
过去三个月	1.05%	0.21%	1.32%	0.04%	-0.27%	0.17%
过去六个月	0.96%	0.27%	2.31%	0.04%	-1.35%	0.23%
过去一年	7.15%	0.36%	2.84%	0.06%	4.31%	0.30%
过去三年	12.77%	0.41%	15.42%	0.07%	-2.65%	0.34%
自基金合同生效起至今	20.33%	0.32%	26.62%	0.08%	-6.29%	0.24%

华富恒利债券 C

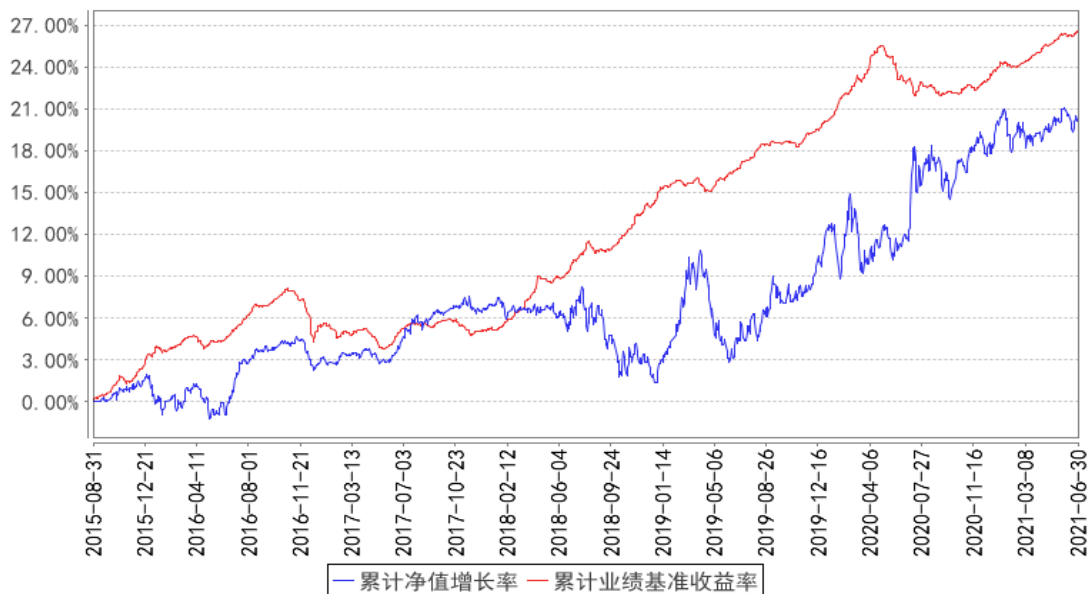
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-0.62%	0.21%	0.18%	0.04%	-0.80%	0.17%
过去三个月	0.90%	0.21%	1.32%	0.04%	-0.42%	0.17%
过去六个月	0.71%	0.27%	2.31%	0.04%	-1.60%	0.23%
过去一年	6.64%	0.37%	2.84%	0.06%	3.80%	0.31%
过去三年	9.07%	0.41%	15.42%	0.07%	-6.35%	0.34%
自基金合同生效起 至今	14.85%	0.32%	26.62%	0.08%	-11.77%	0.24%

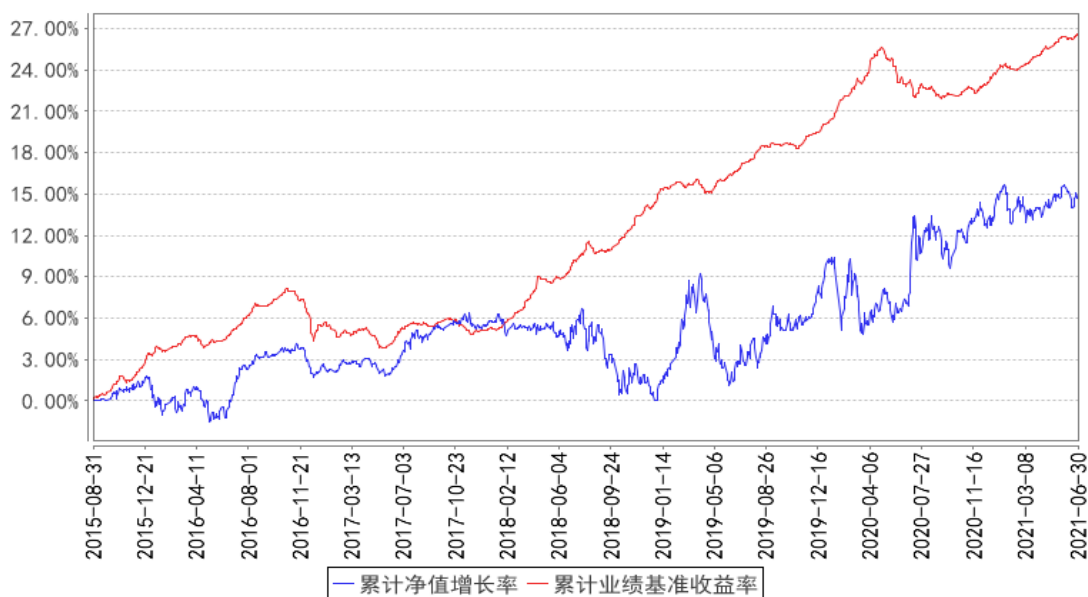
注：业绩比较基准收益率=中证全债指数，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

华富恒利债券A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



华富恒利债券C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《华富恒利债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；投资于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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2015 年 8 月 31 日到 2016 年 2 月 29 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《华富恒利债券型证券投资基金基金合同》的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资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 2021 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、华富中小企业 100 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、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金和华富新能源股票型发起式证券投资基金共四十六只基金。

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		
张惠	华富恒利债券型基金基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富安鑫债券型基金基金经理、华富安享债券型基金基金经理、华富安福债券型基金基金经理	2015 年 8 月 31 日	-	十四年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历。2007 年 6 月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员，2012 年 5 月 21 日至 2014 年 3 月 19 日任华富策略精选混合型基金基金经理助理，2014 年 3 月 20 日至 2014 年 11 月 18 日任华富保本混合型基金基金经理助理，2016 年 6 月 28 日至 2017 年 7 月 5 日任华富灵活配置混合型基金基金经理，2015 年 3 月 16 日至 2018 年 3 月 22 日任华富旺财保本混合型基金基金经理，2016 年 11 月 17 日至 2018 年 6 月 19 日任华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理，2016 年 8 月 26 日至 2018 年 8 月 1 日任华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理。

理、华富星玉衡一年定期开放混合型基金经理、华富益鑫灵活配置混合型基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金经理、固定收益部总监助理				
--	--	--	--	--

注：这里的任职日期是指该基金成立之日。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

2021 年上半年，国内经济整体进入扩张尾部的环境。6 月官方制造业 PMI 回落至 50.9%，显示经济仍在扩张区间但修复斜率有所放缓，企业盈利相对有韧性，1-6 月规模以上工业企业收入和利润累计同比分别为 27.9%和 66.9%，仍处在较高水平但有放缓。库存周期方面，6 月末工业产成品库存同比增速回升至 11.3%，今年以来虽波动较大，但仍处在“主动补库存”阶段。融资环境方面，前 6 月信贷与社融增速总体看趋势下行，有财政后置的影响，也反应企业融资环境趋于恶化。通胀方面，6 月 PPI 同比高达 8.8%，较 5 月有所回落但仍高于市场预期，但由于猪周期等原因，工业品通胀对于 CPI 的传导尚不显著。

海外宏观主线主要在美债、疫苗和中美关系三个方面。疫情方面，近期部分国家疫情再度反复引发关注，尤其是英国和美国局部地区受到变异病毒影响严重，欧洲其他国家如德、法、意等疫情维持改善趋势不变。全球流动性方面，7 月美联储议息会议整体基调符合市场预期，参照过往经验，美联储可能在就业恢复到 75%附近时释放缩减 QE 信号，并最快在今年 4 季度开始缩减 QE，美债与美元走强的风险较高，对于风险资产或会形成阶段性冲击。总体而言，随着疫情不断变化，全球经济以及流动性预期变化波动较大，后期还是需要关注疫情演绎。

从国内资本市场的表现来看，上半年 A 股市场整体波动较大并且市场风格出现转变。一季度延续去年以来的“核心资产”冲高回落后出现抱团瓦解，低估值金融周期股表现相对活跃，市场风格趋于均衡，估值分化有所收敛；二季度市场底部反弹，“核心资产”出现分化，受益于大宗商品价格持续上涨的周期股和以新能源半导体为代表的高景气度行业持续走强，而短期业绩增速不高以及一季度相对较好的低估值大金融表现相对较差，资金持续追捧高景气成长赛道的行业与公司，市场分化极度严重。转债市场跟随股票市场走势，也呈现出震荡和分化走势，部分高景气行业高价个券持续走强，中低价位个券估值修复有限。上半年货币政策相对温和，银行间流动性持续宽松，债券市场整体走强，信用债表现更佳。

在股债性价比相对均衡的情况下，基于相对确定的基本面向上优势和政策收紧时滞，本基金在上半年相对看好风险资产，保持了较高的风险资产仓位。在行业配置上一方面选取了部分低估值的金融、地产以及建筑建材个股，另一方面选取了疫情恢复后高景气运行的板块，整体配置相对均衡，可转债配置主要以中低价位转债为主，整体仓位较低。债券资产以中短久期高等级信用债票息策略为主适度杠杆为辅的策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富恒利债券 A 份额净值为 1.158 元，累计份额净值为 1.202 元。本报告期的基金份额净值增长率为 0.96%，同期业绩比较基准收益率为 2.31%。截止本期末，华富恒利债券 C 份额净值为 1.127 元，累计份额净值为 1.148 元。本报告期的基金份额净值增长率为 0.71%，同期业绩比较基准收益率为 2.31%。

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，国内经济高点出现缓慢回落，但韧性犹存，在内外需恢复共振下企业盈利仍将维持景气，地方债发行提速财政有所发力，货币政策缓慢收紧；而海外主要经济体仍将演绎经济快速恢复，通胀预期有所抬升。从资产配置角度，当前股债估值性价比较为均衡，债券资产赔率改善但胜率不足，投资时机略偏左侧，风险资产估值分化有所收敛，结构性机会更为突出，胜率仍在操作难度加大；但中期来看随着政策收紧和经济下行压力加大，股债可能迎来切换。性价比角度来看，股债性价比上股票略优于债券，赔率差异不显著，当前经济基本面当前仍在高位放缓，存在类滞胀风险，但股票存在结构性机会、债券仍有尾部风险未消除，当前权益风险收益比仍更高，但下半年需要把握股债切换的机会。

本基金短期仍将维持中性的风险资产配置思路，主要根据公司盈利和估值匹配程度来进行个股的选择，转债资产主要以低估值银行煤炭为主要配置方向；纯债部分将继续保持以获取票息收入为主的中短久期债券配置思路。中期而言，本基金将考虑逐步拉长债券久期和增加偏债品种配置，股票仓位仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念，寻找具有估值优势或拥有优势赛道具备长期成长性的企业。本基金仍将坚持在较低风险程度下，认真研究各个投资领域潜在的机会，相对积极地做好配置策略，均衡投资，降低业绩波动，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富恒利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 3,832,870.45 元，期末可供分配利润为 32,568,038.14 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富恒利债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
-----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,801,901.59	678,744.06
结算备付金		8,078,321.92	9,116,592.25
存出保证金		74,079.62	79,644.98
交易性金融资产	6.4.7.2	470,375,526.53	516,101,615.66
其中：股票投资		67,113,545.77	87,849,128.29
基金投资		-	-
债券投资		403,261,980.76	428,252,487.37
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	5,348,982.30	6,642,872.53
应收股利		-	-
应收申购款		-	110.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		495,678,811.96	532,619,579.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		80,000,000.00	24,200,000.00
应付证券清算款		9,722,903.77	323,366.69
应付赎回款		1,084.87	931.90
应付管理人报酬		199,954.60	248,534.61
应付托管费		66,651.54	82,844.88
应付销售服务费		35.05	78.88
应付交易费用	6.4.7.7	226,266.10	105,825.54
应交税费		19,837.23	24,643.27
应付利息		-	-8,679.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	218,260.16	189,000.00
负债合计		90,454,993.32	25,166,546.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	350,072,396.47	442,356,305.01
未分配利润	6.4.7.10	55,151,422.17	65,096,728.15
所有者权益合计		405,223,818.64	507,453,033.16
负债和所有者权益总计		495,678,811.96	532,619,579.48

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 350,072,396.47 份，其中华富恒利债券 A 基金份额总额 349,985,049.50 份，基金份额净值 1.158 元；华富恒利债券 C 基金份额总额 87,346.97 份，基金份额净值 1.127 元。

6.2 利润表

会计主体：华富恒利债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		7,310,388.01	1,248,010.78
1. 利息收入		7,007,403.11	6,517,454.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	60,619.15	68,058.56
债券利息收入		6,946,783.96	6,449,395.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		87,451.58	3,295,308.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,110,354.53	594,041.85
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,721,100.82	2,163,737.02
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
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	698,197.87	537,529.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	203,446.93	-8,598,134.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,086.39	33,383.01
减：二、费用		3,477,517.56	3,246,764.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,357,175.34	1,292,798.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	452,391.80	430,932.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	358.52	36,975.20
4. 交易费用	6.4.7.19	708,428.86	658,858.79

5. 利息支出		825,692.89	697,222.09
其中：卖出回购金融资产支出		825,692.89	697,222.09
6. 税金及附加		16,332.69	11,777.24
7. 其他费用	6.4.7.20	117,137.46	118,200.14
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,832,870.45	-1,998,753.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3,832,870.45	-1,998,753.39

注：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：华富恒利债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	442,356,305.01	65,096,728.15	507,453,033.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,832,870.45	3,832,870.45
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)	-92,283,908.54	-13,778,176.43	-106,062,084.97
其中：1. 基金申购款	61,127,281.98	9,516,523.96	70,643,805.94
2. 基金赎回款	-153,411,190.52	-23,294,700.39	-176,705,890.91
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)	350,072,396.47	55,151,422.17	405,223,818.64

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	374,001,583.65	43,391,840.03	417,393,423.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,998,753.39	-1,998,753.39
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)	-143,298.89	4,664,987.70	4,521,688.81
其中：1. 基金申购款	312,553,486.91	36,860,623.09	349,414,110.00
2. 基金赎回款	-312,696,785.80	-32,195,635.39	-344,892,421.19
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)	373,858,284.76	46,058,074.34	419,916,359.10

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：

赵万里

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

华富恒利债券型证券投资基金（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[2015]220号）核准，基金合同于2015年8月31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设立经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2015）6-153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，基金托管人为招

商银行股份有限公司。

根据《华富恒利债券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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85号）、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36号）、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税〔2016〕46号）、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2016〕70号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入, 暂免征收企业所得税;

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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%。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	11,801,901.59
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	11,801,901.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	68,920,144.35	67,113,545.77	-1,806,598.58

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	253,360,728.63	255,651,480.76
	银行间市场	147,252,751.94	147,610,500.00
	合计	400,613,480.57	403,261,980.76
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	469,533,624.92	470,375,526.53	841,901.61

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	520.66
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	3,635.30
应收债券利息	5,344,793.04
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	-
应收出借证券利息	-
其他	33.30
合计	5,348,982.30

注：其他所列金额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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	224,753.60
银行间市场应付交易费用	1,512.50
合计	226,266.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.01
应付证券出借违约金	-
上清账户维护费	4,500.00
应付审计费	29,752.78
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	179,507.37
合计	218,260.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富恒利债券 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	442,129,705.65	442,129,705.65
本期申购	60,714,728.02	60,714,728.02
本期赎回(以“-”号填列)	-152,859,384.17	-152,859,384.17
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	349,985,049.50	349,985,049.50

华富恒利债券 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	226,599.36	226,599.36
本期申购	412,553.96	412,553.96
本期赎回(以“-”号填列)	-551,806.35	-551,806.35
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	87,346.97	87,346.97

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

华富恒利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,460,204.37	26,609,603.73	65,069,808.10
本期利润	3,627,900.72	205,678.82	3,833,579.54
本期基金份额交易产生的变动数	-9,525,642.61	-4,237,386.75	-13,763,029.36
其中：基金申购款	5,538,342.16	3,924,162.11	9,462,504.27
基金赎回款	-15,063,984.77	-8,161,548.86	-23,225,533.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,562,462.48	22,577,895.80	55,140,358.28

华富恒利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,632.93	13,287.12	26,920.05
本期利润	1,522.80	-2,231.89	-709.09
本期基金份额交易产生的变动数	-9,580.07	-5,567.00	-15,147.07
其中：基金申购款	28,889.72	25,129.97	54,019.69
基金赎回款	-38,469.79	-30,696.97	-69,166.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,575.66	5,488.23	11,063.89

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	7,807.70
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	52,172.03
其他	639.42
合计	60,619.15

注：其他所列金额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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,110,354.53
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,110,354.53

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	236,568,683.88
减：卖出股票成本总额	235,458,329.35
买卖股票差价收入	1,110,354.53

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 2021年1月1日至2021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	-1,721,100.82
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,721,100.82

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	313,911,974.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	312,008,879.72
减：应收利息总额	3,624,195.87
买卖债券差价收入	-1,721,100.82

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	698,197.87
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	698,197.87

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	203,446.93
股票投资	-3,613,327.26
债券投资	3,816,774.19
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	203,446.93

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	12,086.39
合计	12,086.39

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	705,503.86
银行间市场交易费用	2,925.00
合计	708,428.86

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	9,577.31
账户维护费	17,700.00
其他	600.00
合计	117,137.46

注：其他所列金额为上清所查询费用。

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
招商银行股份有限公司(“招商银行股份有限公司”)	基金托管人
华安证券(“华安证券”)	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华安证券	15,404,092.71	3.52	207,872,703.11	50.41

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	10,975,598.20	2.97	170,066,404.42	46.12

注：本表中“当期债券成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券交易成交总额。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华安证券	280,000,000.00	3.35	2,362,300,000.00	30.25

注：本表中“当期债券回购成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券回购成交总额。。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华安证券	14,424.31	3.40	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华安证券	199,596.58	50.27	-	-

注：本基金本报告期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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,357,175.34	1,292,798.06
其中：支付销售机构的客户维护费	-	30,723.96

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	452,391.80	430,932.65

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	-	-	-
招商银行股份有限公司 (托管人)	-	24.32	24.32
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	-	-	-
合计	-	24.32	24.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	0.00	36,816.86	36,816.86
招商银行股份有限公司 (托管人)	-	27.61	27.61
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	-	-	-
合计	0.00	36,844.47	36,844.47

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 0.40% 年费率计提，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：本基金本报告期内及上年度可比期间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 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

6.4.10.4.1 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：报告期内未发生转融通证券出借业务

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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：本基金本报告期和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
招商银行股份有限公司	11,801,901.59	7,807.70	2,517,852.62	16,821.17

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.10.7 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及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 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(2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月17	2021年7月1	新债未上市	100.00	100.00	1,160	116,000.00	116,000.00	-

		日	日							
--	--	---	---	--	--	--	--	--	--	--

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

注：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

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 80,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	10,022,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	5,011,000.00
合计	-	15,033,000.00

注：

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	225,392,103.46	267,688,936.22
AAA 以下	143,482,298.30	115,043,730.65
-	5,097,773.57	15,012,421.35
未评级		0.00
合计	368,874,401.76	382,732,666.87

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按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2021年6月30日							
资产							
银行存款	11,801,901.59	-	-	-	-	-	11,801,901.59
结算备付金	8,078,321.92	-	-	-	-	-	8,078,321.92
存出保证金	74,079.62	-	-	-	-	-	74,079.62
交易性金融资产	23,384,000.00	35,578,327.66	149,463,353.20	185,169,299.90	9,667,000.00	67,113,545.77	470,375,526.53
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	5,348,982.30	5,348,982.30
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	43,338,303.13	35,578,327.66	149,463,353.20	185,169,299.90	9,667,000.00	72,462,528.07	495,678,811.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,084.87	1,084.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	199,954.60	199,954.60
应付托管费	-	-	-	-	-	66,651.54	66,651.54
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,722,903.77	9,722,903.77
卖出回购金融资产款	80,000,000.00	-	-	-	-	-	80,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	35.05	35.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	226,266.10	226,266.10
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	19,837.23	19,837.23
其他负债	-	-	-	-	-	218,260.16	218,260.16
负债总计	80,000,000.00	-	-	-	-	10,454,993.32	90,454,993.32
利率敏感度缺口	-36,661,696.87	35,578,327.66	149,463,353.20	185,169,299.90	9,667,000.00	62,007,534.75	405,223,818.64
上年度末	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

2020 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	678,744.06	-	-	-	-	-	678,744.06
结算备付金	9,116,592.25	-	-	-	-	-	9,116,592.25
存出保证金	79,644.98	-	-	-	-	-	79,644.98
交易性金融资产	5,840,839.80	21,296,497.80	188,699,899.27	202,839,250.50	9,576,000.00	87,849,128.29	516,101,615.66
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	6,642,872.53	6,642,872.53
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	110.00	110.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,715,821.09	21,296,497.80	188,699,899.27	202,839,250.50	9,576,000.00	94,492,110.82	532,619,579.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	931.90	931.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	248,534.61	248,534.61
应付托管费	-	-	-	-	-	82,844.88	82,844.88
应付证券清算款	-	-	-	-	-	323,366.69	323,366.69
卖出回购金融资产款	24,200,000.00	-	-	-	-	-	24,200,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	78.88	78.88
应付交易费用	-	-	-	-	-	105,825.54	105,825.54
应付利息	-	-	-	-	-	-8,679.45	-8,679.45
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	24,643.27	24,643.27
其他负债	-	-	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	24,200,000.00	-	-	-	-	966,546.32	25,166,546.32
利率敏感度缺口	-8,484,178.91	21,296,497.80	188,699,899.27	202,839,250.50	9,576,000.00	93,525,564.50	507,453,033.16

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	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率下降 25 基点	2,523,903.32	2,958,006.84
	市场利率上升 25 基点	-2,516,871.44	-2,951,877.48

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	67,113,545.77	16.56	87,849,128.29	17.31
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	403,261,980.76	99.52	428,252,487.37	84.39
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	470,375,526.53	116.08	516,101,615.66	101.70

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升百分之五	337,339.56	1,196,684.05
	沪深 300 指数下降百分之五	-337,339.56	-1,196,684.05

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
		合计	455,358,341.40

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	67,113,545.77	13.54
	其中：股票	67,113,545.77	13.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	403,261,980.76	81.36
	其中：债券	403,261,980.76	81.36
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	19,880,223.51	4.01
8	其他各项资产	5,423,061.92	1.09
9	合计	495,678,811.96	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见 7.11.3 其他各项资产构成。

7.2 报告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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,105,332.42	1.01
C	制造业	28,898,336.60	7.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,884,629.00	0.96
H	住宿和餐饮业	2,720,040.00	0.67
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	27,505,207.75	6.79
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	67,113,545.77	16.56

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601658	邮储银行	1,411,100	7,083,722.00	1.75
2	002142	宁波银行	180,000	7,014,600.00	1.73

3	601601	中国太保	161,575	4,680,827.75	1.16
4	600919	江苏银行	484,000	3,436,400.00	0.85
5	600926	杭州银行	225,968	3,333,028.00	0.82
6	002706	良信股份	128,100	2,887,374.00	0.71
7	600660	福耀玻璃	50,300	2,809,255.00	0.69
8	600258	首旅酒店	114,000	2,720,040.00	0.67
9	603786	科博达	35,900	2,710,450.00	0.67
10	002459	晶澳科技	53,404	2,616,796.00	0.65
11	300894	火星人	36,100	2,454,800.00	0.61
12	601021	春秋航空	39,300	2,236,170.00	0.55
13	601899	紫金矿业	228,418	2,213,370.42	0.55
14	000001	平安银行	86,500	1,956,630.00	0.48
15	601699	潞安环能	160,200	1,891,962.00	0.47
16	000333	美的集团	25,200	1,798,524.00	0.44
17	688599	天合光能	60,716	1,721,298.60	0.42
18	601012	隆基股份	18,900	1,679,076.00	0.41
19	300911	亿田智能	23,900	1,655,792.00	0.41
20	002930	宏川智慧	100,700	1,648,459.00	0.41
21	603801	志邦家居	45,900	1,466,964.00	0.36
22	300767	震安科技	16,400	1,362,020.00	0.34
23	603501	韦尔股份	4,200	1,352,400.00	0.33
24	300132	青松股份	58,600	1,236,460.00	0.31
25	002832	比音勒芬	34,500	882,855.00	0.22
26	600745	闻泰科技	6,500	629,850.00	0.16
27	002906	华阳集团	19,700	622,126.00	0.15
28	600584	长电科技	16,300	614,184.00	0.15
29	000725	京东方 A	63,800	398,112.00	0.10

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600926	杭州银行	14,422,584.99	2.84
2	601899	紫金矿业	9,548,594.76	1.88
3	601601	中国太保	9,128,420.00	1.80
4	601658	邮储银行	7,463,420.00	1.47
5	002142	宁波银行	7,253,037.15	1.43
6	002833	弘亚数控	6,307,423.00	1.24
7	002706	良信股份	6,253,924.20	1.23

8	002555	三七互娱	5,353,106.67	1.05
9	601699	潞安环能	5,289,316.00	1.04
10	000932	华菱钢铁	4,064,207.26	0.80
11	601939	建设银行	4,042,600.00	0.80
12	601225	陕西煤业	4,028,804.00	0.79
13	000786	北新建材	3,858,321.60	0.76
14	600919	江苏银行	3,664,221.00	0.72
15	002043	兔宝宝	3,632,639.00	0.72
16	300059	东方财富	3,444,506.00	0.68
17	002353	杰瑞股份	3,427,323.00	0.68
18	603993	洛阳钼业	3,376,611.00	0.67
19	002600	领益智造	3,286,745.00	0.65
20	601088	中国神华	3,261,685.00	0.64

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600926	杭州银行	11,140,814.60	2.20
2	601668	中国建筑	8,630,628.68	1.70
3	002043	兔宝宝	8,070,445.82	1.59
4	601899	紫金矿业	7,198,555.71	1.42
5	601111	中国国航	6,960,440.36	1.37
6	002833	弘亚数控	6,902,655.41	1.36
7	000786	北新建材	6,884,288.13	1.36
8	000651	格力电器	6,288,873.97	1.24
9	000001	平安银行	6,257,882.38	1.23
10	002318	久立特材	5,599,070.21	1.10
11	601318	中国平安	4,872,133.00	0.96
12	601818	光大银行	4,754,448.30	0.94
13	002402	和而泰	4,285,521.05	0.84
14	002555	三七互娱	4,171,838.64	0.82
15	600009	上海机场	4,030,717.30	0.79
16	601939	建设银行	3,891,800.00	0.77
17	603799	华友钴业	3,830,790.00	0.75
18	601225	陕西煤业	3,811,396.95	0.75
19	601699	潞安环能	3,657,934.13	0.72
20	000932	华菱钢铁	3,649,588.84	0.72

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	218,336,074.09
卖出股票收入（成交）总额	236,568,683.88

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,175,000.00	0.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,212,579.00	7.70
	其中：政策性金融债	31,212,579.00	7.70
4	企业债券	166,443,900.00	41.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	110,726,000.00	27.32
7	可转债（可交换债）	91,704,501.76	22.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	403,261,980.76	99.52

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	163327	20 国电 01	300,000	29,940,000.00	7.39
2	163109	20 奉发 01	200,000	20,108,000.00	4.96
3	110079	杭银转债	145,380	16,554,420.60	4.09
4	163130	20 财富 01	120,000	12,090,000.00	2.98
5	127032	苏行转债	104,690	11,774,484.30	2.91

7.7 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。

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括光大证券股份有限公司。上海证券交易所于 2020 年 6 月 12 日作出了对光大证券股份有限公司予以通报批评的决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	74,079.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,348,982.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,423,061.92

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113017	吉视转债	10,032,407.40	2.48
2	127027	靖远转债	7,729,090.40	1.91
3	113516	苏农转债	6,056,102.00	1.49
4	110077	洪城转债	5,849,541.30	1.44
5	128129	青农转债	3,905,305.56	0.96
6	113040	星宇转债	3,259,826.70	0.80
7	127006	敖东转债	2,835,071.80	0.70
8	128138	侨银转债	2,830,332.50	0.70
9	132004	15 国盛 EB	2,112,495.00	0.52
10	132018	G 三峡 EB1	2,007,205.20	0.50
11	132011	17 浙报 EB	1,742,670.00	0.43
12	113025	明泰转债	1,229,540.80	0.30

13	132021	19 中电 EB	320,019.70	0.08
14	113044	大秦转债	291,235.30	0.07
15	128137	洁美转债	198,457.87	0.05
16	132022	20 广版 EB	150,405.00	0.04
17	123064	万孚转债	88,796.10	0.02
18	128125	华阳转债	69,224.00	0.02

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（%）
华富恒利债券 A	81	4,320,803.08	349,271,923.75	99.80	713,125.75	0.20
华富恒利债券 C	187	467.10	0.00	0	87,346.97	100
合计	268	1,306,240.29	349,271,923.75	99.77	800,472.72	0.23

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C
基金合同生效日 (2015 年 8 月 31 日) 基金份额总额	252,261,700.61	108,231,824.59
本报告期期初基金份 额总额	442,129,705.65	226,599.36
本报告期基金总申购 份额	60,714,728.02	412,553.96
减：本报告期基金总 赎回份额	152,859,384.17	551,806.35
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	349,985,049.50	87,346.97

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

- 2021 年 3 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，因工作需要，增聘姚姣女士为华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
- 2021 年 3 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，因工作需要，增聘陈奇先生为华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
- 2021 年 3 月 26 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，张亮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。
- 2021 年 3 月 26 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，张亮先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5. 2021 年 5 月 7 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, 增聘李孝华先生为华富中证 100 指数证券投资基金基金经理。
6. 2021 年 6 月 28 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, 增聘李孝华先生为华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
7. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	
海通证券	1	127,091,633.47	29.03%	123,138.80	28.99%	-
兴业证券	1	99,617,162.64	22.76%	94,216.43	22.18%	-
广发证券	1	87,488,951.95	19.98%	79,730.97	18.77%	-
银河证券	1	65,625,279.31	14.99%	66,976.60	15.77%	-
申万宏源	1	27,545,933.92	6.29%	26,742.81	6.30%	-
华安证券	2	15,404,092.71	3.52%	14,424.31	3.40%	-
方正证券	1	12,613,148.78	2.88%	16,730.15	3.94%	-
西藏东方财富	1	2,394,414.10	0.55%	2,230.03	0.52%	-

富						
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	612.00	0.14%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银证券	1	-	-	-	-	-

注：1) 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司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。

2) 本报告期本基金新增德邦证券 1 个交易单元，东方财富证券 1 个交易单元。

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

10.7.2 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
海通证券	50,214,802.90	13.60%	3,768,500,000.00	45.10%	-	-
兴业证券	57,206,643.69	15.49%	-	-	-	-
广发证券	46,922,968.72	12.71%	-	-	-	-
银河证券	82,890,370.70	22.45%	2,941,900,000.00	35.21%	-	-
申万宏源	54,363,900.00	14.72%	752,900,000.00	9.01%	-	-
华安证券	10,975,598.20	2.97%	280,000,000.00	3.35%	-	-
方正证券	52,359,602.30	14.18%	612,000,000.00	7.32%	-	-
西藏东方 财富	4,067,330.66	1.10%	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	10,200,000.00	2.76%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-

注：债券交易中的企业债及可分离债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旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2021倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021年1月4日
2	华富基金管理有限公司关于旗下部分	中国证监会指定媒介	2021年1月4日

	开放式基金参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动的公告		
3	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 4 日
4	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 16 日
5	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 22 日
6	华富恒利债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 22 日
7	华富基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 26 日
8	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	2021 年 3 月 18 日
9	华富基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 20 日
10	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 26 日
11	华富基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 30 日
12	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 31 日
13	华富恒利债券型证券投资基金 2020 年度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 3 月 31 日
14	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加天风证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 16 日
15	关于华富基金管理有限公司旗下部分基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 17 日
16	华富基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
17	华富恒利债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 22 日
18	华富基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 6 月 30 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	2021.1.1-2021.6.30	94,387,401.83	0.00	0.00	94,387,401.83	26.96
	2	2021.1.1-2021.6.30	91,883,757.22	0.00	0.00	91,883,757.22	26.25
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、华富恒利债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富恒利债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富恒利债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富恒利债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

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。

华富基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日