

华富安华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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
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的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	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.11 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
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情况	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富安华债券型证券投资基金	
基金简称	华富安华债券	
基金主代码	010473	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 28 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,025,253,533.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富安华债券 A	华富安华债券 C
下属分级基金的交易代码	010473	010474
报告期末下属分级基金的份额总额	1,811,225,745.55 份	214,027,788.32 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	根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合流动性、估值水平、风险偏好等因素，综合评价各类资产的风险收益水平。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	中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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	中国建设银行股份有限公司
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	021-60637111
传真	021-68887997	021-60635778
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	赵万利	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	ttp://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 28 日(基金合同生效日)-2021 年 6 月 30 日)	
	华富安华债券 A	华富安华债券 C
本期已实现收益	29,164,910.98	4,651,317.29
本期利润	48,087,777.45	7,722,489.26
加权平均基金份额本期利润	0.0327	0.0293
本期加权平均净值利润率	3.23%	2.91%
本期基金份额净值增长率	3.40%	3.22%
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	4,120,271.25
	期末可供分配基金份额利润	0.0193
	期末基金资产净值	220,927,348.02

期末基金份额净值	1.0340	1.0322
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	3.40%	3.22%

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

华富安华债券 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	0.24%	0.17%	-0.24%	0.09%	0.48%	0.08%
过去三个月	2.87%	0.15%	0.77%	0.10%	2.10%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.40%	0.12%	-0.02%	0.14%	3.42%	-0.02%

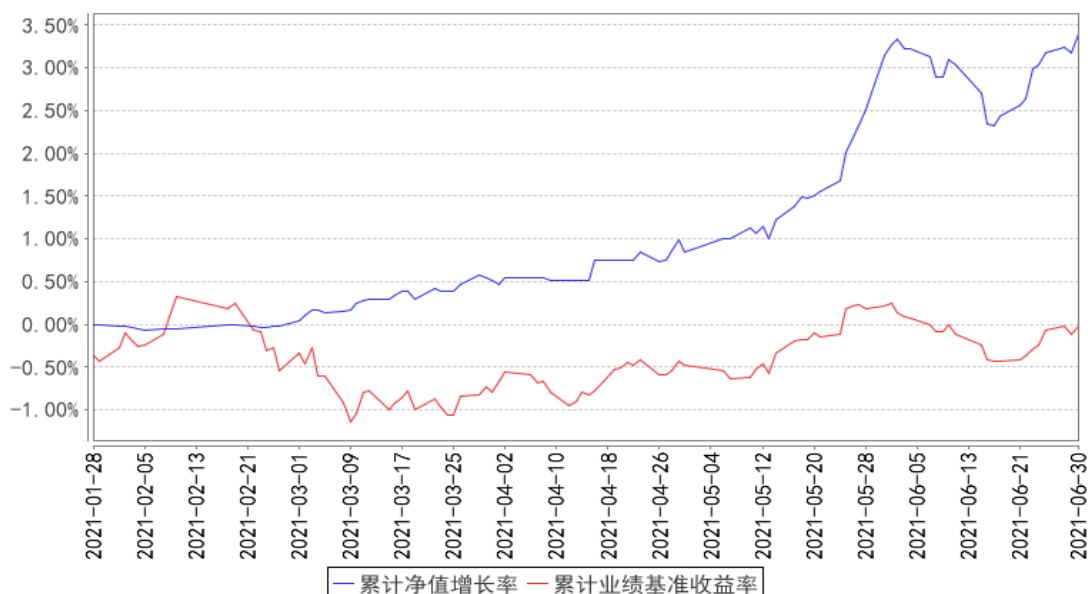
华富安华债券 C

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	0.20%	0.17%	-0.24%	0.09%	0.44%	0.08%
过去三个月	2.75%	0.15%	0.77%	0.10%	1.98%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.22%	0.12%	-0.02%	0.14%	3.24%	-0.02%

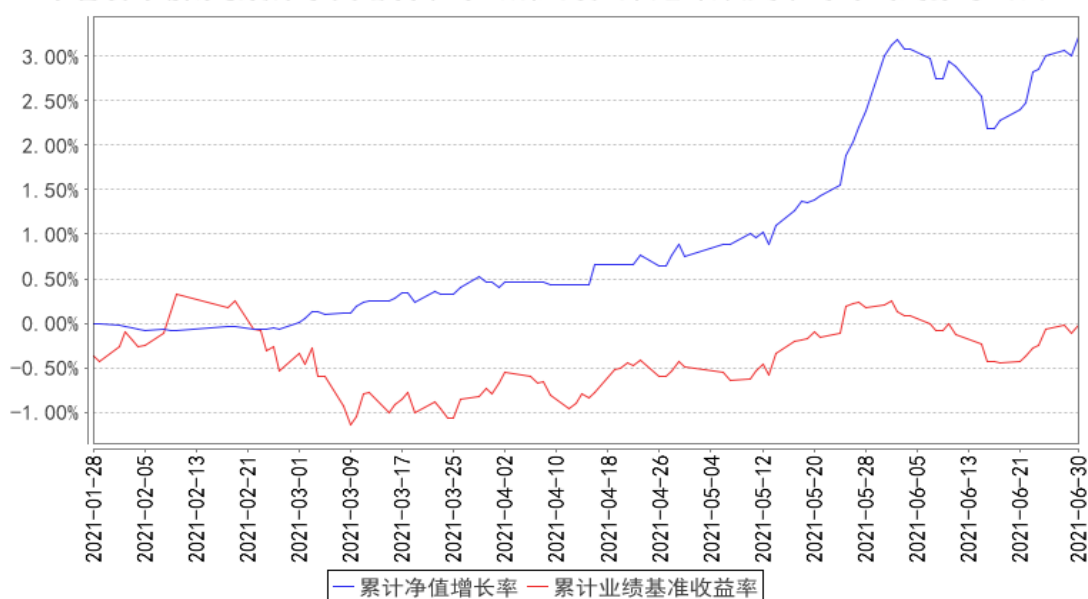
注：本基金业绩比较基准收益率=中债综合指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%

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

华富安华债券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



华富安华债券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《华富安华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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；本基金投资可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券的比例不高于基金资产的 20%。本基金买入信用债的债项评级不得低于 AA。其中投资债项评级 AA 的信用债比例不高于债券资产的 20%，投资债项评级 AA+ 的信用债比例不高于债券资产的 50%，投资债项评级 AAA 的信用债比例不低于债券资产的 50%。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。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2021 年 1 月 28 日到 2021 年 7 月 28 日，本报告期末本基金仍在建仓期内。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用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		
尹培俊	华富安华债券型基金基金经理、华富可转债债券型基金基金经理、华富收益增强债券型基金基金经理、华富强化回报债券型基金基金经理、华富安享债券型基金基金经理、华富华鑫灵活配置混合型基金经理、公司总经理助理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会委员	2021年1月28日	-	15年	兰州大学工商管理硕士，研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012年7月加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用研究员、固定收益部总监助理、固定收益部副总监，2016年5月5日至2018年9月4日（9.5基金合同终止）任华富诚鑫灵活配置混合型基金经理、2014年3月6日至2019年6月20日任华富货币市场基金基金经理。

注：这里的任职日期指基金成立之日。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，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 在回落至 50.9%，显示经济仍在扩张区间但仍修复斜率有所放缓，企业盈利相对有韧性，1-5 月规模以上工业企业收入和利润累计同比分别为 30.5% 和 83.4%，以 2019 年为基期的两年复合增速分别为 9.9% 和 48%，5 月当月利润同比增长 36.4%，两年复合增速 20.2%，较 4 月的 22.5% 略有放缓但维持在偏高的位置。库存周期方面，5 月末工业产成品库存同比增速回升至 10.2%，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 5 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，5 月 PPI 同比高达 9%，显著高于市场预期，但由于猪周期等原因，工业品通胀对于 CPI 的传导尚不显著。总体而言，融资环境逐渐收紧、企业盈利维持韧性、制造业波动补库存、PPI 通胀趋势上行，总体而言国内经济处于扩张的尾部，需要关注滞胀风险。

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，尤其是英国等国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，6 月美联储议息会议维持基准利率水平与购债规模描述并大幅上调今年经济增长及通胀预期。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。

从国内资本市场的表现来看，上半年 A 股市场冲高回落，然后震荡上行，“核心资产”抱团瓦解之后仍然处在估值消化过程中，周期和中小价值品种估值有所修复，半导体、新能源等高景气成长行业表现突出，结构分化依然较为严重；转债市场整体表现较强，转债指数创出阶段新高；债券市场表现相对稳健，在偏宽松的资金利率水平下，利率债小幅走强，高等级信用债需求旺盛。本基金在上半年逐步提升风险资产仓位，加大了新能源和军工等行业的配置，债券部分以 3 年左

右的高等级信用债为底仓，逐步加仓长久期利率债，产品成立以来净值表现较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富安华债券 A 份额净值为 1.0340 元，累计份额净值为 1.0340 元。本报告期的基金份额净值增长率为 3.40%，同期业绩比较基准收益率为-0.02%。截止本期末，华富安华债券 C 份额净值为 1.0322 元，累计份额净值为 1.0322 元。本报告期的基金份额净值增长率为 3.22%，同期业绩比较基准收益率为-0.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面仍有韧性但下行压力加大，基建乏力，出口承压，经济增长见顶回落趋势不改；通胀层面 PPI 高位回落，CPI 低位回升，通胀预期有所回落。在全球疫情持续反复的背景下，稳增长压力将明显增大，财政政策将比上半年更为积极，货币政策仍将合理充裕，政策面整体趋于稳中偏松。全球来看，欧美经济复苏晚于中国，下半年也需要重点关注政策的逐步退出对市场的影响。整体而言，全面降准之后，政策较前期预期更为偏松，对资产价格形成支撑。从资产配置角度，股债估值性价比较为均衡，债券资产胜率在改善，但是上半年偏强的表现导致赔率不足，风险资产整体不贵，估值分化持续收敛，但结构性机会操作难度加大；中期来看随着政策对冲经济下行压力，股债系统性风险均不大。

本基金短期仍以 3 年期左右的高等级信用债配置为主，逐步拉长债券组合久期；股票配置重于均衡，转债以低估值正股类和精选中低价为主要配置方向。中期而言，本基金将考虑进一步平衡股债比例配置，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，稳健地做好配置策略，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基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富安华债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 55,810,266.71 元，期末可供分配利润为 42,087,025.46 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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。

报告期内，本基金未进行利润分配。

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富安华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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	1,534,589.71
结算备付金		55,158,401.47
存出保证金		101,670.85

交易性金融资产	6.4.7.2	2,448,365,495.06
其中：股票投资		318,458,144.11
基金投资		-
债券投资		2,129,907,350.95
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		5,252,484.40
应收利息	6.4.7.5	25,350,436.57
应收股利		-
应收申购款		715,570.15
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,536,478,648.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		423,700,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		16,918,772.03
应付管理人报酬		1,120,575.59
应付托管费		320,164.45
应付销售服务费		73,513.03
应付交易费用	6.4.7.7	435,442.17
应交税费		118,184.75
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	121,935.22
负债合计		442,808,587.24
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,025,253,533.87
未分配利润	6.4.7.10	68,416,527.10
所有者权益合计		2,093,670,060.97
负债和所有者权益总计		2,536,478,648.21

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0340 元、C 类基金份额净值 1.0322 元，基金份额总额 2,025,253,533.87 份，A 类基金份额总额 1,811,225,745.55 份、C 类基金份额总额 214,027,788.32 份。后附表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富安华债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2021 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		66,594,851.16
1. 利息收入		27,600,111.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,169,482.40
债券利息收入		24,796,084.38
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,634,545.04
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,853,496.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,441,013.15
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,830,053.25
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	3,582,429.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	21,994,038.44
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	147,204.88
减：二、费用		10,784,584.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,141,370.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,468,962.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	446,816.51
4. 交易费用	6.4.7.19	692,641.42
5. 利息支出		2,838,217.60
其中：卖出回购金融资产支出		2,838,217.60
6. 税金及附加		71,994.17
7. 其他费用	6.4.7.20	124,581.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		55,810,266.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		55,810,266.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富安华债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 28 日（基金合同生效日）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）	1,734,937,012.23	-	1,734,937,012.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,810,266.71	55,810,266.71
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）	290,316,521.64	12,606,260.39	302,922,782.03
其中：1. 基金申购款	822,890,579.22	24,201,068.34	847,091,647.56
2. 基金赎回款	-532,574,057.58	-11,594,807.95	-544,168,865.53
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）	2,025,253,533.87	68,416,527.10	2,093,670,060.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-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

华富安华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）《关于准予华富安华债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2020〕2549号）准予募集注册，基金合同于2021年1月28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审验，并由其出具《验证报告》（天健验〔2021〕6-8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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华富安华债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资范围为：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允许上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券(含可分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货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相关规定)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金合同于 2021 年 1 月 28 日生效，无上年度可比期间。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

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

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

(2) 估值方法及关键假设

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。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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最后一位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式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。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

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

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

(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	1,534,589.71
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	1,534,589.71

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	306,145,751.41	318,458,144.11	12,312,392.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,017,999,484.55	4,549,866.40
	银行间市场	1,102,226,220.66	5,131,779.34

	合计	2,120,225,705.21	2,129,907,350.95	9,681,645.74
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	2,426,371,456.62	2,448,365,495.06	21,994,038.44

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	323.16
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	24,821.30
应收债券利息	25,325,246.31
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	45.80
合计	25,350,436.57

注：本表列示的“应收其他存款利息”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应收银行存款利息；“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 2021年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	429,417.17
银行间市场应付交易费用	6,025.00
合计	435,442.17

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	12,698.16
应付证券出借违约金	-
上清账户维护费	4,500.00
应付审计费	36,450.26
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	63,786.80
合计	121,935.22

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华富安华债券 A

项目	本期 2021年1月28日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,446,617,759.89	1,446,617,759.89
本期申购	749,306,139.49	749,306,139.49
本期赎回（以“-”号填列）	-384,698,153.83	-384,698,153.83
-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	1,811,225,745.55	1,811,225,745.55

华富安华债券 C

项目	本期 2021年1月28日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	288,319,252.34	288,319,252.34
本期申购	73,584,439.73	73,584,439.73
本期赎回（以“-”号填列）	-147,875,903.75	-147,875,903.75
-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	214,027,788.32	214,027,788.32

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

华富安华债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	29,164,910.98	18,922,866.47	48,087,777.45
本期基金份额交易产生的变动数	8,801,843.23	4,627,346.72	13,429,189.95
其中：基金申购款	14,448,567.65	7,810,838.73	22,259,406.38
基金赎回款	-5,646,724.42	-3,183,492.01	-8,830,216.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,966,754.21	23,550,213.19	61,516,967.40

华富安华债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,651,317.29	3,071,171.97	7,722,489.26
本期基金份额交易产生的变动数	-531,046.04	-291,883.52	-822,929.56
其中：基金申购款	1,238,828.45	702,833.51	1,941,661.96
基金赎回款	-1,769,874.49	-994,717.03	-2,764,591.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,120,271.25	2,779,288.45	6,899,559.70

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月28日（基金合同生效日）至2021年6月30日
活期存款利息收入	140,081.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	816,666.67
结算备付金利息收入	212,370.54
其他	363.38
合计	1,169,482.40

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28日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,441,013.15
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	5,441,013.15

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28日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	118,569,047.00
减：卖出股票成本总额	113,128,033.85
买卖股票差价收入	5,441,013.15

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28日（基金合同生效日）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	7,830,053.25
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	7,830,053.25

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28日（基金合同生效日）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	616,042,720.89
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	601,278,750.65
减：应收利息总额	6,933,916.99
买卖债券差价收入	7,830,053.25

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28日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,582,429.62
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	3,582,429.62

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28日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	21,994,038.44
股票投资	12,312,392.70
债券投资	9,681,645.74
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	21,994,038.44
----	---------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	147,204.88
合计	147,204.88

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	677,766.42
银行间市场交易费用	14,875.00
合计	692,641.42

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	36,450.26
信息披露费	63,786.80
证券出借违约金	-
银行费用	11,484.31
账户维护费	12,360.00
其他	500.00
合计	124,581.37

注：其他费用为上清算查询费 100 元，开户费 400 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

华富基金管理有限公司	基金管理人、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（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华安证券	516,541,538.53	100.00

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 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
华安证券	1,335,023,140.19	100.00

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 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
华安证券	36,600,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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28日（基金合同生效日）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	506,897.82	100.00	429,417.17	100.00

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28日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	5,141,370.41
其中：支付销售机构的客户维护费	2,379,017.45	

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月28日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	1,468,962.97

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28日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富安华债券 A	华富安华债券 C	合计
中国建设银行股份有限公司	-	342,244.86	342,244.86
华安证券	-	3.06	3.06
华富基金管理有限公司	-	1.53	1.53
合计	-	342,249.45	342,249.45

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

注：本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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：本报告期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28日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,534,589.71	140,081.81

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日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	5,550	555,000.00	555,000.00	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。本报告期间若有除权，认购价格为除权后价格，数量为期末实际持有数量。

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：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本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 423,700,000.00 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

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有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
AAA	1,543,610,504.02
AAA 以下	324,104,646.93
未评级	
合计	1,867,715,150.95

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有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 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。本基金以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制以确保按摊余成本计算的基金资产净值近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	1,534,589.71	-	-	-	-	-	-1,534,589.71
结算备付金	55,158,401.47	-	-	-	-	-	55,158,401.47
存出保证金	101,670.85	-	-	-	-	-	101,670.85
交易性金融资产	8,616,800.00	32,373,020.00	255,337,090.95	1,681,495,440.00	152,085,000.00	318,458,144.11	2,448,365,495.06
应收利息	-	-	-	-	-	25,350,436.57	25,350,436.57
应收申购款	-	-	-	-	-	-715,570.15	715,570.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,252,484.40	5,252,484.40
资产总计	65,411,462.03	32,373,020.00	255,337,090.95	1,681,495,440.00	152,085,000.00	349,776,635.23	2,536,478,648.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,918,772.03	16,918,772.03
应付管理人	-	-	-	-	-	-1,120,575.15	1,120,575.59

报酬						59	
应付托管费	-	-	-	-	-	-320,164.45	320,164.45
卖出回购金 融资产款	423,700,000.00	-	-	-	-	-	423,700,000.00
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	-73,513.03	73,513.03
应付交易费 用	-	-	-	-	-	-435,442.17	435,442.17
应交税费	-	-	-	-	-	-118,184.75	118,184.75
其他负债	-	-	-	-	-	-121,935.22	121,935.22
负债总计	423,700,000.00	-	-	-	-	19,108,587.24	442,808,587.24
利率敏感度 缺口	-358,288,537.97	32,373,020.00	255,337,090.95	1,681,495,440.00	152,085,000.00	330,668,047.99	2,093,670,060.97

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）
分析	市场利率下降 25 基点	16,762,770.21
	市场利率上升 25 基点	-16,676,775.20

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票 投资	318,458,144.11	15.21

交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,129,907,350.95	101.73
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	2,448,365,495.06	116.94

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）
分析	沪深 300 指数上升百分之五	2,542,453.54
	沪深 300 指数下降百分之五	-2,542,453.54

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）
	合计	2,472,053,545.67

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	318,458,144.11	12.56

	其中：股票	318,458,144.11	12.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,129,907,350.95	83.97
	其中：债券	2,129,907,350.95	83.97
	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	56,692,991.18	2.24
8	其他各项资产	31,420,161.97	1.24
9	合计	2,536,478,648.21	100.00

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	25,323,000.00	1.21
C	制造业	203,056,856.21	9.70
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	18,339,323.70	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	33,772,900.00	1.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,306,100.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	9,637,000.00	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	10,022,964.20	0.48
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	318,458,144.11	15.21

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	300769	德方纳米	98,980	20,458,176.20	0.98
2	002415	海康威视	310,000	19,995,000.00	0.96
3	601888	中国中免	61,000	18,306,100.00	0.87
4	600872	中炬高新	410,000	17,228,200.00	0.82
5	688598	金博股份	63,000	16,947,000.00	0.81
6	002025	航天电器	320,000	16,054,400.00	0.77
7	000333	美的集团	220,000	15,701,400.00	0.75
8	601166	兴业银行	750,000	15,412,500.00	0.74
9	002459	晶澳科技	300,000	14,700,000.00	0.70
10	300751	迈为股份	29,980	13,631,906.00	0.65
11	601225	陕西煤业	1,100,000	13,035,000.00	0.62
12	600188	XD 兖州煤	800,000	12,288,000.00	0.59
13	688586	江航装备	425,000	11,849,000.00	0.57
14	600426	华鲁恒升	379,959	11,759,731.05	0.56
15	600885	宏发股份	160,000	10,032,000.00	0.48
16	600323	瀚蓝环境	459,980	10,022,964.20	0.48
17	300215	电科院	1,150,000	9,637,000.00	0.46
18	601111	中国国航	1,200,000	9,336,000.00	0.45
19	601601	中国太保	320,000	9,270,400.00	0.44
20	601288	农业银行	3,000,000	9,090,000.00	0.43
21	603885	吉祥航空	589,995	9,003,323.70	0.43
22	688408	中信博	40,000	8,032,000.00	0.38
23	600183	生益科技	300,000	7,023,000.00	0.34
24	300477	合纵科技	1,000,000	6,890,000.00	0.33
25	688599	天合光能	220,000	6,237,000.00	0.30
26	300207	欣旺达	118,091	3,845,042.96	0.18
27	603337	杰克股份	100,000	2,673,000.00	0.13

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	600872	中炬高新	19,562,381.12	0.93
2	300769	德方纳米	19,314,834.20	0.92
3	601888	中国中免	19,223,771.65	0.92
4	002415	海康威视	18,887,636.65	0.90
5	601288	农业银行	18,339,000.00	0.88
6	002459	晶澳科技	17,937,206.00	0.86
7	000651	格力电器	17,821,231.23	0.85
8	600985	淮北矿业	17,684,878.75	0.84
9	000333	美的集团	17,428,714.00	0.83
10	601225	陕西煤业	17,136,886.00	0.82
11	601166	兴业银行	16,364,300.00	0.78
12	002025	航天电器	15,679,742.00	0.75
13	600188	XD 兖州煤	14,904,772.00	0.71
14	600048	保利地产	13,743,477.00	0.66
15	688005	容百科技	13,446,365.31	0.64
16	688598	金博股份	12,939,435.31	0.62
17	600183	生益科技	12,373,941.00	0.59
18	601601	中国太保	12,340,874.00	0.59
19	688586	江航装备	12,157,836.00	0.58
20	600885	宏发股份	11,729,006.00	0.56

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688005	容百科技	24,048,294.58	1.15
2	000651	格力电器	17,156,716.00	0.82
3	600985	淮北矿业	15,124,614.71	0.72
4	002459	晶澳科技	13,368,928.00	0.64
5	600048	保利地产	12,166,479.00	0.58
6	601288	农业银行	7,725,000.00	0.37
7	000069	华侨城 A	7,554,466.00	0.36
8	601225	陕西煤业	4,754,670.00	0.23
9	603337	杰克股份	4,441,039.30	0.21
10	600183	生益科技	4,438,043.00	0.21
11	600188	XD 兖州煤	2,965,228.73	0.14
12	600885	宏发股份	2,954,948.68	0.14
13	300477	合纵科技	1,669,400.00	0.08
14	600905	三峡能源	178,204.00	0.01
15	688538	和辉光电	10,500.00	0.00

16	688425	铁建重工	7,830.00	0.00
17	688660	电气风电	4,685.00	0.00

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	419,273,785.26
卖出股票收入（成交）总额	118,569,047.00

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	262,192,200.00	12.52
	其中：政策性金融债	262,192,200.00	12.52
4	企业债券	838,230,000.00	40.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	834,933,000.00	39.88
7	可转债（可交换债）	194,552,150.95	9.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,129,907,350.95	101.73

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	200215	20 国开 15	1,500,000	152,085,000.00	7.26
2	210206	21 国开 06	800,000	80,008,000.00	3.82
3	175467	20 中财 G5	500,000	50,710,000.00	2.42
4	155180	G19 三峡 1	500,000	50,565,000.00	2.42
5	188261	21CHNE01	500,000	49,985,000.00	2.39

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

注：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，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	101,670.85
2	应收证券清算款	5,252,484.40
3	应收股利	-
4	应收利息	25,350,436.57
5	应收申购款	715,570.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,420,161.97

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	110053	苏银转债	30,340,000.00	1.45
2	132018	G 三峡 EB1	28,468,440.00	1.36
3	110051	中天转债	19,521,100.00	0.93
4	113611	福 20 转债	13,767,200.00	0.66
5	128109	楚江转债	11,778,003.16	0.56
6	128107	交科转债	10,856,000.00	0.52
7	113588	润达转债	8,878,212.00	0.42
8	110073	国投转债	8,616,800.00	0.41
9	113043	财通转债	8,535,200.00	0.41
10	127022	恒逸转债	7,775,327.60	0.37
11	110063	鹰 19 转债	7,079,400.00	0.34

12	128130	景兴转债	4,297,420.00	0.21
13	123083	朗新转债	4,054,218.52	0.19
14	113530	大丰转债	3,529,411.20	0.17
15	113017	吉视转债	1,464,300.00	0.07

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(%)
华富安华债券 A	9,360	193,507.02	76,499,598.04	4.22	1,734,726,147.51	95.78
华富安华债券 C	28,840	7,421.21	7,775,313.63	3.63	206,252,474.69	96.37
合计	38,200	53,017.11	84,274,911.67	4.16	1,940,978,622.20	95.84

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

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	华富安华债券 A	25,963.96	0.00140
	华富安华债券 C	55,039.69	0.02570

人员持有本基金			
	合计	81,003.65	0.00400

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、本基金基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富安华债券 A	华富安华债券 C
基金合同生效日 (2021 年 1 月 28 日) 基金份额总额	1,446,617,759.89	288,319,252.34
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	749,306,139.49	73,584,439.73
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	384,698,153.83	147,875,903.75
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,811,225,745.55	214,027,788.32

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. 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。

2. 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。

3. 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。

4. 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	
华安证券	2	516,541,538.53	100.00%	506,897.82	100.00%	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-

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

2) 本报告期本基金新增 2 个东亚前海证券交易单元。

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	1,335,023,140.19	100.00%	36,600,000,000.00	100.00%	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-

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	华富安华债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2021 年 1 月 29 日
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	华富安华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
8	关于华富基金管理有限公司旗下部分	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 16 日

	基金参加天风证券股份有限公司费率优惠活动的公告		
9	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
10	华富安华债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证监会指定媒介	2021 年 4 月 21 日
11	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
12	华富安华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
13	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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华富安华债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富安华债券型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富安华债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富安华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