

# 华富安福债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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。本中期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 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>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                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9         |
| 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 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                 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 39        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 42        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 42        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 43        |
| 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 ..... | 43        |
| 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 .....    | 43        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 43        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 43        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 45        |
| 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 .....      | 45        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>45</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 46        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 46        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>47</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 47        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 48        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 48        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                |
|------------|----------------|
| 基金名称       | 华富安福债券型证券投资基金  |
| 基金简称       | 华富安福债券         |
| 基金主代码      | 002412         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式         |
| 基金合同生效日    | 2019 年 4 月 2 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 | 5,531,767.17 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期            |

### 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。本基金投资组合中债券类、权益类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          | 基金管理人                              | 基金托管人                 |
|-------------|------------------------------------|-----------------------|
| 名称          | 华富基金管理有限公司                         | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>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       | 赵万里                                | 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -254,593.12                         |
| 本期利润          | -355,871.58                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0676                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -5.51%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -4.99%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 1,205,615.66                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2179                              |
| 期末基金资产净值      | 6,912,666.70                        |
| 期末基金份额净值      | 1.2496                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 21.20%                              |

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。

### 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

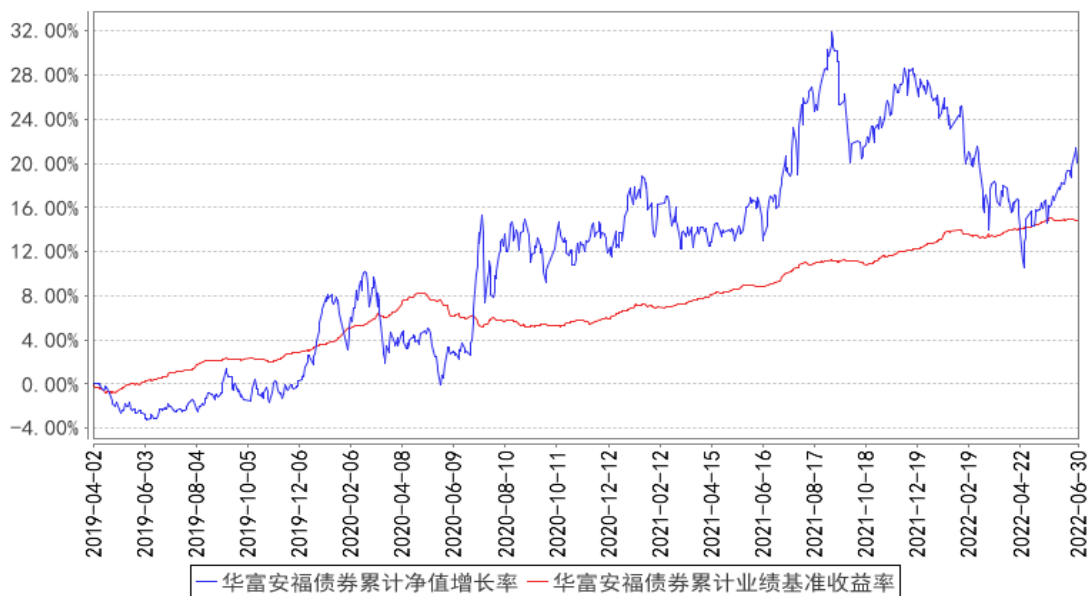
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 3.62%    | 0.49%       | -0.03%     | 0.04%         | 3.65% | 0.45% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 3.56%  | 0.75% | 1.11%  | 0.05% | 2.45%  | 0.70% |
| 过去六个月      | -4.99% | 0.78% | 1.90%  | 0.06% | -6.89% | 0.72% |
| 过去一年       | 3.47%  | 0.80% | 5.22%  | 0.06% | -1.75% | 0.74% |
| 过去三年       | 24.01% | 0.73% | 14.08% | 0.07% | 9.93%  | 0.66% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.20% | 0.70% | 14.87% | 0.07% | 6.33%  | 0.63% |

注：业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率。

### 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

华富安福债券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：本基金转型前为华富安福保本混合型证券投资基金。根据《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金的投资组合比例为：本基金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%；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。本基金建仓期为 2019 年 4 月 2 日到 2019 年 10 月 2 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《华富安福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 2022 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、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定



期开放债券型发起式证券投资基金和华富安业一年持有期债券型证券投资基金共五十五只基金。

#### 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 | 本基金基金经理、固定收益部总监助理 | 2019年4月2日       | -    | 十五年    | 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，曾任研究发展部助理行业研究员、行业研究员，固定收益部固收研究员、基金经理助理，自2014年11月19日起任华富保本混合型证券投资基金基金经理，自2015年8月31日起任华富恒利债券型证券投资基金基金经理，自2016年9月7日起任华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年1月30日起任华富安享债券型证券投资基金基金经理，自2018年8月28日起任华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2019年4月2日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，自2019年4月15日起任华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年6月12日起任华富安鑫债券型证券投资基金基金经理，自2020年11月9日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2021年8月16日起任华富63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。 |

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

2022 年上半年，在政策前置发力的影响下，1 至 2 月国内经济整体向好，多项经济数据超出市场预期，但进入 3 月后，随着国内疫情形势再度严峻，各地多采取封锁等措施以控制疫情传播，国内经济增速较一季度出现明显回落。特别是 4 月受疫情冲击最大的时期，各项经济数据明显回落，工业增加值、社会消费品零售等数据同比均出现负增长。5 月、6 月，随着国内疫情形势逐步得到控制、各地复工复产，经济开始出现疫后修复，各项经济数据边际上都出现较大的改善，但距离本轮疫情前的基本面水平仍有一定距离。

通胀方面，上半年国内通胀预期有限，扰动不大。海外需求相对强劲，但国内需求相对低迷。具体来说，今年一季度猪价惯性偏弱，受此影响 CPI 同比读数整体承压。但二季度开始，猪肉价格开始出现反弹，带动 CPI 同比读数有所回暖。核心 CPI 方面，受制于上半年经济表现较弱、居民收入增速低迷，核心 CPI 整体表现较弱。PPI 方面，一季度受国内宽信用预期及俄乌战争影响，黑色链及能化链价格出现上涨，PPI 环比表现较强。但二季度后期开始，海外衰退担忧明显加剧，海外定价的商品价格出现较大程度的回落，带动 PPI 环比有所降温。

货币政策方面，央行今年整体维持稳定偏松的基调，加上实体宽信用受阻碍，大量资金停留在金融市场，二季度资金实际利率持续远低于公开市场操作的政策利率。

海外方面，由于通胀高企，欧美国家央行纷纷趋紧，美联储 6 月 FOMC 会议加息 75BP，且市场预期 7 月与 9 月仍分别有 3 次与 2 次加息幅度。经济基本面方面，6 月美国密西根大学消费信心指数下跌幅度与以往衰退前夕相当，6 月 PMI 也下降明显，二季度末开始海外衰退预期显著升

温。

从国内资本市场的表现来看，上半年债券市场有所分化，利率债整体短端下行、长债维持震荡，资金利率与长端资产表现分割，曲线陡峭化。而信用债表现强于利率债，特别是二季度以来信用债走出了一段牛市行情，一是央行流动性宽松叠加实体融资需求偏弱，给票息资产加杠杆提供了良好条件，二是随着宽信用政策的推进、城投配套融资限制的放开，整体市场风险偏好也有所抬升，尤其对城投债市场开始做信用挖掘，三是合意票息资产减少和广义基金扩张导致的供需缺口，市场演绎了票息资产荒行情。上半年权益市场呈现显著的 V 型走势，年初开始在美联储加息、俄乌冲突与上海疫情封控的背景下，1-4 月市场呈现惯性下跌趋势，市场估值一度达到历史极低位置。随后随着上海疫情封控放松与复工复产，一揽子稳增长政策陆续落地，LPR5 年期下调 15BP，以及汽车消费刺激，美国对光伏行业反规避调查放松等产业方面利好下，以新能源为领涨的成长股开始反弹，进入 6 月，反弹逐渐扩散，疫情修复的消费板块、部分持续紧缺的涨价资源品均有不俗的表现。可转债市场方面，转债跟随权益市场出现反弹，但是受制于较高的估值水平，反弹幅度弱于正股。

回顾上半年，我们对内外多重负面因素的预估显著不足，本基金产品风险资产仓位较高，净值回撤较大，需要进一步反思操作的失误。在年末对 2022 年全年的展望中，我们预判一季度将维持宽松的流动性环境，叠加稳增长政策的发力，同时考虑股债性价比相对均衡，所以超配了风险资产，中性配置了债券资产。在海外加息、地缘战争以及国内疫情反复等多重利空下，风险偏好大幅下行，较高的股票仓位承受了净值大幅回撤的风险。在行业配置上，我们维持了前期的部分受益于稳增长发力的基建等行业，保留了一定的长期景气度向好的光伏、风电等行业，增配了受益于复工复产，困境反转的消费等行业，保持风险资产组合相对均衡。债券资产上，可转债主要以精选个券为主，主要配置养殖、周期、新能源、金融等行业个券，受益于风险资产的反弹，本基金净值有所修复。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 1.2496 元，累计份额净值为 1.2496 元。报告期，本基金份额净值增长率为-4.99%，同期业绩比较基准收益率为 1.90 %。

#### 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，随着国内疫情缓和、各地封控政策相继放松，经济有望出现反弹。一方面，随着前期积极的财政政策相继落地，三季度基建有望维持高增长；另一方面，随着政策的边际放松以及疫情后需求释放，汽车、地产等消费均将出现边际修复，但是距离本轮疫情前依然还有距离。

在资产配置上，债券的核心变量依然是经济及政策。三季度国内基本面大概率会逐步回暖、

货币政策存在回归中性的可能，一些潜在的风险因素可能对未来利率债市场形成扰动。但考虑到国内疫情形势仍具有较大的不确定性，后续国内经济恢复的斜率可能偏慢，货币政策仍会保持合理充裕以支持经济。利率债市场经历了前期的调整后，对后续经济复苏、资金收紧已有一定预期，可以关注后续长端利率调整后“跌出来的机会”。

权益市场方面，展望三季度，市场依然面临复杂的内外部环境。从外部看，全球流动性收紧同时有着强烈的衰退；从内部看，稳增长政策陆续落地但效果有待观察、市场对盈利底出现在二季度的预期较强烈但也隐含了部分触底回升的预期，同时市场短期经历了快速的反弹后，需要进一步等待基本面的验证。在结构上，我们重点关注三个方向，一是具备中长期景气度优势的新能源板块，二是疫后消费复苏板块，三是受益于原材料见顶回落后中下游制造业毛利率持续回升的板块。

#### 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《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为-355,871.58元，期末可供分配利润为1,205,615.66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2019年4月2日起至本报告期末（2022年06月30日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于5000万元的情形，至本报告期末（2022年06月30日）基金资产净值仍低于5000万元。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合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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：华富安福债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 34,019.86              | 88,734.85                |
| 结算备付金      |         | 30,672.84              | 42,478.50                |
| 存出保证金      |         | 695.15                 | 1,700.23                 |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 7,490,351.11           | 6,994,632.27             |
| 其中：股票投资    |         | 1,377,789.14           | 1,332,411.00             |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 6,112,561.97           | 5,662,221.27             |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 债权投资       |         | -                      | -                        |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：债券投资       |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                         | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                         | -                           |
| 应收清算款         |            | 48,270.13                 | -                           |
| 应收股利          |            | -                         | -                           |
| 应收申购款         |            | 2,070.72                  | 449.64                      |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                         | 28,449.36                   |
| 资产总计          |            | 7,606,079.81              | 7,156,444.85                |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                           |                             |
| 短期借款          |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | 600,000.00                | 100,000.00                  |
| 应付清算款         |            | -                         | 60.11                       |
| 应付赎回款         |            | 41,903.76                 | 7,956.67                    |
| 应付管理人报酬       |            | 3,672.22                  | 4,186.45                    |
| 应付托管费         |            | 1,049.22                  | 1,196.14                    |
| 应付销售服务费       |            | -                         | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 239.19                    | 474.73                      |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 46,548.72                 | 43,135.66                   |
| 负债合计          |            | 693,413.11                | 157,009.76                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 5,531,767.17              | 5,321,858.38                |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 1,380,899.53              | 1,677,576.71                |
| 净资产合计         |            | 6,912,666.70              | 6,999,435.09                |
| 负债和净资产总计      |            | 7,606,079.81              | 7,156,444.85                |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2496 元，基金份额总额 5,531,767.17 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华富安福债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 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                |
|-----|-----|------------------------|------------------------|
|     |     | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 |

|                            |              | 6 月 30 日    | 6 月 30 日    |
|----------------------------|--------------|-------------|-------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |              | -299,926.81 | 167,165.72  |
| 1. 利息收入                    |              | 462.44      | 29,064.08   |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.13     | 462.44      | 571.26      |
| 债券利息收入                     |              | -           | 28,492.82   |
| 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）          |              | -199,222.37 | 265,158.90  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14     | -198,920.50 | 27,607.74   |
| 基金投资收益                     |              | -           | -           |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15     | -7,618.19   | 233,668.75  |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.16     | -           | -           |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17     | -           | -           |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18     | -           | -           |
| 股利收益                       | 6.4.7.19     | 7,316.32    | 3,882.41    |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |              | -           | -           |
| 其他投资收益                     |              | -           | -           |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.20     | -101,278.46 | -127,149.25 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |              | -           | -           |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.21     | 111.58      | 91.99       |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |              | 55,944.77   | 75,651.30   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1   | 22,462.06   | 19,424.77   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2   | 6,417.73    | 5,549.98    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3   | -           | -           |
| 4. 投资顾问费                   | 6.4.10.2.1.1 | -           | -           |
| 5. 利息支出                    |              | 3,116.65    | 5,792.46    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |              | 3,116.65    | 5,792.46    |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22     | -           | -           |
| 7. 税金及附加                   |              | 28.93       | 25.09       |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23     | 23,919.40   | 44,859.00   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |              | -355,871.58 | 91,514.42   |
| 减：所得税费用                    |              | -           | -           |

|                   |  |             |           |
|-------------------|--|-------------|-----------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | -355,871.58 | 91,514.42 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -           | -         |
| 六、综合收益总额          |  | -355,871.58 | 91,514.42 |

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富安福债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |              |              |
|----------------------|---------------------------------------|--------|--------------|--------------|
|                      | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计        |
| 一、上期期末净资产(基金净值)      | 5,321,858.38                          | -      | 1,677,576.71 | 6,999,435.09 |
| 加：会计政策变更             | -                                     | -      | -            | -            |
| 前期差错更正               | -                                     | -      | -            | -            |
| 其他                   | -                                     | -      | -            | -            |
| 二、本期期初净资产(基金净值)      | 5,321,858.38                          | -      | 1,677,576.71 | 6,999,435.09 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 209,908.79                            | -      | -296,677.18  | -86,768.39   |
| （一）、综合收益总额           | -                                     | -      | -355,871.58  | -355,871.58  |
| （二）、本期基金份额交易产生的基     | 209,908.79                            | -      | 59,194.40    | 269,103.19   |



|  |                                 |        |              |              |
|--|---------------------------------|--------|--------------|--------------|
| 金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)                  |                                 |        |              |              |
| 其中:1. 基金申购款                              | 566,043.07                      | -      | 138,377.61   | 704,420.68   |
| 2. 基金赎回款                                 | -356,134.28                     | -      | -79,183.21   | -435,317.49  |
| (三)、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) | -                               | -      | -            | -            |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                               | -      | -            | -            |
| 四、本期末净资产(基金净值)                           | 5,531,767.17                    | -      | 1,380,899.53 | 6,912,666.70 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        |              |              |
|  | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计        |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 5,339,528.13                    | -      | 999,468.39   | 6,338,996.52 |
| 加:会计政策变更                                 | -                               | -      | -            | -            |
| 前期差错                                     | -                               | -      | -            | -            |

|  |               |   |             |               |
|--|---------------|---|-------------|---------------|
| 更正   |               |   |             |               |
| 其他   | -             | - | -           | -             |
| 二、本<br>期初<br>净<br>资<br>产(基<br>金<br>净<br>值)   | 5,339,528.13  | - | 999,468.39  | 6,338,996.52  |
| 三、本<br>期<br>增<br>减<br>变<br>动<br>额(减<br>少以“-<br>”<br>号<br>填<br>列)   | -951,017.10   | - | -88,133.48  | -1,039,150.58 |
| (一)、<br>综<br>合<br>收<br>益<br>总<br>额   | -             | - | 91,514.42   | 91,514.42     |
| (二)、<br>本<br>期<br>基<br>金<br>份<br>额<br>交<br>易<br>产<br>生<br>的<br>基<br>金<br>净<br>值<br>变<br>动<br>数<br>(净<br>值<br>减<br>少<br>以<br>“-”<br>号<br>填<br>列)                      | -951,017.10   | - | -179,647.90 | -1,130,665.00 |
| 其中:1.<br>基<br>金<br>申<br>购<br>款   | 159,816.84    | - | 31,491.91   | 191,308.75    |
| 2<br>.基<br>金<br>赎<br>回<br>款  | -1,110,833.94 | - | -211,139.81 | -1,321,973.75 |
| (三)、<br>本<br>期<br>向<br>基<br>金<br>份<br>额<br>持<br>有<br>人<br>分<br>配<br>利<br>润<br>产<br>生<br>的<br>基<br>金<br>净<br>值<br>变<br>动(净<br>值<br>减<br>少<br>以<br>“-”<br>号<br>填<br>列) | -             | - | -           | -             |

|                             |              |   |            |              |
|-----------------------------|--------------|---|------------|--------------|
| (四)、<br>其他综合收益<br>结转留存收益    | -            | - | -          | -            |
| 四、本期<br>期末净<br>资产(基<br>金净值) | 4,388,511.03 | - | 911,334.91 | 5,299,845.94 |

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：

赵万利

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

华富安福保本混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）从 2019 年 4 月 2 日转型为华富安福债券型证券投资基金。华富安福债券型证券投资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[2016]22 号）核准。基金合同于 2016 年 3 月 23 日生效。成立时本基金份额为 378,984,818.71 份。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（天健验（2016）6-53 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《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金的投资组合比例为：本基金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%；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。

### 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、经营成果和净资产变动等有关信息。

#### 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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本报告期所采用的其他会计政策、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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

##### 原金融工具准则 新金融工具准则

列报项目 计量类别 账面价值 列报项目 计量类别 账面价值

银行存款 摊余成本 88,734.85 银行存款 摊余成本 88,743.16

结算备付金 摊余成本 42,478.50 结算备付金 摊余成本 42,499.51

存出保证金 摊余成本 1,700.23 存出保证金 摊余成本 1,701.00

交易性金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益 6,994,632.27 交易性金融资产 以

公允价值计量且其变动计入当期损益 7,023,051.54

衍生金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益 衍生金融资产 以公允价值计量且其变动计入当期损益

买入返售金融资产 摊余成本 买入返售金融资产 摊余成本

应收利息 摊余成本 28,449.36 其他资产-应收利息 摊余成本

应收证券清算款 摊余成本 应收清算款 摊余成本

应收股利 摊余成本 应收股利 摊余成本

应收申购款 摊余成本 449.64 应收申购款 摊余成本 449.64

其他资产-持有至到期投资 摊余成本 债权投资 摊余成本

其他资产-其他应收款 摊余成本 其他资产-其他应收款 摊余成本

交易性金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 交易性金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益

衍生金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益 衍生金融负债 以公允价值计量且其变动计入当期损益

卖出回购金融资产款 摊余成本 100,000.00 卖出回购金融资产款 摊余成本 99,954.92

应付证券清算款 摊余成本 60.11 应付清算款 摊余成本 60.11

应付赎回款 摊余成本 7,956.67 应付赎回款 摊余成本 7,956.67

应付管理人报酬 摊余成本 4,186.45 应付管理人报酬 摊余成本 4,186.45

应付托管费 摊余成本 1,196.14 应付托管费 摊余成本 1,196.14

应付销售服务费 摊余成本 应付销售服务费 摊余成本

应交税费 摊余成本 474.73 应交税费 摊余成本 474.73

应付利润 摊余成本 应付利润 摊余成本

应付交易费用 摊余成本 4,175.75 其他负债-应付交易费用 摊余成本 4,175.75

应付利息 摊余成本 -45.08 其他负债-应付利息 摊余成本

其他负债-其他应付款 摊余成本 39,004.99 其他负债-其他应付款 摊余成本 39,004.99

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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重大变更。

#### 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)、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2014〕81 号)、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2016〕127 号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101 号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36 号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46 号)、《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56 号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90 号)及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

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

(四) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港

联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

主要税种及税率列示如下：

税种 计税依据 税率

增值税 以按税法规定计算的金融服务销售额 3%

城市维护建设税 实际缴纳的流转税税额 7%

教育费附加 实际缴纳的流转税税额 3%

地方教育附加 实际缴纳的流转税税额 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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 34,019.86              |
| 等于：本金          | 34,007.54              |
| 加：应计利息         | 12.32                  |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 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           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 34,019.86              |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |              |              |              |            |
|-------------------|------------------------|--------------|--------------|--------------|------------|
|                   | 成本                     | 应计利息         | 公允价值         | 公允价值变动       |            |
| 股票                | 1,363,176.01           | -            | 1,377,789.14 | 14,613.13    |            |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -            | -            | -            |            |
| 债券                | 交易所市场                  | 5,987,798.11 | 23,516.36    | 6,112,561.97 | 101,247.50 |
|                   | 银行间市场                  | -            | -            | -            | -          |

|        |    |              |           |              |            |
|--------|----|--------------|-----------|--------------|------------|
|        | 合计 | 5,987,798.11 | 23,516.36 | 6,112,561.97 | 101,247.50 |
| 资产支持证券 |    | -            | -         | -            | -          |
| 基金     |    | -            | -         | -            | -          |
| 其他     |    | -            | -         | -            | -          |
|        | 合计 | 7,350,974.12 | 23,516.36 | 7,490,351.11 | 115,860.63 |

#### 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 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 1.81              |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 2,287.51          |
| 其中：交易所市场    | 2,287.51          |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 应付审计费       | 34,959.40         |
| 中债账户维护费     | 4,500.00          |
| 上清账户维护费     | 4,800.00          |
| 合计          | 46,548.72         |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              |
|---------------|----------------------------|--------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额         |
| 上年度末          | 5,321,858.38               | 5,321,858.38 |
| 本期申购          | 566,043.07                 | 566,043.07   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -356,134.28                | -356,134.28  |
| 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           | 5,531,767.17 | 5,531,767.17 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 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      |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 本期期初           | 1,414,892.82 | 262,683.89  | 1,677,576.71 |
| 本期利润           | -254,593.12  | -101,278.46 | -355,871.58  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 45,315.96    | 13,878.44   | 59,194.40    |
| 其中：基金申购款       | 128,070.14   | 10,307.47   | 138,377.61   |
| 基金赎回款          | -82,754.18   | 3,570.97    | -79,183.21   |
| 本期已分配利润        | -            | -           | -            |
| 本期末            | 1,205,615.66 | 175,283.87  | 1,380,899.53 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 247.22                     |
| 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 | 204.37                     |
| 其他        | 10.85                      |
| 合计        | 462.44                     |

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -198,920.50                |
| 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               | -198,920.50                |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|            | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,868,809.87                    |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,062,117.10                    |
| 减：交易费用     | 5,613.27                        |
| 买卖股票差价收入   | -198,920.50                     |

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 29,225.02                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -36,843.21                 |
| 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                           | -7,618.19                  |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 4,011,782.14               |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,018,149.08               |
| 减：应计利息总额               | 29,861.05                  |
| 减：交易费用                 | 615.22                     |
| 买卖债券差价收入               | -36,843.21                 |

#### 6.4.7.12 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。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 7,316.32                              |

|               |          |
|---------------|----------|
| 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            | 7,316.32 |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | -101,278.46                     |
| 股票投资                   | 21,433.13                       |
| 债券投资                   | -122,711.59                     |
| 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                     | -101,278.46                     |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 111.58                          |
| 合计      | 111.58                          |

#### 6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 审计费用    | 4,959.40                        |
| 信息披露费   | -                               |
| 证券出借违约金 | -                               |
| 银行费用    | 60.00                           |
| 账户维护费   | 18,600.00                       |
| 其他      | 300.00                          |
| 合计      | 23,919.40                       |

注：“其他”为支付上清所查询费。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 华富基金管理有限公司           | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“建设银行”） | 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                     |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例(%) |
| 华安证券  | 2,091,979.55               | 56.70                   | 6,431,948.28                    | 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 华安证券  | 6,160,441.73               | 83.70                   | 8,384,901.90                    | 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1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 (%) | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) |
|------|---------------|--------------------|---------------|--------------------|
| 华安证券 | 10,500,000.00 | 50.60              | 61,100,000.00 | 100.00             |

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<br>2022年1月1日至2022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  | 2,358.09                        | 59.98          | 714.18   | 31.22            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>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  | 6,603.67                        | 100.00         | 2,888.55 | 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 22,462.06                  | 19,424.77                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 9,939.36                   | 8,117.88                        |

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.7% 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,417.73                   | 5,549.98                        |

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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）。

**6.4.10.3 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：本基金本报告期内及上年度可比期间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**

**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。

**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：本基金本报告期内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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |        | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        |
|--------------|----------------------------|--------|---------------------------------|--------|
|              | 期末余额                       | 当期利息收入 | 期末余额                            | 当期利息收入 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 34,019.86                  | 247.22 | 54,179.05                       | 140.28 |

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(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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，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 600,000.00 元，于 2022 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：本基金本报告期末和上年度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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 3,545,791.90      | 2,536,696.00        |
| AAA 以下 | 1,846,213.01      | 2,247,794.17        |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 5,392,004.91      | 4,784,490.17        |

#### 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<br>2022<br>年 6<br>月 30<br>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                            | 34,019.86  | -          | -            | -          | -          | -            | 34,019.86    |
| 结算备付金                           | 30,672.84  | -          | -            | -          | -          | -            | 30,672.84    |
| 存出保证金                           | 695.15     | -          | -            | -          | -          | -            | 695.15       |
| 交易性金融资产                         | 134,270.19 | 641,408.28 | 4,876,122.34 | 123,165.64 | 337,595.52 | 1,377,789.14 | 7,490,351.11 |
| 衍生金融资产                          | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 买入返售金融资产                        | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 债权投资                            | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应收股利                            | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应收                              | -          | -          | -            | -          | -          | 2,070.72     | 2,070.72     |

|           |            |            |              |            |            |              |              |
|-----------|------------|------------|--------------|------------|------------|--------------|--------------|
| 申购款       |            |            |              |            |            |              |              |
| 应收清算款     | -          | -          | -            | -          | -          | 48,270.13    | 48,270.13    |
| 其他资产      | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 资产总计      | 199,658.04 | 641,408.28 | 4,876,122.34 | 123,165.64 | 337,595.52 | 1,428,129.99 | 7,606,079.81 |
| 负债        |            |            |              |            |            |              |              |
| 应付赎回款     | -          | -          | -            | -          | -          | 41,903.76    | 41,903.76    |
| 应付管理人报酬   | -          | -          | -            | -          | -          | 3,672.22     | 3,672.22     |
| 应付托管费     | -          | -          | -            | -          | -          | 1,049.22     | 1,049.22     |
| 应付清算款     | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 卖出回购金融资产款 | 600,000.00 | -          | -            | -          | -          | -            | 600,000.00   |
| 应付销售服务费   | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应付投资顾问费   | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应付利润      | -          | -          | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应交税费      | -          | -          | -            | -          | -          | 239.19       | 239.19       |
| 其他负债      | -          | -          | -            | -          | -          | 46,548.72    | 46,548.72    |
| 负债总计      | 600,000.00 | -          | -            | -          | -          | 93,413.11    | 693,413.11   |

|                                   |             |              |              |            |            |              |              |
|-----------------------------------|-------------|--------------|--------------|------------|------------|--------------|--------------|
| 利率敏感<br>度缺口                       | -400,341.96 | 641,408.28   | 4,876,122.34 | 123,165.64 | 337,595.52 | 1,334,716.88 | 6,912,666.70 |
| 上年度末<br>2021<br>年 12<br>月 31<br>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                              | 88,734.85   | -            | -            | -          | -          | -            | 88,734.85    |
| 结算<br>备付<br>金                     | 42,478.50   | -            | -            | -          | -          | -            | 42,478.50    |
| 存出<br>保证<br>金                     | 1,700.23    | -            | -            | -          | -          | -            | 1,700.23     |
| 交易<br>性金<br>融资<br>产               | 410,706.70  | 1,452,255.80 | 2,735,696.17 | 594,954.20 | 468,608.40 | 1,332,411.00 | 6,994,632.27 |
| 买入<br>返售<br>金融<br>资产              | -           | -            | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应收<br>股利                          | -           | -            | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应收<br>申购<br>款                     | -           | -            | -            | -          | -          | 449.64       | 449.64       |
| 应收<br>证券<br>清算<br>款               | -           | -            | -            | -          | -          | -            | -            |
| 其他<br>资产                          | -           | -            | -            | -          | -          | 28,449.36    | 28,449.36    |
| 资产<br>总计                          | 543,620.28  | 1,452,255.80 | 2,735,696.17 | 594,954.20 | 468,608.40 | 1,361,310.00 | 7,156,444.85 |
| 负债                                |             |              |              |            |            |              |              |
| 应付<br>赎回<br>款                     | -           | -            | -            | -          | -          | 7,956.67     | 7,956.67     |

|           |            |              |              |            |            |              |              |
|-----------|------------|--------------|--------------|------------|------------|--------------|--------------|
| 应付管理人报酬   | -          | -            | -            | -          | -          | 4,186.45     | 4,186.45     |
| 应付托管费     | -          | -            | -            | -          | -          | 1,196.14     | 1,196.14     |
| 应付证券清算款   | -          | -            | -            | -          | -          | 60.11        | 60.11        |
| 卖出回购金融资产款 | 100,000.00 | -            | -            | -          | -          | -            | 100,000.00   |
| 应付销售服务费   | -          | -            | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应付利润      | -          | -            | -            | -          | -          | -            | -            |
| 应交税费      | -          | -            | -            | -          | -          | 474.73       | 474.73       |
| 其他负债      | -          | -            | -            | -          | -          | 43,135.66    | 43,135.66    |
| 负债总计      | 100,000.00 | -            | -            | -          | -          | 57,009.76    | 157,009.76   |
| 利率敏感度缺口   | 443,620.28 | 1,452,255.80 | 2,735,696.17 | 594,954.20 | 468,608.40 | 1,304,300.24 | 6,999,435.09 |

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（2022年6月30日）             | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 市场利率下降 25 基点      | 54,446.50                   | 50,676.88         |

|  |              |            |            |
|--|--------------|------------|------------|
|  | 市场利率上升 25 基点 | -51,300.82 | -50,676.88 |
|--|--------------|------------|------------|

#### 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<br>2022年6月30日 |               | 上年度末<br>2021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  | 1,377,789.14      | 19.93         | 1,332,411.00        | 19.04         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 6,112,561.97      | 88.43         | 5,662,221.27        | 80.90         |
| 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            | 7,490,351.11      | 108.36        | 6,994,632.27        | 99.93         |

##### 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（2022年6月30日）             | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 沪深 300 指数上升百分之五          | 27,589.28                   | -17,090.96        |
|    | 沪深 300 指数下降百分之五          | -27,589.28                  | 17,090.96         |

#### 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<br>(单位：人民币元) | 本期末（2022 年 6 月<br>30 日） | 上年度末（2021 年<br>12 月 31 日） |
|    | 合计                | 1,705,029.72            | 7,347,690.76              |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 6,182,024.89           | 5,521,946.97             |
| 第二层次          | 1,308,326.22           | 1,472,685.30             |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 7,490,351.11           | 6,994,632.27             |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 06 月

30 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 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              | 1,377,789.14 | 18.11         |
|    | 其中：股票             | 1,377,789.14 | 18.11         |
| 2  | 基金投资              | -            | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 6,112,561.97 | 80.36         |
|    | 其中：债券             | 6,112,561.97 | 80.36         |
|    | 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 | -            | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 64,692.70    | 0.85          |
| 8  | 其他各项资产            | 51,036.00    | 0.67          |
| 9  | 合计                | 7,606,079.81 | 100.00        |

注：本表列示的其他各项资产详见 7.11.3 期末其他各项资产构成。

### 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         | 114,352.00 | 1.65          |
| B  | 采矿业              | -          | -             |
| C  | 制造业              | 951,237.50 | 13.76         |
| 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           | 62,600.00  | 0.91          |

|   |                 |              |       |
|---|-----------------|--------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 70,020.00    | 1.01  |
| H | 住宿和餐饮业          | -            | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 179,579.64   | 2.60  |
| J | 金融业             | -            | -     |
| 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              | 1,377,789.14 | 19.93 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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  | 600406 | 国电南瑞 | 3,860 | 104,220.00 | 1.51         |
| 2  | 002271 | 东方雨虹 | 2,000 | 102,940.00 | 1.49         |
| 3  | 600600 | 青岛啤酒 | 800   | 83,136.00  | 1.20         |
| 4  | 000596 | 古井贡酒 | 300   | 74,898.00  | 1.08         |
| 5  | 300973 | 立高食品 | 700   | 72,765.00  | 1.05         |
| 6  | 688599 | 天合光能 | 1,109 | 72,362.25  | 1.05         |
| 7  | 601021 | 春秋航空 | 1,200 | 70,020.00  | 1.01         |
| 8  | 603345 | 安井食品 | 400   | 67,148.00  | 0.97         |
| 9  | 603233 | 大参林  | 2,000 | 62,600.00  | 0.91         |
| 10 | 688408 | 中信博  | 650   | 60,112.00  | 0.87         |
| 11 | 600598 | 北大荒  | 4,000 | 59,040.00  | 0.85         |
| 12 | 688187 | 时代电气 | 899   | 58,426.01  | 0.85         |
| 13 | 603517 | 绝味食品 | 900   | 52,038.00  | 0.75         |
| 14 | 603786 | 科博达  | 800   | 49,256.00  | 0.71         |
| 15 | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,400 | 48,328.00  | 0.70         |
| 16 | 600460 | 士兰微  | 900   | 46,800.00  | 0.68         |
| 17 | 300122 | 智飞生物 | 400   | 44,404.00  | 0.64         |
| 18 | 300450 | 先导智能 | 700   | 44,226.00  | 0.64         |
| 19 | 002475 | 立讯精密 | 1,300 | 43,927.00  | 0.64         |
| 20 | 688111 | 金山办公 | 221   | 43,563.52  | 0.63         |



|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 21 | 688777 | 中控技术 | 437   | 31,796.12 | 0.46 |
| 22 | 688357 | 建龙微纳 | 271   | 30,471.24 | 0.44 |
| 23 | 300498 | 温氏股份 | 1,300 | 27,677.00 | 0.40 |
| 24 | 002714 | 牧原股份 | 500   | 27,635.00 | 0.40 |

#### 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  | 300059 | 东方财富  | 201,178.80 | 2.87           |
| 2  | 600808 | 马钢股份  | 179,607.00 | 2.57           |
| 3  | 688599 | 天合光能  | 132,679.97 | 1.90           |
| 4  | 000069 | 华侨城 A | 104,116.00 | 1.49           |
| 5  | 002271 | 东方雨虹  | 94,780.00  | 1.35           |
| 6  | 600600 | 青岛啤酒  | 75,672.00  | 1.08           |
| 7  | 300973 | 立高食品  | 68,592.00  | 0.98           |
| 8  | 300498 | 温氏股份  | 68,134.00  | 0.97           |
| 9  | 000977 | 浪潮信息  | 65,845.00  | 0.94           |
| 10 | 601238 | 广汽集团  | 63,824.28  | 0.91           |
| 11 | 603233 | 大参林   | 62,515.60  | 0.89           |
| 12 | 600598 | 北大荒   | 62,320.00  | 0.89           |
| 13 | 601021 | 春秋航空  | 61,560.00  | 0.88           |
| 14 | 603345 | 安井食品  | 59,992.00  | 0.86           |
| 15 | 688408 | 中信博   | 58,841.85  | 0.84           |
| 16 | 688187 | 时代电气  | 54,798.22  | 0.78           |
| 17 | 600031 | 三一重工  | 53,482.00  | 0.76           |
| 18 | 605108 | 同庆楼   | 52,755.00  | 0.75           |
| 19 | 688111 | 金山办公  | 50,207.20  | 0.72           |
| 20 | 300450 | 先导智能  | 48,090.00  | 0.69           |

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  | 300059 | 东方财富  | 210,891.30 | 3.01           |
| 2  | 600808 | 马钢股份  | 157,824.00 | 2.25           |
| 3  | 000001 | 平安银行  | 120,028.00 | 1.71           |
| 4  | 300763 | 锦浪科技  | 85,696.00  | 1.22           |
| 5  | 000069 | 华侨城 A | 84,000.00  | 1.20           |
| 6  | 000776 | 广发证券  | 70,337.00  | 1.00           |
| 7  | 600036 | 招商银行  | 65,716.00  | 0.94           |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 8  | 601688 | 华泰证券 | 65,440.00 | 0.93 |
| 9  | 601238 | 广汽集团 | 62,891.92 | 0.90 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 55,734.00 | 0.80 |
| 11 | 600132 | 重庆啤酒 | 52,936.00 | 0.76 |
| 12 | 688599 | 天合光能 | 52,666.43 | 0.75 |
| 13 | 603986 | 兆易创新 | 52,272.00 | 0.75 |
| 14 | 300498 | 温氏股份 | 50,097.00 | 0.72 |
| 15 | 601669 | 中国电建 | 48,896.00 | 0.70 |
| 16 | 000977 | 浪潮信息 | 47,286.00 | 0.68 |
| 17 | 605108 | 同庆楼  | 46,810.00 | 0.67 |
| 18 | 600031 | 三一重工 | 45,254.00 | 0.65 |
| 19 | 002714 | 牧原股份 | 44,999.00 | 0.64 |
| 20 | 603359 | 东珠生态 | 43,200.00 | 0.62 |

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 | 2,086,062.11 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,868,809.87 |

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      | 709,412.74   | 10.26        |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 5,403,149.23 | 78.16        |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 6,112,561.97 | 88.43        |

#### 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  | 113044 | 大秦转债     | 4,710 | 513,663.57 | 7.43         |
| 2  | 110079 | 杭银转债     | 3,890 | 487,348.58 | 7.05         |
| 3  | 132015 | 18 中油 EB | 4,540 | 475,747.84 | 6.88         |
| 4  | 110053 | 苏银转债     | 3,110 | 391,796.18 | 5.67         |
| 5  | 019641 | 20 国债 11 | 3,630 | 371,817.22 | 5.38         |

#### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、光大银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、成都银行股份有限公司在本报告期内出现被监管部门处罚，或在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内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。

##### 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 | 695.15    |
| 2  | 应收清算款 | 48,270.13 |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 2,070.72  |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |

|   |    |           |
|---|----|-----------|
| 8 | 其他 | -         |
| 9 | 合计 | 51,036.00 |

## 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  | 113044 | 大秦转债     | 513,663.57 | 7.43          |
| 2  | 110079 | 杭银转债     | 487,348.58 | 7.05          |
| 3  | 132015 | 18 中油 EB | 475,747.84 | 6.88          |
| 4  | 110053 | 苏银转债     | 391,796.18 | 5.67          |
| 5  | 113620 | 傲农转债     | 332,148.58 | 4.80          |
| 6  | 113011 | 光大转债     | 232,872.90 | 3.37          |
| 7  | 113042 | 上银转债     | 184,932.51 | 2.68          |
| 8  | 110075 | 南航转债     | 163,609.37 | 2.37          |
| 9  | 123117 | 健帆转债     | 144,778.89 | 2.09          |
| 10 | 113637 | 华翔转债     | 136,883.95 | 1.98          |
| 11 | 123107 | 温氏转债     | 129,980.08 | 1.88          |
| 12 | 127015 | 希望转债     | 123,169.06 | 1.78          |
| 13 | 132018 | G 三峡 EB1 | 123,165.64 | 1.78          |
| 14 | 128129 | 青农转债     | 113,401.92 | 1.64          |
| 15 | 127005 | 长证转债     | 79,859.16  | 1.16          |
| 16 | 123099 | 普利转债     | 69,250.11  | 1.00          |
| 17 | 123060 | 苏试转债     | 68,705.75  | 0.99          |
| 18 | 113626 | 伯特转债     | 67,925.81  | 0.98          |
| 19 | 123114 | 三角转债     | 67,524.08  | 0.98          |
| 20 | 113016 | 小康转债     | 66,819.00  | 0.97          |
| 21 | 127045 | 牧原转债     | 65,789.92  | 0.95          |
| 22 | 113516 | 苏农转债     | 65,727.64  | 0.95          |
| 23 | 127030 | 盛虹转债     | 64,607.20  | 0.93          |
| 24 | 123071 | 天能转债     | 63,702.98  | 0.92          |
| 25 | 127050 | 麒麟转债     | 61,981.35  | 0.90          |
| 26 | 128137 | 洁美转债     | 61,595.98  | 0.89          |
| 27 | 123078 | 飞凯转债     | 61,363.46  | 0.89          |
| 28 | 113017 | 吉视转债     | 60,722.90  | 0.88          |
| 29 | 113037 | 紫银转债     | 58,173.40  | 0.84          |
| 30 | 123073 | 同和转债     | 52,745.34  | 0.76          |
| 31 | 128111 | 中矿转债     | 51,154.96  | 0.74          |
| 32 | 113025 | 明泰转债     | 47,976.54  | 0.69          |
| 33 | 128095 | 恩捷转债     | 43,302.68  | 0.63          |
| 34 | 113582 | 火炬转债     | 33,479.14  | 0.48          |
| 35 | 110074 | 精达转债     | 24,671.58  | 0.36          |
| 36 | 110081 | 闻泰转债     | 7,391.04   | 0.11          |
| 37 | 110080 | 东湖转债     | 1,182.98   | 0.02          |

|    |        |       |          |      |
|----|--------|-------|----------|------|
| 38 | 127025 | 冀东转债  | 1,147.99 | 0.02 |
| 39 | 113631 | 皖天转债  | 1,142.93 | 0.02 |
| 40 | 123108 | 乐普转 2 | 1,138.02 | 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>(%) | 持有份额         | 占总份额比例<br>(%) |
| 325          | 17,020.82     | 198,019.80 | 3.58          | 5,333,747.37 | 96.42         |

### 8.2 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 | 1,933.28   | 0.0349       |

### 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

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                     |               |
|-------------------------------------|---------------|
| 基金合同生效日 (2019 年 4 月 2 日) 基<br>金份额总额 | 35,847,544.24 |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 5,321,858.38  |
| 本报告期基金总申购份额                         | 566,043.07    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 356,134.28    |
| 本报告期基金拆分变动份额                        | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 5,531,767.17  |

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. 本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。
2. 本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 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      | 2,091,979.55 | 56.70            | 2,358.09  | 59.98          | -  |
| 国泰君安 | 1      | 1,150,359.05 | 31.18            | 1,156.53  | 29.42          | -  |
| 申港证券 | 1      | 447,530.30   | 12.13            | 416.80    | 10.60          | -  |
| 国联证券 | 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)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。

3) 本报告期本基金交易单元没有发生变化。

### 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 | 6,160,441.73 | 83.70            | 10,500,000.00 | 50.60              | -    | -                |
| 国泰君安 | 860,263.70   | 11.69            | 10,200,000.00 | 49.16              | -    | -                |
| 申港证券 | 339,754.32   | 4.62             | 50,000.00     | 0.24               | -    | -                |
| 国联证券 | -            | -                | -             | -                  | -    | -                |

注：债券交易的成交金额按净价统计，其中交易所上市实行全价交易的债券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公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告 | 中国证监会指定媒介 | 2022 年 1 月 5 日  |
| 2  | 华富基金管理有限公司旗下基金 2021 年第四季度报告提示性公告     | 中国证监会指定媒介 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 3  | 华富安福债券型证券投资基金 2021 年第四季度报告           | 中国证监会指定媒介 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 4  | 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 | 2022 年 1 月 29 日 |
| 5  | 华富基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告       | 中国证监会指定媒介 | 2022 年 3 月 31 日 |
| 6  | 华富安福债券型证券投资基金 2021 年度报告              | 中国证监会指定媒介 | 2022 年 3 月 31 日 |
| 7  | 华富安福债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告         | 中国证监会指定媒介 | 2022 年 4 月 22 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|------|----------------|------------|
|      |                |            |

| 别      | 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(%) |
|--------|----|------------------------|------|------|------|------|---------|
| 产品特有风险 |    |                        |      |      |      |      |         |
| 无      |    |                        |      |      |      |      |         |

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

2022 年 8 月 31 日