

华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 3 月 29 日起至 2022 年 06 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	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	39
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	39
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	39
7.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.11	投资组合报告附注	39
§ 8	基金份额持有人信息	40
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	41
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	41
§ 9	开放式基金份额变动	41
§ 10	重大事件揭示	41
10.1	基金份额持有人大会决议	41
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8	其他重大事件	43
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12	备查文件目录	44
12.1	备查文件目录	44
12.2	存放地点	44
12.3	查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	华富富鑫一年定期开放债券型发起式
基金主代码	014475
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2022 年 3 月 29 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,610,998,000.00 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	<p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>本基金通过合理灵活的资产配置策略，同时结合固定收益资产投资策略等积极把握中国经济增长和债券市场发展机遇，在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金综合考量经济长期发展趋势、宏观经济周期变动、相关政策导向、利率水平等并结合各类资产的风险收益特征和当前估值水平等因素，决定各类资产配置比例，并随着上述因素的变化而适时调整配置比例。</p> <p>本基金在基金合同约定的各类资产配置范围内，根据上述资产配置策略，进行各类资产配置。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>本基金通过久期配置、期限结构配置、类属资产配置、息差策略等多方面进行固定收益类资产的投资管理。</p> <p>1) 久期配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济周期变化和当前利率水平，预测后续收益率曲线变动趋势，并据此调整固定收益类资产的组合久期，以期在利率水平变动时获得正收益。</p> <p>2) 期限结构配置策略</p> <p>本基金根据收益率曲线变动趋势和组合既定久期，在长期、中期和短期之间调整不同期限品种的的配置比例，力争在收益率曲线变动时获得正收益。</p> <p>3) 类属资产配置策略</p> <p>本基金将根据不同类型固定收益类资产的风险收益特征及相应收益率曲线变动趋势，调整利率债、信用债、资产支持证券等各类固定收益类资产的配置比例。</p> <p>4) 信用债投资策略</p>

	<p>信用债收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险的信用利差，因此信用风险与债券价值的平衡是信用债投资的核心。因此，一方面，本基金根据宏观经济周期变动和行业研究评估信用利差；另一方面，本基金还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，即采用内外结合的信用研究和评级制度，研究信用债发行主体的基本面和实际信用风险。本基金高度重视控制信用债的信用风险和流动性风险，发挥基金管理人宏观经济研究和信用研究的专业性，精选优质信用债。</p> <p>本基金买入信用债的信用评级不得低于 AA。其中投资于信用评级为 AA 的信用债比例不高于信用债资产的 20%，投资于信用评级为 AA+ 的信用债比例不高于信用债资产的 70%，投资于信用评级为 AAA 的信用债比例不低于信用债资产的 30%。其中金融债（不含政策性金融债）、政府支持机构债券、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中期票据、次级债等信用评级依照评级机构出具的债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体评级，本基金投资的信用债如果没有债项评级，则参照主体评级。</p> <p>基金持有信用债期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。</p> <p>5) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金从信用债投资角度考察资产支持证券的信用风险和流动性风险，同时研究资产支持证券的收益结构和特殊条款等，本基金将严格控制资产支持证券的投资总量并进行分散投资。</p> <p>6) 息差策略</p> <p>债券回购成本往往低于更长期限债券的收益率，为息差策略提供了可行性。本基金根据对回购成本的预判，选择适当的杠杆比率，谨慎实施息差策略。</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*90%+一年定期存款利率（税后）*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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	满志弘	李真
	联系电话	021-68886996	021-52629999-212051
	电子邮箱	manzh@hffund.com	ztgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95561
传真		021-68887997	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	赵万利	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼
会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号新湖商贸大厦 6 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 3 月 29 日(基金合同生效日) - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	11,228,147.59
本期利润	15,363,572.49
加权平均基金份额本期利润	0.0095
本期加权平均净值利润率	0.95%
本期基金份额净值增长率	0.95%
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	7,200,652.59
期末可供分配基金份额利润	0.0045
期末基金资产净值	1,622,334,077.49
期末基金份额净值	1.0070
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	0.95%

注：1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2) 以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

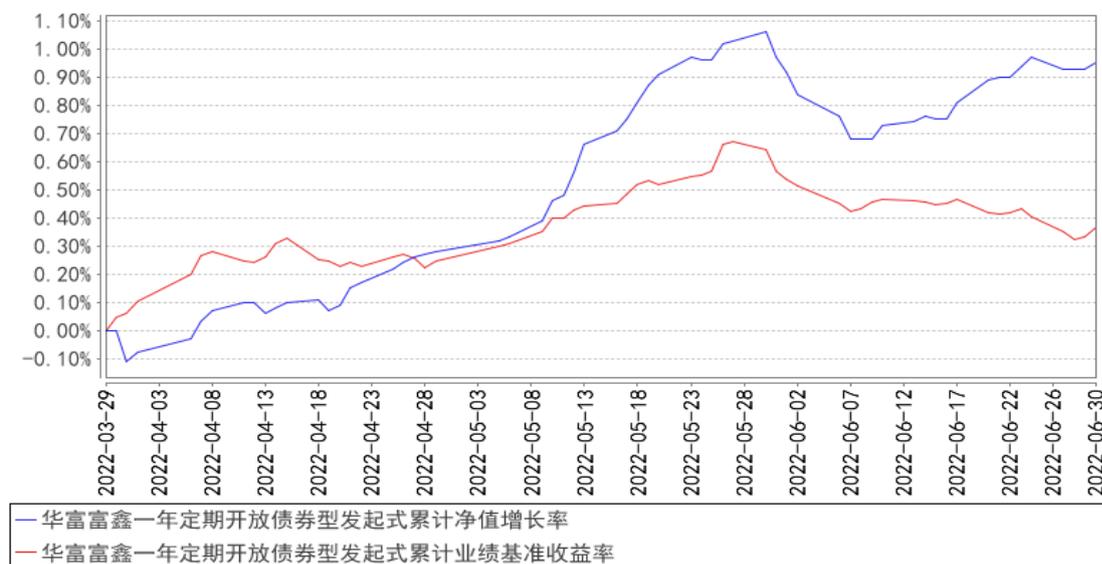
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.02%	0.04%	-0.20%	0.02%	0.18%	0.02%
过去三个月	1.06%	0.04%	0.30%	0.03%	0.76%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.95%	0.04%	0.36%	0.03%	0.59%	0.01%

注：

本基金业绩比较基准收益率=中债综合全价指数收益率*90%+一年定期存款利率(税后)*10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华富富鑫一年定期开放债券型发起式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《华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本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%，但应开放期流动性需求，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 1 个月、开放期及开放期结束后 1 个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但开放期内本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法

规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本报告期内，本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2022 年 3 月 29 日至 2022 年 9 月 28 日，本报告期末仍处于建仓期内。本报告期内，本基金严格执行了《华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用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		
倪莉莎	本基金的基金经理	2022 年 3 月 29 日	-	八年	英国曼彻斯特大学管理学硕士，研究生学历。2014 年 2 月加入华富基金管理有限公司，曾任集中交易部助理交易员、交易员，固定收益部基金经理助理，自 2018 年 3 月 29 日起任华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 11 月 20 日起任华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 5 日起任华富货币市场基金基金经理，自 2019 年 10 月 31 日起任华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 16 日起任华富天盈货币市场基金基金经理，自 2021 年 11 月 8 日起任华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 1 日起任华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 27 日起任华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，自 2022 年 3 月 29 日起任华富富鑫一年定期开放债券型发起式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 年上半年无论国内国外的宏观经济基本面都经历了大起大落的起伏以及频发的黑天鹅事件冲击。国内受疫情反复影响，经济短期面临巨大的下行压力，之后逐渐步入弱复苏阶段，但依然受到地产下行、消费萎靡等需求端压力，复苏进度缓慢力度偏弱。海外则是与国内相反的经济周期演变，年初强劲的疫后复苏使得通胀高企，在俄乌冲突等黑天鹅事件冲击下，通胀屡创新高，在二季度将海外经济带入衰退周期。

资本市场表现上，A 股上半年的表现可以说基本反应了宏观经济面的情况。年初各大指数在短时间内快速大幅下跌，尤其以偏成长风格的高估值板块跌幅靠前，在 4 月末达到了本轮 A 股行情的最低点，5-6 月随着国内疫情得到控制，A 股才开启超跌反弹行情，这波反弹中也以前期跌幅居前的成长板块，特别是新能源板块为反弹主力。相反的，债券市场则依然延续 18 年以来的牛市行情，在震荡中利率中枢逐步下探，在非常规宽松的货币政策支持下，短端利率水平下行幅度远远超过中长端，利率曲线快速走陡，同时票息策略为主的信用债表现也远远好于久期策略为主的利率债，使得各个期限的信用利差也快速压缩，均来到了历史极值附近。

本基金全年以中高等级信用债为底仓，维持中性久期，结合长久期利率债波动操作以获趋利率波动中的资本利得。

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 1.0070 元，累计份额净值为 1.0095 元。报告期，本基金份额净值增长率为 0.95%，同期业绩比较基准收益率为 0.36 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，市场焦点集中在国内经济恢复的高度和节奏、海外通胀顶点的到来以及随之而来的海外经济衰退幅度。权益市场已经回到了上海疫情前的位置，基本上 5-6 月完成了对上海疫情的这段深坑的超跌反弹，后续预计将重新回到结构性行情中，随着大宗商品价格的回落，更加看好边际成本改善的制造业以及国内疫后大消费复苏方向，7 月面临半年报披露窗口，个券选择上要更加看重二季度业绩和基本面上。债券市场在货币政策流动性宽松的呵护下大幅下跌的概率较低，以票息配置为主，适当关注长端无风险利率超跌的机会。

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《华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 15,363,572.49 元，本报告期共实施一次利润分配，分配金额为 4,027,495.00 元。期末可供分配利润为 7,200,652.59 元。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人

利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金

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 2022 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	4,773,741.26
结算备付金		12,013,079.02
存出保证金		100,577.71
交易性金融资产	6.4.7.2	1,726,198,183.16
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,726,198,183.16
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	100,007,697.26
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		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		1,843,093,278.41
负债和净资产	附注号	本期末 2022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		220,046,109.58
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		400,288.19
应付托管费		133,429.43
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		98,611.05
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	80,762.67
负债合计		220,759,200.92
净资产:		
实收基金	6.4.7.10	1,610,998,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	11,336,077.49
净资产合计		1,622,334,077.49
负债和净资产总计		1,843,093,278.41

注：本基金合同生效日为 2022 年 03 月 29 日，本报告期自基金合同生效日 2022 年 03 月 29 日起至 2022 年 06 月 30 日止。报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0070 元，基金份额总额 1,610,998,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年3月29日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
一、营业总收入		18,318,243.29

1. 利息收入		836,070.92
其中：存款利息收入	6.4.7.13	107,330.08
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		728,740.84
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,346,747.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	13,346,747.47
资产支持证券投资	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	-
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	4,135,424.90
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	-
减：二、营业总支出		2,954,670.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,237,569.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	412,523.30
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		1,195,592.82
其中：卖出回购金融资产支出		1,195,592.82
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		30,608.38
8. 其他费用	6.4.7.23	78,376.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,363,572.49
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,363,572.49
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		15,363,572.49

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月29日（基金合同生效日）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)	1,610,998,000.00	-	-	1,610,998,000.00
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)	1,610,998,000.00	-	-	1,610,998,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	11,336,077.49	11,336,077.49
(一)、综合收益总额	-	-	15,363,572.49	15,363,572.49
(二)、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)	-	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-

(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)	-	-	-4,027,495.00	-4,027,495.00
(四)、 其他综合 收益结转 留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	1,610,998,000.00	-	11,336,077.49	1,622,334,077.49

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：

<u>赵万里</u>	<u>曹华玮</u>	<u>邵恒</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金（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）《关于准予华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的批复》（证监许可[2021]3739号）准予募集注册，基金合同于2022年3月29日生效。本基金为契约型、定期开放式基金，存续期限不定。设立时募集资金到位情况已经天健会计师事务所审验，并由其出具《验证报告》（天健验〔2022〕6-13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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华富富鑫一年定期开放债券型发起式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，包括债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府

支持机构债券、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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%,但应开放期流动性需求,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前 1 个月、开放期及开放期结束后 1 个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但开放期内本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

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

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。本财务报表所载财务信息的会计期间为 2022 年 3 月 29 日(基金合同生效日)起至 2022 年 6 月 30 日止。

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

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：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。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。对曾经实施份额拆分的基金由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。对曾经实施份额折算的基金由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行

价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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则按直线法计算。

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。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 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 2022年6月30日
活期存款	4,773,741.26
等于：本金	4,772,796.91
加：应计利息	944.35
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	4,773,741.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,370,671,546.06	13,807,989.04	1,388,574,989.04	4,095,453.94
	银行间市场	336,628,029.04	955,194.12	337,623,194.12	39,970.96
	合计	1,707,299,575.10	14,763,183.16	1,726,198,183.16	4,135,424.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,707,299,575.10	14,763,183.16	1,726,198,183.16	4,135,424.90	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	100,007,697.26	-
合计	100,007,697.26	-

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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,836.25
其中：交易所市场	-
银行间市场	3,836.25
应付利息	-
应付审计费	20,288.02
中债账户维护费	4,500.00
应付信息披露费	47,338.40
上清账户维护费	4,800.00
合计	80,762.67

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,610,998,000.00	1,610,998,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	1,610,998,000.00	1,610,998,000.00

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	11,228,147.59	4,135,424.90	15,363,572.49
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-4,027,495.00	-	-4,027,495.00
本期末	7,200,652.59	4,135,424.90	11,336,077.49

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月29日（基金合同生效日）至2022年6月30日
活期存款利息收入	60,173.30
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	46,828.96
其他	327.82
合计	107,330.08

6.4.7.10 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

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
	2022年3月29日（基金合同生效日）至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	12,068,831.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,277,915.96
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	13,346,747.47

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 2022年3月29日（基金合同生效日）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	527,972,705.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	517,745,782.20
减：应计利息总额	8,942,006.58
减：交易费用	7,000.48
买卖债券差价收入	1,277,915.96

6.4.7.11.3 债券投资收益——申购差价收入

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

注：本基金本报告期内无股利收益。

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3月29日（基金合同生效日）至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	4,135,424.90
股票投资	-
债券投资	4,135,424.90
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	4,135,424.90

6.4.7.17 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

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 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	20,288.02
信息披露费	47,338.40
证券出借违约金	-
银行费用	1,450.00
账户维护费	9,300.00
合计	78,376.42

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 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	1,832,238,200.00	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 2022 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 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	7,552,210,000.00	100.00

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.30%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 2022 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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

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。

6.4.10.5 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年6月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
兴业银行股份有限公司资金营运中心	1,599,999,000.00	99.32
华安证券股份有限公司	10,999,000.00	0.68

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

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 2022年3月29日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	4,773,741.26	60,173.30

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

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每10份 基金份 额分红 数	现金形式 发放总额	再投资 形式 发放总 额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022年	-	2022年	0.0250	4,027,495.00	-	4,027,495.00	-

	6 月 22 日		6 月 22 日					
合计	-	-	-	0.0250	4,027,495.00	-	4,027,495.00	-

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：本基金没有因认购新发/增发证券而于本报告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债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 220,046,109.58 元，于 2022 年 7 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	20,018,000.00
合计	20,018,000.00

注：本基金基金合同于 2022 年 3 月 29 日生效，无上年度可比期间。

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。本基金基金合同于 2022 年 3 月 29 日生效，无上年度可比期间。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	146,625,000.00
合计	146,625,000.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日
AAA	1,495,107,000.00
AAA 以下	69,703,000.00
未评级	-
合计	1,564,810,000.00

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。本基金基金合同于 2022 年 3 月 29 日生效，无上年度可比期间。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日
AAA	146,625,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	146,625,000.00

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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	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

2022年6月30日							
资产							
银行存款	4,773,741.26	-	-	-	-	-	-4,773,741.26
结算备付金	12,013,079.02	-	-	-	-	-	12,013,079.02
存出保证金	100,577.71	-	-	-	-	-	100,577.71
交易性金融资产	20,093,480.55	-	207,338,404.53	1,498,766,298.08	-	-	1,726,198,183.16
买入返售金融资产	100,007,697.26	-	-	-	-	-	100,007,697.26
资产总计	136,988,575.80	-	207,338,404.53	1,498,766,298.08	-	-	1,843,093,278.41
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-400,288.19	400,288.19
应付托管费	-	-	-	-	-	-133,429.43	133,429.43
卖出回购金融资产款	220,046,109.58	-	-	-	-	-	220,046,109.58
应交税费	-	-	-	-	-	-98,611.05	98,611.05
其他负债	-	-	-	-	-	-80,762.67	80,762.67
负债总计	220,046,109.58	-	-	-	-	-713,091.34	220,759,200.92
利率敏感度缺口	-83,057,533.78	-	207,338,404.53	1,498,766,298.08	-	-713,091.34	1,622,334,074.49

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）
分析	市场利率下降 25 基点	11,807,950.78
	市场利率上升 25 基点	-11,754,654.42

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 2022 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	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,726,198,183.16	106.40
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	1,726,198,183.16	106.40

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本期及上期末股票类权益资产占基金资产净值的比例为 0%，因此若除利率和汇率外的其他市场因素变化导致本基金持有的权益性工具的公允价值变动 5%而其他市场变量保持不变，则本基金资产净值不会发生重大变动。

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 (95%)	
	2. 观察期 (1 年)	
	—	
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末 (2022 年 6 月 30 日)
	合计	13,473,573.26

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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	1,726,198,183.16
第三层次	-
合计	1,726,198,183.16

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,726,198,183.16	93.66
	其中：债券	1,726,198,183.16	93.66
	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	100,007,697.26	5.43
	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	16,786,820.28	0.91
8	其他各项资产	100,577.71	0.01
9	合计	1,843,093,278.41	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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

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

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,489,311,800.00	91.80
5	企业短期融资券	20,093,480.55	1.24
6	中期票据	69,752,121.10	4.30
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	147,040,781.51	9.06
9	其他	-	-
10	合计	1,726,198,183.16	106.40

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

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	185497	22 临港 G1	1,600,000	162,454,838.35	10.01
2	185466	22 远发 01	1,500,000	151,769,794.52	9.36
3	149789	22 申证 01	1,500,000	151,422,082.19	9.33
4	112209108	22 浦发银行 CD108	1,500,000	147,040,781.51	9.06
5	188736	21 国君 12	1,200,000	123,408,992.88	7.61

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，国泰君安证券股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司出现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	100,577.71
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,577.71

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
2	805,499,000.00	1,610,998,000.00	100.00	0.00	0.00

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	0.00	0.0000

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 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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额 占基金总 份 额比例 (%)	发起份 额总数	发起份 额占 基金总份 额 比例(%)	发起份 额承 诺持有期 限
基金管理人固有资 金	0.00	0	0.00	0	-
基金管理人高级管 理人员	0.00	0	0.00	0	-
基金经理等人员	0.00	0	0.00	0	-
基金管理人股东	10,999,000.00	0.68	10,999,000.00	0.68	三年
其他	0.00	0	0.00	0	-
合计	10,999,000.00	0.68	10,999,000.00	0.68	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年3月29日） 基金份额总额	1,610,998,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,610,998,000.00

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 (%)	
安信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	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) 本报告期本基金新成立，所有席位均为新增。

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 (%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	1,832,238,200.00	100.00	7,552,210,000.00	100.00	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

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	华富富鑫一年定期开放债券型发起式基金净值日报 2022-06-22 更正公告	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 23 日
2	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年第一次分红公告	中国证监会指定媒介	2022 年 6 月 21 日
3	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 30 日
4	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 30 日
5	关于华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 29 日
6	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 25 日
7	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 25 日
8	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 25 日
9	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 25 日
10	华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 25 日
11	华富富鑫一年定期开放债券型发起式	中国证监会指定媒介	2022 年 3 月 25 日

证券投资基金基金份额发售公告	
----------------	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022.3.29-2022.6.30	1,599,999,000.00	0.00	0.00	1,599,999,000.00	99.3200
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 2、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
- 3、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富富鑫一年定期开放债券型发起式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