

华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证 券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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 基金管理人及基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 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 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 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遵规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 41 |
| 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 | 41 |
| 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 | 41 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 41 |

| | |
|--|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 42 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 42 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 43 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 43 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 43 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 43 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 43 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 44 |
| § 10 重大事件揭示..... | 44 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 44 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 44 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 44 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 44 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 45 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 45 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 45 |
| 10.8 其他重大事件..... | 46 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 46 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 46 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 46 |
| § 12 备查文件目录..... | 46 |
| 12.1 备查文件目录..... | 46 |
| 12.2 存放地点..... | 47 |
| 12.3 查阅方式..... | 47 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------------|
| 基金名称 | 华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 华富富瑞 3 个月定期开放债券 |
| 基金主代码 | 005781 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 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 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,503,240,043.08 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 | 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。 |
| 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，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|------------------------------------|-------------------------|
| 名称 | | 华富基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 满志弘 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 021-68886996 | 95559 |
| | 电子邮箱 | manzh@hffund.com | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-8001 | 95559 |
| 传真 | | 021-68887997 | 021-62701216 |
| 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 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200336 |
| 法定代表人 | | 赵万里 | 任德奇 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 65,338,502.32 |
| 本期利润 | 74,567,004.75 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0166 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.52% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.53% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 419,158,094.42 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0931 |
| 期末基金资产净值 | 4,934,246,859.60 |
| 期末基金份额净值 | 1.0957 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 18.17% |

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

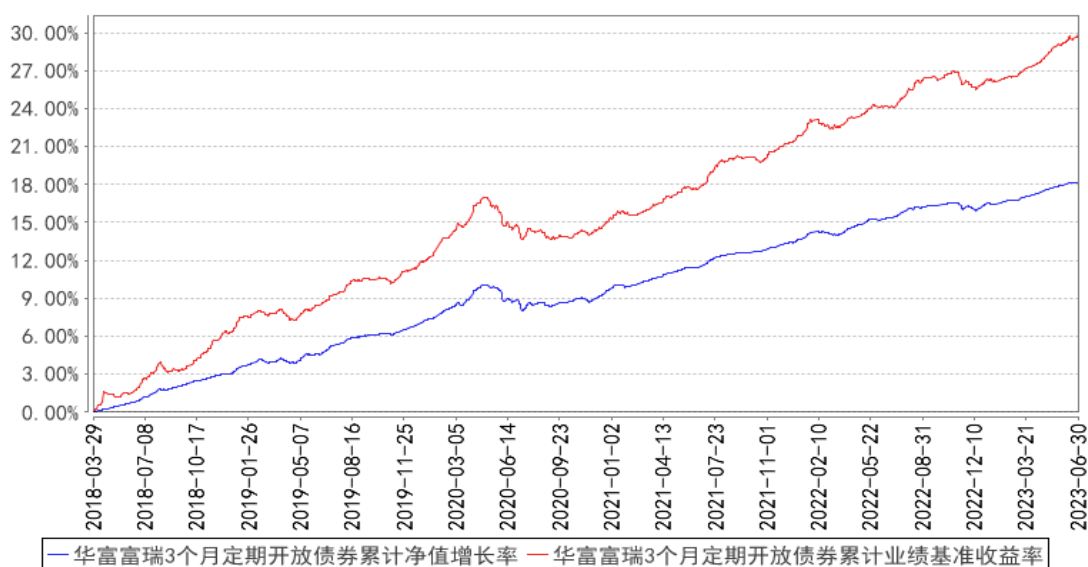
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.19% | 0.01% | 0.55% | 0.06% | -0.36% | -0.05% |
| 过去三个月 | 0.89% | 0.01% | 1.98% | 0.05% | -1.09% | -0.04% |
| 过去六个月 | 1.53% | 0.02% | 2.98% | 0.05% | -1.45% | -0.03% |
| 过去一年 | 2.41% | 0.03% | 4.58% | 0.06% | -2.17% | -0.03% |
| 过去三年 | 8.59% | 0.03% | 13.17% | 0.06% | -4.58% | -0.03% |

| | | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|---|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 18.17% | 0.03% | 29.84% | 0.07% | - | 11.67% | -0.04% |
|------------|--------|-------|--------|-------|---|--------|--------|

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

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

华富富瑞3个月定期开放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：根据《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合同》的规定，本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，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。本基金建仓期为 2018 年 3 月 29 日到 2018 年 9 月 29 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富富瑞 3 个月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

2023 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、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、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、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金共六十只基金。

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 | 本基金基金经理 | 2018 年 3 月 29 日 | - | 九年 | 英国曼彻斯特大学管理学硕士，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 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，自 2022 年 11 月 17 日起任华富吉富 30 天滚动持有中短债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《证券投资基金经营机构董事、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

国内宏观经济方面，上半年 GDP 累计增速为 5.5%，累计固定资产投资增速为 3.8%，6 月份工业增加值增速 4.4%，社零增速 3.1%。一季度增速较快，二季度随着补偿性因素衰减后，经济动能边际转弱。消费增速虽然保持在双位数的增长，但商品房销售投资边际回落，整体行业景气度有明显的回落。基建相对平稳，投资增速保持在较好的水平。

一季度国内货币政策维持稳健，财政政策较为积极。前 5 个月，广义预算收入累计同比下降 13.8%，但支出同比增长 12.4%，同时 1-5 月累计超支 29701 亿元。一般公共预算收入端受疫情、退税影响大幅下滑，但支出端重点支持基建特征明显。今年新增专项债发行相比往年前置约 3 个月，有力对冲了土地市场下行压力。

流动性方面，1 月债券市场在理财赎回负反馈冲击的余波中经历小幅调整。央行投放大量短期流动性跨春节假期，资金面季节性波动，短端品种利率上行。央行 1-2 月 MLF 超额投放共 2780 亿，但没有降准，银行中长期资金存在缺口，资金收紧。存单等短端流动性品种调整。3 月 5 日全国两会政府工作报告提出 2023 年 GDP5% 的增速目标，低于市场预期，市场对稳增长政策发力预期下降，触发利率下行。3 月央行公告降准 0.25%，释放中长期流动性，资金面压力有所缓解。4 月 8 日左右，多家银行公告下调存款利率，对债市形成利好。3 月上旬至 4 月下旬，短端、长端品种均小幅下行。4 月下旬起流动性转大幅宽松，5 月短端品种大幅下行。6 月中旬，央行超预期，降息 10bp，带动市场利率快速下行。国常会释放稳增长政策将加码的信号，叠加跨半年末资金面季节性收紧，利率快速回调。

信用债方面，城投债利差整体压缩，偏弱区域利差变动分歧较大。上半年城投债整体走强，利差震荡下行，在结构性资产荒、理财净值化背景下中高等级短久期城投债利差已压至低位。市场对于各地债务化解进度关注度较高。隐性债务“遏制新增、化解存量”的总体思路不变，重点区域建议持续跟踪化债进度、土地财政情况、平台付息能力、资金可得性、到期结构等因素的边际变化。

上半年，华富富瑞债券基金利用封闭期内规模较稳定的优势，灵活增减组合杠杆，利用资金面宽松时点，为组合提高收益，并利用管理人信用研究团队对信用债主体的专业研究，精选个券，配置中高等级债券，获得合理的票息收益。

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 1.0957 元，累计基金份额净值为 1.1767 元。报告期，本基金份额净值增长率为 1.53%，同期业绩比较基准收益率为 2.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，利率走势关键在于增量政策力度与市场期望的对比关系。扩大内需、提振信心、防范风险依然是政策核心，也是市场关注焦点。预计宏观调控政策仍然坚持积极的财政政策和稳健的货币政策为主线，政策的定力和延续性较强。市场对力度预期有所降温，其中地方债务化解、产业政策和财政政策最受期待。下半年整体上 DR007 中枢预计低于政策利率，但短期的趋势变化可能基于经济基本面的变化。例如，密切关注地产行业的边际变化，如果后续政策继续出台推动地产行业指标改善，资金利率可能会随之抬升。预计三季度专项债将加速发行，缴款对流动性有短期冲击。

本基金将继续密切跟踪每日债券市场变化，紧跟资金面、存单一二级、杠杆、资金融入融出等指标，严控融资成本，精选个券。灵活调整组合的久期、杠杆，为持有人提供合理稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富富瑞 3 个月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，本报告期内共进行一次利润分配，分配金额合计为 139,600,443.37 元，符合基金合同相关约定。本期利润为 74,567,004.75 元，期末可供分配利

润为 419,158,094.42 元。滚存至下一期进行分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，华富基金管理有限公司在华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,431,055.15 | 1,931,237.14 |
| 结算备付金 | | — | 1,405,994.38 |
| 存出保证金 | | 81,311.97 | — |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 4,067,437,560.96 | 5,396,365,285.80 |
| 其中：股票投资 | | — | — |
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | 3,941,650,676.02 | 5,396,365,285.80 |

| | | | |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产支持证券投资 | | 125,786,884.94 | - |
| 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 | 903,246,841.92 | - |
| 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 | | 4,972,196,770.00 | 5,399,702,517.32 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 36,010,256.73 | 398,301,983.60 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,215,620.81 | 1,270,988.75 |
| 应付托管费 | | 405,206.94 | 423,662.92 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 175,245.00 | 195,581.39 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 143,580.92 | 229,910.40 |
| 负债合计 | | 37,949,910.40 | 400,422,127.06 |
| 净资产: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 4,503,240,043.08 | 4,503,240,127.65 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 431,006,816.52 | 496,040,262.61 |
| 净资产合计 | | 4,934,246,859.60 | 4,999,280,390.26 |
| 负债和净资产总计 | | 4,972,196,770.00 | 5,399,702,517.32 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0957 元，基金份额总额 4,503,240,043.08 份。

6.2 利润表

会计主体：华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 89,014,403.92 | 105,502,961.65 |
| 1. 利息收入 | | 2,625,154.17 | 581,549.75 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 59,243.42 | 112,633.56 |
| 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 | | 2,565,910.75 | 468,916.19 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 77,158,170.94 | 114,457,519.00 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 76,585,466.84 | 113,265,633.46 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.12 | 572,704.10 | 1,191,885.54 |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 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） | 6.4.7.16 | 9,228,502.43 | -9,536,107.10 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 2,576.38 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 14,447,399.17 | 29,743,504.54 |
| 1. 管理人报酬 | | 7,286,200.00 | 7,317,202.92 |
| 2. 托管费 | | 2,428,733.32 | 2,439,067.61 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 4,440,669.72 | 19,647,639.23 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,440,669.72 | 19,647,639.23 |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 174,017.18 | 221,515.83 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 117,778.95 | 118,078.95 |

| | | | |
|---------------------|--|---------------|---------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 74,567,004.75 | 75,759,457.11 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 74,567,004.75 | 75,759,457.11 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 74,567,004.75 | 75,759,457.11 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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） | 4,503,240,127.65 | - | 496,040,262.61 | 4,999,280,390.26 |
| 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） | 4,503,240,127.65 | - | 496,040,262.61 | 4,999,280,390.26 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -84.57 | - | -65,033,446.09 | -65,033,530.66 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 74,567,004.75 | 74,567,004.75 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| (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) | -84.57 | - | -7.47 | -92.04 |
| 其中: | | | | |
| 1. 基金 申购款 | - | - | - | - |
| 2 . 基金赎回款 | -84.57 | - | -7.47 | -92.04 |
| (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) | - | - | -139,600,443.37 | -139,600,443.37 |
| (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) | 4,503,240,043.08 | - | 431,006,816.52 | 4,934,246,859.60 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 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 | 4,503,240,114.61 | - | 377,124,993.60 | 4,880,365,108.21 |

| | | | | |
|---|------------------|---|----------------|------------------|
| 净资产 (基金 净值) | | | | |
| 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) | 4,503,240,114.61 | - | 377,124,993.60 | 4,880,365,108.21 |
| 三、本 期增减 变动额 (减少 以“-” 号填 列) | -56.73 | - | 75,759,451.77 | 75,759,395.04 |
| (一)、 综合收 益总额 | - | - | 75,759,457.11 | 75,759,457.11 |
| (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) | -56.73 | - | -5.34 | -62.07 |
| 其中： | | | | |
| 1. 基金 申购款 | - | - | - | - |
| 2 . 基金赎 回款 | -56.73 | - | -5.34 | -62.07 |
| (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、本期期末净资产（基金净值） | 4,503,240,057.88 | - | 452,884,445.37 | 4,956,124,503.25 |

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

华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）《关于准予华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】58 号）准予募集注册，基金合同于 2018 年 3 月 29 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况业经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并由其出具《验证报告》（天健字〔2018〕6-8 号）。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《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合同》的规定，本基金投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发

行的次级债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、中小企业私募债、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、可分离交易可转债的纯债部分、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的相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

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。

（五）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 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 1,431,055.15 |
| 等于：本金 | 1,429,775.98 |
| 加：应计利息 | 1,279.17 |
| 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 | 1,431,055.15 |

注：“其他存款”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2023 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 | 749,372,042.18 | 4,970,303.56 | 751,005,303.56 | -3,337,042.18 |
| | 银行间市场 | 3,138,629,421.88 | 52,304,372.46 | 3,190,645,372.46 | -288,421.88 |
| | 合计 | 3,888,001,464.06 | 57,274,676.02 | 3,941,650,676.02 | -3,625,464.06 |
| 资产支持证券 | | 125,000,000.00 | 589,884.94 | 125,786,884.94 | 197,000.00 |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 4,013,001,464.06 | 57,864,560.96 | 4,067,437,560.96 | -3,428,464.06 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2023 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 | 903,246,841.92 | - |
| 合计 | 903,246,841.92 | - |

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 2023 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 | 35,101.97 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 35,101.97 |
| 应付利息 | - |
| 应付审计费 | 39,671.58 |
| 中债账户维护费 | 4,500.00 |
| 应付信息披露费 | 59,507.37 |
| 上清账户维护费 | 4,800.00 |
| 合计 | 143,580.92 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,503,240,127.65 | 4,503,240,127.65 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -84.57 | -84.57 |
| 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 | 4,503,240,043.08 | 4,503,240,043.08 |

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 |
|----------|----------------|--------------|----------------|
| 上年度末 | 493,420,042.83 | 2,620,219.78 | 496,040,262.61 |
| 本期利润 | 65,338,502.32 | 9,228,502.43 | 74,567,004.75 |
| 本期基金份额交易 | -7.36 | -0.11 | -7.47 |

| | | | |
|----------|-----------------|---------------|-----------------|
| 产生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | -7.36 | -0.11 | -7.47 |
| 本期已分配利润 | -139,600,443.37 | - | -139,600,443.37 |
| 本期末 | 419,158,094.42 | 11,848,722.10 | 431,006,816.52 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 28,039.18 |
| 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 | 30,725.22 |
| 其他 | 479.02 |
| 合计 | 59,243.42 |

注：“其他存款利息收入”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。“其他”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

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 100,597,249.08 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -24,011,782.24 |
| 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 | 76,585,466.84 |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 3,537,770,649.04 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,472,556,135.67 |
| 减：应计利息总额 | 89,215,595.61 |
| 减：交易费用 | 10,700.00 |
| 买卖债券差价收入 | -24,011,782.24 |

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 572,704.10 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | — |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入 | — |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入 | — |
| 合计 | 572,704.10 |

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

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

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 9,228,502.43 |
| 股票投资 | — |
| 债券投资 | 9,031,502.43 |
| 资产支持证券投资 | 197,000.00 |
| 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 | 9,228,502.43 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | — |
| 其他 | 2,576.38 |
| 合计 | 2,576.38 |

注：其他为 TB17A1、TB19A1 募集期利息。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | — |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 117,778.95 |

6.4.7.20 分部报告

无。

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 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华安证券股份有限公司（“华安证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) |
| 华安证券 | 826,403,248.64 | 74.28 | 513,886,900.00 | 89.53 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) |

| | | | | |
|------|------------------|--------|------------------|-------|
| 华安证券 | 3,011,000,000.00 | 100.00 | 8,723,700,000.00 | 99.31 |
|------|------------------|--------|------------------|-------|

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：本基金本报告期和上年度可比期间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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 7,286,200.00 | 7,317,202.92 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1.69 | 1.69 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,428,733.32 | 2,439,067.61 |

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

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

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

的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------------------------|---------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2018 年 3 月 29 日）持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.2200% | 0.2200% |

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，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

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 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
|------------|------------------------|---------------------|--------------------------|---------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |
| 交通银行股份有限公司 | 4,493,237,499.37 | 99.7800 | 4,493,237,499.37 | 99.7800 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 |
| 交通银行股份有限公司 | 1,431,055.15 | 28,039.18 | 1,413,923.49 | 50,134.75 |

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

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 | 2023 年 1 月 5 日 | - | 2023 年 1 月 5 日 | 0.3100 | 139,600,443.37 | - | 139,600,443.37 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.3100 | 139,600,443.37 | - | 139,600,443.37 | - |

6.4.12 期末（2023 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

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 36,010,256.73 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|-----------------|-------------------|--------|---------|---------------|
| 101900037 | 19 南电 MTN002 | 2023 年 7 月 5 日 | 102.47 | 379,000 | 38,837,837.06 |
| 合计 | | | | 379,000 | 38,837,837.06 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金管理人已建立董事會領導下的架構清晰、控制有效、系統全面、切實可行的風險控制體系，並設定適當的風險限額及內部控制流程，通過可靠的管理及信息系統持續監控上述各類風險。

董事會下設風險管理委員會，負責對公司風險管理制度進行審查並提供諮詢和建議。總經理下設投資決策委員會和風險控制委員會，負責對公司经营及基金運作中的風險進行研究、評估和監控。公司設督察長，組織、指導公司監察稽核工作，監督檢查基金及公司運作的合法合規情況和公司的內部風險控制情況。公司設有獨立的監察稽核部門，監察稽核部有權對公司各部門內部風險控制制度的建立和落實情況進行檢查，對公司的內部風險控制制度的合理性、有效性進行分析，提出改進意見，上報總經理，通報督察長。

6.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易過程中因交易對手未履行合約責任，或者基金所投資證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息，導致基金資產損失和收益變化的風險。本基金均投資於具有良好信用等級的證券，且通過分散化投資以分散信用風險。本基金投資於一家公司發行的證券市值不超過基金資產淨值的 10%，且本基金與由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的證券不得超過該證券的 10%。

本基金在交易所進行的交易均與中國證券登記結算有限責任公司完成證券交收和款項清算，因此違約風險發生的可能性很小；基金在進行銀行間同業市場交易前均對交易對手進行信用評估以控制相應的信用風險。

6.4.13.2.1 按短期信用評級列示的債券投資

單位：人民幣元

| 短期信用評級 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | — | — |
| A-1 以下 | — | — |
| 未評級 | 201,538,225.11 | — |
| 合計 | 201,538,225.11 | — |

6.4.13.2.2 按短期信用評級列示的資產支持證券投資

單位：人民幣元

| 短期信用評級 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | — | — |
| A-1 以下 | — | — |

| | | |
|-----|----------------|---|
| 未评级 | 125,786,884.94 | - |
| 合计 | 125,786,884.94 | - |

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 3,700,831,485.79 | 4,390,903,802.51 |
| AAA 以下 | 220,724,621.92 | 463,431,250.41 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 3,921,556,107.71 | 4,854,335,052.92 |

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 125,786,884.94 | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 125,786,884.94 | - |

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 202 3 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---------------|----------------|------------------|------------------|-------|-----|------------------|
| 资 产 | | | | | | | |
| 银 行 存 款 | 1,431,055.15 | - | - | - | - | - | -1,431,055.15 |
| 结 算 备 付 金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 存 出 保 证 金 | 81,311.97 | - | - | - | - | - | 81,311.97 |
| 交 易 性 金 融 资 产 | 62,058,638.36 | 664,910,695.89 | 2,256,579,832.80 | 1,083,888,393.91 | - | - | 4,067,437,560.96 |

| | | | | | | | |
|----------|----------------|----------------|------------------|------------------|---|---|------------------|
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 903,246,841.92 | - | - | - | - | - | 903,246,841.92 |
| 债权投资 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 966,817,847.40 | 664,910,695.89 | 2,256,579,832.80 | 1,083,888,393.91 | - | - | 4,972,196,770.00 |
| 负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|-----------|---------------|---|---|---|---|--------------|---------------|
| 回款 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,215,620.81 | 1,215,620.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 405,206.94 | 405,206.94 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 36,010,256.73 | - | - | - | - | - | 36,010,256.73 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|-----|----------------|----------------|------------------|------------------|-------|--------------|------------------|
| 润 | | | | | | | |
| 应 | | | | | | | |
| 交 | | | | | | 175,245.0 | 175,245.00 |
| 税 | - | - | - | - | - | 0 | |
| 费 | | | | | | | |
| 其 | | | | | | 143,580.9 | 143,580.92 |
| 他 | - | - | - | - | - | 2 | |
| 负 | | | | | | | |
| 债 | | | | | | | |
| 总 | 36,010,256.73 | - | - | - | - | 1,939,653.67 | 37,949,910.40 |
| 计 | | | | | | | |
| 利 | | | | | | | |
| 率 | | | | | | | |
| 敏 | 930,807,590.67 | 664,910,695.89 | 2,256,579,832.80 | 1,083,888,393.91 | - | 1,939,653.67 | 4,934,246,859.60 |
| 感 | | | | | | | |
| 度 | | | | | | | |
| 缺 | | | | | | | |
| 口 | | | | | | | |
| 上 | | | | | | | |
| 年 | | | | | | | |
| 度 | | | | | | | |
| 末 | | | | | | | |
| 202 | | | | | | | |
| 2 | 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 |
| 年 | | | | | | | |
| 12 | | | | | | | |
| 月 | | | | | | | |
| 31 | | | | | | | |
| 日 | | | | | | | |
| 资 | | | | | | | |
| 产 | | | | | | | |
| 银 | | | | | | | |
| 行 | 1,931,237.14 | - | - | - | - | - | 1,931,237.14 |
| 存 | | | | | | | |
| 款 | | | | | | | |
| 结 | | | | | | | |
| 算 | 1,405,994.38 | - | - | - | - | - | 1,405,994.38 |
| 备 | | | | | | | |
| 付 | | | | | | | |
| 金 | | | | | | | |
| 存 | | | | | | | |
| 出 | - | - | - | - | - | - | - |
| 保 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|----------|---------------|----------------|------------------|------------------|------------------|---|------------------|
| 证金 | | | | | | | |
| 交易性金融资产 | 20,610,049.32 | 348,015,012.34 | 1,814,858,518.37 | 1,535,144,040.02 | 1,677,737,665.75 | | 5,396,365,285.80 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|-----------|----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|--------------|------------------|
| 资产总计 | 23,947,280.84 | 348,015,012.34 | 1,814,858,518.37 | 1,535,144,040.02 | 1,677,737,665.75 | | 5,399,702,517.32 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,270,988.75 | 1,270,988.75 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 423,662.92 | 423,662.92 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 398,301,983.60 | - | - | - | - | - | 398,301,983.60 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---------|-----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|---------------|------------------|
| 付投资顾问费 | | | | | | | |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 195,581.39 | 195,581.39 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 229,910.40 | 229,910.40 |
| 负债总计 | 398,301,983.60 | - | - | - | - | 2,120,143.46 | 400,422,127.06 |
| 利率敏感度缺口 | -374,354,702.76 | 348,015,012.34 | 1,814,858,518.37 | 1,535,144,040.02 | 1,677,737,665.75 | -2,120,143.46 | 4,999,280,390.26 |

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 | 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（2023 年 6 月 30 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 市场利率上升 25 基点 | -8,971,073.06 | -31,215,612.27 |
| | 市场利率下降 25 基点 | 9,024,727.59 | 31,112,406.78 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 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 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 3,941,650,676.02 | 79.88 | 5,396,365,285.80 | 107.94 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | — | — | — | — |
| 衍生金融资产—权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | 125,786,884.94 | 2.55 | — | — |
| 合计 | 4,067,437,560.96 | 82.43 | 5,396,365,285.80 | 107.94 |

注：其他为交易性金融资产—资产支持证券投资。

6.4.13.4.3.2 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。

6.4.13.4.4 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 (2023 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2022 年 12 月 31 日) |
|----|-------------------|--------------------------|----------------------------|
| | 合计 | 27,531,714.30 | 63,751,115.25 |

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 4,067,437,560.96 | 5,396,365,285.80 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 4,067,437,560.96 | 5,396,365,285.80 |

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

本基金本报告期及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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 | 4,067,437,560.96 | 81.80 |
| | 其中：债券 | 3,941,650,676.02 | 79.27 |
| | 资产支持证券 | 125,786,884.94 | 2.53 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 903,246,841.92 | 18.17 |
| | 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 | 1,431,055.15 | 0.03 |
| 8 | 其他各项资产 | 81,311.97 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 4,972,196,770.00 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金报告期末未持有境内股票投资。

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内无股票买入。

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

注：本基金本报告期内无股票卖出。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

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 | 1,204,747,876.74 | 24.42 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,094,568.31 | 0.41 |
| 4 | 企业债券 | 761,323,900.82 | 15.43 |
| 5 | 企业短期融资券 | 201,538,225.11 | 4.08 |
| 6 | 中期票据 | 1,774,040,673.35 | 35.95 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,941,650,676.02 | 79.88 |

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 | 101900066 | 19 招商局 MTN001 | 2,800,000 | 286,980,699.18 | 5.82 |
| 2 | 175975 | 21 海通 03 | 2,500,000 | 253,354,383.55 | 5.13 |
| 3 | 2120092 | 21 徽商银行二 级 01 | 2,000,000 | 209,526,334.25 | 4.25 |
| 4 | 1928009 | 19 农业银行二 级 04 | 2,000,000 | 204,622,622.95 | 4.15 |
| 5 | 101900037 | 19 南电 MTN002 | 1,900,000 | 194,701,557.81 | 3.95 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量 (份) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------------------|
| 1 | 199739 | TB19A1 | 700,000 | 70,275,972.61 | 1.42 |
| 2 | 199249 | TB17A1 | 550,000 | 55,510,912.33 | 1.13 |

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。

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

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

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，中国农业银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国建筑股份有限公司、徽商银行股份有限公司曾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 | 81,311.97 |
| 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 | 81,311.97 |

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 (%) |
| 231 | 19,494,545.64 | 4,503,240,043.08 | 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

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

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 | 10,000,000.00 | 0.2200 | 10,000,000.00 | 0.2200 | 三年 |
| 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 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | — |
| 其他 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | — |
| 合计 | 10,000,000.00 | 0.2200 | 10,000,000.00 | 0.2200 | 三年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2018 年 3 月 29 日） 基金份额总额 | 1,609,999,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,503,240,127.65 |
| 本报告期基金总申购份额 | — |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 84.57 |

| | |
|--------------|------------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,503,240,043.08 |

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

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 | |

| | | | (%) | | (%) | |
|------|---|---|-----|---|-----|---|
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 3 | - | - | - | - | - |

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(%) |
| 国信证券 | 286,181,615.62 | 25.72 | - | - | - | - |
| 华安证券 | 826,403,248.64 | 74.28 | 3,011,000,000.00 | 100.00 | - | - |

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 | 华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第一次分红公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 1 月 4 日 |
| 2 | 华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 3 | 华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金第十七次开放申购、赎回及转换业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 2 月 17 日 |
| 4 | 华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 5 | 华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 6 | 华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 5 月 24 日 |

| | | | |
|--|----------------------------|---|--|
| | 式证券投资基金第十八次开放申购、赎回及转换业务的公告 | 介 | |
|--|----------------------------|---|--|

§ 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 | 2023. 1. 1-2023. 6. 30 | 4, 493, 237, 499. 37 | 0. 00 | 0. 00 | 4, 493, 237, 499. 37 | 99. 7800 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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、华富富瑞 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富富瑞 3 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富富瑞 3 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富富瑞 3 个月定期开放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

2023 年 8 月 30 日