

# 华富强化回报债券型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<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	6
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	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>12</b>
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
<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	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44

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.....	44
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.11 投资组合报告附注.....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.4 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.....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</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.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华富强化回报债券型证券投资基金
基金简称	华富强化回报债券
场内简称	华富强债
基金主代码	164105
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 9 月 8 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	1,588,224,836.83 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 9 月 2 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素，研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险，以确定各类金融资产的配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期风险和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 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	021-60637228
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	《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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	-5,663,279.15
本期利润	28,709,608.73
加权平均基金份额本期利润	0.0133
本期加权平均净值利润率	0.78%
本期基金份额净值增长率	0.41%
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	1,027,397,850.86
期末可供分配基金份额利润	0.6469
期末基金资产净值	2,694,206,685.29
期末基金份额净值	1.696
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	138.38%

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

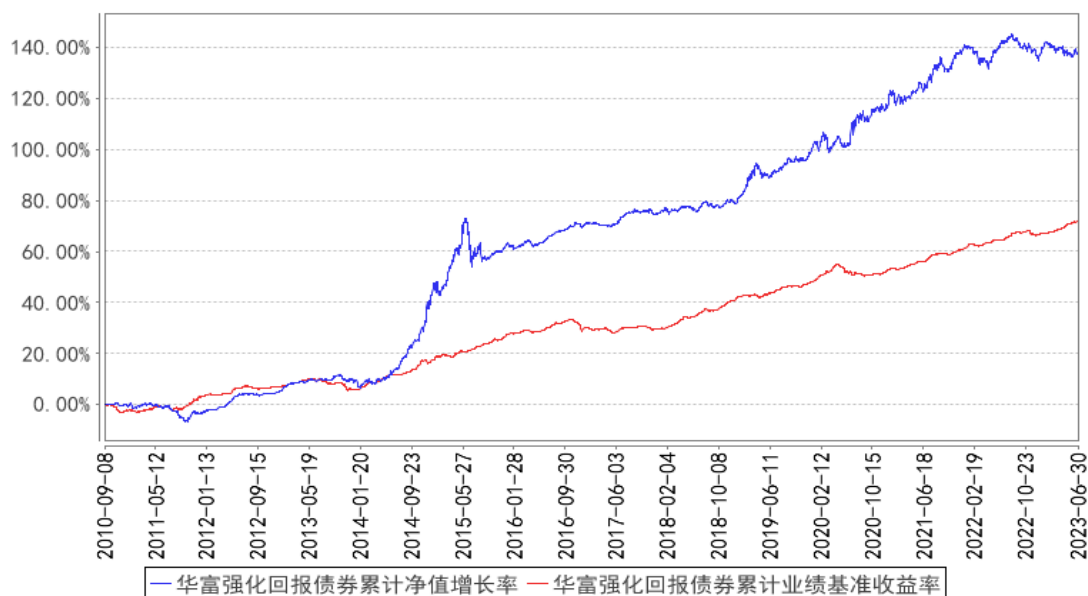
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.95%	0.25%	0.55%	0.06%	0.40%	0.19%
过去三个月	-0.47%	0.23%	1.98%	0.05%	-2.45%	0.18%

过去六个月	0.41%	0.21%	2.98%	0.05%	-2.57%	0.16%
过去一年	-1.51%	0.20%	4.58%	0.06%	-6.09%	0.14%
过去三年	17.70%	0.30%	13.17%	0.06%	4.53%	0.24%
自基金合同生效起至今	138.38%	0.29%	71.96%	0.09%	66.42%	0.20%

注：业绩比较基准收益率=中证全债指数，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

华富强化回报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《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债、分离交易可转债、债券回购等固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%。本基金还可以参与新股申购、股票增发和要约收购类股票投资，并可持有因可转债转股所形成的股票、持有股票所派发的权证和因投资可分离债券所产生的权证。本基金投资于非固定收益类证券的比例不超过基金资产的 20%。在封闭期结束后，本基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2010 年 9 月 8 日到 2011 年 3 月 8 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《华富强化回报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 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		
尹培俊	本基金基金经理、公司总经理助理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会联席主席	2014 年 3 月 6 日	-	十七年	兰州大学工商管理硕士，硕士研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任信用研究员、固定收益部总监助理、固定收益部副总监，自 2014 年 3 月 6 日起任华富强化回报债券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 日起任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 28 日起任华富可转债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 28 日起任华富安华债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 26 日起任华富安盈一年持有期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 2022 年 6 月 6 日起任华富安业一年持有期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

今年上半年，国内疫情防控完全放开、压制需求有所释放，促进了国内宏观经济格局的小幅修复，但短暂的修复之后，经济增长再次体现压力。结构上，由于基数偏低与疫情影响消退的原因，消费增长相对亮眼。但房地产市场销售走势在短暂反弹后快速遇冷，竣工相对投资韧性更好一些。基建领域则保持了持续稳定的投资增速。出口方面，新兴市场经济体为出口持续扩张提供了支撑，但发达国家的出口增速呈明显下滑趋势。经济整体较为低迷的状态导致实体融资需求不足，社融和信贷表现较弱，通胀持续走低。货币政策上，央行在 3 月、6 月分别降准降息，但需求不足导致实体宽信用受阻，上半年金融市场流动性较为充裕。

海外经济方面，劳动力市场的强劲以及劳动供给的改善支撑了经济的软着陆可能性，美国经济表现持续超预期，导致通胀压力始终高企，美联储紧缩周期也随之较预期延长，强势美元和高利率美债对全球风险偏好和新兴市场流动性依然体现负面影响。

上半年，国内债市表现强劲，虽然有政策刺激预期的扰动，但由于经济复苏程度不足，叠加流动性宽松，利率债和信用债市场基本呈现收益率单边下行的趋势，除了民企地产债，各类期限和不同等级的债券品种均有出色的表现。而股票市场上半年先涨后跌，年初在疫情放开与国内经济复苏预期、海外流动性改善等多重因素下，A 股出现了快速回暖，但在春节后开始市场赚钱效

应逐渐收缩，主要集中在中特估和数字经济两条线，进入二季度赚钱效应进一步收缩，整体震荡下跌。可转债市场受益于股票和债券市场均有正向收益，上半年整体上涨。

本基金在上半年以两年左右中高等级中短久期信用债为底仓配置，股票资产通过转债转股、定增等方式逐步提高仓位，增配了券商、TMT 等个股，降低新能源仓位占比，在存量博弈的市场环境下，股票市场整体表现低迷且结构分化严重，导致股票仓位负向贡献；转债部分以券商、水电、交运、养殖等低估值和中低价位品种作为底仓配置，加仓成长风格转债。由于风险资产整体表现不佳，且纯债部分久期较短相对贡献受限，组合净值在上半年的表现仍不及预期。

#### 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 1.696 元，累计基金份额净值为 2.147 元。报告期，本基金份额净值增长率为 0.41%，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 2023 年下半年，国内经济基本面依然会承压，政治局会议对市场所关心的房地产、地方债务、资本市场等问题都做出了相应的回应，政策仍然会有托底，但预期不可太高，总量上依然是增长阶梯下行的趋势，强调结构转型和高质量发展。海外方面，美国经济依然表现得韧性十足，通胀放缓速度不及预期，促使美联储的紧缩进程再度延长，货币政策拐点仍需等待。但从资产定价的角度，权益和债券资产均对国内经济的悲观预期有所定价，资产价格的表现也开始对内外部因素的冲击有所钝化，因此从赔率的角度看，下半年大类资产配置维持超配权益类风险资产的预判。

在资产配置上，由于市场对经济的预期很低，债券市场的胜率仍在，但在收益率持续下行后，短期性价比不算有吸引力，在经济弱复苏背景下，流动性仍然充裕，债券市场还未出现打破低波动的边际信号，短期内震荡概率偏高。而股票市场基本处于中长期底部区间，虽然经济总量缺乏弹性，但整体估值仍低，结构性机会较多，风险偏好与估值仍有修复空间，现阶段仍维持对风险资产的高度重视。行业配置层面，相对看好以低估值蓝筹、有色、贵金属、人工智能（算力端、应用端）、高端制造（光储、军工等）、以及消费板块为主要配置方向。可转债方面，整体性价比不算高但也没有明显的泡沫，市场表现预计跟随股票市场波动，中长期来看，资产荒时代下固收+资金对于可转债的配置需求仍较高，可转债性价比从中长期看应该持续处于紧平衡的状态。

本基金提升了风险资产仓位，股票风格整体略偏成长，转债适当增加了平衡型和低溢价偏股型品种的配置，整体方向均衡偏价值；纯债部分将提升票息策略强度，考虑适度拉长久期。中期而言，本基金将根据性价比进一步平衡股债配置，股票仓位仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的

投资理念，寻找具有估值优势或拥有优势赛道具备长期成长性的企业。本基金仍将坚持在较低风险程度下，认真研究各个投资领域潜在的机会，相对积极地做好配置策略，均衡投资，降低业绩波动，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、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《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内未进行利润分配，本期利润为 28,709,608.73 元，期末可供分配利润为 1,027,397,850.86 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本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：华富强化回报债券型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,548,144.75	2,754,318.72
结算备付金		94,791,536.48	31,803,571.95
存出保证金		95,354.02	74,916.37
交易性金融资产	6.4.7.2	3,493,893,594.19	5,666,073,747.13
其中：股票投资		309,335,746.40	326,116,050.81
基金投资		-	-
债券投资		3,181,300,296.76	5,323,070,438.55
资产支持证券投资		3,257,551.03	16,887,257.77
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	-	35,043,274.58
应收清算款		16,260,137.53	15,055,740.60
应收股利		-	-
应收申购款		132,968.37	941,995.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,606,721,735.34	5,751,747,565.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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		904,691,333.68	987,720,553.95
应付清算款		-	114,632.71
应付赎回款		5,722,581.13	5,017,364.30
应付管理人报酬		1,358,828.48	2,517,437.11
应付托管费		452,942.82	839,145.71

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		154,668.28	263,346.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	134,695.66	226,487.72
负债合计		912,515,050.05	996,698,967.61
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,588,224,836.83	2,815,272,135.56
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,105,981,848.46	1,939,776,462.16
净资产合计		2,694,206,685.29	4,755,048,597.72
负债和净资产总计		3,606,721,735.34	5,751,747,565.33

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.696 元，基金份额总额 1,588,224,836.83 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华富强化回报债券型证券投资基金

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	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		55,521,935.59	23,369,272.35
1. 利息收入		799,567.10	216,290.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	792,403.32	196,169.20
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		7,163.78	20,120.81
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,842,783.93	51,431,907.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,375,493.88	-947,913.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	28,266,987.10	51,423,540.60
资产支持证券投资	6.4.7.12	127,468.16	-
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	1,823,822.55	956,280.49
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	34,372,887.88	-28,475,687.30
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	506,696.68	196,762.11
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>26,812,326.86</b>	<b>13,526,605.31</b>
1. 管理人报酬		11,012,949.75	8,603,405.01
2. 托管费		3,670,983.22	2,867,801.67
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		11,862,901.33	1,841,638.78
其中：卖出回购金融资产支出		11,862,901.33	1,841,638.78
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		145,963.16	89,692.71
8. 其他费用	6.4.7.19	119,529.40	124,067.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>28,709,608.73</b>	<b>9,842,667.04</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>28,709,608.73</b>	<b>9,842,667.04</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>28,709,608.73</b>	<b>9,842,667.04</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富强化回报债券型证券投资基金

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）	2,815,272,135.56	-	1,939,776,462.16	4,755,048,597.72

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）	2,815,272,135.56	-	1,939,776,462.16	4,755,048,597.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,227,047,298.73	-	-833,794,613.70	-2,060,841,912.43
（一）、综合收益总额	-	-	28,709,608.73	28,709,608.73
（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）	-1,227,047,298.73	-	-862,504,222.43	-2,089,551,521.16
其中： 1. 基金申购款	147,199,909.06	-	104,311,628.80	251,511,537.86
2. 基金赎回款	-1,374,247,207.79	-	-966,815,851.23	-2,341,063,059.02
（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）	1,588,224,836.83	-	1,105,981,848.46	2,694,206,685.29
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、上期期末净资产（基金净值）	1,097,458,711.26	-	783,887,732.69	1,881,346,443.95
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）	1,097,458,711.26	-	783,887,732.69	1,881,346,443.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填	933,789,534.90	-	682,093,626.01	1,615,883,160.91

列)				
(一)、综合收益总额	-	-	9,842,667.04	9,842,667.04
(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)	933,789,534.90	-	672,250,958.97	1,606,040,493.87
其中:				
1. 基金申购款	1,501,681,940.79	-	1,056,940,879.80	2,558,622,820.59
2. 基金赎回款	-567,892,405.89	-	-384,689,920.83	-952,582,326.72
(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)	2,031,248,246.16	-	1,465,981,358.70	3,497,229,604.86

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

华富强化回报债券型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可【2010】989号）2010年7月23日核准，基金合同于2010年9月8日生效。本基金为创新型封闭式，本基金合同生效后三年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易，基金合同生效满三年后，转为上市开放式基金（LOF）。设立时募集资金到位情况经天健正信会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健正信验（2010）综字第020119号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人为华富基金管理有限公司，基金份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

### 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	1,548,144.75
等于：本金	1,547,567.34
加：应计利息	577.41
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	1,548,144.75

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	377,947,684.75	-	309,335,746.40	-68,611,938.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,455,165,574.40	25,921,416.92	2,442,017,746.58	-39,069,244.74
	银行间市场	724,869,085.29	12,391,840.18	739,282,550.18	2,021,624.71
	合计	3,180,034,659.69	38,313,257.10	3,181,300,296.76	-37,047,620.03
资产支持证券	3,252,000.00	5,551.03	3,257,551.03	0.00	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,561,234,344.44	38,318,808.13	3,493,893,594.19	-105,659,558.38

### 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

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,051.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	23,165.00
其中：交易所市场	16,540.00
银行间市场	6,625.00
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	134,695.66

### 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	2,815,272,135.56	2,815,272,135.56
本期申购	147,199,909.06	147,199,909.06
本期赎回（以“-”号填列）	-1,374,247,207.79	-1,374,247,207.79
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	1,588,224,836.83	1,588,224,836.83

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	1,822,642,873.35	117,133,588.81	1,939,776,462.16
本期利润	-5,663,279.15	34,372,887.88	28,709,608.73
本期基金份额交易产生的变动数	-789,581,743.34	-72,922,479.09	-862,504,222.43
其中：基金申购款	95,226,141.73	9,085,487.07	104,311,628.80
基金赎回款	-884,807,885.07	-82,007,966.16	-966,815,851.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,027,397,850.86	78,583,997.60	1,105,981,848.46

#### 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	44,695.30
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	746,943.92
其他	764.10
合计	792,403.32

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,375,493.88
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	-10,375,493.88

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	71,466,674.81
减：卖出股票成本总额	81,699,005.93
减：交易费用	143,162.76
买卖股票差价收入	-10,375,493.88

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	58,175,769.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-29,908,782.08
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	28,266,987.10

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	3,267,591,911.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,257,018,172.67
减：应计利息总额	40,425,705.79
减：交易费用	56,814.66
买卖债券差价收入	-29,908,782.08

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	127,468.16
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	127,468.16

##### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	13,668,000.00
减：卖出资产支持证券成本总额	13,668,000.00
减：应计利息总额	0.00
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

##### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,823,822.55

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	1,823,822.55

#### 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	34,372,887.88
股票投资	-48,275,050.02
债券投资	82,581,937.90
资产支持证券投资	66,000.00
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	34,372,887.88

#### 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	506,696.68
合计	506,696.68

#### 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	-
银行费用	1,900.45
账户维护费	18,450.00
合计	119,529.40

#### 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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华安证券	71,466,674.81	100.00	29,354,484.14	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 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	1,066,746,854.13	56.95	1,150,658,377.05	76.08

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	114,155,500,000.00	98.25	19,028,100,000.00	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	66,067.95	100.00	16,540.00	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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	26,991.35	100.00	12,782.43	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 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	11,012,949.75	8,603,405.01
其中：支付销售机构的客户维护 费	2,183,356.82	899,859.00

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.6% 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	3,670,983.22	2,867,801.67

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 ÷ 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

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 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
中国建设银行股份有限公司	1,548,144.75	44,695.30	104,027,247.65	87,561.65

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

注: 本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

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 904,691,333.68 元，于 2023 年 07 月 03 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同责任，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发行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 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	40,810,060.28	675,153,507.94
合计	40,810,060.28	675,153,507.94

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	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	3,257,551.03	16,887,257.77
合计	3,257,551.03	16,887,257.77

#### 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 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	-	49,967,144.11
合计	-	49,967,144.11

#### 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	2,093,855,648.12	3,554,620,578.52
AAA 以下	946,226,552.12	1,468,833,815.92
未评级	-	-
合计	3,040,082,200.24	5,023,454,394.44

#### 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	3,257,551.03	16,887,257.77
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	3,257,551.03	16,887,257.77

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	49,967,144.11
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	49,967,144.11

#### 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 2023 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	1,548,144.75	-	-	-	-	-	1,548,144.75
结算备付金	94,791,536.48	-	-	-	-	-	94,791,536.48
存出保证金	95,354.02	-	-	-	-	-	95,354.02
交易性金融资产	138,931,926.26	228,121,432.55	1,165,067,327.61	1,652,437,161.37	-	309,335,746.40	3,493,893,594.19
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	-	-	-	-	-	132,968.37	132,968.37
应收清算款	-	-	-	-	-	16,260,137.53	16,260,137.53
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	235,366,961.51	228,121,432.55	1,165,067,327.61	1,652,437,161.37	-	325,728,852.30	3,606,721,735.34
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,722,581.13	5,722,581.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,358,828.48	1,358,828.48
应	-	-	-	-	-	452,942.82	452,942.82

付托管费							
应付清算款							
卖出回购金融资产款	904,691,333.68						904,691,333.68
应付销售服务费							
应付投资顾问费							
应付利润							
应交税费						154,668.28	154,668.28
其他负债						134,695.66	134,695.66
负	904,691,333					7,823,716.	912,515,050.

债总计	.68					37	05
利率敏感度缺口	669,324,372.17	228,121,432.55	1,165,067,327.61	1,652,437,161.37		317,905,135.93	2,694,206,685.29
上年度末 2022 年 12 月 31 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	2,754,318.72	-	-	-	-	-	2,754,318.72
结算备付金	31,803,571.95	-	-	-	-	-	31,803,571.95
存出保证金	74,916.37	-	-	-	-	-	74,916.37
交易性金融资产	156,844,528.02	468,934,791.38	1,921,000,219.53	2,710,712,770.00	82,465,387.39	326,116,050.81	5,666,073,747.13
衍	-	-	-	-	-	-	-

生金融资产							
买入返售金融资产	35,043,274.58	-	-	-	-	-	35,043,274.58
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	941,995.98	941,995.98
应收清算款	-	-	-	-	-	15,055,740.60	15,055,740.60
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	226,520,609.64	468,934,791.38	1,921,000,219.53	2,710,712,770.00	82,465,387.39	342,113,787.39	5,751,747,565.33
负债							
应付赎回	-	-	-	-	-	5,017,364.30	5,017,364.30

款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,517,437.11	2,517,437.11
应付托管费	-	-	-	-	-	839,145.71	839,145.71
应付清算款	-	-	-	-	-	114,632.71	114,632.71
卖出回购金融资产款	987,720,553.95	-	-	-	-	-	987,720,553.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-	263,346.11	263,346.11
其他负债	-	-	-	-	-	226,487.72	226,487.72
负债总计	987,720,553.95	-	-	-	-	8,978,413.66	996,698,967.61
利率敏感度缺口	761,199,944.31	468,934,791.38	1,921,000,219.53	2,710,712,770.00	82,465,387.39	333,135,373.73	4,755,048,597.72

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（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	-13,853,790.26	-24,854,999.97
	市场利率下降 25 基点	13,987,361.93	24,806,606.60

#### 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债券等固定收益类资产和少量因在一级市场申购所形成的股票及因可转债转股所形成的股

票等权益类资产，这里的其他价格风险主要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	309,335,746.40	11.48	326,116,050.81	6.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,181,300,296.76	118.08	5,323,070,438.55	111.95
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	3,257,551.03	0.12	16,887,257.77	0.36
合计	3,493,893,594.19	129.68	5,666,073,747.13	119.16

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

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 (2023年6月30日)	上年度末 (2022年12月31日)	
分析	沪深 300 指数下降百分之五	17,593,917.17	1,518,580.49	
	沪深 300 指数上升百分之五	-17,593,917.17	-1,518,580.49	

#### 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	107,888,553.40	315,866,668.93

#### 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	941,276,261.91	1,258,015,291.13
第二层次	2,552,617,332.28	4,374,303,323.90
第三层次	-	33,755,132.10
合计	3,493,893,594.19	5,666,073,747.13

###### 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	309,335,746.40	8.58
	其中：股票	309,335,746.40	8.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,184,557,847.79	88.30
	其中：债券	3,181,300,296.76	88.20
	资产支持证券	3,257,551.03	0.09
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	96,339,681.23	2.67
8	其他各项资产	16,488,459.92	0.46
9	合计	3,606,721,735.34	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	142,459,094.25	5.29
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	5,371,853.71	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,055,532.69	1.78
J	金融业	106,139,692.34	3.94
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	7,309,573.41	0.27
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	309,335,746.40	11.48

### 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	601881	中国银河	5,379,254	62,453,138.94	2.32
2	300059	东方财富	2,250,959	31,963,617.80	1.19
3	002459	晶澳科技	700,000	29,190,000.00	1.08
4	002706	良信股份	2,393,981	26,932,286.25	1.00
5	688599	天合光能	623,095	26,550,077.95	0.99
6	300170	汉得信息	1,558,004	17,979,366.16	0.67
7	603596	伯特利	222,965	17,672,205.90	0.66
8	300687	赛意信息	625,000	17,362,500.00	0.64
9	002368	太极股份	308,809	12,713,666.53	0.47
10	601677	明泰铝业	840,000	11,659,200.00	0.43
11	000001	平安银行	750,000	8,422,500.00	0.31
12	600323	瀚蓝环境	386,137	7,309,573.41	0.27
13	600690	海尔智家	250,000	5,870,000.00	0.22
14	002891	中宠股份	225,000	5,431,500.00	0.20
15	603707	健友股份	401,783	5,424,070.50	0.20
16	603939	益丰药房	134,306	4,969,322.00	0.18
17	603225	新凤鸣	447,284	4,942,488.20	0.18
18	601966	玲珑轮胎	179,109	3,979,801.98	0.15
19	300003	乐普医疗	155,327	3,511,943.47	0.13
20	002142	宁波银行	130,452	3,300,435.60	0.12
21	002815	崇达技术	100,000	1,245,000.00	0.05
22	603233	大参林	14,371	402,531.71	0.01
23	688981	中芯国际	1,000	50,520.00	0.00

## 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	601881	中国银河	78,052,975.54	1.64
2	300170	汉得信息	21,079,794.12	0.44
3	002368	太极股份	14,060,981.88	0.30

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	300174	元力股份	19,183,407.56	0.40
2	002459	晶澳科技	17,952,740.22	0.38
3	603305	旭升集团	10,430,851.65	0.22
4	603806	福斯特	10,079,284.48	0.21
5	300763	锦浪科技	8,399,384.20	0.18
6	000887	中鼎股份	3,313,058.80	0.07
7	688598	金博股份	2,107,947.90	0.04

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	113,193,751.54
卖出股票收入（成交）总额	71,466,674.81

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	90,640,165.01	3.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	640,855,127.43	23.79
	其中：政策性金融债	50,577,931.51	1.88
4	企业债券	1,134,250,682.37	42.10

5	企业短期融资券	40,810,060.28	1.51
6	中期票据	542,208,914.55	20.12
7	可转债（可交换债）	732,535,347.12	27.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,181,300,296.76	118.08

### 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	132018	G 三峡 EB1	608,830	86,369,207.61	3.21
2	188650	21 华新 01	800,000	82,268,010.96	3.05
3	019679	22 国债 14	800,000	81,438,312.33	3.02
4	2028038	20 中国银行二 级 01	700,000	74,385,605.48	2.76
5	102280353	22 鲲鹏资本 MTN001	700,000	70,819,613.70	2.63

### 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	135467	徐租 23A1	300,000	3,257,551.03	0.12

### 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，中国银行股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国长江三峡集团有限公司、平安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、财通证券股份有

限公司、华新水泥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	95,354.02
2	应收清算款	16,260,137.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	132,968.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,488,459.92

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132018	G 三峡 EB1	86,369,207.61	3.21
2	123107	温氏转债	50,032,433.48	1.86
3	110085	通 22 转债	43,092,469.86	1.60
4	110075	南航转债	41,097,895.16	1.53
5	113648	巨星转债	29,151,803.01	1.08
6	127045	牧原转债	28,685,819.64	1.06
7	118019	金盘转债	26,525,558.24	0.98
8	113060	浙 22 转债	26,368,169.10	0.98
9	113641	华友转债	23,777,552.66	0.88
10	123109	昌红转债	22,823,500.55	0.85
11	113045	环旭转债	22,229,333.70	0.83
12	110088	淮 22 转债	22,022,053.86	0.82
13	118027	宏图转债	20,117,773.97	0.75
14	113043	财通转债	20,073,596.21	0.75
15	110062	烽火转债	17,841,208.90	0.66
16	118003	华兴转债	17,576,320.55	0.65
17	123144	裕兴转债	17,538,582.38	0.65
18	113588	润达转债	17,154,973.86	0.64

19	113623	凤 21 转债	15,214,701.58	0.56
20	123170	南电转债	14,225,624.00	0.53
21	128131	崇达转 2	13,983,870.00	0.52
22	113633	科沃转债	12,191,676.71	0.45
23	113061	拓普转债	11,477,065.62	0.43
24	127036	三花转债	11,455,956.16	0.43
25	113640	苏利转债	11,099,753.43	0.41
26	127031	洋丰转债	10,975,479.45	0.41
27	127076	中宠转 2	10,580,502.17	0.39
28	113048	晶科转债	8,976,291.23	0.33
29	113625	江山转债	8,929,322.20	0.33
30	123122	富瀚转债	8,373,020.32	0.31
31	113632	鹤 21 转债	7,301,682.43	0.27
32	128136	立讯转债	6,574,640.57	0.24
33	127041	弘亚转债	6,399,741.95	0.24
34	127012	招路转债	6,275,602.74	0.23
35	113064	东材转债	6,022,316.71	0.22
36	123119	康泰转 2	5,782,732.88	0.21
37	113579	健友转债	5,416,947.74	0.20
38	123133	佩蒂转债	4,483,284.77	0.17
39	110082	宏发转债	4,048,530.34	0.15
40	123127	耐普转债	3,944,503.41	0.15
41	123104	卫宁转债	1,439,934.25	0.05

### 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 (%)
253,850	6,256.55	1,200,076,864.79	75.56	388,147,972.04	24.44

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	国家电网公司东北分	5,074,200.00	67.54

	部企业年金计划—招商银行股份有限公司		
2	华中电网有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	295,000.00	3.93
3	李宁	280,000.00	3.73
4	刘万华	129,000.00	1.72
5	孙靖国	117,956.00	1.57
6	黄侃	95,796.00	1.28
7	蒋家亮	92,011.00	1.22
8	林建勇	74,700.00	0.99
9	许剑虹	71,100.00	0.95
10	喻金连	70,223.00	0.93

注：本表所列的持有份额为持有人持有的本基金可在深圳证券交易所上市交易部分的份额。

### 8.3 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	96,104.64	0.0061

### 8.4 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、基金投资和研部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年9月8日）基金份额总额	1,999,206,694.42
本报告期期初基金份额总额	2,815,272,135.56
本报告期基金总申购份额	147,199,909.06
减：本报告期基金总赎回份额	1,374,247,207.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,588,224,836.83

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 (%)	
华安证券	2	71,466,674.81	100.00	66,067.95	100.00	-
国联证券	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) 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	1,066,746,854.13	56.95	114,155,500,000.00	98.25	-	-
国联证券	806,413,953.77	43.05	2,030,700,000.00	1.75	-	-

### 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	华富强化回报债券型证券投资基金 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
2	华富强化回报债券型证券投资基金 2022 年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
3	华富强化回报债券型证券投资基金 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

## § 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
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、《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富强化回报债券型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富强化回报债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富强化回报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