

华富恒利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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 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	40
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	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.11 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§ 9 开放式基金份额变动.....	48
§ 10 重大事件揭示.....	48
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富恒利债券型证券投资基金	
基金简称	华富恒利债券	
基金主代码	001086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 8 月 31 日	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,627,936.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C
下属分级基金的交易代码	001086	001087
报告期末下属分级基金的份额总额	605,691.20 份	1,022,245.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。
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	招商银行股份有限公司
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	95555
传真	021-68887997	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040

法定代表人	赵万里	缪建民
-------	-----	-----

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

§ 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)		
	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C	
本期已实现收益	-11,251.34	-20,388.75	
本期利润	-6,097.81	-13,178.02	
加权平均基金份额本期利润	-0.0095	-0.0140	
本期加权平均净值利润率	-0.92%	-1.41%	
本期基金份额净值增长率	-1.06%	-1.19%	
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	-291,758.00	-512,157.26
	期末可供分配基金份额利润	-0.4817	-0.5010
	期末基金资产净值	623,452.79	1,015,720.34
期末基金份额净值	1.029	0.994	
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	6.92%	1.30%
-------------	-------	-------

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

华富恒利债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.38%	0.84%	0.55%	0.06%	0.83%	0.78%
过去三个月	-0.77%	0.59%	1.98%	0.05%	-2.75%	0.54%
过去六个月	-1.06%	0.43%	2.98%	0.05%	-4.04%	0.38%
过去一年	-12.57%	0.48%	4.58%	0.06%	-	0.42%
					17.15%	
过去三年	-4.79%	0.41%	13.17%	0.06%	-	0.35%
					17.96%	
自基金合同生效起至今	6.92%	0.35%	39.33%	0.07%	-	0.28%
					32.41%	

华富恒利债券 C

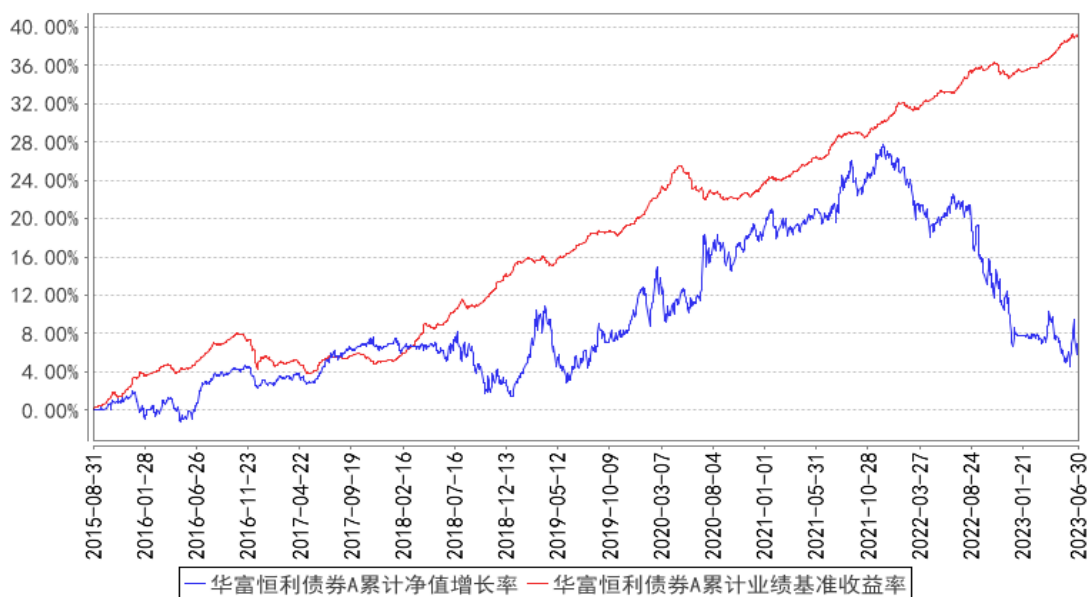
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.33%	0.84%	0.55%	0.06%	0.78%	0.78%
过去三个月	-0.80%	0.59%	1.98%	0.05%	-2.78%	0.54%
过去六个月	-1.19%	0.43%	2.98%	0.05%	-4.17%	0.38%
过去一年	-12.88%	0.49%	4.58%	0.06%	-	0.43%
					17.46%	

过去三年	-5.94%	0.41%	13.17%	0.06%	- 19.11%	0.35%
自基金合同生效起 至今	1.30%	0.35%	39.33%	0.07%	- 38.03%	0.28%

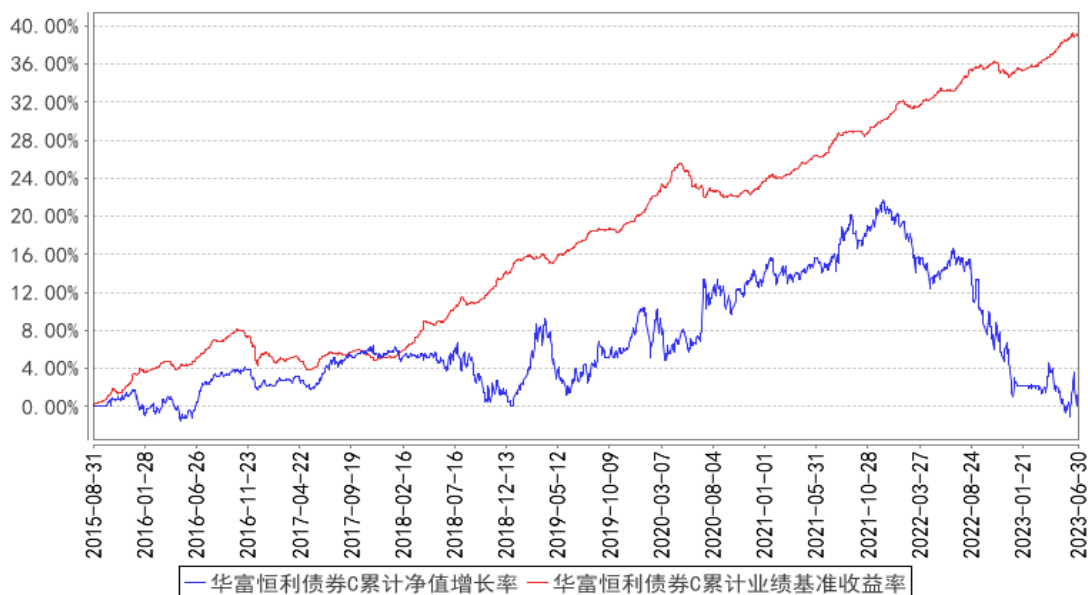
注：业绩比较基准收益率=中证全债指数，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

华富恒利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华富恒利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富恒利债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的20%，

其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。本基金建仓期为 2015 年 8 月 31 日到 2016 年 2 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《华富恒利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		
张惠	本基金基金经理、固定收益部副总监	2015 年 8 月 31 日	-	十六年	合肥工业大学产业经济学硕士、硕士研究生学历，2007 年 6 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部助理行业研究员、行业研究员，固定收益部固收研究员、基金经理助理，自 2015 年 8 月 31 日起任华富恒利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 9 月 7 日起任华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 1 月 30 日起任华富安享债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 28 日起任华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 4 月 02 日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，自 2019 年 4 月 15 日起任华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 12 日起任华富安鑫债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 16 日起任华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国内经济从疫后修复回归到常态阶段。宏观数据来看，上半年全国 GDP 同比增速 5.5%，其中二季度 GDP 同比增速 6.3%，经济动能较一季度有所转弱。传统的三驾马车中，消费受益于需求释放总体表现亮眼；出口方面虽然欧美市场需求下滑明显但新兴市场需求体现了较强的韧性，为出口提供了有力的支撑；基建投资保持稳定但地产投资仍面临较弱的态势，经济整体稳中向好但曲折前行。社融方面，一季度受益于企业中长期贷款需求释放信贷大幅增长，但二季度受到经济修复放缓和地产销售低迷的影响出现一定回落。通胀方面，目前整体压力较小，核心 CPI 维持低位运行。上半年两会政府工作报告将 GDP 预期目标定为“5.0%左右”，既考虑了“稳中求进”的工作总基调，又反映了新政府对经济质的诉求高于量。在货币政策方面，央行分别于三月超预期降准，六月超预期降息，上半年银行间流动性保持在合理适度的状态。在财政政策方面，上半年着力于稳增长和宽信用的政策导向。海外方面，上半年的关键词分别是避险情绪和软着陆。在通胀边际放缓，美联储紧缩周期逐渐接近尾声的过程中，由于资产端亏损与负债端流动性不足，欧美部分中小型银行接连破产。这也迫使海外央行暂缓加息、采取结构流动性补充，金

融风险得到控制。欧美实体经济并未受到太大影响，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。

资产表现方面，国内债市表现强劲，上半年利率债收益率呈现出震荡下行的走势，尤其是经历了一季度对经济复苏斜率的预期提升，在信贷逐渐转弱、宏观经济边际降温的背景下，二季度收益率出现了明显的下行，信用债整体在修复了去年末的下跌后也重拾涨势。股票市场方面，上半年先涨后跌，表现分化，市场风格轮动较快。年初在经济复苏预期、海外流动性改善等多重因素下，出现整体性上涨，但在春节后市场赚钱效应逐渐收缩，聚焦于中特估和数字经济两条线，进入二季度后赚钱效应进一步收缩，整体下跌。具体来看，上半年全 A 指数上涨 3.06%，上证涨 3.65%，沪深 300 跌 0.75%，创业板指跌 5.61%，科创 50 涨 4.71%，其中二季度各板块均有不同程度的跌幅。上半年表现较好的板块主要集中在受益于 AI 的 TMT 和中特估板块，以及后续延伸出来的机器人和自动驾驶等板块，而表现较差的板块主要集中在传统赛道新能源、消费、医药等板块。可转债市场方面，指数整体表现较好，但受到权益风格轮动较快的影响整体赚钱效应一般，转债估值持续提高。

回顾上半年，本基金以追求绝对收益为目标，在大类资产配置上主要配置金融债和短久期利率债，获取稳定的票息和杠杆收益。在风险资产上，一季度我们基于经济复苏预期的强化配置了顺周期相关消费、家电等板块，但是随着二季度经济修复动能减弱后同时基于对全球人工智能产业周期的共振趋势判断，我们降低了顺周期板块的配置，转而超配了通信、计算机、电子等相关板块，虽然相关行业取得了一定的相对收益，但是在市场整体下跌中较高的仓位依然对组合净值贡献了负贡献。在可转债方面，我们主要配置哑铃型策略，一方面选取低价有绝对票息的大金融、公用事业等个券，另一方面选取行业景气度较高，溢价率较低的偏股型个股来获取超额收益。二季度受到转债整体估值压缩的影响，较高的转债仓位对组合贡献了较多负收益。总体来说，由于较高的风险资产配置上半年组合净值表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富恒利债券 A 份额净值为 1.029 元，累计份额净值为 1.073 元。报告期，华富恒利债券 A 份额净值增长率为-1.06%，同期业绩比较基准收益率为 2.98%。截止本期末，华富恒利债券 C 份额净值为 0.994 元，累计份额净值为 1.015 元。报告期，华富恒利债券 C 份额净值增长率为-1.19%，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，全球经济增速或将继续放缓，出口增长面临压力，中国经济增长仍将主要取决于内需的恢复程度。7 月份召开的政治局会议，回应了当前经济修复过程中面临的一些问题并指

出了后续发力的方向，同时也首次提出活跃资本市场的建议，给市场注入了信心，使得市场对下半年经济增长的预期有所升温。未来随着各项政策的具体落地，叠加国内库存周期基本进入主动去库的尾声，下半年大概率将进入被动去库的阶段，我们相信下半年国内经济有望走出新的增长态势。基于当前的经济环境，我们预计央行仍将灵活使用公开市场操作、各类借贷便利工具确保流动性合理充裕，维持稳健略宽的流动性环境。

在资产配置上，虽然当前债券市场绝对赔率偏低，但是在经济维持目前震荡格局下胜率依然不低，仍然需要重视票息收入和把握阶段性长端利率的机会。而股票市场在经历了二季度下跌后已经较充分反应经济复苏偏弱的悲观预期，随着 6 月份部分经济数据的筑底企稳以及对政策预期的强化，目前整体赔率较高，胜率取决于政策的发力点以及对复苏斜率抬升交易的重启。

债券市场方面，经济弱复苏背景下，央行维持暖意，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，组合依然保持中性久期、中性杠杆，本基金还是以票息收入杠杆为辅的策略。

权益市场方面，政治局会议之后，稳地产、化解债务风险、活跃资本市场等诸多提法进一步提升了市场的风险偏好，市场重新开启了对经济复苏的预期。未来我们将密切跟踪各项政策的持续落地，也将重点关注以下几个方向：一是在上半年调整充分的顺周期地产链、可选消费等板块寻找业绩确定性强、受益于新消费模式下的细分领域和公司；二是具备长期高分红能力的央企、国企，看好在新一轮央国企改革与重估中胜出的公司；三是本轮人工智能的产业趋势是明确的，随着主题投资热情退却后，我们依然看好人工智能领域相对景气度明确或商业模式清晰的细分领域，同时在国家战略中属于大安全和自主可控领域，具备核心竞争力以及中长期景气度优势的通信、计算机、电子板块；四是具备国际比较优势的高端制造业，包括新能源车、光伏、机械制造等中报业绩依然高增，并且能够分享全球产业趋势的优势板块。

可转债市场方面，短期来看，反弹后转债溢价率略有收敛但整体性价比仍不高。中长期看，资产荒时代下固收+资金对于可转债的配置需求仍较高，因此我们继续围绕选股思路的正股替代与中低价位的纯债替代两个维度展开，把握结构性机会。

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《华富恒利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-19,275.83元，期末可供分配利润为-803,915.26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

从2022年12月29日起至本报告期末（2023年06月30日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于5000万元的情形，至本报告期末（2023年06月30日）基金资产净值仍低于5000万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：华富恒利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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,831.34	41,083,112.43
结算备付金		15,636.61	604,913.06
存出保证金		5,387.45	32,857.41
交易性金融资产	6.4.7.2	1,706,364.21	2,899,742.58
其中：股票投资		317,776.40	-
基金投资		-	-
债券投资		1,388,587.81	2,899,742.58
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	-	-
应收清算款		9,955.91	10,518,502.87
应收股利		-	-
应收申购款		1,129.99	620.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,754,305.51	55,139,748.35
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		89,970.61	2,551,910.75
应付清算款		-	-
应付赎回款		12,358.15	51,519,048.39
应付管理人报酬		795.83	25,890.10
应付托管费		265.29	8,630.02
应付销售服务费		325.50	27.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7.59	883.35
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	11,409.41	234,036.27
负债合计		115,132.38	54,340,426.51
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,627,936.81	771,469.73
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	11,236.32	27,852.11
净资产合计		1,639,173.13	799,321.84
负债和净资产总计		1,754,305.51	55,139,748.35

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,627,936.81 份，其中华富恒利债券 A 基金份额总额 605,691.20 份，基金份额净值 1.029 元；华富恒利债券 C 基金份额总额 1,022,245.61 份，基金份额净值 0.994 元。

6.2 利润表

会计主体：华富恒利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 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		11,159.92	-9,590,555.29
1. 利息收入		2,157.38	24,119.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,157.38	24,119.79
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,458.57	-9,445,282.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-29,682.41	-13,177,155.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	24,836.74	3,488,339.58
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
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	1,387.10	243,533.36
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	12,364.26	-179,129.15
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	96.85	9,736.41
减：二、营业总支出		30,435.75	1,477,982.36
1. 管理人报酬		4,759.30	797,959.55
2. 托管费		1,586.33	265,986.54
3. 销售服务费		1,848.93	996.23
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,916.15	295,246.09
其中：卖出回购金融资产支出		1,916.15	295,246.09
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		2.97	8,216.12
8. 其他费用	6.4.7.19	20,322.07	109,577.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,275.83	-11,068,537.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,275.83	-11,068,537.65
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,275.83	-11,068,537.65

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富恒利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）	771,469.73	-	27,852.11	799,321.84
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）	771,469.73	-	27,852.11	799,321.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	856,467.08	-	-16,615.79	839,851.29
（一）、综合收益总额	-	-	-19,275.83	-19,275.83
（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）	856,467.08	-	2,660.04	859,127.12
其中： 1. 基金申购款	1,300,717.61	-	9,596.32	1,310,313.93
2. 基金赎回款	-444,250.53	-	-6,936.28	-451,186.81
（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)	1,627,936.81	-	11,236.32	1,639,173.13
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)	280,587,717.26	-	61,597,512.01	342,185,229.27
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)	280,587,717.26	-	61,597,512.01	342,185,229.27
三、本 期增减 变动额 (减少 以“-” 号填 列)	-88,855,256.44	-	-27,713,347.27	-116,568,603.71
(一)、 综合收	-	-	-11,068,537.65	-11,068,537.65

益总额				
(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)	-88,855,256.44	-	-16,644,809.62	-105,500,066.06
其中： 1. 基金 申购款	17,028,010.51	-	3,714,664.00	20,742,674.51
2 . 基金赎 回款	-105,883,266.95	-	-20,359,473.62	-126,242,740.57
(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)	191,732,460.82	-	33,884,164.74	225,616,625.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富恒利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[2015]220号）核准，基金合同于2015年8月31日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并出具《验资报告》（天健验（2015）6-153号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华富恒利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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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（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	15,831.34
等于：本金	15,826.05
加：应计利息	5.29
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	15,831.34

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	318,755.00	-	317,776.40	-978.60	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,365,081.44	7,352.51	1,388,587.81	16,153.86
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,365,081.44	7,352.51	1,388,587.81	16,153.86
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,683,836.44	7,352.51	1,706,364.21	15,175.26	

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,109.41
其中：交易所市场	2,109.41
银行间市场	-
应付利息	-
中债账户维护费	4,500.00
上清账户维护费	4,800.00
合计	11,409.41

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华富恒利债券 A

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	693,789.12	693,789.12
本期申购	105,878.67	105,878.67
本期赎回（以“-”号填列）	-193,976.59	-193,976.59
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	605,691.20	605,691.20

华富恒利债券 C

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	77,680.61	77,680.61
本期申购	1,194,838.94	1,194,838.94
本期赎回 (以“-”号填列)	-250,273.94	-250,273.94
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	1,022,245.61	1,022,245.61

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

华富恒利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-321,788.55	349,200.65	27,412.10
本期利润	-11,251.34	5,153.53	-6,097.81
本期基金份额交易产生的变动数	41,281.89	-44,834.59	-3,552.70
其中：基金申购款	-49,319.96	53,233.39	3,913.43
基金赎回款	90,601.85	-98,067.98	-7,466.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-291,758.00	309,519.59	17,761.59

华富恒利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-37,415.72	37,855.73	440.01
本期利润	-20,388.75	7,210.73	-13,178.02
本期基金份额交易产生的变动数	-454,352.79	460,565.53	6,212.74
其中：基金申购款	-577,718.40	583,401.29	5,682.89
基金赎回款	123,365.61	-122,835.76	529.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-512,157.26	505,631.99	-6,525.27

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	1,182.05
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	853.53
其他	121.80
合计	2,157.38

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	-29,682.41
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	-29,682.41

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	1,319,254.72
减：卖出股票成本总额	1,344,749.71
减：交易费用	4,187.42
买卖股票差价收入	-29,682.41

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	9,725.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,111.33

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	24,836.74

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	5,668,023.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,629,634.86
减：应计利息总额	23,006.05
减：交易费用	271.56
买卖债券差价收入	15,111.33

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

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

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	1,387.10
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	1,387.10

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	12,364.26
股票投资	-978.60
债券投资	13,342.86
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	12,364.26

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	96.85
合计	96.85

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	-

信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,722.07
账户维护费	18,600.00
合计	20,322.07

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
招商银行股份有限公司	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	1,647,690.32	57.79	21,995,372.62	6.13

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	3,256,617.18	33.73	3,277,035.41	2.41

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	5,694,000.00	62.61	-	-

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	1,577.52	57.31	1,577.52	74.78
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	20,043.68	5.93	-	-

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	4,759.30
其中：支付销售机构的客户维护费	2,041.23	1,460.07

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{管理费率} \div \text{当年天数}$ （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	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,586.33	265,986.54

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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）。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	-	-	-
招商银行股份有限公司 (托管人)	-	22.82	22.82
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	-	-	-
合计	-	22.82	22.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C	合计
华富基金管理有限公司 (管理人)	-	-	-
招商银行股份有限公司 (托管人)	-	23.98	23.98
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	-	-	-
合计	-	23.98	23.98

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。计算公式 $H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$ （H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费，E 为 C 类基金份额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：本基金本报告期和上年度可比期间内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
招商银行股份有限公司	15,831.34	1,182.05	1,618,144.72	6,940.46

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 89,970.61 元，于 2023 年 7 月 3 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 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

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	199,835.42	-
AAA 以下	718,323.05	-
未评级	-	-
合计	918,158.47	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为

未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	15,831.34	-	-	-	-	-	15,831.34
结算备付金	15,636.61	-	-	-	-	-	15,636.61
存出保证金	5,387.45	-	-	-	-	-	5,387.45
交易性金融资产	63,405.81	102,920.72	1,105,749.35	-	116,511.93	317,776.40	1,706,364.21
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	-	-	-	-	-	1,129.99	1,129.99
应收清算款	-	-	-	-	-	9,955.91	9,955.91

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	100,261.21	102,920.72	1,105,749.35	-116,511.93	328,862.30	1,754,305.51	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	12,358.15	12,358.15	
应付管理人报酬	-	-	-	-	795.83	795.83	
应付托管费	-	-	-	-	265.29	265.29	
应付清算款	-	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	89,970.61	-	-	-	-	89,970.61	
应付销售服务费	-	-	-	-	325.50	325.50	
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	
应付利润	-	-	-	-	-	-	
应交税费	-	-	-	-	7.59	7.59	
其他负债	-	-	-	-	11,409.41	11,409.41	
负债总计	89,970.61	-	-	-	25,161.77	115,132.38	
利率敏感度缺口	10,290.60	102,920.72	1,105,749.35	-116,511.93	303,700.53	1,639,173.13	
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	41,083,112.43	-	-	-	-	-41,083,112.43	
结算备付金	604,913.06	-	-	-	-	-	604,913.06

存出保证金	32,857.41	-	-	-	-	-	32,857.41
交易性金融资产	-	-2,899,742.58	-	-	-	-	2,899,742.58
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	-	-	-	-	-	620.00	620.00
应收清算款	-	-	-	-	-	10,518,502.87	10,518,502.87
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	41,720,882.90	-2,899,742.58	-	-	-	10,519,122.87	55,139,748.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	51,519,048.39	51,519,048.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,890.10	25,890.10
应付托管费	-	-	-	-	-	8,630.02	8,630.02
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,551,910.75	-	-	-	-	-	2,551,910.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	27.63	27.63
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税	-	-	-	-	-	883.35	883.35

费							
其他负债		-	-	-	-	234,036.27	234,036.27
负债总计	2,551,910.75		-	-	-	51,788,515.76	54,340,426.51
利率敏感度缺口	39,168,972.15		-2,899,742.58	-	-	-41,269,392.89	799,321.84

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	-14,135.05	-16,373.85
	市场利率下降 25 基点	14,506.85	16,248.25

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	317,776.40	19.39	-	-

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,388,587.81	84.71	2,899,742.58	362.78
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	1,706,364.21	104.10	2,899,742.58	362.78

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 指数上升百分之五	16,993.55	-
	沪深 300 指数下降百分之五	-16,993.55	-

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	135,998.29	96,590.59

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	1,229,224.67	-
第二层次	477,139.54	2,899,742.58
第三层次	-	-
合计	1,706,364.21	2,899,742.58

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	317,776.40	18.11
	其中：股票	317,776.40	18.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,388,587.81	79.15

	其中：债券	1,388,587.81	79.15
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,467.95	1.79
8	其他各项资产	16,473.35	0.94
9	合计	1,754,305.51	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	203,121.40	12.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,160.00	0.80
F	批发和零售业	-	-
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	75,285.00	4.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	26,210.00	1.60
S	综合	-	-
	合计	317,776.40	19.39

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	000063	中兴通讯	500	22,770.00	1.39
2	300499	高澜股份	1,100	19,382.00	1.18
3	002050	三花智控	600	18,156.00	1.11
4	002475	立讯精密	500	16,225.00	0.99
5	600487	亨通光电	1,100	16,126.00	0.98
6	002401	中远海科	600	15,792.00	0.96
7	603019	中科曙光	300	15,270.00	0.93
8	002463	沪电股份	700	14,658.00	0.89
9	002343	慈文传媒	1,900	14,402.00	0.88
10	300634	彩讯股份	500	13,200.00	0.81
11	000032	深桑达 A	400	13,160.00	0.80
12	601138	工业富联	500	12,600.00	0.77
13	002459	晶澳科技	300	12,510.00	0.76
14	300459	汤姆猫	1,900	12,331.00	0.75
15	300014	亿纬锂能	200	12,100.00	0.74
16	300654	世纪天鸿	900	11,808.00	0.72
17	300458	全志科技	400	10,900.00	0.66
18	300548	博创科技	300	10,335.00	0.63
19	300496	中科创达	100	9,635.00	0.59
20	600986	浙文互联	1,300	8,320.00	0.51
21	603236	移远通信	140	8,079.40	0.49
22	002558	巨人网络	400	7,172.00	0.44
23	300638	广和通	300	6,804.00	0.42
24	601728	中国电信	1,200	6,756.00	0.41
25	300054	鼎龙股份	200	4,946.00	0.30
26	002156	通富微电	100	2,260.00	0.14
27	300188	美亚柏科	100	2,079.00	0.13

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	601900	南方传媒	131,635.68	16.47
2	300687	赛意信息	41,944.00	5.25
3	600109	国金证券	38,640.00	4.83
4	600487	亨通光电	35,930.00	4.50
5	002401	中远海科	29,427.00	3.68
6	603198	迎驾贡酒	26,094.00	3.26

7	600809	山西汾酒	25,555.00	3.20
8	600986	浙文互联	25,421.00	3.18
9	002343	慈文传媒	25,381.00	3.18
10	002100	天康生物	24,008.00	3.00
11	000681	视觉中国	23,212.00	2.90
12	603019	中科曙光	22,542.00	2.82
13	300499	高澜股份	20,986.00	2.63
14	300496	中科创达	20,771.00	2.60
15	600839	四川长虹	20,562.00	2.57
16	300252	金信诺	19,854.00	2.48
17	000063	中兴通讯	19,830.00	2.48
18	002291	遥望科技	18,683.00	2.34
19	002335	科华数据	18,650.00	2.33
20	600702	舍得酒业	18,574.00	2.32
21	600507	方大特钢	16,794.00	2.10
22	600998	九州通	16,692.00	2.09
23	002493	荣盛石化	16,640.00	2.08
24	000932	华菱钢铁	16,530.00	2.07
25	688596	正帆科技	16,344.61	2.04
26	300133	华策影视	16,263.00	2.03
27	002727	一心堂	16,120.00	2.02
28	603259	药明康德	16,088.00	2.01
29	300494	盛天网络	16,068.00	2.01

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	601900	南方传媒	136,076.52	17.02
2	300687	赛意信息	41,135.00	5.15
3	600109	国金证券	36,889.00	4.62
4	603198	迎驾贡酒	24,388.00	3.05
5	600809	山西汾酒	23,781.00	2.98
6	000681	视觉中国	23,656.00	2.96
7	002100	天康生物	20,784.00	2.60
8	600839	四川长虹	19,488.00	2.44
9	002401	中远海科	19,292.00	2.41
10	002493	荣盛石化	18,406.00	2.30
11	300252	金信诺	18,144.00	2.27
12	600487	亨通光电	17,680.00	2.21
13	688596	正帆科技	17,348.60	2.17

14	600702	舍得酒业	17,081.00	2.14
15	002727	一心堂	16,921.00	2.12
16	000932	华菱钢铁	16,860.00	2.11
17	600998	九州通	16,824.00	2.10
18	002335	科华数据	16,407.00	2.05
19	002291	遥望科技	16,236.00	2.03
20	300494	盛天网络	16,208.00	2.03
21	000539	粤电力 A	16,162.00	2.02
22	002415	海康威视	16,114.00	2.02
23	603259	药明康德	16,034.00	2.01

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	1,663,504.71
卖出股票收入（成交）总额	1,319,254.72

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	470,429.34	28.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	918,158.47	56.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,388,587.81	84.71

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	019688	22 国债 23	3,500	353,917.41	21.59
2	019547	16 国债 19	1,110	116,511.93	7.11

3	113057	中银转债	540	70,365.67	4.29
4	110091	合力转债	220	34,321.69	2.09
5	113021	中信转债	290	33,383.24	2.04

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。

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，中信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	5,387.45
2	应收清算款	9,955.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,129.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	16,473.35

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	113057	中银转债	70,365.67	4.29
2	110091	合力转债	34,321.69	2.09
3	113021	中信转债	33,383.24	2.04
4	123164	法本转债	27,721.34	1.69
5	128079	英联转债	24,996.27	1.52
6	118013	道通转债	22,574.77	1.38
7	110062	烽火转债	22,457.47	1.37
8	113594	淳中转债	21,581.61	1.32
9	110048	福能转债	21,573.93	1.32
10	127058	科伦转债	18,897.21	1.15
11	123048	应急转债	16,217.95	0.99
12	113024	核建转债	15,731.48	0.96
13	128140	润建转债	15,299.32	0.93
14	110043	无锡转债	15,296.35	0.93
15	123158	宙邦转债	15,271.61	0.93
16	123107	温氏转债	15,071.52	0.92
17	127012	招路转债	15,061.45	0.92
18	123071	天能转债	15,004.50	0.92
19	123050	聚飞转债	14,800.64	0.90
20	127045	牧原转债	14,171.96	0.86
21	113045	环旭转债	14,039.58	0.86
22	111010	立昂转债	13,722.56	0.84
23	123138	丝路转债	13,721.56	0.84
24	123115	捷捷转债	13,579.25	0.83
25	127065	瑞鹄转债	12,610.63	0.77
26	113061	拓普转债	12,152.19	0.74
27	118024	冠宇转债	11,849.44	0.72
28	110060	天路转债	11,071.10	0.68
29	123075	贝斯转债	10,985.68	0.67
30	113661	福 22 转债	10,894.22	0.66
31	113059	福莱转债	9,593.28	0.59
32	127046	百润转债	8,603.10	0.52
33	118021	新致转债	8,466.94	0.52
34	113663	新化转债	8,389.28	0.51
35	110090	爱迪转债	8,368.49	0.51
36	113530	大丰转债	8,247.96	0.50
37	128083	新北转债	7,893.05	0.48
38	111000	起帆转债	7,786.40	0.48

39	127029	中钢转债	7,753.07	0.47
40	113602	景 20 转债	7,621.30	0.46
41	128133	奇正转债	7,591.08	0.46
42	123161	强联转债	7,565.58	0.46
43	110080	东湖转债	7,560.92	0.46
44	118023	广大转债	7,501.30	0.46
45	123038	联得转债	7,485.02	0.46
46	127073	天赐转债	7,409.69	0.45
47	123112	万讯转债	7,366.21	0.45
48	113588	润达转债	7,291.30	0.44
49	127018	本钢转债	7,247.56	0.44
50	128044	岭南转债	7,222.58	0.44
51	110058	永鼎转债	7,189.19	0.44
52	123122	富瀚转债	7,108.83	0.43
53	118011	银微转债	7,097.24	0.43
54	118003	华兴转债	7,087.23	0.43
55	113055	成银转债	7,004.11	0.43
56	113604	多伦转债	6,946.32	0.42
57	123145	药石转债	6,943.73	0.42
58	123054	思特转债	6,905.14	0.42
59	110079	杭银转债	6,900.89	0.42
60	113063	赛轮转债	6,858.42	0.42
61	113062	常银转债	6,845.80	0.42
62	123170	南电转债	6,710.20	0.41
63	127056	中特转债	6,612.03	0.40
64	113039	嘉泽转债	6,599.27	0.40
65	128132	交建转债	6,243.17	0.38

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

华富恒利债券 A	145	4,177.18	0.00	0.00	605,691.20	100.00
华富恒利债券 C	162	6,310.16	0.00	0.00	1,022,245.61	100.000
合计	307	5,302.73	0.00	0.00	1,627,936.81	100.000

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自份额级别的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华富恒利债券 A	2,184.72	0.3607
	华富恒利债券 C	771,729.80	75.4936
	合计	773,914.52	47.5396

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例，对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	华富恒利债券 A	0
	华富恒利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华富恒利债券 A	0
	华富恒利债券 C	50~100
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C
基金合同生效日（2015年8月31日）基金份额总额	252,261,700.61	108,231,824.59
本报告期期初基金份额总额	693,789.12	77,680.61
本报告期基金总申购份额	105,878.67	1,194,838.94
减：本报告期基金总赎回份额	193,976.59	250,273.94

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	605,691.20	1,022,245.61

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	5	1,647,690.32	57.79	1,577.52	57.31	-
东北证券	2	466,978.82	16.38	433.03	15.73	-
申万宏源	1	245,859.61	8.62	258.09	9.38	-
中银国际	1	226,709.00	7.95	238.43	8.66	-
民生证券	1	202,953.00	7.12	188.97	6.86	-
东方财富证券	1	60,933.00	2.14	56.74	2.06	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金融证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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

2)此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3)本报告期本基金新增华安证券、华泰证券等交易单元。

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	3,256,617.18	33.73	5,694,000.00	62.61	-	-
东北证券	1,394,837.24	14.45	2,900,000.00	31.89	-	-
申万宏源	1,294,015.26	13.40	500,000.00	5.50	-	-
中银国际	492,517.04	5.10	-	-	-	-
民生证券	556,562.97	5.76	-	-	-	-
东方财富证券	62,024.85	0.64	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证	-	-	-	-	-	-

券						
银河证 券	2,599,136.6 5	26.92	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

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	华富恒利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	华富恒利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	华富恒利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	1	2023.1.4- 2023.6.30	0.00	771,720. 93	0.00	771,720.93	47.40 00
-	-	-	-	-	-	-	-
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、华富恒利债券型证券投资基金基金合同

- 2、华富恒利债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富恒利债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富恒利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