

# 华富安福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                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 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合规守信情况的说明              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 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                | 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>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                    | 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       | 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                    | 45        |
| 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      | 45        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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..... | 45        |
| 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.....    | 46        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 46        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 46        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 48        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 48        |
| 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.....      | 48        |
| <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>49</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 49        |
| 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.....      | 49        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 49        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 49        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 49        |
| 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.....                           | 52        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>52</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.....    | 52        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 53        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                     | <b>53</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                           | 53        |
| 12.2 存放地点.....                             | 53        |
| 12.3 查阅方式.....                             | 53        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 华富安福债券型证券投资基金    |
| 基金简称       | 华富安福债券           |
| 基金主代码      | 002412           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2019 年 4 月 2 日   |
| 基金管理人      | 华富基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 175,178,311.02 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | 本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。本基金投资组合中债券类、权益类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          | 基金管理人                              | 基金托管人                 |
|-------------|------------------------------------|-----------------------|
| 名称          | 华富基金管理有限公司                         | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                                 | 满志弘                   |
|             | 联系电话                               | 021-68886996          |
|             | 电子邮箱                               | manzh@hffund.com      |
| 客户服务电话      | 400-700-8001                       | 021-60637228          |
| 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 | 《中国证券报》 |
|----------------|---------|

|                     |                       |
|---------------------|-----------------------|
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.hffund.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人的办公场所      |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                   |
|--------|------------|--|
| 注册登记机构 | 华富基金管理有限公司 | 上海市浦东新区栖霞路 18 号<br>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       | -3,827,694.21                       |
| 本期利润          | 4,911,354.73                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0164                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.59%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.93%                               |
| 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      | 872,580.60                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0050                              |
| 期末基金资产净值      | 179,571,162.12                      |
| 期末基金份额净值      | 1.0251                              |
| 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   | 22.05%                              |

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

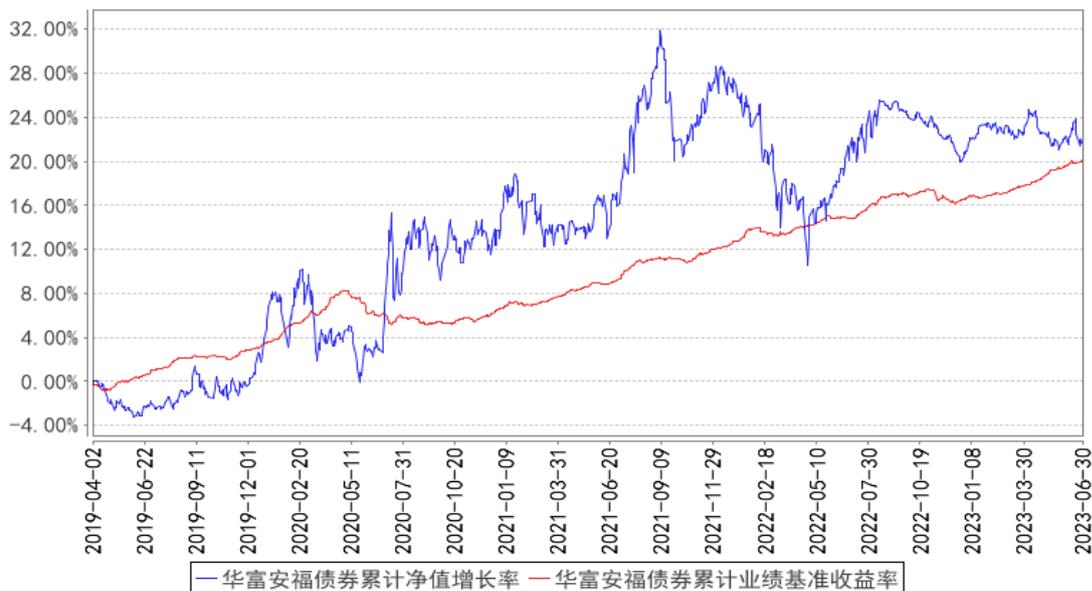
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.06%    | 0.42%       | 0.55%      | 0.06%         | -0.49% | 0.36% |
| 过去三个月 | -0.73%   | 0.32%       | 1.98%      | 0.05%         | -2.71% | 0.27% |
| 过去六个月 | 0.93%    | 0.28%       | 2.98%      | 0.05%         | -2.05% | 0.23% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 0.70%  | 0.35% | 4.58%  | 0.06% | -3.88% | 0.29% |
| 过去三年       | 17.73% | 0.67% | 13.17% | 0.06% | 4.56%  | 0.61% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.05% | 0.64% | 20.14% | 0.07% | 1.91%  | 0.57% |

注：业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率。

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

华富安福债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金转型前为华富安福保本混合型证券投资基金。根据《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金建仓期为 2019 年 4 月 2 日到 2019 年 10 月 2 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止

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 | 2019 年 4 月 2 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

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，本基金继续以追求绝对收益为目标，在大类资产配置上优先配置了高等级信用债，以票息为主杠杆为辅的债券策略给组合贡献了正向的票息和杠杆收益。在风险资产上，年初我们基于疫后复苏的大逻辑和股权风险溢价比较的判断，提高了风险资产的仓位，在行业配置上，一方面站在全年维度我们选择了业绩有望困境反转的计算机和医药板块，同时基于 ChatGPT 的问世所带来的新产业趋势，我们增加了以半导体为代表的电子行业个股配置；另一方面，由于今年我们所面临的复杂的内外部环境，海外演绎通胀走向衰退，国内疫后复苏趋势显现但是复苏强度需要进一步验证，因此我们也配置了一部分高分红的个股来平衡组合的波动，使得风险资产组合相对均衡。4 月份随着地产销售数据改善的放缓，我们开始对经济复苏的预期进行下修，也适当降低了部分顺周期板块的配置比例，但是基于对全球人工智能产业周期的共振趋势判断，我们进一步增加了通信、计算机的配置比例，同时组合中保留了以半导体为代表的电子行业配置，组合整体维持较高仓位。在二季度权益市场整体下行的节奏中，虽然以 TMT 为代表的部分仓位有一定相对收益，但是组合的高仓位依然贡献了负收益，对净值影响较大。由于可转债市场整体估值依然较高，二季度我们转债依然偏中低价转债为主的策略，但是在转债信用风险带来的估值压缩中也对组合贡献了负收益。上半年，债券资产给组合贡献了票息，但风险资产整体出现负贡献，对净值有所影响。

#### 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 1.0251 元，累计基金份额净值为 1.2622 元。报告期，本基金份额净值增长率为 0.93%，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基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 4,911,354.73 元，期末可供分配利润为 872,580.60 元。报告期

内未进行利润分配，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：华富安福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<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 97,579.06              | 166,257.08               |
| 结算备付金      |         | 5,501,385.01           | 10,122,725.33            |
| 存出保证金      |         | 79,816.42              | 60,391.66                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 223,506,695.06         | 539,452,436.07           |
| 其中：股票投资    |         | 34,136,645.47          | 76,425,481.90            |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 189,370,049.59         | 463,026,954.17           |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 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         |            | 5,000,000.00              | 29,083,888.59               |
| 应收股利          |            | -                         | -                           |
| 应收申购款         |            | 596.18                    | 9.99                        |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 234,186,071.73            | 578,885,708.72              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>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     |            | 49,182,619.91             | 88,566,161.55               |
| 应付清算款         |            | 4,926,070.13              | -                           |
| 应付赎回款         |            | 1,415.93                  | 47,025,426.80               |
| 应付管理人报酬       |            | 103,606.07                | 298,009.29                  |
| 应付托管费         |            | 29,601.74                 | 85,145.52                   |
| 应付销售服务费       |            | -                         | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 8,250.11                  | 25,932.07                   |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 363,345.72                | 378,043.18                  |
| 负债合计          |            | 54,614,909.61             | 136,378,718.41              |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 175,178,311.02            | 435,651,376.46              |
| 其他综合收益        |            | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 4,392,851.10              | 6,855,613.85                |
| 净资产合计         |            | 179,571,162.12            | 442,506,990.31              |
| 负债和净资产总计      |            | 234,186,071.73            | 578,885,708.72              |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0251 元，基金份额总额 175,178,311.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华富安福债券型证券投资基金

本报告期：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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | 7,060,056.46                             | -299,926.81                                   |
| 1. 利息收入                |          | 62,806.13                                | 462.44  |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.9  | 62,806.13                                | 462.44  |
| 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）      |          | -1,789,594.17                            | -199,222.37                                   |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.10 | -3,393,238.81                            | -198,920.50                                   |
| 基金投资收益                 |          | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.11 | 1,347,569.30                             | -7,618.19                                     |
| 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 | 256,075.34                               | 7,316.32                                      |
| 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 | 8,739,048.94                             | -101,278.46                                   |
| 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 | 47,795.56                                | 111.58  |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |          | 2,148,701.73                             | 55,944.77                                     |
| 1. 管理人报酬               |          | 1,092,085.94                             | 22,462.06                                     |
| 2. 托管费                 |          | 312,024.55                               | 6,417.73                                      |
| 3. 销售服务费               |          | -  | -   |
| 4. 投资顾问费               |          | -  | -   |
| 5. 利息支出                |          | 622,489.06                               | 3,116.65                                      |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |          | 622,489.06                               | 3,116.65                                      |
| 6. 信用减值损失              |          | -  | -   |
| 7. 税金及附加               |          | 9,107.63                                 | 28.93   |
| 8. 其他费用                | 6.4.7.19 | 112,994.55                               | 23,919.40                                     |

|                     |  |              |             |
|---------------------|--|--------------|-------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |  | 4,911,354.73 | -355,871.58 |
| 减：所得税费用             |  | -            | -           |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |  | 4,911,354.73 | -355,871.58 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |  | -            | -           |
| 六、综合收益总额            |  | 4,911,354.73 | -355,871.58 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富安福债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>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）      | 435,651,376.46                        | -      | 6,855,613.85  | 442,506,990.31  |
| 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）      | 435,651,376.46                        | -      | 6,855,613.85  | 442,506,990.31  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -260,473,065.44                       | -      | -2,462,762.75 | -262,935,828.19 |
| （一）、综合收益总额           | -                                     | -      | 4,911,354.73  | 4,911,354.73    |

|  |                                 |        |               |                 |
|--|---------------------------------|--------|---------------|-----------------|
| (二)、<br>本期基金份额<br>交易产生的基金<br>净值变动数<br>(净值减少以<br>“-”号<br>填列)          | -260,473,065.44                 | -      | -7,374,117.48 | -267,847,182.92 |
| 其中:  |                                 |        |               |                 |
| 1. 基金<br>申购款   | 405,287.20                      | -      | 11,437.30     | 416,724.50      |
| 2<br>. 基金赎回<br>款   | -260,878,352.64                 | -      | -7,385,554.78 | -268,263,907.42 |
| (三)、<br>本期向基金份<br>额持有人分配<br>利润产生的基金<br>净值变动<br>(净值减少以<br>“-”号<br>填列) | -                               | -      | -             | -               |
| (四)、<br>其他综合收益<br>结转留存收益   | -                               | -      | -             | -               |
| 四、本期期末<br>净资产<br>(基金<br>净值)  | 175,178,311.02                  | -      | 4,392,851.10  | 179,571,162.12  |
| 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<br>期末   | 5,321,858.38                    | -      | 1,677,576.71  | 6,999,435.09    |

|   |              |   |              |              |
|---|--------------|---|--------------|--------------|
| 净资产<br>(基金<br>净值)   |              |   |              |              |
| 加：会<br>计政策<br>变更  | -            | - | -            | -            |
| 前期差<br>错更正  | -            | - | -            | -            |
| 其他  | -            | - | -            | -            |
| 二、本<br>期期初<br>净资产<br>(基金<br>净值)   | 5,321,858.38 | - | 1,677,576.71 | 6,999,435.09 |
| 三、本<br>期增减<br>变动额<br>(减少<br>以“-”<br>号填<br>列)                                | 209,908.79   | - | -296,677.18  | -86,768.39   |
| (一)、<br>综合收<br>益总额  | -            | - | -355,871.58  | -355,871.58  |
| (二)、<br>本期基<br>金份额<br>交易产<br>生的基<br>金净值<br>变动数<br>(净值<br>减少以<br>“-”号<br>填列) | 209,908.79   | - | 59,194.40    | 269,103.19   |
| 其中：<br>1. 基金<br>申购款   | 566,043.07   | - | 138,377.61   | 704,420.68   |
| 2<br>. 基金<br>赎回款  | -356,134.28  | - | -79,183.21   | -435,317.49  |
| (三)、<br>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）                   | 5,531,767.17 | - | 1,380,899.53 | 6,912,666.70 |

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

华富安福保本混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）从 2019 年 4 月 2 日转型为华富安福债券型证券投资基金。华富安福保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监许可[2016]22 号）核准。基金合同于 2016 年 3 月 23 日生效。成立时本基金份额为 378,984,818.71 份。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（天健验（2016）6-53 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，

其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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% 的征税率缴纳增值税。

(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<br>2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 97,579.06              |
| 等于：本金          | 97,495.72              |
| 加：应计利息         | 83.34                  |
| 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          | 97,579.06 |

注：“其他存款”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<br>2023 年 6 月 30 日 |                |                |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 应计利息           | 公允价值           | 公允价值变动         |               |
| 股票            | 33,811,977.50          | -              | 34,136,645.47  | 324,667.97     |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -              | -              |               |
| 债券            | 交易所市场                  | 125,961,332.38 | 1,871,216.15   | 127,071,754.05 | -760,794.48   |
|               | 银行间市场                  | 61,355,611.50  | 1,598,295.54   | 62,298,295.54  | -655,611.50   |
|               | 合计                     | 187,316,943.88 | 3,469,511.69   | 189,370,049.59 | -1,416,405.98 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -              | -              |               |
| 基金            | -                      | -              | -              | -              |               |
| 其他            | -                      | -              | -              | -              |               |
| 合计            | 221,128,921.38         | 3,469,511.69   | 223,506,695.06 | -1,091,738.01  |               |

#### 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<br>2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 0.73                   |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 259,825.44             |
| 其中：交易所市场    | 259,125.44             |
| 银行间市场       | 700.00                 |
| 应付利息        | -                      |
| 应付审计费       | 34,712.18              |
| 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          | 363,345.72             |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 435,651,376.46                        | 435,651,376.46  |
| 本期申购          | 405,287.20                            | 405,287.20      |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -260,878,352.64                       | -260,878,352.64 |
| 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           | 175,178,311.02                        | 175,178,311.02  |

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           | 10,124,213.47 | -3,268,599.62 | 6,855,613.85  |
| 本期利润           | -3,827,694.21 | 8,739,048.94  | 4,911,354.73  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,423,938.66 | -1,950,178.82 | -7,374,117.48 |
| 其中：基金申购款       | 6,639.68      | 4,797.62      | 11,437.30     |
| 基金赎回款          | -5,430,578.34 | -1,954,976.44 | -7,385,554.78 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 872,580.60    | 3,520,270.50  | 4,392,851.10  |

#### 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  | 10,230.82                       |
| 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 | 51,883.27                       |
| 其他        | 692.04                          |
| 合计        | 62,806.13                       |

注：“其他存款利息收入”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<br>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 | -3,393,238.81              |
| 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               | -3,393,238.81              |

##### 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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 359,879,277.14                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 362,231,787.36                        |
| 减：交易费用     | 1,040,728.59                          |
| 买卖股票差价收入   | -3,393,238.81                         |

##### 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 3,856,017.39               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -2,508,448.09              |
| 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             | 1,347,569.30 |

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>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   | 473,942,761.21             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 471,695,020.38             |
| 减：应计利息总额               | 4,734,506.23               |
| 减：交易费用                 | 21,682.69                  |
| 买卖债券差价收入               | -2,508,448.09              |

#### 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   | 256,075.34                      |
| 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            | 256,075.34                      |

## 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             | 8,739,048.94                    |
| 股票投资                   | 4,734,740.41                    |
| 债券投资                   | 4,004,308.53                    |
| 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                     | 8,739,048.94                    |

## 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 | 47,795.56                       |
| 合计      | 47,795.56                       |

## 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 | 34,712.18                       |

|         |            |
|---------|------------|
| 信息披露费   | 59,507.37  |
| 证券出借违约金 | -          |
| 银行费用    | 175.00     |
| 账户维护费   | 18,600.00  |
| 合计      | 112,994.55 |

#### 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） |
| 华安证券  | 289,988,370.67             | 43.01                   | 2,091,979.55                    | 56.70                   |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |  | 上年度可比期间<br>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 | 274,325,015.37 | 63.56            | 6,160,441.73 | 83.70            |

注：本表中“当期债券成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券交易成交总额。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                    | 上年度可比期间<br>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  | 2,915,221,000.00           | 49.81              | 10,500,000.00                   | 50.60              |

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<br>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  | 277,191.77                      | 43.64          | 14,551.21 | 5.62             |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                |           |                  |
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 华安证券  | 2,358.09                        | 59.98          | 714.18    | 31.22            |

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间<br>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             | 1,092,085.94                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 96,457.12                  | 9,939.36                        |

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6<br>月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>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   |
| 当期发生的基金应支付的托管费 |  | 312,024.55 |   | 6,417.73 |

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生转融通证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30<br>日 |           | 上年度可比期间<br>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<br>有限公司 | 97,579.06                                | 10,230.82 | 34,019.86                                  | 247.22 |

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 49,182,619.91 元，于 2023 年 7 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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | -                      | 130,380,747.94           |
| 合计     | -                      | 130,380,747.94           |

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 154,032,861.88         | 343,661,353.50           |
| AAA 以下 | 22,334,469.49          | 95,799,400.05            |
| 未评级    | -                      | -                        |
| 合计     | 176,367,331.37         | 439,460,753.55           |

#### 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<br>期<br>末<br>202<br>3<br>年<br>6<br>月<br>30<br>日 | 1 个月以内    | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计        |
|---|-----------|--------|----------|-------|-------|-----|-----------|
| 资<br>产  |           |        |          |       |       |     |           |
| 银<br>行  | 97,579.06 | -      | -        | -     | -     | -   | 97,579.06 |

|          |               |               |               |               |           |               |                |
|----------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------|---------------|----------------|
| 存款       |               |               |               |               |           |               |                |
| 结算备付金    | 5,501,385.01  | -             | -             | -             | -         | -             | -5,501,385.01  |
| 存出保证金    | 79,816.42     | -             | -             | -             | -         | -             | 79,816.42      |
| 交易性金融资产  | 11,051,515.10 | 35,187,214.01 | 71,136,588.50 | 71,974,788.50 | 19,943.48 | 34,136,645.47 | 223,506,695.06 |
| 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     | -             | -             | -             | -             | -         | 596.18        | 596.18         |

|          |               |               |               |               |           |               |                |
|----------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------|---------------|----------------|
| 款        |               |               |               |               |           |               |                |
| 应收清算款    |               |               |               |               |           | -5,000,000.00 | 5,000,000.00   |
| 其他资产     |               |               |               |               |           |               |                |
| 资产总计     | 16,730,295.59 | 35,187,214.01 | 71,136,588.50 | 71,974,788.50 | 19,943.48 | 39,137,241.65 | 234,186,071.73 |
| 负债       |               |               |               |               |           |               |                |
| 应付赎回款    |               |               |               |               |           | 1,415.93      | 1,415.93       |
| 应付管理人报酬  |               |               |               |               |           | 103,606.07    | 103,606.07     |
| 应付托管费    |               |               |               |               |           | 29,601.74     | 29,601.74      |
| 应付清算款    |               |               |               |               |           | -4,926,070.13 | 4,926,070.13   |
| 卖出回购金融资产 | 49,182,619.91 |               |               |               |           |               | 49,182,619.91  |

|           |               |               |               |               |           |               |                |
|-----------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------|---------------|----------------|
| 产款        |               |               |               |               |           |               |                |
| 应付销售服务费   |               |               |               |               |           |               |                |
| 应付投资顾问费   |               |               |               |               |           |               |                |
| 应付利润      |               |               |               |               |           |               |                |
| 应交税费      |               |               |               |               |           | 8,250.11      | 8,250.11       |
| 其他负债      |               |               |               |               |           | 363,345.72    | 363,345.72     |
| 负债总计      | 49,182,619.91 |               |               |               |           | -5,432,289.70 | 54,614,909.61  |
| 利率敏感度缺口   | 32,452,324.32 | 35,187,214.01 | 71,136,588.50 | 71,974,788.50 | 19,943.48 | 33,704,951.95 | 179,571,162.12 |
| 上年度末 2022 | 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<br>12<br>月<br>31<br>日              |               |               |                |                |           |               |                |
| 资<br>产                               |               |               |                |                |           |               |                |
| 银<br>行<br>存<br>款                     | 166,257.08    | -             | -              | -              | -         | -             | 166,257.08     |
| 结<br>算<br>备<br>付<br>金                | 10,122,725.33 | -             | -              | -              | -         | -             | 10,122,725.33  |
| 存<br>出<br>保<br>证<br>金                | 60,391.66     | -             | -              | -              | -         | -             | 60,391.66      |
| 交<br>易<br>性<br>金<br>融<br>资<br>产      | 13,201,928.98 | 12,347,506.06 | 234,677,549.46 | 202,780,836.18 | 19,133.49 | 76,425,481.90 | 539,452,436.07 |
| 衍<br>生<br>金<br>融<br>资<br>产           | -             | -             | -              | -              | -         | -             | -              |
| 买<br>入<br>返<br>售<br>金<br>融<br>资<br>产 | -             | -             | -              | -              | -         | -             | -              |
| 债<br>权<br>投                          | -             | -             | -              | -              | -         | -             | -              |

|         |               |               |                |                |           |                |                |
|---------|---------------|---------------|----------------|----------------|-----------|----------------|----------------|
| 资产      |               |               |                |                |           |                |                |
| 应收股利    | -             | -             | -              | -              | -         | -              | -              |
| 应收申购款   | -             | -             | -              | -              | -         | 9.99           | 9.99           |
| 应收清算款   | -             | -             | -              | -              | -         | 29,083,888.59  | 29,083,888.59  |
| 其他资产    | -             | -             | -              | -              | -         | -              | -              |
| 资产总计    | 23,551,303.05 | 12,347,506.06 | 234,677,549.46 | 202,780,836.18 | 19,133.49 | 105,509,380.48 | 578,885,708.72 |
| 负债      |               |               |                |                |           |                |                |
| 应付赎回款   | -             | -             | -              | -              | -         | 47,025,426.80  | 47,025,426.80  |
| 应付管理人报酬 | -             | -             | -              | -              | -         | 298,009.29     | 298,009.29     |
| 应付托管费   | -             | -             | -              | -              | -         | 85,145.52      | 85,145.52      |
| 应付清     | -             | -             | -              | -              | -         | -              | -              |

|           |               |               |                |                |           |               |                |
|-----------|---------------|---------------|----------------|----------------|-----------|---------------|----------------|
| 算款        |               |               |                |                |           |               |                |
| 卖出回购金融资产款 | 88,566,161.55 | -             | -              | -              | -         | -             | 88,566,161.55  |
| 应付销售服务费   | -             | -             | -              | -              | -         | -             | -              |
| 应付投资顾问费   | -             | -             | -              | -              | -         | -             | -              |
| 应付利润      | -             | -             | -              | -              | -         | -             | -              |
| 应交税费      | -             | -             | -              | -              | -         | 25,932.07     | 25,932.07      |
| 其他负债      | -             | -             | -              | -              | -         | 378,043.18    | 378,043.18     |
| 负债总计      | 88,566,161.55 | -             | -              | -              | -         | 47,812,556.86 | 136,378,718.41 |
| 利率敏感      | 65,014,858.50 | 12,347,506.06 | 234,677,549.46 | 202,780,836.18 | 19,133.49 | 57,696,823.62 | 442,506,990.31 |

|             |  |  |  |  |  |  |  |
|-------------|--|--|--|--|--|--|--|
| 度<br>缺<br>口 |  |  |  |  |  |  |  |
|-------------|--|--|--|--|--|--|--|

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      | -604,964.16                 | -3,623,417.43     |
|    | 市场利率下降 25 基点      | 611,079.46                  | 3,136,776.10      |

#### 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<br>2023年6月30日 |              | 上年度末<br>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 | 34,136,645.47     | 19.01        | 76,425,481.90       | 17.27        |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                 | -            | -                   | -            |
| 交易性金融资产—债券投资 | 189,370,049.59    | 105.46       | 463,026,954.17      | 104.64       |

|               |                |        |                |        |
|---------------|----------------|--------|----------------|--------|
| 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            | 223,506,695.06 | 124.47 | 539,452,436.07 | 121.91 |

#### 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          | 1,731,736.00                | 611,414.12             |
|    | 沪深 300 指数下降百分之五          | -1,731,736.00               | -611,414.12            |

#### 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<br>(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                | 9,397,692.86         | 37,834,482.99          |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 66,339,828.99          | 120,614,787.35           |
| 第二层次          | 157,166,866.07         | 418,837,648.72           |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 223,506,695.06         | 539,452,436.07           |

## 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<br>(%) |
|----|--------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | 34,136,645.47  | 14.58            |
|    | 其中：股票  | 34,136,645.47  | 14.58            |
| 2  | 基金投资   | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资 | 189,370,049.59 | 80.86            |
|    | 其中：债券  | 189,370,049.59 | 80.86            |
|    | 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      | 5,598,964.07   | 2.39   |
| 8 | 其他各项资产            | 5,080,412.60   | 2.17   |
| 9 | 合计                | 234,186,071.73 | 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              | 2,050,673.00  | 1.14         |
| C  | 制造业              | 19,618,312.82 | 10.93        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 1,033,972.00  | 0.58         |
| 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  | 8,746,471.65  | 4.87         |
| J  | 金融业              | 724,842.00    | 0.40         |
| 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       | 585,714.00    | 0.33         |
| 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        | 1,376,660.00  | 0.77         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 34,136,645.47 | 19.01        |

### 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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 |
|----|------|------|----|---------|-----------|
|----|------|------|----|---------|-----------|

|    |        |      | (股)     |              | (%)  |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 1  | 600547 | 山东黄金 | 68,500  | 1,608,380.00 | 0.90 |
| 2  | 002459 | 晶澳科技 | 29,600  | 1,234,320.00 | 0.69 |
| 3  | 000999 | 华润三九 | 19,100  | 1,158,606.00 | 0.65 |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 32,300  | 1,048,135.00 | 0.58 |
| 5  | 300308 | 中际旭创 | 7,000   | 1,032,150.00 | 0.57 |
| 6  | 002463 | 沪电股份 | 48,000  | 1,005,120.00 | 0.56 |
| 7  | 300124 | 汇川技术 | 14,100  | 905,361.00   | 0.50 |
| 8  | 002154 | 报喜鸟  | 163,000 | 899,760.00   | 0.50 |
| 9  | 300499 | 高澜股份 | 50,300  | 886,286.00   | 0.49 |
| 10 | 688111 | 金山办公 | 1,806   | 852,829.32   | 0.47 |
| 11 | 688099 | 晶晨股份 | 9,946   | 838,646.72   | 0.47 |
| 12 | 002401 | 中远海科 | 31,400  | 826,448.00   | 0.46 |
| 13 | 300459 | 汤姆猫  | 124,700 | 809,303.00   | 0.45 |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 13,700  | 807,204.00   | 0.45 |
| 15 | 300548 | 博创科技 | 22,600  | 778,570.00   | 0.43 |
| 16 | 002368 | 太极股份 | 18,600  | 765,762.00   | 0.43 |
| 17 | 688041 | 海光信息 | 11,052  | 754,520.04   | 0.42 |
| 18 | 688981 | 中芯国际 | 14,392  | 727,083.84   | 0.40 |
| 19 | 601601 | 中国太保 | 27,900  | 724,842.00   | 0.40 |
| 20 | 301269 | 华大九天 | 5,900   | 724,756.00   | 0.40 |
| 21 | 603019 | 中科曙光 | 14,100  | 717,690.00   | 0.40 |
| 22 | 688777 | 中控技术 | 11,409  | 716,257.02   | 0.40 |
| 23 | 002371 | 北方华创 | 2,200   | 698,830.00   | 0.39 |
| 24 | 601390 | 中国中铁 | 90,400  | 685,232.00   | 0.38 |
| 25 | 688072 | 拓荆科技 | 1,456   | 620,212.32   | 0.35 |
| 26 | 000681 | 视觉中国 | 32,500  | 597,675.00   | 0.33 |
| 27 | 603259 | 药明康德 | 9,400   | 585,714.00   | 0.33 |
| 28 | 002293 | 罗莱生活 | 48,200  | 554,300.00   | 0.31 |
| 29 | 600572 | 康恩贝  | 78,800  | 539,780.00   | 0.30 |
| 30 | 300750 | 宁德时代 | 2,300   | 526,217.00   | 0.29 |
| 31 | 002439 | 启明星辰 | 17,000  | 505,920.00   | 0.28 |
| 32 | 688025 | 杰普特  | 5,755   | 502,699.25   | 0.28 |
| 33 | 002230 | 科大讯飞 | 7,300   | 496,108.00   | 0.28 |
| 34 | 600132 | 重庆啤酒 | 5,300   | 488,448.00   | 0.27 |
| 35 | 688256 | 寒武纪  | 2,593   | 487,484.00   | 0.27 |
| 36 | 688083 | 中望软件 | 3,331   | 482,628.59   | 0.27 |
| 37 | 600276 | 恒瑞医药 | 10,000  | 479,000.00   | 0.27 |
| 38 | 688502 | 茂莱光学 | 2,473   | 474,816.00   | 0.26 |
| 39 | 600986 | 浙文互联 | 73,900  | 472,960.00   | 0.26 |
| 40 | 600150 | 中国船舶 | 13,900  | 457,449.00   | 0.25 |
| 41 | 601728 | 中国电信 | 79,000  | 444,770.00   | 0.25 |
| 42 | 601899 | 紫金矿业 | 38,900  | 442,293.00   | 0.25 |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 43 | 300654 | 世纪天鸿  | 32,300 | 423,776.00 | 0.24 |
| 44 | 002409 | 雅克科技  | 5,300  | 386,264.00 | 0.22 |
| 45 | 002156 | 通富微电  | 16,700 | 377,420.00 | 0.21 |
| 46 | 300133 | 华策影视  | 50,100 | 355,209.00 | 0.20 |
| 47 | 000032 | 深桑达 A | 10,600 | 348,740.00 | 0.19 |
| 48 | 603501 | 韦尔股份  | 3,500  | 343,140.00 | 0.19 |
| 49 | 603345 | 安井食品  | 2,300  | 337,640.00 | 0.19 |
| 50 | 002864 | 盘龙药业  | 7,800  | 328,926.00 | 0.18 |
| 51 | 002624 | 完美世界  | 19,100 | 322,599.00 | 0.18 |
| 52 | 688566 | 吉贝尔   | 7,437  | 290,117.37 | 0.16 |
| 53 | 300666 | 江丰电子  | 3,800  | 258,248.00 | 0.14 |

## 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  | 300036 | 超图软件 | 5,082,422.00 | 1.15           |
| 2  | 600109 | 国金证券 | 4,551,883.00 | 1.03           |
| 3  | 600809 | 山西汾酒 | 4,516,873.00 | 1.02           |
| 4  | 688777 | 中控技术 | 4,322,470.21 | 0.98           |
| 5  | 002607 | 中公教育 | 4,281,442.00 | 0.97           |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 3,911,165.00 | 0.88           |
| 7  | 002508 | 老板电器 | 3,810,405.18 | 0.86           |
| 8  | 688122 | 西部超导 | 3,470,252.52 | 0.78           |
| 9  | 603517 | 绝味食品 | 3,454,603.00 | 0.78           |
| 10 | 603259 | 药明康德 | 3,419,034.00 | 0.77           |
| 11 | 605117 | 德业股份 | 3,402,244.00 | 0.77           |
| 12 | 000681 | 视觉中国 | 3,323,759.00 | 0.75           |
| 13 | 688099 | 晶晨股份 | 3,220,930.81 | 0.73           |
| 14 | 603658 | 安图生物 | 3,111,322.00 | 0.70           |
| 15 | 688072 | 拓荆科技 | 3,032,316.88 | 0.69           |
| 16 | 002335 | 科华数据 | 3,020,253.00 | 0.68           |
| 17 | 600050 | 中国联通 | 3,009,292.00 | 0.68           |
| 18 | 000999 | 华润三九 | 2,844,080.84 | 0.64           |
| 19 | 600600 | 青岛啤酒 | 2,746,608.00 | 0.62           |
| 20 | 688111 | 金山办公 | 2,723,222.83 | 0.62           |

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(%) |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

|    | 码      |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 1  | 688599 | 天合光能 | 7,319,245.37 | 1.65 |
| 2  | 000733 | 振华科技 | 6,645,286.00 | 1.50 |
| 3  | 601318 | 中国平安 | 6,010,260.00 | 1.36 |
| 4  | 002508 | 老板电器 | 5,750,225.00 | 1.30 |
| 5  | 300036 | 超图软件 | 5,034,523.00 | 1.14 |
| 6  | 002142 | 宁波银行 | 4,582,042.00 | 1.04 |
| 7  | 002180 | 纳思达  | 4,573,686.00 | 1.03 |
| 8  | 002244 | 滨江集团 | 4,531,798.00 | 1.02 |
| 9  | 002049 | 紫光国微 | 4,450,484.72 | 1.01 |
| 10 | 600109 | 国金证券 | 4,401,796.00 | 0.99 |
| 11 | 600809 | 山西汾酒 | 4,319,224.00 | 0.98 |
| 12 | 300451 | 创业慧康 | 4,299,904.80 | 0.97 |
| 13 | 600536 | 中国软件 | 4,107,720.00 | 0.93 |
| 14 | 002607 | 中公教育 | 3,883,901.00 | 0.88 |
| 15 | 002727 | 一心堂  | 3,755,092.00 | 0.85 |
| 16 | 300911 | 亿田智能 | 3,745,176.81 | 0.85 |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 3,712,535.00 | 0.84 |
| 18 | 688777 | 中控技术 | 3,657,782.09 | 0.83 |
| 19 | 002271 | 东方雨虹 | 3,413,525.00 | 0.77 |
| 20 | 600600 | 青岛啤酒 | 3,319,906.00 | 0.75 |

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 | 315,208,210.52 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 359,879,277.14 |

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 2,649,044.25  | 1.48         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,539,682.19 | 11.44        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,353,673.97 | 5.77         |
| 4  | 企业债券      | 81,856,368.78 | 45.58        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | 51,944,621.57 | 28.93        |

|    |           |                |        |
|----|-----------|----------------|--------|
| 7  | 可转债（可交换债） | 32,380,332.80  | 18.03  |
| 8  | 同业存单      | -              | -      |
| 9  | 其他        | -              | -      |
| 10 | 合计        | 189,370,049.59 | 105.46 |

## 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<br>(张) | 公允价值          | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|-----------|-------------------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 101900910 | 19 粤铁建<br>MTN002  | 100,000   | 10,483,031.78 | 5.84             |
| 2  | 101800767 | 18 越秀集团<br>MTN003 | 100,000   | 10,459,487.67 | 5.82             |
| 3  | 101800931 | 18 国开投<br>MTN001B | 100,000   | 10,424,196.71 | 5.81             |
| 4  | 102101295 | 21 鄂能源<br>MTN002  | 100,000   | 10,376,180.82 | 5.78             |
| 5  | 180211    | 18 国开 11          | 100,000   | 10,353,673.97 | 5.77             |

## 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，国泰君安证券股份有限公司、兴业证券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 | 79,816.42    |
| 2  | 应收清算款 | 5,000,000.00 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 596.18       |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 5,080,412.60 |

### 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    | 3,795,836.92 | 2.11          |
| 2  | 127058 | 科伦转债    | 2,345,143.20 | 1.31          |
| 3  | 110091 | 合力转债    | 1,940,735.43 | 1.08          |
| 4  | 113044 | 大秦转债    | 1,875,982.51 | 1.04          |
| 5  | 113021 | 中信转债    | 1,747,440.09 | 0.97          |
| 6  | 128074 | 游族转债    | 1,415,494.13 | 0.79          |
| 7  | 110079 | 杭银转债    | 1,242,160.08 | 0.69          |
| 8  | 127045 | 牧原转债    | 1,078,250.00 | 0.60          |
| 9  | 123025 | 精测转债    | 964,292.79   | 0.54          |
| 10 | 118027 | 宏图转债    | 934,805.90   | 0.52          |
| 11 | 128140 | 润建转债    | 910,309.57   | 0.51          |
| 12 | 113660 | 寿 22 转债 | 868,785.22   | 0.48          |
| 13 | 123075 | 贝斯转债    | 850,605.15   | 0.47          |
| 14 | 110062 | 烽火转债    | 722,381.82   | 0.40          |
| 15 | 127069 | 小熊转债    | 623,082.30   | 0.35          |
| 16 | 118003 | 华兴转债    | 544,298.96   | 0.30          |
| 17 | 110090 | 爱迪转债    | 541,162.10   | 0.30          |
| 18 | 113045 | 环旭转债    | 533,504.01   | 0.30          |
| 19 | 123164 | 法本转债    | 532,541.60   | 0.30          |
| 20 | 113017 | 吉视转债    | 478,038.82   | 0.27          |
| 21 | 113625 | 江山转债    | 359,286.34   | 0.20          |
| 22 | 118023 | 广大转债    | 358,812.04   | 0.20          |
| 23 | 113024 | 核建转债    | 356,983.62   | 0.20          |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 24 | 113594 | 淳中转债    | 355,377.17 | 0.20 |
| 25 | 123138 | 丝路转债    | 351,272.05 | 0.20 |
| 26 | 123050 | 聚飞转债    | 350,775.26 | 0.20 |
| 27 | 110048 | 福能转债    | 341,587.15 | 0.19 |
| 28 | 123154 | 火星转债    | 335,515.56 | 0.19 |
| 29 | 128079 | 英联转债    | 299,955.22 | 0.17 |
| 30 | 113063 | 赛轮转债    | 271,593.56 | 0.15 |
| 31 | 127024 | 盈峰转债    | 194,083.10 | 0.11 |
| 32 | 113619 | 世运转债    | 189,666.85 | 0.11 |
| 33 | 113661 | 福 22 转债 | 187,622.66 | 0.10 |
| 34 | 113059 | 福莱转债    | 187,069.00 | 0.10 |
| 35 | 113519 | 长久转债    | 185,566.19 | 0.10 |
| 36 | 127028 | 英特转债    | 184,447.12 | 0.10 |
| 37 | 128083 | 新北转债    | 182,855.64 | 0.10 |
| 38 | 118024 | 冠宇转债    | 182,481.35 | 0.10 |
| 39 | 127046 | 百润转债    | 181,894.03 | 0.10 |
| 40 | 123161 | 强联转债    | 180,312.89 | 0.10 |
| 41 | 123071 | 天能转债    | 180,053.97 | 0.10 |
| 42 | 127012 | 招路转债    | 179,482.24 | 0.10 |
| 43 | 118013 | 道通转债    | 178,089.86 | 0.10 |
| 44 | 123170 | 南电转债    | 177,149.28 | 0.10 |
| 45 | 111000 | 起帆转债    | 173,896.21 | 0.10 |
| 46 | 113641 | 华友转债    | 162,516.30 | 0.09 |
| 47 | 123107 | 温氏转债    | 125,596.03 | 0.07 |
| 48 | 123117 | 健帆转债    | 75,084.86  | 0.04 |
| 49 | 113537 | 文灿转债    | 73,229.82  | 0.04 |
| 50 | 123099 | 普利转债    | 71,798.92  | 0.04 |
| 51 | 113621 | 彤程转债    | 65,002.04  | 0.04 |
| 52 | 128137 | 洁美转债    | 61,899.36  | 0.03 |
| 53 | 113037 | 紫银转债    | 58,560.40  | 0.03 |

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构 |       |
|--------------|---------------|-------|-------|
|              |               | 机构投资者 | 个人投资者 |
|              |               |       |       |

|     |            | 持有份额           | 占总份额比例<br>(%) | 持有份额         | 占总份额比例<br>(%) |
|-----|------------|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 303 | 578,146.24 | 171,196,411.38 | 97.73         | 3,981,899.64 | 2.27          |

## 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、基金投资和研发部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                              |                |
|------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019年4月2日）<br>基金份额总额 | 35,847,544.24  |
| 本报告期期初基金份额总额                 | 435,651,376.46 |
| 本报告期基金总申购份额                  | 405,287.20     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                | 260,878,352.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额                 | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                 | 175,178,311.02 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 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     | 3      | 289,988,370.67 | 43.01            | 277,191.77 | 43.64          | -  |
| 信达证券     | 1      | 132,243,201.56 | 19.61            | 123,157.59 | 19.39          | -  |
| 东方财富证券   | 1      | 91,554,654.56  | 13.58            | 85,265.52  | 13.42          | -  |
| 财通证券     | 1      | 55,252,390.00  | 8.20             | 51,457.31  | 8.10           | -  |
| 东吴证券     | 1      | 51,195,804.15  | 7.59             | 47,678.67  | 7.51           | -  |
| 中泰证券     | 1      | 39,056,201.30  | 5.79             | 36,373.05  | 5.73           | -  |
| 海通证券     | 1      | 9,715,429.00   | 1.44             | 8,950.84   | 1.41           | -  |
| 国泰君安     | 1      | 5,191,941.57   | 0.77             | 5,124.32   | 0.81           | -  |
| 安信证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 长江证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 东北证券     | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 东兴证券     | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 东亚前海证券公司 | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 光大证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国联证券     | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国盛证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |

|           |   |   |   |   |   |   |
|-----------|---|---|---|---|---|---|
| 国信证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 华金证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券      | 2 | - | - | - | - | - |
| 申港证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源      | 2 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证<br>券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券      | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金财富      | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投      | 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)本报告期本基金新增东方财富证券、东吴证券等交易单元。

### 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   | 274,325,015.37 | 63.56           | 2,915,221,000.00 | 49.81             | -    | -               |
| 信达证券   | 31,269,893.79  | 7.24            | -                | -                 | -    | -               |
| 东方财富证券 | 39,067,435.91  | 9.05            | 1,189,346,000.00 | 20.32             | -    | -               |
| 财通证券   | 17,970,417.18  | 4.16            | 27,000,000.00    | 0.46              | -    | -               |
| 东吴证券   | 40,714,026.81  | 9.43            | 1,535,336,000.00 | 26.23             | -    | -               |
| 中泰证券   | 17,939,916.06  | 4.16            | -                | -                 | -    | -               |

|                  |                  |      |                    |      |   |   |
|------------------|------------------|------|--------------------|------|---|---|
| 海通证<br>券         | 5,503,257.1<br>3 | 1.28 | 10,000,000.0<br>0  | 0.17 | - | - |
| 国泰君<br>安         | 4,818,129.8<br>0 | 1.12 | 175,700,000.<br>00 | 3.00 | - | - |
| 安信证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 长江证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 东北证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 东兴证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 东亚前<br>海证券<br>公司 | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 光大证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 国联证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 国盛证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 国信证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 国元证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 华宝证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 华福证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 华金证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 华鑫证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 申港证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 申万宏<br>源         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 世纪证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 新时代<br>证券        | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 银河证<br>券         | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 中金财              | -                | -    | -                  | -    | - | - |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 富    |   |   |   |   |   |   |
| 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  | 华富安福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  | 华富安福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  | 华富安福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     | 1              | 2023. 1. 1-2023. 6. 30  | 76, 562, 573. 79 | 0. 00 | 5, 057, 221. 27 | 71, 505, 352. 52 | 40. 8200 |
| 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、《华富安福债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富安福债券型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富安福债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富安福债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日