

华富恒利债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.11 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 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	10,455,667.34 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	9,450,613.06 份	1,005,054.28 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	林之懿
	联系电话	张姗
	电子邮箱	021-68886996
客户服务电话	400-700-8001	400-61-95555
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(2024 年 1 月 1 日-2024 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	145,970.67	27,944.24
本期利润	70,622.41	-50,303.28
加权平均基金份额本期利润	0.0069	-0.0423
本期加权平均净值利润率	0.67%	-4.22%
本期基金份额净值增长率	0.59%	0.30%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-4,430,097.96	-495,293.45
期末可供分配基金份额利润	-0.4688	-0.4928
期末基金资产净值	9,720,010.66	993,437.20
期末基金份额净值	1.029	0.988
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

基金份额累计净值增长率	6.92%	0.69%
-------------	-------	-------

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	-3.47%	0.79%	0.99%	0.04%	-4.46%	0.75%
过去三个月	-0.48%	0.57%	1.92%	0.08%	-2.40%	0.49%
过去六个月	0.59%	0.54%	4.31%	0.08%	-3.72%	0.46%
过去一年	0.00%	0.41%	6.59%	0.07%	-6.59%	0.34%
过去三年	-11.14%	0.42%	17.29%	0.06%	-28.43%	0.36%
自基金合同生效起至今	6.92%	0.36%	48.51%	0.07%	-41.59%	0.29%

华富恒利债券 C

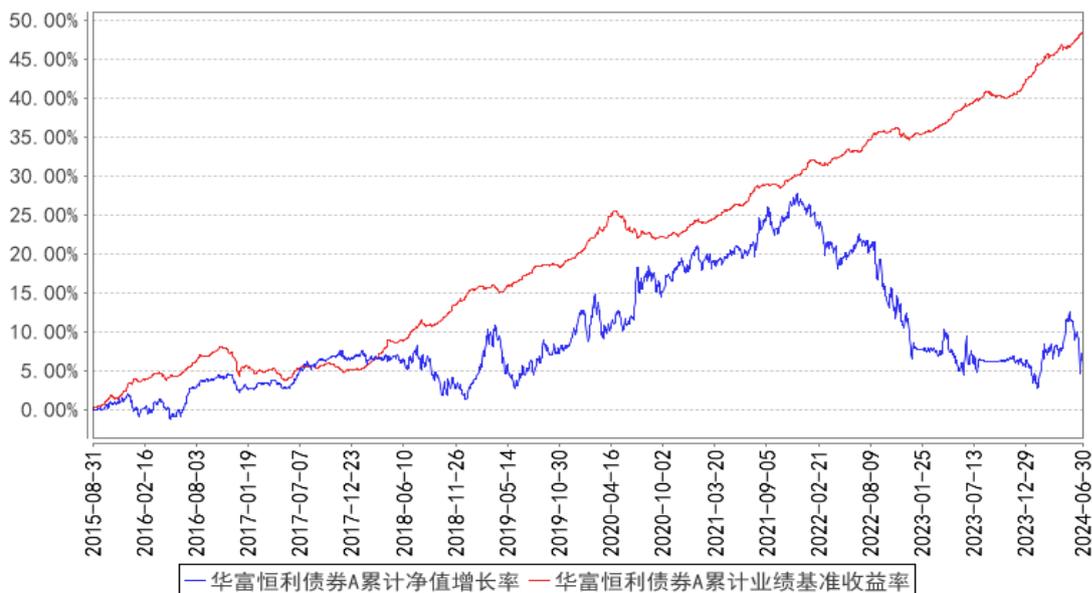
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.61%	0.77%	0.99%	0.04%	-4.60%	0.73%
过去三个月	-0.70%	0.56%	1.92%	0.08%	-2.62%	0.48%
过去六个月	0.30%	0.53%	4.31%	0.08%	-4.01%	0.45%
过去一年	-0.60%	0.41%	6.59%	0.07%	-7.19%	0.34%
过去三年	-12.33%	0.42%	17.29%	0.06%	-29.62%	0.36%

自基金合同生效起 至今	0.69%	0.36%	48.51%	0.07%	-47.82%	0.29%
----------------	-------	-------	--------	-------	---------	-------

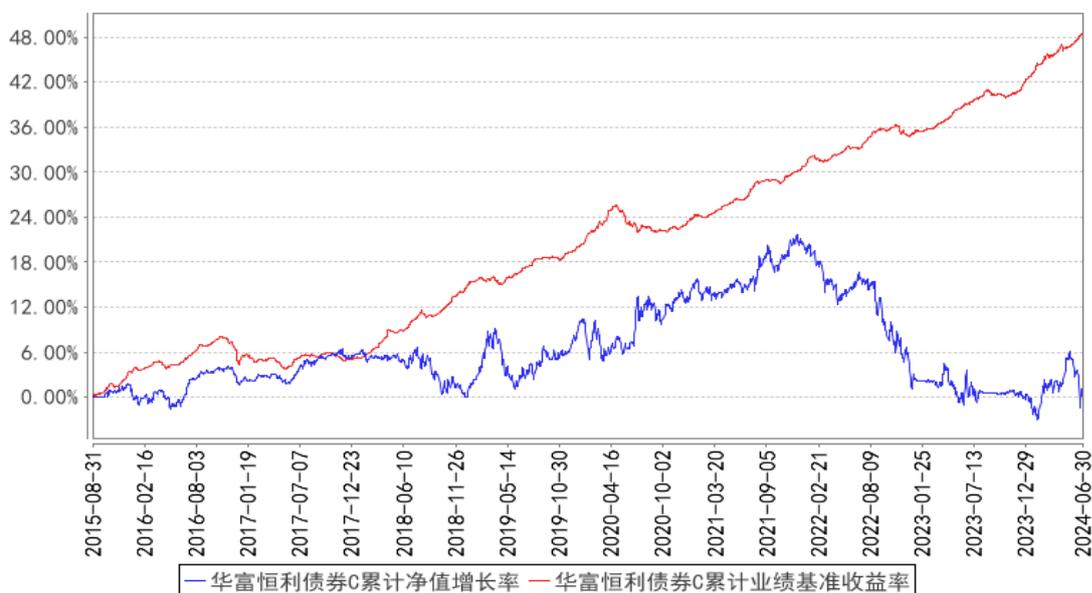
注：业绩比较基准收益率=中证全债指数

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：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 2024 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、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、华富时代锐选混合型证券投资基金、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、华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金、华富恒享纯债债券型证券投资基金、华富泰合平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、华富产业智选混合型证券投资基金、华富恒惠纯债债券型证券投资基金共六十五只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张惠	本基金基金经理、固定收益部副总监	2015 年 8 月 31 日	-	十七年	合肥工业大学经济学硕士、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、总监助理，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 2019 年 4 月 2 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 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，自 2023 年 9 月 12 日起任华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2024 年上半年宏观经济运行平稳，稳中有进，实现 GDP 同比增长 5%。分季度看，一季度同比增长 5.3%，二季度同比增长 4.7%。从拉动经济的“三驾马车”看：出口依然具有韧性，根据统计局数据，上半年货物和服务净出口对经济增长的贡献率为 13.9%；投资方面，受到制造业拉动（固定资产投资完成额累计同比（制造业）从 2023 年底的 6.5% 升至 2024 年上半年的 9.5%），且基建投资较为稳定（固定资产投资完成额累计同比（基础建设投资）基本在 5.5%-6%），但房地产投资仍呈现回落趋势；消费方面，一季度韧性较强，但二季度有所放缓，主要由于汽车消费影响，居民收入预期有待提高。

海外方面，2024 年上半年，海外经济有所放缓，通胀小幅回落。一季度，美联储维持利率不变，但是二季度开始，美国经济数据和通胀有所反复，美联储降息预期多次起伏，10Y 美债收益率在 4.2%-4.7% 的区间内震荡，同时由于大选即将开始，市场对年内降息预期有所下降；其他经济体欧洲方面的降息已开启、日本央行的加息一直不及预期，叠加地缘政治局势的变化，美元指数整体波动上行。

2024 年上半年，在宏观经济弱复苏同时资金偏宽松的背景下，债券市场整体表现较好，收益率持续下行，具有代表性的十年期国债收益率从年初的 2.56% 一度降至 2.22%，三十年国债收益率从年初的 2.83% 下行至 2.5% 以内，十年以内各期限下行幅度更大。信用债方面，一方面跟随于利率债走势持续下行，另一方面，在信用债整体供给收缩需求持续增长的背景下，信用债整体表现强于利率债，各期限均呈现大幅下行趋势，且信用利差、期限利差和等级利差均持续收窄。可转

债方面，上半年转债市场一波三折。年初权益市场的下跌，转债跟随调整，中证转债指数跌至 2022 年以来低点。2-5 月，随着正股行情修复叠加流动性宽松，转债市场迎来一波修复。但随着 5 月下旬以来受权益市场回调、交易所对部分个股问询函增多、新制度下退市政策收紧、转债评级下调事件增多等诸多因素影响，6 月份的可转债市场又出现了快速调整，上半年中证转债指数累计下跌 0.07%，万得可转债等权指数则下跌 5.21%。从结构上看，金融、公用事业等大盘高等级可转债表现较好，低价低等级转债表现较差。权益市场方面，上半年呈现先抑后扬然后高位震荡的格局。年初在经济基本面改善较弱同时流动性压力显现之下市场出现下跌行情，随着 2 月监管层出手维护市场流动性之后，全 A 整体企稳回升，3 月开始随着经济基本面出现改善的预期以及数据的验证，以沪深 300 为代表的与总量经济相关的大盘股涨幅明显，但随后市场风险偏好下行，主要股指分化严重且呈现震荡格局，上半年沪深 300 上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%，科创 50 下跌 16.42%。

回顾上半年，本基金继续以追求绝对收益为目标，在一季度末股债性价比开始出现明显左侧的偏移，组合用超跌的可转债资产部分代替原先的纯债票息策略，特别是高 YTM 的转债配置价值凸显后我们加大了对这类资产的增配，在 4-5 月的市场上涨中该部分仓位对组合收益的贡献明显。但是在 6 月的可转债市场急跌过程中，虽然我们将组合中持仓个券做了详细的信用风险和股票基本面风险筛查，有效规避了发生实质风险的标的，但是由于情绪和转债流动性缺失导致的大跌使得组合 6 月回撤较大，上半年组合净值小幅上涨。

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 0.59%，同期业绩比较基准收益率为 4.31%。截止本期末，华富恒利债券 C 份额净值为 0.988 元，累计份额净值为 1.009 元。报告期，华富恒利债券 C 份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准收益率为 4.31%。

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 2024 年三季度，内需偏弱的环境下，政策发力仍然值得期待。结构上，前期增发国债项目继续施工，三季度地方专项债加速发行进一步促开工，政府支出可能仍然是三季度宏观经济最重要的拉动因素。此外，地产“517”新政后，多地城市跟进，政策出台的节奏之快，超出市场预期，目前二手房销售已经出现企稳迹象，未来我们将继续关注房地产行业的走势。

在资产配置上，对于债券来说，虽然赔率不高但是基于经济发展阶段和持续偏宽松的货币环境胜率依然在，我们尽量在波动中择机进行配置；对于权益来说，各项估值和比价指标均显示赔率较高，但是胜率的改善需要持续观察并积极应对，当下的市场值得我们多一份耐心等待信心的

进一步修复；对于可转债来说，债券的胜率提供了安全边际，权益的胜率改善有望带来资产弹性，依然是 2024 年值得重视和挖掘的资产。

债券市场方面，展望 2024 年三季度，财政政策或更加积极，预计政府债和地方专项债供给将加速，或使利率债供需更加平衡。从赔率角度看，当前利率债绝对收益率及期限利差均处于历史低位，历史维度下，利率债赔率偏低。但考虑到当前经济企稳回升的动力还不突出，货币政策仍需要为经济企稳回升提供协助，预计一段时间内低利率的环境可能还会持续。对于收益率而言，只要货币政策处于偏宽松的状态，倾向于潜在的政府债供给压力是脉冲式的，不会对利率趋势产生影响。但在绝对收益率低位之下，债券波动可能有所放大。不过从中长期维度看，我们正处于经济结构转型之中，此背景下利率继续下行的长期趋势未改变。

权益市场方面，展望三季度，复杂的国内外环境下，我们认为目前市场依然处于存量博弈阶段，资金不再一味追逐高 ROE（尤其以高杠杆维持的高 ROE），转而追求稳定回报，即自由现金流为正且长期稳定或改善，负债率低或有息负债下降或增速低的行业，我们也将重点在这些行业中找到有相对较高确定性收益回报的个股。行业配置上，我们将主要在以下几个方面去重点研究和找寻：1. 我们将继续跟踪海外经济再通胀的风险，在供给约束下找寻需求边际改善的资源品涨价景气投资；2. 在内需偏弱的环境下，我们将继续寻找具有全球优势生产力的行业和公司，分享“出海”红利；3. 我们将继续找寻估值风险释放充分后，长期 ROE 稳定且未来有望盈利回升的消费品优秀上市公司；4. 我们将继续关注红利因子，关注稳定价值类高股息资产的投资机会。

可转债市场方面，展望 2024 年三季度，6 月下跌后转债的信用违约率定价处于历史高位，低价券定价水平处于不合理区间，未来随着转债市场流动性恢复，理性定价或将会逐步回归。从股债配置和权益角度看，转债资产整体进可攻退可守的期权属性依然明显，从中期维度看，可转债资产胜率较大。我们将立足转债基本面，一方面重视高 YTM 转债的纯债替代策略；另一方面，也从正股业绩出发，找寻业绩增长确定的优秀公司做正股替代策略。

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

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公

布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

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（2024 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（2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产:			
货币资金	6.4.7.1	58,110.13	1,300,752.49
结算备付金		150,547.80	15,215.81
存出保证金		3,088.12	1,517.24
交易性金融资产	6.4.7.2	11,092,632.35	10,398,644.13
其中: 股票投资		1,378,206.31	893,803.60
基金投资		-	-
债券投资		9,714,426.04	9,504,840.53
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	-	1,000,000.00
应收清算款		616,349.62	-
应收股利		-	-
应收申购款		202.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		11,920,930.02	12,716,129.67
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		1,037,000.00	-
应付清算款		131,688.45	1,000,000.00
应付赎回款		1,143.68	-
应付管理人报酬		5,772.89	5,924.69
应付托管费		1,924.31	1,974.87
应付销售服务费		494.86	354.33
应付投资顾问费		-	-
应交税费		152.16	88.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	29,305.81	12,516.04
负债合计		1,207,482.16	1,020,858.76
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	10,455,667.34	11,473,059.97
未分配利润	6.4.7.8	257,780.52	222,210.94
净资产合计		10,713,447.86	11,695,270.91

负债和净资产总计		11,920,930.02	12,716,129.67
----------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 10,455,667.34 份，其中华富恒利债券 A 基金份额总额 9,450,613.06 份，基金份额净值 1.029 元；华富恒利债券 C 基金份额总额 1,005,054.28 份，基金份额净值 0.988 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		106,572.85	11,159.92
1. 利息收入		1,423.76	2,157.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,346.77	2,157.38
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		76.99	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		258,341.38	-3,458.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-27,833.47	-29,682.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	254,272.37	24,836.74
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	31,902.48	1,387.10
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	-153,595.78	12,364.26
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	403.49	96.85
减：二、营业总支出		86,253.72	30,435.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	34,964.16	4,759.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,654.71	1,586.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,315.22	1,848.93

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,288.89	1,916.15
其中：卖出回购金融资产支出		7,288.89	1,916.15
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		92.19	2.97
8. 其他费用	6.4.7.19	29,938.55	20,322.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,319.13	-19,275.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,319.13	-19,275.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20,319.13	-19,275.83

6.3 净资产变动表

会计主体：华富恒利债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	11,473,059.97	-	222,210.94	11,695,270.91
二、本期期初净资产	11,473,059.97	-	222,210.94	11,695,270.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,017,392.63	-	35,569.58	-981,823.05
（一）、综合收益总额	-	-	20,319.13	20,319.13
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,017,392.63	-	15,250.45	-1,002,142.18
其中：1. 基金申购款	4,220,746.66	-	150,469.40	4,371,216.06
2. 基金赎回款	-5,238,139.29	-	-135,218.95	-5,373,358.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	10,455,667.34	-	257,780.52	10,713,447.86
项目	上年度可比期间			
	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	771,469.73	-	27,852.11	799,321.84
二、本期期初净资产	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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,627,936.81	-	11,236.32	1,639,173.13

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重大变更。

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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（三）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
	活期存款
等于：本金	58,097.41
加：应计利息	12.72
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	58,110.13

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 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,420,615.91	-	1,378,206.31	-42,409.60	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,773,875.37	66,051.10	9,714,426.04	-125,500.43
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,773,875.37	66,051.10	9,714,426.04	-125,500.43
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	11,194,491.28	66,051.10	11,092,632.35	-167,910.03	

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.04
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	10,061.29
其中：交易所市场	10,061.29
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	9,944.48
中债账户维护费	4,500.00
上清账户维护费	4,800.00
合计	29,305.81

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,365,606.95	10,365,606.95
本期申购	664,667.25	664,667.25
本期赎回（以“-”号填列）	-1,579,661.14	-1,579,661.14
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	9,450,613.06	9,450,613.06

华富恒利债券 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,107,453.02	1,107,453.02
本期申购	3,556,079.41	3,556,079.41
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,658,478.15	-3,658,478.15
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	1,005,054.28	1,005,054.28

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	-5,000,220.47	5,238,627.24	238,406.77
本期期初	-5,000,220.47	5,238,627.24	238,406.77
本期利润	145,970.67	-75,348.26	70,622.41
本期基金份额交易产生的变动数	424,151.84	-463,783.42	-39,631.58
其中：基金申购款	-304,374.19	353,503.11	49,128.92
基金赎回款	728,526.03	-817,286.53	-88,760.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,430,097.96	4,699,495.56	269,397.60

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	-557,925.10	541,729.27	-16,195.83
本期期初	-557,925.10	541,729.27	-16,195.83
本期利润	27,944.24	-78,247.52	-50,303.28
本期基金份额交易产生的变动数	34,687.41	20,194.62	54,882.03
其中：基金申购款	-1,735,759.12	1,837,099.60	101,340.48
基金赎回款	1,770,446.53	-1,816,904.98	-46,458.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-495,293.45	483,676.37	-11,617.08

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	600.51

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	727.07
其他	19.19
合计	1,346.77

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-27,833.47
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	-27,833.47

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	8,677,940.35
减：卖出股票成本总额	8,684,115.75
减：交易费用	21,658.07
买卖股票差价收入	-27,833.47

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	72,799.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	181,473.03
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	254,272.37
----	------------

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,306,779.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,943,034.89
减：应计利息总额	179,291.78
减：交易费用	2,979.75
买卖债券差价收入	181,473.03

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	31,902.48
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	31,902.48

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-153,595.78
股票投资	-4,152.84
债券投资	-149,442.94
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	-153,595.78

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	276.82
基金转换费收入	126.67
合计	403.49

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	9,944.48
信息披露费	-

证券出借违约金	-
银行费用	1,394.07
账户维护费	18,600.00
合计	29,938.55

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
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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	17,487,834.16	100.00	1,647,690.32	57.79

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	68,086,163.67	100.00	3,256,617.18	33.73

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	78,143,000.00	100.00	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 2024年1月1日至2024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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
华安证券	17,315.09	100.00	10,061.29	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
华安证券	1,577.52	57.31	1,577.52	74.78

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	34,964.16	4,759.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,439.57	2,041.23
应支付基金管理人的净管理费	32,524.59	2,718.07

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 $H = E \times \text{年费率} / 12$

管理费率 ÷ 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,654.71	1,586.33

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 $H = E \times$ 年托管费率 ÷ 当年天数 (H 为每日应计提的基金托管费, E 为前一日基金资产净值)。

6.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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)	-	29.88	29.88
华安证券股份有限公司 (管理人股东)	-	-	-
合计	-	29.88	29.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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 $H = E \times$ 年销售服务费率 ÷ 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固定期限费率的证券出借业务。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日	2024年1月1日至2024年6月30日
	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）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	9,764,648.44	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	940,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	8,824,648.44	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	84.40%	0.00%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
	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）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末和上年度末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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	58,110.13	600.51	15,831.34	1,182.05

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（2024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 1,037,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 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。公司设有独立的风险管理部、监察稽核部，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投资

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	1,927,347.94	-
AAA 以下	6,201,660.01	2,145,979.47
未评级	-	-
合计	8,129,007.95	2,145,979.47

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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

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 2024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							
货币资金	58,110.13	-	-	-	-	-	58,110.13
结算备付金	150,547.80	-	-	-	-	-	150,547.80
存出保证金	3,088.12	-	-	-	-	-	3,088.12
交易性金融资产	1,470,693.04	945,018.24	6,673,052.91	-	625,661.85	1,378,206.31	11,092,632.35
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	-	-	-	-	-	202.00	202.00
应收清算款	-	-	-	-	-	616,349.62	616,349.62
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,682,439.09	945,018.24	6,673,052.91	-	625,661.85	1,994,757.93	11,920,930.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,143.68	1,143.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,772.89	5,772.89
应付托管费	-	-	-	-	-	1,924.31	1,924.31
应付清算款	-	-	-	-	-	131,688.45	131,688.45
卖出回购金融资产款	1,037,000.00	-	-	-	-	-	1,037,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	494.86	494.86
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	152.16	152.16
其他负债	-	-	-	-	-	29,305.81	29,305.81
负债总计	1,037,000.00	-	-	-	-	170,482.16	1,207,482.16
利率敏感度缺口	645,439.09	945,018.24	6,673,052.91	-	625,661.85	1,824,275.77	10,713,447.86
上年度末 2023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							
货币资金	1,300,752.49	-	-	-	-	-	1,300,752.49
结算备付金	15,215.81	-	-	-	-	-	15,215.81
存出保证金	1,517.24	-	-	-	-	-	1,517.24
交易性金融资产	53,365.29	259,464.24	7,462,454.05	-	1,729,556.95	893,803.60	10,398,644.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	-	-	1,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,370,850.83	259,464.24	7,462,454.05	-	1,729,556.95	893,803.60	12,716,129.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,924.69	5,924.69
应付托管费	-	-	-	-	-	1,974.87	1,974.87
应付清算款	-	-	-	-	-	-1,000,000.00	1,000,000.00
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	354.33	354.33
应付投资	-	-	-	-	-	-	-

顾问费							
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	88.83	88.83
其他负债	-	-	-	-	-	12,516.04	12,516.04
负债总计	-	-	-	-	-	1,020,858.76	1,020,858.76
利率敏感度缺口	2,370,850.83	259,464.24	7,462,454.05	-1,729,556.95	-127,055.16		11,695,270.91

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		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	83,948.87	108,794.48
市场利率上升 25 基点	-82,112.14	-103,942.19	

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	1,378,206.31	12.86	893,803.60	7.64

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,714,426.04	90.68	9,504,840.53	81.27
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	11,092,632.35	103.54	10,398,644.13	88.91

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		
分析	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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升百分之五	71,005.32	36,827.07
	沪深 300 指数下降百分之五	-71,005.32	-36,827.07

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	9,507,214.26	3,039,783.07

第二层次	1,585,418.09	7,358,861.06
第三层次	-	-
合计	11,092,632.35	10,398,644.13

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,378,206.31	11.56
	其中：股票	1,378,206.31	11.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,714,426.04	81.49
	其中：债券	9,714,426.04	81.49
	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	208,657.93	1.75
8	其他各项资产	619,639.74	5.20
9	合计	11,920,930.02	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	213,278.00	1.99
C	制造业	875,105.49	8.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,653.82	0.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	66,607.00	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	141,570.00	1.32
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	56,992.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	1,378,206.31	12.86

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	002244	滨江集团	19,500	141,570.00	1.32
2	601899	紫金矿业	5,900	103,663.00	0.97
3	601989	中国重工	19,400	95,642.00	0.89
4	300782	卓胜微	1,000	77,740.00	0.73
5	603558	健盛集团	7,600	75,620.00	0.71
6	600585	海螺水泥	3,000	70,770.00	0.66
7	601919	中远海控	4,300	66,607.00	0.62
8	002154	报喜鸟	12,000	65,280.00	0.61
9	002043	兔宝宝	5,600	58,072.00	0.54

10	601928	凤凰传媒	5,200	56,992.00	0.53
11	002884	凌霄泵业	2,900	55,680.00	0.52
12	300558	贝达药业	1,600	52,080.00	0.49
13	688502	茂莱光学	549	51,062.49	0.48
14	601898	中煤能源	3,600	44,928.00	0.42
15	000513	丽珠集团	1,200	44,652.00	0.42
16	603129	春风动力	300	42,702.00	0.40
17	301061	匠心家居	900	42,264.00	0.39
18	002790	瑞尔特	4,500	40,635.00	0.38
19	600060	海信视像	1,600	39,584.00	0.37
20	300979	华利集团	500	30,425.00	0.28
21	600028	中国石化	4,700	29,704.00	0.28
22	600461	洪城环境	2,129	24,653.82	0.23
23	601857	中国石油	2,100	21,672.00	0.20
24	002353	杰瑞股份	400	14,032.00	0.13
25	601088	中国神华	300	13,311.00	0.12
26	600346	恒力石化	700	9,765.00	0.09
27	301004	嘉益股份	100	9,100.00	0.08

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	002100	天康生物	462,591.00	3.96
2	002567	唐人神	290,774.00	2.49
3	688072	拓荆科技	271,904.31	2.32
4	300782	卓胜微	258,392.00	2.21
5	002865	钧达股份	256,667.00	2.19
6	600985	淮北矿业	239,165.48	2.04
7	002043	兔宝宝	184,548.00	1.58
8	605296	神农集团	176,912.00	1.51
9	600295	鄂尔多斯	173,416.00	1.48
10	300558	贝达药业	169,744.00	1.45
11	605117	德业股份	168,245.00	1.44
12	002244	滨江集团	162,704.00	1.39
13	300494	盛天网络	146,427.00	1.25
14	002415	海康威视	136,012.00	1.16
15	002299	圣农发展	130,212.00	1.11
16	002154	报喜鸟	126,864.00	1.08
17	688502	茂莱光学	126,492.04	1.08
18	603558	健盛集团	126,315.00	1.08
19	000630	铜陵有色	117,140.00	1.00
20	603806	福斯特	117,039.00	1.00

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	002100	天康生物	486,479.00	4.16
2	688072	拓荆科技	268,701.91	2.30
3	002567	唐人神	263,681.00	2.25
4	002865	钧达股份	241,162.00	2.06
5	600985	淮北矿业	232,850.75	1.99
6	605117	德业股份	217,646.00	1.86
7	605296	神农集团	195,687.00	1.67
8	300494	盛天网络	178,517.00	1.53
9	600295	鄂尔多斯	176,771.00	1.51
10	300782	卓胜微	168,763.00	1.44
11	600547	山东黄金	146,158.00	1.25
12	002415	海康威视	138,856.00	1.19
13	600976	健民集团	135,874.00	1.16
14	000630	铜陵有色	127,695.00	1.09
15	002517	恺英网络	125,354.00	1.07
16	002299	圣农发展	124,933.00	1.07
17	688012	中微公司	124,502.72	1.06
18	002408	齐翔腾达	121,410.00	1.04
19	601288	农业银行	119,616.00	1.02
20	002043	兔宝宝	113,936.00	0.97

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	9,172,671.30
卖出股票收入（成交）总额	8,677,940.35

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	1,585,418.09	14.80

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）	8,129,007.95	75.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,714,426.04	90.68

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	110059	浦发转债	9,150	1,009,019.63	9.42
2	019709	23 国债 16	9,450	959,756.24	8.96
3	019744	24 特国 02	6,000	613,814.47	5.73
4	110047	山鹰转债	4,840	458,733.87	4.28
5	113052	兴业转债	3,860	417,720.21	3.90

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，上海浦东发展银行股份有限公司、兴业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的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	3,088.12
2	应收清算款	616,349.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	202.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	619,639.74

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	110059	浦发转债	1,009,019.63	9.42
2	110047	山鹰转债	458,733.87	4.28
3	113052	兴业转债	417,720.21	3.90
4	127027	能化转债	349,540.12	3.26
5	110063	鹰 19 转债	232,833.66	2.17
6	113042	上银转债	229,620.48	2.14
7	113033	利群转债	172,820.32	1.61
8	128071	合兴转债	166,718.12	1.56
9	123127	耐普转债	132,009.40	1.23
10	113037	紫银转债	120,783.53	1.13
11	127083	山路转债	115,340.54	1.08
12	123233	凯盛转债	109,477.75	1.02
13	127043	川恒转债	108,642.99	1.01
14	110068	龙净转债	105,931.55	0.99
15	123182	广联转债	105,915.52	0.99
16	123200	海泰转债	105,900.85	0.99
17	127092	运机转债	105,231.40	0.98
18	113641	华友转债	100,452.34	0.94
19	113569	科达转债	100,193.32	0.94
20	128144	利民转债	99,931.12	0.93
21	123144	裕兴转债	98,876.06	0.92

22	113623	凤 21 转债	97,838.47	0.91
23	123076	强力转债	96,180.87	0.90
24	113066	平煤转债	96,053.64	0.90
25	123205	大叶转债	94,099.18	0.88
26	123035	利德转债	92,002.76	0.86
27	113640	苏利转债	91,462.03	0.85
28	123126	瑞丰转债	88,159.91	0.82
29	113672	福蓉转债	87,625.73	0.82
30	123159	崧盛转债	85,717.81	0.80
31	127087	星帅转 2	85,614.90	0.80
32	123131	奥飞转债	82,356.51	0.77
33	113618	美诺转债	82,229.42	0.77
34	110086	精工转债	78,437.41	0.73
35	123085	万顺转 2	71,931.04	0.67
36	113582	火炬转债	70,515.48	0.66
37	123225	翔丰转债	68,942.15	0.64
38	123191	智尚转债	66,765.54	0.62
39	123192	科思转债	66,200.89	0.62
40	128048	张行转债	65,707.56	0.61
41	128105	长集转债	63,678.62	0.59
42	113647	禾丰转债	63,588.49	0.59
43	123100	朗科转债	62,293.50	0.58
44	123143	胜蓝转债	62,100.76	0.58
45	123130	设研转债	61,393.03	0.57
46	118021	新致转债	60,351.89	0.56
47	113593	沪工转债	59,700.62	0.56
48	113024	核建转债	59,593.44	0.56
49	123218	宏昌转债	58,978.29	0.55
50	123152	润禾转债	58,932.39	0.55
51	127093	章鼓转债	57,865.02	0.54
52	127024	盈峰转债	57,599.51	0.54
53	118043	福立转债	57,283.76	0.53
54	128132	交建转债	57,055.67	0.53
55	113615	金诚转债	56,707.91	0.53
56	113048	晶科转债	55,759.04	0.52
57	123234	中能转债	55,130.26	0.51
58	118034	晶能转债	51,740.26	0.48
59	123201	纽泰转债	51,490.32	0.48
60	127095	广泰转债	46,710.80	0.44
61	123216	科顺转债	44,822.79	0.42
62	123214	东宝转债	42,040.11	0.39
63	128053	尚荣转债	38,754.20	0.36
64	123135	泰林转债	37,301.71	0.35

65	111017	蓝天转债	37,089.89	0.35
66	123114	三角转债	36,702.86	0.34
67	123193	海能转债	35,858.64	0.33
68	113546	迪贝转债	35,351.17	0.33
69	127016	鲁泰转债	35,109.81	0.33
70	118025	奕瑞转债	34,518.46	0.32
71	118030	睿创转债	34,320.27	0.32
72	123204	金丹转债	33,786.37	0.32
73	123188	水羊转债	33,619.49	0.31
74	123061	航新转债	33,554.40	0.31
75	111004	明新转债	32,941.79	0.31
76	123154	火星转债	32,925.61	0.31
77	123166	蒙泰转债	32,794.39	0.31
78	113606	荣泰转债	31,198.21	0.29
79	123168	惠云转债	25,411.04	0.24
80	118036	力合转债	22,502.66	0.21
81	128122	兴森转债	22,454.58	0.21

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	147	64,289.88	8,824,648.44	93.38	625,964.62	6.62
华富恒利债券 C	204	4,926.74	0.00	0.00	1,005,054.28	100.00
合计	351	29,788.23	8,824,648.44	84.40	1,631,018.90	15.60

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	2,176.13	0.0230
	华富恒利债券 C	771,720.93	76.7840
	合计	773,897.06	7.4017

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	10,365,606.95	1,107,453.02
本报告期基金总申购份额	664,667.25	3,556,079.41
减：本报告期基金总赎回份额	1,579,661.14	3,658,478.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,450,613.06	1,005,054.28

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

本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华安证券	5	17,487,834.16	100.00	17,315.09	100.00	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	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	-	-	-	-	-
申万宏源	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)本报告期本基金交易单元退租德邦证券等 2 个交易单元。

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	68,086,163.67	100.00	78,143,000.00	100.00	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
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	华富基金管理有限公司关于旗下基金2023年度最后一日基金份额净值及基金份额累计净值的公告	中国证监会指定披露媒介	2024年1月1日
2	华富基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理相关销售	中国证监会指定披露媒介	2024年1月12日

	业务的公告		
3	华富恒利债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 22 日
4	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 24 日
5	华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 15 日
6	华富恒利债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 30 日
7	华富恒利债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 20 日
8	华富恒利债券型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 27 日
9	华富恒利债券型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 27 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	20240101-20240630	9,764,648.44	0.00	940,000.00	8,824,648.44	84.40
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

2024 年 8 月 30 日