华富安福保本混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月25日

§1 重要提示

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。本半年度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2018年8月24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2018年1月1日起至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富安福保本混合
基金主代码	002412
交易代码	002412
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月23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	172,319,932.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取恒定比例组合保险策略CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance),通过动态调整资产组合,在确保本金安全的前提下,力争实现保本周期内基金资产的稳定增值。
投资策略	根据恒定比例组合保险原理,本基金将根据市场的波动,组合安全垫(即基金净资产超过基金价值底线的数额)的大小动态调整保本资产与风险资产投资的比例,通过对保本资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全,通过对收益资产的投资寻求保本周期间资产的稳定增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	田青
	联系电话	021-68886996	010-67595096
	电子邮箱	manzh@hffund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-8001	010-67595096
传真		021-68887997	010-66275853

2.4信息披露方式

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

§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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-5,221,848.26
本期利润	-1,175,565.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0060
本期基金份额净值增长率	-0.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0031
期末基金资产净值	172,602,303.49
期末基金份额净值	1.002

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。表中的"期末"均指报告期最后一日,即6月30日。

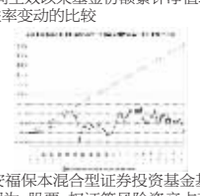
3.2 基金净值表现

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	-0.60%	0.09%	0.21%	0.01%	-0.81%	0.08%
过去三个月	-0.79%	0.11%	0.65%	0.01%	-1.44%	0.10%
过去六个月	-0.69%	0.14%	1.30%	0.01%	-1.99%	0.13%
过去一年	-0.50%	0.12%	2.66%	0.01%	-3.16%	0.11%
自基金合同生效起至今	0.20%	0.10%	6.25%	0.01%	-6.05%	0.09%

注:业绩比较基准收益率=三年期银行定期存款收益率(税后),业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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



注:根据《华富安福保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或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%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为2016年3月23日到2016年9月23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《华富安福保本混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基金字[2004]47号文核准开业,4月19日在上海正式注册成立。注册资本2.5亿元,公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用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2018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、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富18个月定期开放债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、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、华富安福保本混合型证券投资基金、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华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、华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金、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、华富恒悦定期开放债券型证券投资基金共三十七只基金。

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		
胡伟	华富安福保本混合型基金基金经理、华富利型基金基金经理、恒利型基金基金经理、恒债型基金基金经理、收益型基金基金经理、保本型基金基金经理、华富18个月定期开放债券型基金基金经理、华富恒财分级债券型基金基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富天鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富一年定期开放混合型基金基金经理、华富可转债债券型基金基金经理、公募基金投资决策委员会委员、公司总经理助理、固定收益部总监	2016年3月23日	-	十四年	中南财经政法大学经济学学士、本科学历,曾任珠海市商业银行资金营运部交易员、从事债券研究及债券交易工作,2006年11月加入华富基金管理有限公司,曾任债券交易员、华富货币市场基金基金经理助理、固定收益部副总监、2009年10月19日至2014年11月17日任华富货币市场基金基金经理、2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理、2016年6月28日至2017年7月4日任华富灵活配置混合型基金基金经理经理、2015年3月16日至2018年5月31日任华富旺财保本混合型基金基金经理。

注:任职日期指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

上半年,国内宏观经济继续保持一定的韧性,通胀压力不大。但在持续发酵的中美贸易问题以及国内结构性去杠杆下的偏紧信用环境影响下,经济面临较大的不确定性,市场信用风险事件明显增多,权益类资产影响较大,其中上证50大幅下跌13.3%,创业板指下跌8.33%。政策方面,央行亦通过多次降准及扩大MLF抵押品等方式向市场注入流动性稳定市场预期,债券市场受益明显,尤其是利率债以及高等级信用债,而中低等级信用利差持续走扩。

上半年,本基金稳健类资产配置上继续以aaa等级信用债为主,并适度杠杆和久期;而对风险资产进行了减持。上半年净值主要受累个股的回调以及中兴通讯事件影响,净值有所回撤表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2016年3月23日正式成立。截止2018年6月30日,本基金份额净值为1.002元,累计份额净值为1.002元。报告期,本基金份额净值增长率为-0.69%,同期业绩比较基准收益率为1.30%。

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,国内经济一方面会受到中美贸易摩擦的持续影响;另一方面,内部结构性去杠杆、打破刚性兑付等强监管下,紧信用环境总体仍将延续,将对下半年经济带来较大的下行压力。而政策层面,货币政策、财政政策存在继续加码对冲经济下行的可能,市场流动性整体充裕,但不会大水漫灌,利率债及高等级信用债将持续受益。资管新规细则逐步落地,也有望缓解紧信用环境对中低评级信用债的冲击,市场存在纠偏的可能,风险偏好将有所修复。权益方面,在大幅下跌之后,部分行业及个股估值处于低位,提供了较好的配置机会。本基金将继续做好大类资产的配置,优化风险资产以及安全资产的比重,通过自下而上精选业绩与估值匹配的个股,阶段性参与权益市场,力争获得较好的投资收益,实现本金的保值增值。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位,在较低风险程度下,认真研究各个潜在投资领域的机会,发挥管理人的综合优势,积极稳健地做好配置策略,均衡投资,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、副总经理、运作保障部负责人、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《华富安福保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本期利润为-1,175,565.86元,期末可供分配利润为-542,198.05元。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

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者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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度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:华富安福保本混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		189,830.28	248,764.34
结算备付金		2,056,357.72	2,458,927.16
存出保证金		25,416.58	18,408.06
交易性金融资产		196,881,615.40	241,744,144.00
其中:股票投资		-	14,433,820.00
基金投资		-	-
债券投资		196,881,615.40	227,310,324.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	2,281,369.95
应收利息		3,174,629.40	4,835,158.17
应收股利		-	-
应收申购款		792.40	495.25
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		202,328,641.78	251,587,266.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		29,300,000.00	22,300,000.00
应付证券清算款		-	1,879,060.33
应付赎回款		-	554,238.14
应付管理人报酬		171,697.46	234,902.08
应付托管费		28,616.24	39,150.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		19,146.37	52,813.92
应交税费		14,080.94	-
应付利息		15,195.78	-10,532.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		177,601.50	344,197.31
负债合计		29,726,338.29	25,393,829.53
所有者权益:			
实收基金		172,319,932.41	224,218,816.06
未分配利润		282,371.08	1,974,621.34
所有者权益合计		172,602,303.49	226,193,437.40
负债和所有者权益总计		202,328,641.78	251,587,266.93

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.002元,基金份额总额172,319,932.41份。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:华富安福保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		1,188,560.33	4,726,273.08
1.利息收入		4,200,541.21	8,187,849.12
其中:存款利息收入		26,212.44	206,365.09
债券利息收入		4,174,328.77	7,981,484.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-7,190,043.27	-4,761,792.64
其中:股票投资收益		-5,440,463.20	-977,628.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,758,707.05	-3,820,464.82
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		9,126.98	36,300.98
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		4,046,282.40	1,149,135.50
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		131,779.99	151,081.10
减:二、费用		2,364,126.19	3,105,102.90
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	1,179,713.48	1,843,461.07
2. 托管费	6.4.8.2.2	196,618.92	307,243.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		109,658.05	57,764.26
5. 利息支出		670,667.14	704,223.84
其中:卖出回购金融资产支出		670,667.14	704,223.84
6. 其他费用		200,018.26	192,410.18
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-1,175,565.86	1,621,170.18
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-1,175,565.86	1,621,170.18

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华富安福保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	224,218,816.06	1,974,621.34	226,193,437.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,175,565.86	-1,175,565.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-51,898,883.65	-516,684.40	-52,415,568.05
其中:1.基金申购款	42,975.01	403.65	43,378.66
2.基金赎回款	-51,941,858.66	-517,088.05	-52,458,946.71
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	172,319,932.41	282,371.08	172,602,303.49
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	322,482,406.21	383,893.22	322,866,299.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,621,170.18	1,621,170.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-29,969,719.36	-86,882.87	-30,056,602.23
其中:1.基金申购款	58,461.27	164.46	58,625.73
2.基金赎回款	-30,028,180.63	-87,047.33	-30,115,227.96
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	292,512,686.85	1,918,180.53	294,430,867.38

注:后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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:

_____章 宏 韬_____ _____余 海 春_____ _____陈大毅_____

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)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《华富安福保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或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%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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、经营成果和净值变动等有关信息。

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)、《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)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(三)对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税;

(四)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。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司(“华安证券”)	基金管理人的股东、代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	67,014,194.64	100.00%	39,919,769.84	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	114,916,027.76	100.00%	137,993,493.76	100.00%

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。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华安证券	2,229,400,000.00	100.00%	2,984,600,000.00	100.00%

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

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	62,424.10	100.00%	15,206.97	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	37,341.35	100.00%	28,431.77	100.00%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,179,713.48	1,843,461.07
其中:支付销售机构的客户维护费	426,192.45	703,420.56

注:基金管理费按前一日基金资产净值1.2%的年费率逐日计提,按月支付。计算方法H=E×年管理费率÷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)。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	196,618.92	307,243.55

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×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)。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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内基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	189,830.28	7,437.10	506,958.35	10,670.13

6.4.8.6 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

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:截至本报告期末,本基金未持有暂时停牌的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 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29,300,000.00元,于2018年7月4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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	196,881,615.40	97.31
	其中:债券	196,881,615.40	97.31
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,246,188.00	1.11
7	其他各项资产	3,200,838.38	1.58
8	合计	202,328,641.78	100.00

注:本表列示的其他各项资产详见7.12.3 期末其他各项资产构成。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细注:本基金本报告期末未持有股票

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	000063	中兴通讯	4,944,897.91	2.19
2	601336	新华保险	3,466,816.00	1.53
3	002007	华兰生物	2,299,026.00	1.02
4	002008	大族激光	1,928,608.00	0.85
5	600031	三一重工	1,892,000.00	0.84
6	601818	光大银行	1,830,337.00	0.81
7	601988	中国银行	1,728,000.00	0.76
8	601288	农业银行	1,716,000.00	0.76
9	601318	中国平安	1,573,823.00	0.70
10	601211	国泰君安	1,439,119.00	0.64
11	600048	保利地产	1,170,654.00	0.52
12	600183	生益科技	1,143,683.00	0.51
13	002236	大华股份	1,061,829.00	0.47
14	600985	雷鸣科化	1,030,318.00	0.46
15	002245	澳洋顺昌	950,985.11	0.42
16	000703	恒逸石化	553,750.00	0.24
17	601138	工业富联	13,770.00	0.01
18	603712	七一二	4,550.00	0.00

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	601211	国泰君安	3,262,469.00	1.44
2	600362	江西铜业	2,959,131.00	1.31
3	002236	大华股份	2,755,489.25	1.22
4	000063	中兴通讯	2,668,202.00	1.18
5	601336	新华保险	2,144,490.00	0.95
6	600183	生益科技	2,130,069.00	0.94
7	002007	华兰生物	2,019,956.18	0.89
8	601988	中国银行	1,820,000.00	0.80
9	002008	大族激光	1,809,801.75	0.80
10	601288	农业银行	1,788,000.00	0