华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金 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:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大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3月23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	华富恒玖3个月定期开放债券
基金主代码	005694
交易代码	005694
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	620,122,283.36份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过合理灵活的资产配置策略,同时结合固定收益资产投资策略等积极把握中国经济增长和债券市场发展机遇,在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
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,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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	石立平
	联系电话	021-68886996	010-63639180
	电子邮箱	manzh@hffund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-700-8001	95595
传真		021-68887997	010-63639132

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3月23日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	8,954,781.19
本期利润	9,422,867.49
加权平均基金份额本期利润	0.0096
本期基金份额净值增长率	0.97%
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	622,440,823.90
期末基金份额净值	1.0037

注:1)本基金合同生效未满一年。

2)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。

3)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。

4)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。

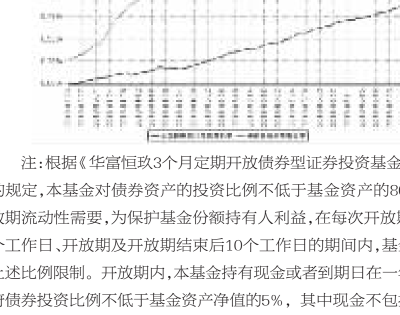
3.2 基金净值表现

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	0.36%	0.01%	0.67%	0.06%	-0.31%	-0.05%
过去三个月	0.91%	0.02%	2.16%	0.10%	-1.25%	-0.08%
自基金合同生效起至今	0.97%	0.02%	2.61%	0.10%	-1.64%	-0.08%

注:业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率,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《华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为2018年3月23日到2018年9月23日。本报告期内,本基金仍在建仓期。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
倪莉莎	华富恒玖3个月定期开放债券型基金基金经理、华富天盈货币市场基金基金经理、华富恒财分级债券型基金基金经理、华富富瑞3个月定期开放债券型发起式基金基金经理、华富恒悦定期开放债券型基金的基金经理	2018年3月23日	-	四年	英国曼彻斯特大学管理学硕士,研究生学历。2014年2月加入华富基金管理有限公司,先后担任集中交易部助理交易员、交易员,固定收益部华富货币市场基金、华富天益货币市场基金、华富益鑫灵活配置混合型基金、华富恒财分级债券型基金的基金经理助理。

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

上半年经济下行压力逐渐显现,一季度经济增长总体平稳,二季度的经济基本面前高后低,经济数据特别是社会融资等指标表现显著弱于预期。叠加国内外经济政治局势复杂化,贸易争端反复发酵,关税等对经济实质影响逐渐释放。市场对于经济预期悲观情绪上升,风险偏好下降,债券市场特别是利率品种受追捧。

年初特别是春节之后,受中美贸易摩擦的不断发酵、央行定向降准等事件的影响,高等级和利率品种走强。回顾上半年,利率下行也受很多因素影响,波动加大。最明显的是4月中旬定向降准之后,叠加去杠杆深入的影响,以及信用事件的频出,给之前受到降准利好的债市带来相当幅度的调整。到5月份之后,中低评级信用品种,更是一级频频取消发行,流动性压力大。中低等级信用走弱持续,信用利差走扩成为趋势。总的来说,宏观经济数据走弱、市场流动性边际改善及监管政策都对债市特别是利率品种形成利好。

政策方面,随着社融等经济指标走弱以及外围贸易争端升级,央行货币政策出现边际转向,债券市场流动性明显好转,资金价格显著下跌。债券市场受经济基本面走弱以及资金面的双重支持,整体利率债收益率曲线呈现下行。另一方面,受信用环境收紧影响,中低评级信用债收益率明显上行,民企等债券市场融资愈发困难,伴随信用事件不断发生和传导,低评级信用利差继续明显走扩。

华富恒玖债券基金,通过自上而下对宏观与债券市场趋势的判断,选择久期和杠杆,为持有人增强收益。同时,通过自下而上地与信用团队一起深耕、调研,严选个券,防范信用风险,取得合理的基础收益。本基金在一季度末期成立,利用较宽松的货币环境,使用杠杆策略,增强收益。同时,为了防范估值和信用风险,优先选择流动性好,资质高的债券进行配置。在预期经济基本面下行,货币政策边际改善的二季度,适当增加了久期和杠杆,并提高信用偏好,严控信用风险,取得了较稳定的合理收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0037元;本报告期基金份额净值增长率为0.97%,业绩比较基准收益率为2.61%。

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,受内外部多因素影响,经济下行压力仍较大,但同时应该看到政策已逐渐对经济形成合力的支撑。首先,央行货币政策仍将维持相对宽松的流动性环境,财政政策也逐渐向积极转向,减税政策也在加速推进。因此,预计年内我国经济增速将是温和下行的总体态势。同时值得注意的是,市场预期可能在政策的引导下与外国经贸摩擦等事件的冲击下,频频发生边际上的改变,风险偏好阶段性地出现分歧,债券市场波动可能加大。

在政策方面,我们预测市场资金面整体将维持较宽松局面,资管新规等政策文件对信用环境的边际放松,可能为资质过硬、之前超跌的信用债券带来趋势上的机会。但同时也不应忽视下半年信用风险仍将点状发生,信用环境的改善绝非大水漫灌,对低评级券种仍需要谨慎挖掘与调研。恒玖债券基金将严选个券,控制久期和杠杆,把控制信用风险和流动性放在重要位置,发挥管理人宏观市场研究和信用研究领域的专业性,为持有人合理增加收益。该基金拟继续采用高杠杆,中短久期,高评级策略,利用套息策略增厚收益的同时,控制流动性和信用风险。

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《华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金》的有关规定,本报告期共实施一次利润分配,分配金额为3,720,733.87元,本期利润为9,422,867.49元,期末可供分配利润为1,948,542.30元,滚存至下一期进行分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或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

本报告期内,中国光大银行股份有限公司在华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金(以下称"本基金")托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。本基金本报告期内共实施一次利润分配,分配金额为3,720,733.87元。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金2018年半年度报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

§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:华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金
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		85,852,017.24	-
结算备付金		-	-
存出保证金		10,274.27	-
交易性金融资产		430,118,000.00	-
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		430,118,000.00	-
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		101,505,577.71	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		6,217,323.13	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		623,703,192.35	-
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		-	-
应付证券清算款		700,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		239,017.20	-
应付托管费		79,672.41	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		24,886.66	-
应交税费		95,553.18	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		123,239.00	-
负债合计		1,262,368.45	-
所有者权益:			
实收基金		620,122,283.36	-
未分配利润		2,318,540.54	-
所有者权益合计		622,440,823.90	-
负债和所有者权益总计		623,703,192.35	-

注:本基金合同于2018年3月23日生效,报告期为2018年3月23日至2018年6月30日,无上年度可比期间。报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0037元,基金份额总额620,122,283.36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:华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金
本报告期: 2018年3月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年3月23日(基金合同生效日)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		11,055,575.31	-
1.利息收入		12,902,461.40	-
其中:存款利息收入		2,477,982.61	-
债券利息收入		7,830,437.45	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,594,041.34	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,314,972.39	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-2,314,972.39	-
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		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		468,086.30	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		1,632,707.82	-
1. 管理人报酬		807,741.45	-
2. 托管费		269,247.15	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		11,804.75	-
5. 利息支出		397,957.14	-
其中:卖出回购金融资产支出		397,957.14	-
6. 其他费用		123,639.00	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		9,422,867.49	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		9,422,867.49	-

注:本基金合同于2018年3月23日生效,报告期为2018年3月23日至2018年6月30日,无上年度可比期间。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:华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2018年3月23日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年3月23日(基金合同生效日)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)	1,000,301,246.62	-	1,000,301,246.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	9,422,867.49	9,422,867.49
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)	-380,178,963.26	-3,383,593.08	-383,562,556.34
其中:1.基金申购款	5.98	0.02	6.00
2.基金赎回款	-380,178,969.24	-3,383,593.10	-383,562,562.34
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)	-	-3,720,733.87	-3,720,733.87
五、期末所有者权益(基金净值)	620,122,283.36	2,318,540.54	622,440,823.90
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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注:本基金合同于2018年3月23日生效,报告期为2018年3月23日至2018年6月30日,无上年度可比期间。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

华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)《关于准予华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2018】234号)准予募集注册,基金合同于2018年3月23日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集资金到位情况业经天健会计师事务所有限责任公司审验,并由其出具《验证报告》(天健字(2018)6-5号)。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《华富恒玖3个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、可分离交易可转债的纯债部分、货币市场工具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、经营成果和净值变动等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金合同于2018年3月23日生效,无上年度可比期间。

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
中国光大银行股份有限公司	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

本基金合同于2018年3月23日生效,无上年度可比期间。

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

注:本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

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3月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
华安证券	202,347,622.61	100.00%	-	-

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3月23日(基金合同生效日)至2018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	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
华安证券	646,700,000.00	100.00%	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期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

注:本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

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3月23日(基金合同生效日)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	807,741.45	-
其中:支付销售机构的客户维护费	95.08	-

注:1)基金管理费按前一日基金资产净值0.3%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)。

2)本基金基金合同生效未满一年,无上年度可比期间。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年3月23日(基金合同生效日)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	269,247.15	-

注:1) 基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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)。

2)本基金基金合同生效未满一年,无上年度可比期间。

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:本基金本报告期和上年度可比期间内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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3月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	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
中国光大银行股份有限公司	852,017.24	110,892.26	-	-

注:1)本表仅列示活期存款余额及产生利息。

2)本基金基金合同生效未满一年,无上年度可比期间。

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:本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:本基金本报告期末未有债券正回购交易。

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	430,118,000.00	68.96
	其中:债券	430,118,000.00	68.96
	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	101,505,577.71	16.27
	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	85,852,017.24	13.76
7	其他各项资产	6,227,597.40	1.00
8	合计	623,703,192.35	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

注:本基金本报告期末未持有股票

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	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	260,725,000.00	41.89
6	中期票据	70,698,000.00	11.36
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	98,695,000.00	15.86
9	其他	-	-
10	合计	430,118,000.00	69.10

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	1182216	11中海运MTN2	500,000	50,590,000.00	8.13
2	011800413	18国电集SCP002	500,000	50,155,000.00	8.06
2	011800526	18华能SCP004	500,000	50,155,000.00	8.06
3	011800615	18中电投SCP007	500,000	50,150,000.00	8.06
4	111810275	18兴业银行CD275	400,000	39,616,000.00	6.36
5	011800609	18中核建SCP003	300,000	30,069,000.00	4.83

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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投资。

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。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

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。

7.12.3 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	10,274.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,217,323.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,227,597.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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。

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
74	8,380,030.86	620,000,000.00	99.98%	122,283.36	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	26,984.89	0.0044%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2018年3月23日)基金份额总额	1,000,301,246.62
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5.98
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	380,178,969.24
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	620,122,283.36

§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、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,增聘张娅女士为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
2、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,王翔先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
3、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,王翔先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
4、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,王翔先生不再担任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
5、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,王翔先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
6、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,增聘郜哲先生为华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
7、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,增聘郜哲先生为华富中小板指数增强型证券投资基金基金经理。
8、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,增聘郜哲先生为华富中证100指数证券投资基金基金经理。
9、经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过,因工作需要,张惠女士不再担任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
10、2018年5月7日,中国光大银行股份有限公司聘任张博先生担任投资与托管业务部总经理职务。

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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
华安证券	2	-	-	-	-	-

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

2)本报告期本基金无新增交易单元。

3)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。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
华安证券	202,347,622.61	100.00%	646,700,000.00	100.00%	-	-

注:债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计,可转债的成交金额按全价统计。

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	3.23-6.30	499,999,000.00	0.00	0.00	499,999,000.00	80.63%
	-	-	-	-	-	-	-
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