本基金本报告期末未持有贵金属。

本基金本报告期末未持有权证。

本基全本报告期末无股指期货投资

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

五名权证投资明细

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体

单位:人民币元

份额单位:份

单位:份

本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

由于四舍五人的原因, 分项之和与合计项之间可能存在

§8 基金份额持有人信息

注: 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末

注: 期末基金管理人的从业人员持有本基金占基金总份

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额

《9 开放式基金份额变动

§ 10 重大事件揭示

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重

基金管理人公告,杨小舟董事长于2019年1月23日任职,

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业

本报告期内,本基金管理人于 2019 年1月4日于《上海

证券报》发布了《富荣基金管理有限公司关于旗下基金改聘

会计师事务所的公告》的公告,自 2019年1月3日起,旗下基

金的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所 (特殊普通

合伙)变更为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),已履

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等

本报告期内本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金

部门及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

李东育副总经理于2019年6月13日任职,刘志军董事长干

2019年1月23日离任,上述人事变动已按相关规定备案。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

本基金本报告期末无可转换债券投资。

本基金本报告期末未持有股票。

额比例展示为0,是由于保留位数导致。

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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

大人事变动

务的诉讼。

行必要的程序。

持有人户数合计。

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金本报告期未投资股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细



富荣富开1-3年国开债纯债债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人: 富荣基金管理有限公司 基金托管人:杭州银行股份有限公司 送出日期:2019年08月27日《1 重要提示

1.1 重要提示

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、误导性陈述或置大遗漏,并对其内容的身性、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;非 。 人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月21日复核了本报告中的财务指 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题,深导性 ·若重大遊邏。 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 。 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 名次社上经验证

§ 2 基金简介

基金简称	富荣富开1-3年国开债纯债	
基金主代码	006488	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年10月31日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	杭州银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	765,324,162.14 ()	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品	品说明
投资目标	在谨慎投资的前提下,追求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将主要投资于剩余期限为1-3年国开债,通过对国内外宏观经济优况,市场利率走势,市场资金供求情况进行综合分析,主要在豪余期限为与中期限及四种则限以内的国产债中进行通难机选择。
业绩比较基准	中债-国开行债券总全价(1-3年)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基 金混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中低风 险品种。

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		富荣基金管理有限公司	杭州银行股份有限公司	
	姓名	滕大江	陈凯伦	
信息披露 负责人	联系电话	0765-84356633	0671-87253683	
电子邮箱		service@furamc.com.cn	chenkailun@hzbank.com.cn	
客户服务电话		4006855600	95398	
传真		0755-83230902	0571-86475525	

基金管理人、基金托管人处

§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(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	7,071,463.96
本期利润	5,819,203.98
加权平均基金份额本期利润	0.0158
本期基金份额净值增长率	1.74%
3.12 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0143
期末基金资产净值	776,277,362.66
期末基金份額净值	1.0143

费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

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期末可供分配利润是采用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: ④本基金合同生效日为2018年10月31日,截止2019年6

月30日止,本基金成立未满一年。

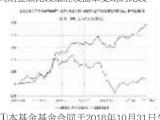
3.2 基金净值表现

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

WHE	墨①	率标准差2	收益率③	收益率标准差 ④	(I)-(3)	(2)-(4)	
过去一个月	0.49%	0.02%	0.23%	0.03%	0.26%	-0.01%	1
过去三个月	0.46%	0.05%	-0.61%	0.07%	1.07%	-0.02%	
过去六个月	1.74%	0.05%	-0.40%	0.06%	2.14%	-0.01%	
自基金合同生效 起至今	2.44%	0.05%	0.25%	0.06%	2.19%	-0.01%	
注:本基	金的业绩	责比较基	准为:中	债-国开	F行债	券总全	全化

(1-3年)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 动及其与同期训练比较基准收益率变动的比较



注: ①本基金基金合同于2018年10月31日生效, 截止 2019年6月30日止,本基金成立未满一年;

②本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比 例符合合同约定。

《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

富荣基金管理有限公司成立于2016年1月25日,是中国证 监会批准成立的国内第101家公募基金管理公司。公司注册地 为广州市南沙区,办公地位于深圳市福田区深圳证券交易所 广场,注册资本金人民币2亿元。富荣基金定位于"综合金融服 务商",围绕客户需求,贯彻投资人利益优先原则,秉持"规范创 造价值,创新推动成长"的经营理念,努力打造企业核心竞争 力,整合产业上下游资源,为各类投资者提供充分满足个性需 求的产品,并以稳定、持续、优秀的投资业绩和全面、及时、优 质的服务回报投资者的信任,与投资者共同分享中国经济发 展的成果,致力成为受人尊重、有价值的综合金融服务企业领

先者。 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		证券丛业年	说明	
		任职日期	离任日期	限		
吕晓蓉	固定收益部 副总监、基金 经理	2018-12-10	-	8	清商中学士从书籍永计审基限头股转20日基 持商中学士从书籍永计审基限头股转20日基 ,一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	

注:1、"任职日期"指根据公司对外公告的聘任日期 2、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 报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证 券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相 关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、 取信于社会的原则管理和运用基金资产, 在控制风险的前提 下,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法 合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理 公司公平交易制度指导意见》 和公司制定的公平交易相关制 度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗 下所有投资组合。

公司利用统计分析的方法和工具,按照不同的时间窗口 (包括当日内、3日内、5日内),对旗下所有投资组合的同向交 易价差情况进行分析,报告期内未发现旗下投资组合之间存 在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益 输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说 阴

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2019年上半年,一季度美联储货币政策逐渐转鸽,中 美贸易关系改善,国内专项债提前发力拉动社融等数据大幅 反弹,经济悲观预期修复,风险偏好明显抬升;二季度政治局 会议重新强调调结构和供给侧改革, 财政发力较一季度有所 减弱,经济数据出现较大波动,对市场预期形成一定干扰。5月

风险偏好重新回落。6月金融供给侧改革深化,"包商银行托管 元,基金份额总额765,324,162.14份。 "事件使得部分风险开始暴露,流动性与信用环境出现一定分 层。资产表现上,上半年商品〉股票〉债券,商品价格受到地 产、基建投资支撑与供给层面影响而维持强势,债券中信用债 金 强于利率债,股票中上证50表现好于创业板。

本基金以1-3年国开债为主要投资标的,灵活调整组合久 期和杠杆,并适度把握波段性交易机会,上半年获取了较为稳

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣富开1-3年国开债纯债基金份额净值 为1.0143元,本报告期内,基金份额净值增长率为1.74%,同期 业结比较其准收益率为-0.40%

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,海外方面,美国经济数据呈现的边际走弱信 号增多,加征关税带来的负面影响可能开始出现,而欧洲经济 未出现明显改善迹象,全球央行进入新一轮共同宽松的阶段。 国内经济在经历上半年较大波动后,将重新回归趋势。地产、 基建主导的建筑产业链短期有韧性,但商品房销售下行、财政 压力上升使得力度不及上半年。制造业产业链受内需乏力和 关税上升抑制,货币政策仍会维持适当流动性宽松,同时定向 支持企业。总需求走弱下,通胀不会构成主要矛盾。利率债方 面,继续看好下半年机会,虽然减税降费等政策刺激下消费有 望转好,但经济企稳的基础仍然不牢,宏观周期依然处于寻底 阶段,这决定了利率向上风险有限;随着海外货币政策进一步 宽松,央行可能适时推进"利率并轨"等改革,降低企业实际融 资利率,国债收益率有望向下突破年初低点。信用债方面,一 方面中高等级信用利差已压缩至较低水平,另一方面"包商事 件"冲击下信用债等级利差或会继续走阔但过程中会出现交 易机会,投资将视负债端的稳定性平衡等级和期限结构。

本基金以1-3国开债指数为基准,组合整体久期与基准偏 离将控制在一定幅度内,以给投资者稳定的预期回报。同时发 挥主动管理的职能,根据市场的走势小幅调整仓位和久期,同 时通过新老债券利差策略, 骑乘策略等高安全性的策略增强 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》、《证

券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员 会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务 及份额净值计价有关事项的通知》与《关于讲一步规范证券 投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约 定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金 份额净值由本基金管理人完成估值后, 经本基金托管人复核 无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核 与基金会计账务的核对同时讲行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序 并由研究部、基金事务部、监察稽核部、固定收益部及基金经 理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小 组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任 能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金 经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但 应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调 整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其 影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估 值政策和程序的一贯性。

报告期内。本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以 根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若 《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益 分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金 红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资: 若投资人 不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分 配后基金份额净值不能低于面值, 即基金收益分配基准目的 基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于 面值;每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另 有规定的,从其规定。

本基金本报告期共进行利润分配一次。2019年3月12日 (权益登记日)分配利润2,711,778.81元,每10份基金份额分 红0.1元。符合本基金合同约定。

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, 本基金未出现连续二十个工作日基金份额 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

§ 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,杭州银行股份有限公司(以下称"本托管人") 在对富荣富开1-3年国开债纯债债券型证券投资基金 (以下 称"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 易。 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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计 易。 算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照《证券投资基金法》、基金合同、 托管协议和其他有关规定,对本基金管理人的投资运作进行 了必要的监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格 的计算以及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。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

《6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富荣富开1-3年国开债纯债债券型证券投资基

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	27,965,361.86	864,405.36
结算备付金	_	_
存出保证金	_	_
交易性金融资产	783,974,000.00	270,056,000.00
其中:股票投资	_	_
基金投资	_	_
债券投资	783,974,000.00	270,056,000.00
资产支持证券投资	-	_
贵金属投资	-	_
衍生金融资产	-	_
买人返售金融资产	-	_
应收证券清算款	-	-
应收利息	11,561,425.08	8,721,006.03
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	823,500,786.94	279,641,410.39
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018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	46,943,856.53	75,999,686.00
应付证券清算款	-	_
应付赎回款	-	_
应付管理人报酬	128,684.32	51,662.82
应付托管费	42,894.76	17,220.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,71239	8,204.85
应交税费	-	-
应付利息	6,509.85	93,841.35
应付利润	-	_
递延所得税负债	-	-
其他负债	88,766.43	66,666.67
负债合计	47,223,424.28	76,237,282.62
所有者权益:		
实收基金	765,324,162.14	202,004,226.42
未分配利润	10,953,200.52	1,399,901.35
所有者权益合计	776,277,362.66	203,404,127.77
负债和所有者权益总计	823,500,786.94	279,641,410.39

中美贸易谈判重生波澜,关税水平抬升、科技制裁范围扩大, 注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值人民币1.0143

6.2 利润夷 会计主体: 富荣富开1-3年国开债纯债债券型证券投资基的约定。

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日 单位:人民币元

项目	本期2019年01月01日 至2019年06月30日
一、收人	6,955,020.47
1.利息收入	8,853,200.47
其中:存款利息收入	32,779.54
债券利息收入	8,760,466.84
资产支持证券利息收入	-
买人返售金融资产收入	59,954.09
其他利息收入	_
2投资收益(损失以"-"填列)	-645,920.00
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-645,920.00
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)	-1,252,260.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收人(损失以 "-" 号填列)	-
城:二、费用	1,135,816.49
1. 管理人报酬	562,675.21
2. 托管费	187,558.38
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	7,975.00
5. 利息支出	282,841.47
其中:卖出回购金融资产支出	282,841.47
B. 税金及附加	
7. 其他费用	94,766.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	5,819,203.98
域:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	5,819,203.98

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 富荣富开1-3年国开债纯债债券型证券投资基

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日 单位:人民币元

来分配利润 1,399,901.35 5,819,203.98 6,445,874.00	所有者权益合计 203,404,127.77 5,819,203.98
5,819,203.98	5,819,203.98
, ,	
6 445 874.00	
0,440,07400	569,765,809.72
7,860,173.71	740,006,921.37
-1,414,299.71	-170,241,111.65
-2,711,778.81	-2,711,778.81
10,953,200.52	776,277,362.66
	-2,711,778.81

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署

基金管理人负责人 6.4 报表附注 6.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期

本基金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。 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。 6.4.3 关联方关系

6.4.2.3 差错更正的说明

6.4.3.1 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未 发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交

6.4.4.1.2 权证交易 本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交

6.4.4.1.1 股票交易

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交

64414 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬 6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元 注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一

日基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.30%/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

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一 日基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值

6.4.4.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购)交

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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金

份额单位:份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	
基金合同生效日(2018年10月 31日)持有的基金份額	1,992,031.87	
报告期初持有的基金份额	1,992,031.87	
报告期间申购/买人总份额	0.00	
报告期间因拆分变动份额	0.00	
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	
报告期末持有的基金份额	1,992,031.87	
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	0.2603%	

注:1、申购含转换入份额、红利再投资份额;赎回含转换

出份额。

2、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件 的前五名贵金属投资明细

6.4.4.4.2 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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息

单位:人民币元

注:本基金的活期银行存款由基金托管人杭州银行保管, 按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明 6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限

本基金本期末未持有因认购新发等流通受限的债券。

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市 场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额46.943.

金额单位:人民币元 尾差。

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量(张)	期末估值总额
160206	16国开06	2019-07-01	99.82	489,000	48,811,980.00
合计				489,000	48,811,980.00

截至本报告期末2019年6月30日止 本基金无从事证券交 易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 1. 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。 2. 其他事项

(1) 公允价值 基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售 金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期

限不长,公允价值与账面价值相若。 各层次金融工具公允价值

856.53元,是以如下债券作为抵押:

于2019年6月30日,本基金持有的持续以公允价值计量且 其变动计入当期损益的金融资产中划分为第二层次的余额为 人民币783,974,000.00元,无划分为第一层次及第三层次的

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券, 若出现交易 不活跃的情况, 本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允

公允价值所属层次间重大变动

价值列入第一层次:根据估值调整中所采用输入值的可观察 性和重要性,确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

金融工具, 本基金本期未发生第三层次公允价值转入(转出) (2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的

的其他重要事项。 3. 财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月26日经本基金的基金管理人

《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

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 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

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前

十名股票投资明细

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 情况

的股票明细 本基金本报告期末未持有股票。

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

五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有股票。 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 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	783,974,000.00	100.99
	其中:政策性金融债	783,974,000.00	100.99
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	783,974,000.00	100.99

金额单位:人民币元

持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 息

本基金本报告期未租用证券公司交易单元。 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的 本基金本报告期未租用证券公司交易单元。 《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 报告期内持有基金份额变化情况

投资者类别	序号	持有基金 份额比例 达超过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	20190101 - 20190527	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	13.07%
	2	20190613 _ 20190626	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	13.07%
	3	20190101 	99,999,000.00	-	30,000, 000.00	69,999,000.00	9.15%
	4	20190613 _ 20190626	-	99,155, 180.96	-	99,155,180.96	12.96%
	5	20190329 - 20190630	-	198,156, 147.83	-	198,156, 147.83	25.89%
	6	20190627 - 20190630	-	296,002, 960.04	-	296,002, 960.04	38.68%
	7	20190115 - 20190328	-	69,168, 972.33	69,168, 972.33	-	0.00%
				产品特有风险	ż		

能於例投資本大聯經學的,德東亞學不及1998年 3、規模的基本學所的別處 多名與比例投資都經過,可能出現基金資产净值低于6000万元的情形。根据本台间的定,否定核大 作方式,与其他基金合并成就後让基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。 作方式,与其他基金合并成就後让基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

的投资者("高比例投资者")大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者 高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。

可可以及25.00 個大幅波动的风险 细壁回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动

本基金本报告期内未出现影响投资者决策的其他重要信

二〇一九年八月二十七日

富荣基金管理有限公司