华富中证100指数证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019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:交通银行股份有限公司

送出日期:2019年8月29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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年8月28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2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华富中证100指数
基金主代码	410008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月30日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	119,927,675.03份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%和年跟踪误差不超过4%,以实现对中证100指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,本基金的标的指数为中证100指数。本基金原则上采用完全复制指数的投资策略,即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	陆志俊
	联系电话	021-68886996	95559
	电子邮箱	manzh@hffund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-700-8001	95559
传真		021-68887997	021-62701216

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(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	3,205,660.31
本期利润	25,969,002.94
加权平均基金份额本期利润	0.3236
本期基金份额净值增长率	29.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.3397
期末基金资产净值	173,015,672.20
期末基金份额净值	1.4427

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)期末可供分配利润指标的计算方法为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期末余额的孰低数,表中的“期末”均指报告期最后一日,即6月30日。

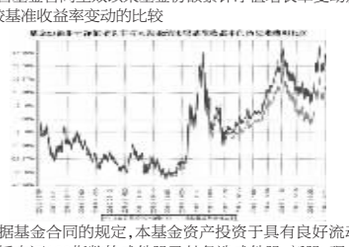
3.2 基金净值表现

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	6.79%	1.10%	6.25%	1.12%	0.54%	-0.02%
过去三个月	3.39%	1.42%	1.84%	1.44%	1.55%	-0.02%
过去六个月	29.53%	1.45%	27.33%	1.47%	2.20%	-0.02%
过去一年	18.13%	1.42%	13.46%	1.45%	4.67%	-0.03%
过去三年	54.85%	1.06%	37.01%	1.07%	17.84%	-0.01%
自基金合同生效起至今	44.27%	1.41%	21.97%	1.40%	22.30%	0.01%

注: 业绩比较基准收益率=中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%,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:根据基金合同的规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证100指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的90%~95%,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2009年12月30日至2010年6月30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《华富中证100指数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2019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、华富恒富18个月定期开放债券型证券投资基金、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、华富恒财定期开放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		
高靖瑜	华富中证100指数基金基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理	2017年9月12日	-	十九年	复旦大学金融学硕士,本科学历。历任金鼎综合证券(维京)股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员,2007年7月加入华富基金管理有限公司,任行业研究员,2013年3月1日至2014年12月14日任华富价值增长混合型基金基金经理助理,2014年12月15日至2016年1月12日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理。
郜哲	华富中证100指数基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理、华富永鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富中证5年恒定久期国开债指数型基金基金经理经理	2018年2月23日	-	五年	北京大学理学博士,研究生学历,先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海同安投资管理有限公司高级研究员,2017年4月加入华富基金管理有限公司。

注:这里的任职日期为公司作出决定之日。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、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,基金运作合法合规,不存在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

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

2019年上半年,股市在一季度大幅上涨后,二季度呈现下跌态势,上半年沪深300上涨27.07%、中证100上涨28.81%、中小板上涨20.75%、创业板上涨20.87%。

一季度随着社融数据改善,1月天量信贷投放,PMI数据企稳, 风险偏好逐渐修复,同时外资持续流入,以及贸易战的缓和,市场出现快速上涨行情,而快速上涨又使得市场赚钱效应越来越强,进一步推高了涨幅。

但国内工业增加值从3月份的8.5%之后, 该指标在4、5月大幅下滑至5.5%和5%,PMI 2季度下滑至荣枯线下,国内经济景气度在短暂回升后再度转为下降。同时货币政策也从出现了边际收紧。再加上贸易战的反复导致国际环境和国内经济都出现了较大波动, 市场风险偏好下降,股市出现了明显的震荡向下。

另一方面,随着核心资产受到投资者认可,以中国平安、贵州茅台、格力电器为首的消费金融龙头二季度创出历史新高。以头部金融和大消费为主要权重的中证100指数,在二季度逆势上涨1.88%。

本基金为完全复制的指数基金,2019年上半年,我们实现了对业绩基准的有效跟踪,并通过打新策略,优化了基金的成本收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于2009年12月30日正式成立。截至2019年6月30日,本基金份额净值为1.4427元,累计基金份额净值为1.4427元。本基金本报告期份额净值增长率为29.53%,同期业绩比较基准收益率为27.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在2019年三季度, 我们将继续通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争实现对业绩基准的有效跟踪。随着科创板上市,本基金通过叠加打新策略,在严格控制基金跟踪误差的前提下,争取获得更多超额收益,为投资者提供最佳跟踪中证100指数的投资工具。

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《华富中证100指数型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本期利润为25,969,002.94元,期末可供分配利润为40,742,653.56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

2019年上半年度,基金托管人在华富中证100指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2019年上半年度,华富基金管理有限公司在华富中证100指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2019年上半年度, 由华富基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华富中证100指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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:华富中证100指数证券投资基金

报告截止日: 2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	13,451,014.64	6,702,014.67
结算备付金		8,909.94	1,241.67
存出保证金		2,822.65	2,194.72
交易性金融资产	6.4.7.2	159,797,042.97	81,163,051.15
其中:股票投资		159,797,042.97	81,163,051.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	148,729.97
应收利息	6.4.7.5	3,406.25	1,475.48
应收股利		-	-
应收申购款		32,198.56	8,730.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		173,295,395.01	88,027,438.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		84,473.97	50,030.84
应付管理人报酬		52,035.78	38,494.55
应付托管费		15,610.74	11,548.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	60,909.07	6,220.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	66,693.25	180,163.54
负债合计		279,722.81	286,458.19
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	119,927,675.03	78,774,850.16
未分配利润	6.4.7.10	53,087,997.17	8,966,129.79
所有者权益合计		173,015,672.20	87,740,979.95
负债和所有者权益总计		173,295,395.01	88,027,438.14

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值173,015,672.20元,基金份额总额119,927,675.03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:华富中证100指数证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		26,456,341.16	-9,052,641.12
1.利息收入		27,905.31	67,845.82
其中:存款利息收入	6.4.7.11	27,899.98	15,944.43
债券利息收入		5.33	51,503.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	397.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		3,653,986.91	2,497,041.18
其中:股票投资收益	6.4.7.12	2,167,993.25	1,409,656.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,684.67	15,634.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,482,308.99	1,071,750.13
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	22,763,342.63	-11,625,757.85
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	11,106.31	8,229.73
减:二、费用		487,338.22	446,493.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	264,579.71	253,615.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	79,373.96	76,084.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	76,637.78	27,461.62
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	66,746.77	89,331.96
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		25,969,002.94	-9,499,134.44
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		25,969,002.94	-9,499,134.44

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:华富中证100指数证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	78,774,850.16	8,966,129.79	87,740,979.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,969,002.94	25,969,002.94
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)	41,152,824.87	18,152,864.44	59,305,689.31
其中:1.基金申购款	48,810,147.12	20,987,523.22	69,797,670.34
2.基金赎回款	-7,657,322.25	-2,834,658.78	-10,491,981.03
五、期末所有者权益(基金净值)	119,927,675.03	53,087,997.17	173,015,672.20
项目	上年度可比期间 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)	75,502,599.10	26,028,110.12	101,530,709.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,499,134.44	-9,499,134.44
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)	1,343,046.55	480,206.26	1,823,252.81
其中:1.基金申购款	9,308,489.36	3,477,717.30	12,786,206.66
2.基金赎回款	-7,965,442.81	-2,997,511.04	-10,962,953.85
五、期末所有者权益(基金净值)	76,845,645.65	17,009,181.94	93,854,827.59

注:后附报表附注为本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_____ _____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

华富中证100指数型证券投资基金(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【2009】1158号)核准,基金合同于2009年12月30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经天健光华(北京)会计师事务所审验,并出具《验资报告》(天健光华验(2009)综字第070007号)。有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华富中证100指数型证券投资基金基金合同》的规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具, 包括中证100 指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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。

主要税种及税率列示如下:

税 种	计税依据	税 率
增值税	金融服务销售额	3%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加[注]	应缴流转税税额	2%、1%

[注]:按地方税务局通知,自2018年7月起下调地方教育附加税税率,由原来的2%下调为1%。

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	基金管理人、注册登记人、销售机构
交通银行股份有限公司	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	50,574,022.37	74.47%	17,865,777.31	98.68%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	48,690.00	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1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	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华安证券	-	-	2,200,000.00	100.00%

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无通过关联方交易单元发生的权证交易。

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 2019年1月1日至2019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	47,082.51	74.88%	45,112.35	74.07%
关联方名称	上年度可比期间 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	16,577.25	98.70%	10,091.38	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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	264,579.71	253,615.18
其中:支付销售机构的客户维护费	34,931.43	32,562.37

注: 基金管理费按前一日基金资产净值0.50%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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	79,373.96	76,084.56

注: 基金托管费按前一日基金资产净值0.15%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。

6.4.8.4 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
交通银行股份有限公司	13,451,014.64	27,808.41	7,522,450.31	12,483.93

注:1)本表仅列示活期存款余额及产生利息。

2) 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。本期末和上年度末的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

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 利润分配情况

6.4.10 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	*ST信威	2016年12月26日	重大事项停牌	14.59	2019年7月12日	13.86	9,203	217,414.82	134,271.77	-

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11 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	159,797,042.97	92.21
	其中:股票	159,797,042.97	92.21
7	银行存款和结算备付金合计	13,459,924.58	7.77
8	其他各项资产	38,427.46	0.02
9	合计	173,295,395.01	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 期末指数投资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	2,467,168.00	1.43
B	采矿业	5,674,010.88	3.28
C	制造业	52,059,252.60	30.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,594,587.62	2.08
E	建筑业	5,621,102.85	3.25
F	批发和零售业	1,514,252.56	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	4,496,438.34	2.59
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,147,865.86	1.82
J	金融业	70,987,186.85	41.03
K	房地产业	7,177,903.41	4.15
L	租赁和商务服务业	2,610,183.42	1.51
M	科学研究和技术服务业	112,684.00	0.07
	合计	159,452,636.39	92.16

注: 本基金本报告期指数投资部分合拟于2019年7月1日调入中证100指数的备选成分股,具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。

7.2.2 期末积极投资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(%)
B	采矿业	43,050.85	0.02
C	制造业	236,066.99	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,418.80	0.02
J	金融业	33,869.94	0.02
	合计	344,406.58	0.20

7.2.3 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股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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

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	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	200,428	17,759,925.08	10.26
2	600519	贵州茅台	9,292	9,143,328.00	5.28
3	600036	招商银行	190,846	6,866,639.08	3.97
4	601166	兴业银行	269,011	4,920,211.19	2.84
5	000651	格力电器	89,044	4,897,420.00	2.83
6	000333	美的集团	85,573	4,437,815.78	2.56
7	000858	五粮液	35,910	4,235,584.50	2.45
8	600276	恒瑞医药	57,316	3,782,856.00	2.19
9	600887	伊利股份	112,791	3,768,347.31	2.18
10	600030	中信证券