

2017年9月30日

基金管理人：华富基金管理有限公司  
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24日核对了本报告中的财务数据、净值表现、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。投资者有风险，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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期间为2017年7月1日至2017年9月30日。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华富恒财分级债券型证券投资基金

基金代码 000622

交易账户 000622

基金运作方式 约定定期开放式

基金份额净值 2014年 5月7日 1.024

报告期末基金份额总额 134,092,542.08

报告期末基金份额总额

投资目标 在较低风险并保持资产流动性的情况下，通过定期开放机制，在严格控制风险的基础上，获取更高的收益。

投资策略 本基金长期和滚动地管理作为持有待售的核算，在此基础上，根据市场环境的变化，适时调整资产配置比例。

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中偏债基金品种。其风险与预期收益水平均低于货币市场基金，高于混合基金和股票型基金。

基金管理人 华富基金管理有限公司

基金托管人 上海浦东发展银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 华富恒财分级债券型A

下属分级基金的基金代码 000622

报告期末该分级基金的份额总额 1,161,036.42份

报告期末该分级基金的份额总额

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日—2017年9月30日

1.本期已实现收益 1,165,248.88

2.本期利润 1,312,102.73

3.加权平均基金份额本期利润 0.0098

4.期末基金资产净值 139,985,801.23

5.期末基金份额净值 1.044

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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期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 净值增长率① (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.3基金净值表现

3.2.3.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.3.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.4基金净值表现

3.2.4.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.4.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.5基金净值表现

3.2.5.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.5.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.6基金净值表现

3.2.6.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.6.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.7基金净值表现

3.2.7.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.7.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.8基金净值表现

3.2.8.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.8.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.9基金净值表现

3.2.9.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.9.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.10基金净值表现

3.2.10.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.10.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.11基金净值表现

3.2.11.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.11.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.12基金净值表现

3.2.12.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.12.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.13基金净值表现

3.2.13.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.13.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.14基金净值表现

3.2.14.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.14.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.15基金净值表现

3.2.15.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 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

过去三个月 0.97% 0.04% 0.56% 0.04% 0.41% 0.00%

3.2.15.2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：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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于否则列数字。

3.2.16基金净值表现

3.2.16.1报告期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 净值增长率为 (%) 净值增长率为标准差 (%) 业绩比较基准收益率 ③ (%) 业绩比较基准收益率标准差④ (%) ①-