

华富安福债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

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。本中期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 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.11 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 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情况	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富安福债券型证券投资基金
基金简称	华富安福债券
基金主代码	002412
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 2 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	216,055,457.84 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。本基金投资组合中债券类、权益类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。
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，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	中国建设银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	林之懿	王小飞
	联系电话	021-68886996	021-60637103
	电子邮箱	linzy@hffund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-700-8001	021-60637228	
传真	021-68887997	021-60635778	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	北京市西城区金融大街 25 号	
办公地址	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
邮政编码	200120	100033	
法定代表人	赵万里	张金良	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
----------------	---------

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路18号陆家嘴富汇大厦A座3楼、5楼

§ 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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	297,371.11
本期利润	2,487,900.68
加权平均基金份额本期利润	0.0268
本期加权平均净值利润率	2.59%
本期基金份额净值增长率	4.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-10,862,023.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0503
期末基金资产净值	225,315,151.91
期末基金份额净值	1.0429
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	24.17%

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。

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

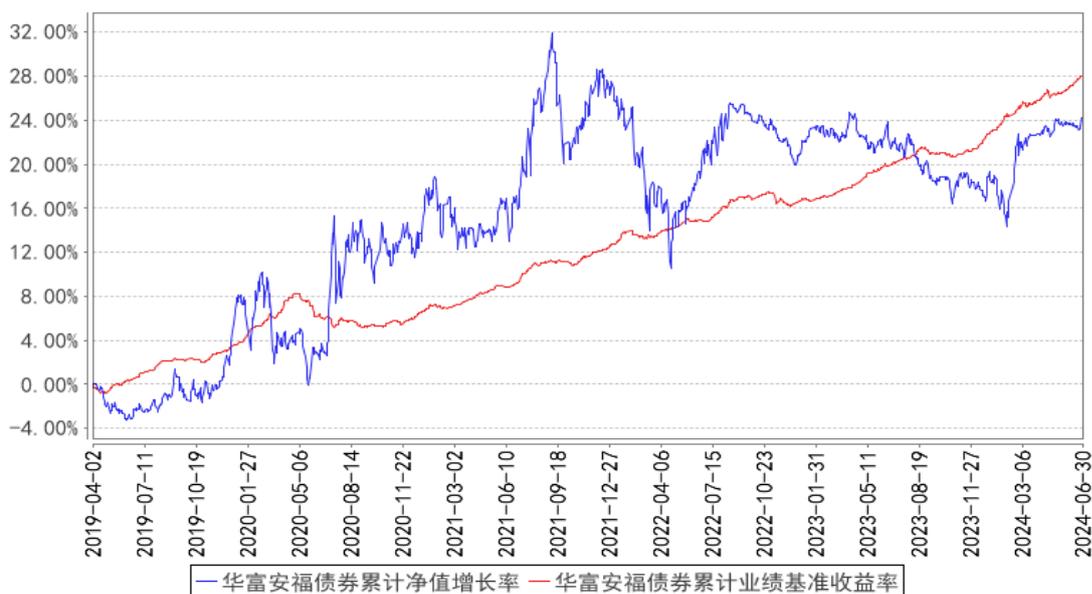
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.34%	0.19%	0.99%	0.04%	-0.65%	0.15%
过去三个月	1.22%	0.19%	1.92%	0.08%	-0.70%	0.11%
过去六个月	4.46%	0.41%	4.31%	0.08%	0.15%	0.33%

过去一年	1.74%	0.36%	6.59%	0.07%	-4.85%	0.29%
过去三年	6.00%	0.54%	17.29%	0.06%	-11.29%	0.48%
自基金合同生效起至今	24.17%	0.59%	28.05%	0.07%	-3.88%	0.52%

注：业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率。

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业绩比较基准收益率变动的比较

华富安福债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金自 2019 年 4 月 2 日由华富安福保本混合型证券投资基金转型而来。

2、本基金建仓期为 2019 年 4 月 2 日到 2019 年 10 月 2 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《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定。

§ 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、安徽省信用融资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 2024 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、华富中小企业 100 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、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金、华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金、华富恒享纯债债券型证券投资基金、华富泰合平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、华富产业智选混合型证券投资基金、华富恒惠纯债债券型证券投资基金共六十五只基金。

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		
张惠	本基金基金经理、固定收益部副总监	2019年4月2日	-	十七年	合肥工业大学经济学硕士、硕士研究生学历。2007年6月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部助理行业研究员、行业研究员，固定收益部固收研究员、基金经理助理、总监助理，自2015年8月31日起任华富恒利债券型证券投资基金基金经理，自2016年9月7日起任华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年1月30日起任华富安享债券型证券投资基金基金经理，自2019年4月2日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，自2019年4月15日起任华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2021年8月16日起任华富63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，自2023年9月12日起任华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
黄立冬	本基金基金经理、绝对收益部副总监、公司公募投资决策委员会委员	2024年4月1日	-	十一年	上海交通大学经济学硕士、硕士研究生学历。先后供职于上海新世纪资信评估投资服务有限公司、华富基金管理有限公司、平安基金管理有限公司。2021年7月重新加入华富基金管理有限公司，曾任专户投资部投资经理、总监助理、副总监，自2024年4月1日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
许一	本基金基金经理	2024年4月2日	-	十一年	伯明翰大学理学硕士，硕士研究生学历。2013年8月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部助理行业研究员、行业研究员，专户投资部投资经理，自2024年4月2日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
许一	公募基金	1	225,315,151.91	2024年4月2日

私募资产管理计划	4	351,298,962.58	2021年11月10日
其他组合	-	-	-
合计	5	576,614,114.49	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2024 年上半年，国内经济延续复苏，但复苏力度有所放缓。上半年国内生产总值 616836 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.0%。其中，第二产业增长 5.8%，全国规模以上工业增加值同比增长 6.0%，保持了相对较快增长；第一产业同比增长 3.5%，第三产业增加值增长 4.6%。上半年，全国社会消费品零售总额 235969 亿元，同比增长 3.7%，消费仍有待全面复苏；全国固定资产投资（不含农户）245391 亿元，同比增长 3.9%，其中基础设施投资增长 5.4%，制造业投资增长 9.5%，房地产开发投资下降 10.1%，房地产行业的调整对投资仍有影响；出口 121298 亿元，同比增长 6.9%，表现相对较好。总体来看，二季度国内制造业投资和出口等维持了复苏态势，但消费、投资恢复较慢，房地产行业的下滑对于国内需求影响仍然较大。上半年，全国居民消费价格指数（CPI）同比上涨 0.1%，全国工业生产者出厂价格同比下降 2.1%，通胀压力不大。

2024 年上半年的债券市场延续了较好的表现，可转债市场则波动较大。伴随国内经济和金融数据稳中有降、资金面维持平稳的态势，上半年国内债券市场收益率继续全线下行。其中，代表性的 10 年国债和 10 年国开债分别下行 35BP 和 39BP；信用债收益率也有较大幅度下行，长限的信用债表现更好。可转债方面，上半年的可转债市场经历了大幅波动，1 月份和 6 月份分别经历了两次较大冲击，最终中证转债指数在上半年下跌 0.07%，万得可转债等权指数则下跌 5.21%。从结构上看，金融、公用事业等大盘高等级可转债表现相对较好，而低等级的小盘转债则收益不佳。

权益方面，国内市场上半年表现跌宕起伏，年初市场延续了 2023 年底的调整，随着政策层面的一系列支持，市场在 1 月底迎来强势反弹，至 5 月中旬告一段落，随后开启调整，市场整体波动有所加大；上半年指数上红利指数涨幅领先，上证 50 和沪深 300 略有正收益，其余指数基本都有不同程度的下跌，市场分化较为明显，沪深 300 上涨 0.89%，上证指数、创业板指分别下跌 0.25%、10.99%；红利指数上半年上涨 11.29%，上证 50 上涨 2.95%；科创 50 以及中证 1000 跌幅达到了 16.42%和 16.84%，市场整体结构明显偏向价值防御，成长板块相对表现较弱。中信一级行业指数中涨跌幅居前 5 位的依次为银行、煤炭、石油石化、家电和电力公用事业，涨跌幅分别为+19.19%、+12.79%、+11.36%、+10.77%、+9.99%；下跌方面，消费者服务、计算机、商贸零售、传媒、医药跌幅居前，涨跌幅分别为-23.82%、-21.62%、-21.47%、-21.45%、-20.00%。

回顾上半年权益市场，1 月出现了出现一定程度的下跌，由于一些资金的被动卖出导致市场短期缺乏增量资金。在此背景下，管理层及时出台了相应的政策措施来提振市场信心，市场很快企稳反弹，此后新“国九条”的出台，进一步增强了市场信心，此轮反弹持续 3 个多月至 5 月中旬，但是随着二季度一些经济数据的不及预期和社融数据，市场在 5 月下旬再次开启回调。上半年市场整体来看，重要指数平稳，但结构分化较大，价值红利明显占优，成长相对较弱，赚钱效应整体一般。

本基金的投资策略自 2024 年二季度开始发生了较大变化。为控制回撤，进一步平衡好收益和回撤的关系，本基金转为以纯债为主、可转债和权益类资产辅助增强收益的运作模式。仓位分配上，纯债占据主要仓位，适度控制可转债和权益类资产的仓位和风险暴露。本基金在二季度维持了较为平衡的资产配置，重点关注各类资产的结构化机会。一方面，在债券市场上，维持了中性偏高的组合久期，积极挖掘品种和曲线结构上的机会；另一方面，对于国内可转债和权益资产也积极参与。可转债方面，重点关注了纯债替代机会和红利类可转债的机会，在信用风险和退市风险暴露增加的背景下，对于纯债替代类可转债的配置有所减少，随着 5 月下旬以来红利类资产的调整，对于红利类可转债的配置有所增加。权益方面，二季度权益仓位进行了重新布局，节奏上

来看，4 月至 5 月上旬，国内权益市场处于惯性上涨阶段，也是整个 1 月底以来反弹的末段，所以在 5 月前比较谨慎，进入 5 月中旬市场开始逐步回调，借机对长期看好的资源品进行了配置。目前权益资产的持仓结构以中游制造、上游资源和中游小周期品种为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 1.0429 元，累计基金份额净值为 1.2800 元。报告期，本基金份额净值增长率为 4.46%，同期业绩比较基准收益率为 4.31%。

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 2024 年下半年，在国内二季度经济有所回落的背景下，国内稳增长力度预计有所增加。海外方面，面临选举和换届带来的外部环境和国际地缘政治的不确定性增加。

资产配置方面，债券市场面临的国内环境仍然有利，但在收益率已经处于较低水平、资金成本下行较慢以及维持外部均衡压力上升的背景下，债券市场的波动或将有所加大；经历第二季度的回调之后，在维护资本市场稳定的背景下，国内权益市场或有较好的配置机会；可转债资产在 6 月经历了快速调整，估值吸引力重新上升，但配置时更应关注风险，尽量回避信用风险、退市风险较大的个券。

债券市场方面，本基金对债券资产仍维持偏积极的配置策略。考虑下半年债券市场扰动因素较多，应密切关注政府债供给、稳增长力度、机构止盈压力等潜在风险，积极把握市场调整机会。

可转债方面，经历了第二季度的调整，转债市场的估值又回到具有较强吸引力的位置。但考虑到新“国九条”落地以来，在严监管的政策背景下，上市企业风险暴露增加，对可转债的配置将更加注重企业资质。同时，红利类可转债经历了第二季度的调整之后，仍然具有较强的吸引力，本基金将继续关注此类可转债的配置机会。

展望下半年权益市场，在一系列稳增长的政策呵护下，国内宏观经济预期保持平稳增长，给权益市场提供了较好的宏观政策环境。随着促消费、稳地产的政策逐步推进，市场信心或将会得到进一步恢复；海外方面，美国通胀数据低预期，虽然二季度 GDP 略超预期，但是微观数据有明显走弱迹象，市场对于年内美联储降息的预期或将有所提升，美元指数承压，对于人民币汇率回升和 A 股的风险偏好提升或有提振作用。综合来看，我们判断下半年市场表现或将优于上半年，波动有所收窄，指数震荡回升，结构上看，我们偏向于受益于降息预期的资源板块，以及国内竞争力较强的制造业领域，目前我们的组合配置的方向主要集中在船舶制造板块、供给收缩逻辑相关的制冷剂板块以及我们长期看好的资源板块，包括贵金属、石油、铜、铝等，对于当前的持仓，配置的均是我们认为兼具中长期行业逻辑以及短期业绩兑现度的板块，对于年内的市场表现我们有比较强的信心。

本基金将继续坚持追求绝对收益的投资思路，关注市场风险并注重防控组合回撤，继续为持有人获取合理的回报。

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》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，本基金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

从 2023 年 08 月 04 日起至 2024 年 03 月 21 日，本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于 5000 万元的情形，从 2024 年 03 月 22 日至本报告期末（2024 年 06 月 30 日），本基金基金资产净值已不存在低于 5000 万元的情形。

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，本基金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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期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：华富安福债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	867,649.10	66,520.33
结算备付金		3,648,710.74	168,515.13
存出保证金		15,679.56	25,399.91
交易性金融资产	6.4.7.2	268,658,983.24	5,074,931.93
其中：股票投资		29,287,876.00	302,907.00
基金投资		-	-
债券投资		239,371,107.24	4,772,024.93
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	220,000.00	-
应收清算款		1,338,797.83	72,072.33
应收股利		-	-
应收申购款		40,266.12	993.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		274,790,086.59	5,408,433.26
负债和净资产			
		本期末	上年度末
		2024 年 6 月 30 日	2023 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		47,739,741.36	448,976.50
应付清算款		1,509,900.81	75,028.80
应付赎回款		5,443.59	-
应付管理人报酬		104,739.71	16,590.11
应付托管费		29,925.64	4,740.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		7,786.85	170.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	77,396.72	219,078.99
负债合计		49,474,934.68	764,585.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	216,055,457.84	4,651,260.42
未分配利润	6.4.7.8	9,259,694.07	-7,412.25
净资产合计		225,315,151.91	4,643,848.17
负债和净资产总计		274,790,086.59	5,408,433.26

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0429 元，基金份额总额 216,055,457.84 份。

6.2 利润表

会计主体：华富安福债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,146,207.52	7,060,056.46
1. 利息收入		39,886.79	62,806.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,123.04	62,806.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,763.75	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		910,646.40	-1,789,594.17
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-381,106.36	-3,393,238.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,203,952.08	1,347,569.30
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	87,800.68	256,075.34
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,190,529.57	8,739,048.94

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,144.76	47,795.56
减：二、营业总支出		658,306.84	2,148,701.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	329,811.15	1,092,085.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	94,231.80	312,024.55
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		206,162.54	622,489.06
其中：卖出回购金融资产支出		206,162.54	622,489.06
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		2,536.68	9,107.63
8. 其他费用	6.4.7.19	25,564.67	112,994.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,487,900.68	4,911,354.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,487,900.68	4,911,354.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,487,900.68	4,911,354.73

6.3 净资产变动表

会计主体：华富安福债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,651,260.42	-	-7,412.25	4,643,848.17
二、本期期初净资产	4,651,260.42	-	-7,412.25	4,643,848.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	211,404,197.42	-	9,267,106.32	220,671,303.74
（一）、综合收益总额	-	-	2,487,900.68	2,487,900.68
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	211,404,197.42	-	6,779,205.64	218,183,403.06

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	231,410,781.32	-	7,436,351.63	238,847,132.95
2. 基金赎回款	-20,006,583.90	-	-657,145.99	-20,663,729.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	216,055,457.84	-	9,259,694.07	225,315,151.91
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	435,651,376.46	-	6,855,613.85	442,506,990.31
二、本期期初净资产	435,651,376.46	-	6,855,613.85	442,506,990.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-260,473,065.44	-	-2,462,762.75	-262,935,828.19
(一)、综合收益总额	-	-	4,911,354.73	4,911,354.73
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-260,473,065.44	-	-7,374,117.48	-267,847,182.92
其中：1. 基金申购款	405,287.20	-	11,437.30	416,724.50
2. 基金赎回款	-260,878,352.64	-	-7,385,554.78	-268,263,907.42
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	175,178,311.02	-	4,392,851.10	179,571,162.12

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：

<u>赵万里</u>	<u>曹华玮</u>	<u>邵恒</u>
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）从 2019 年 4 月 2 日转型为华富安福债券型证券投资基金。华富安福保本混合型证券投资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《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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、经营成果和净资产变动等有关信息。

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重大变更。

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重大变更。

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)、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2014〕81号)、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》(财税〔2016〕127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%的征收率缴纳增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(三) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(四) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称中国结算)提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上

市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(五) 主要税种及税率列示如下：

税种	计税依据	税率
增值税	以按税法规定计算的金融服务销售额	3%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	867,649.10
等于：本金	867,407.40
加：应计利息	241.70
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	867,649.10

注：“其他存款”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	28,783,084.31	-	29,287,876.00	504,791.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	92,609,160.61	603,777.85	93,558,313.85	345,375.39
	银行间市场	143,156,609.17	1,239,793.39	145,812,793.39	1,416,390.83
	合计	235,765,769.78	1,843,571.24	239,371,107.24	1,761,766.22
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		264,548,854.09	1,843,571.24	268,658,983.24	2,266,557.91

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	220,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	220,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	63,122.01
其中：交易所市场	54,144.74
银行间市场	8,977.27
应付利息	-
应付审计费	4,972.24
中债账户维护费	4,500.00
上清账户维护费	4,800.00

合计	77,396.72
----	-----------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,651,260.42	4,651,260.42
本期申购	231,410,781.32	231,410,781.32
本期赎回（以“-”号填列）	-20,006,583.90	-20,006,583.90
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	216,055,457.84	216,055,457.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-356,489.41	349,077.16	-7,412.25
本期期初	-356,489.41	349,077.16	-7,412.25
本期利润	297,371.11	2,190,529.57	2,487,900.68
本期基金份额交易产生的变动数	-10,802,905.67	17,582,111.31	6,779,205.64
其中：基金申购款	-11,862,701.37	19,299,053.00	7,436,351.63
金赎回款	1,059,795.70	-1,716,941.69	-657,145.99
本期已分配利	-	-	-

润			
本期末	-10,862,023.97	20,121,718.04	9,259,694.07

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		7,726.81
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		7,299.36
其他		96.87
合计		15,123.04

注：“其他存款利息收入”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-381,106.36
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		-381,106.36

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		15,592,493.87
减：卖出股票成本总额		15,905,651.35
减：交易费用		67,948.88
买卖股票差价收入		-381,106.36

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,049,126.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	154,825.30
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,203,952.08

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	274,200,124.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	270,985,973.39
减：应计利息总额	3,042,986.09
减：交易费用	16,339.62
买卖债券差价收入	154,825.30

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	87,800.68
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	87,800.68

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	2,190,529.57
股票投资	502,545.69
债券投资	1,687,983.88
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,190,529.57

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	5,144.76
合计	5,144.76

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	4,972.24
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,992.43
账户维护费	18,600.00
合计	25,564.67

6.4.7.20 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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	59,362,519.86	99.32	289,988,370.67	43.01

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	259,695,320.83	98.76	274,325,015.37	63.56

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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
华安证券	1,841,945,000.00	99.79	2,915,221,000.00	49.81

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。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	58,604.28	99.48	54,144.74	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	277,191.77	43.64	14,551.21	5.62

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年
----	------------------------	----------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	329,811.15	1,092,085.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	18,202.81	96,457.12
应支付基金管理人的净管理费	311,608.34	995,628.82

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	94,231.80	312,024.55

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 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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：本基金本报告期末和上年度末基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	867,649.10	7,726.81	97,579.06	10,230.82

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 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 47,739,741.36 元，其中 36,500,000.00 元于 2024 年 07 月 01 日到期，9,002,304.68 元于 2024 年 07 月 03 日到期，2,237,436.68 元于 2024 年 07 月 04 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金管

理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的风险管理部、监察稽核部，对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	165,375,467.43	1,483,933.78
AAA 以下	10,436,576.13	2,448,458.41
未评级	-	-
合计	175,812,043.56	3,932,392.19

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 4年 6月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							

货币资金	867,649.10	-	-	-	-	-	867,649.10
结算备付金	3,648,710.74	-	-	-	-	-	-3,648,710.74
存出保证金	15,679.56	-	-	-	-	-	15,679.56
交易性金融资产	1,227,983.53	2,432,268.96	48,695,951.29	133,478,482.03	53,536,421.43	29,287,876.00	268,658,983.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	220,000.00	-	-	-	-	-	220,000.00
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	40,266.12	40,266.12

申购款							
应收清算款						1,338,797.83	1,338,797.83
其他资产							
资产总计	5,980,022.93	2,432,268.96	48,695,951.29	133,478,482.03	53,536,421.43	30,666,939.95	274,790,086.59
负债							
应付赎回款						5,443.59	5,443.59
应付管理人报酬						104,739.71	104,739.71
应付托管费						29,925.64	29,925.64
应付清算款						1,509,900.81	1,509,900.81
卖出回购金	47,739,741.36						47,739,741.36

融资产款							
应付销售服务费							
应付投资顾问费							
应付利润							
应交税费						7,786.85	7,786.85
其他负债						77,396.72	77,396.72
负债总计	47,739,741.36					1,735,193.32	49,474,934.68
利率敏感度缺口	-41,759,718.43	2,432,268.96	48,695,951.29	133,478,482.03	53,536,421.43	28,931,746.63	225,315,151.91
上年度末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2023年12月31日							
资产							
货币资金	66,520.33	-	-	-	-	-	66,520.33
结算备付金	168,515.13	-	-	-	-	-	168,515.13
存出保证金	25,399.91	-	-	-	-	-	25,399.91
交易性金融资产	343,229.40	705,378.83	3,185,353.82	-	538,062.88	302,907.00	5,074,931.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权	-	-	-	-	-	-	-

投资							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	993.63	993.63
应收清算款	-	-	-	-	-	72,072.33	72,072.33
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	603,664.77	705,378.83	3,185,353.82	-	538,062.88	375,972.96	5,408,433.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,590.11	16,590.11
应付托管费	-	-	-	-	-	4,740.02	4,740.02
应付	-	-	-	-	-	75,028.80	75,028.80

清算款							
卖出回购金融资产款	448,976.50	-	-	-	-	-	448,976.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	170.67	170.67
其他负债	-	-	-	-	-	219,078.99	219,078.99
负债总计	448,976.50	-	-	-	-	315,608.59	764,585.09
利率敏	154,688.27	705,378.83	3,185,353.82	-	538,062.88	60,364.37	4,643,848.17

感 度 缺 口							
------------------	--	--	--	--	--	--	--

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	2,581,261.37	56,476.17
	市场利率上升 25 基点	-2,519,992.36	-54,957.76

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	29,287,876.00	13.00	302,907.00	6.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	239,371,107.24	106.24	4,772,024.93	102.76

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	268,658,983.24	119.24	5,074,931.93	109.28

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升百分之五	1,273,743.05	15,865.63
	沪深 300 指数下降百分之五	-1,273,743.05	-15,865.63

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	51,299,709.86	4,235,299.19
第二层次	217,359,273.38	839,632.74
第三层次	-	-

合计	268,658,983.24	5,074,931.93
----	----------------	--------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
 本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	29,287,876.00	10.66
	其中：股票	29,287,876.00	10.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	239,371,107.24	87.11
	其中：债券	239,371,107.24	87.11
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	220,000.00	0.08
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,516,359.84	1.64
8	其他各项资产	1,394,743.51	0.51
9	合计	274,790,086.59	100.00

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

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	-	-
B	采矿业	11,231,836.00	4.98
C	制造业	18,056,040.00	8.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,287,876.00	13.00

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所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600150	中国船舶	149,700	6,094,287.00	2.70
2	601989	中国重工	1,049,300	5,173,049.00	2.30
3	600160	巨化股份	94,200	2,273,046.00	1.01
4	600482	中国动力	86,100	1,677,228.00	0.74
5	600489	中金黄金	111,300	1,647,240.00	0.73
6	601857	中国石油	158,600	1,636,752.00	0.73
7	600938	中国海油	48,700	1,607,100.00	0.71
8	603379	三美股份	38,900	1,522,546.00	0.68
9	601899	紫金矿业	84,900	1,491,693.00	0.66
10	600028	中国石化	219,900	1,389,768.00	0.62
11	600547	山东黄金	47,700	1,306,026.00	0.58
12	000975	山金国际	55,300	900,837.00	0.40
13	603993	洛阳钼业	78,500	667,250.00	0.30
14	600346	恒力石化	47,400	661,230.00	0.29

15	601600	中国铝业	85,800	654,654.00	0.29
16	601168	西部矿业	32,600	585,170.00	0.26

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	600150	中国船舶	5,919,534.00	127.47
2	601989	中国重工	5,024,631.00	108.20
3	600160	巨化股份	3,273,917.00	70.50
4	600482	中国动力	3,247,545.00	69.93
5	603379	三美股份	2,221,480.00	47.84
6	600489	中金黄金	1,616,270.00	34.80
7	601857	中国石油	1,592,070.00	34.28
8	600378	昊华科技	1,487,870.00	32.04
9	600938	中国海油	1,465,499.00	31.56
10	601899	紫金矿业	1,458,723.00	31.41
11	600547	山东黄金	1,437,068.00	30.95
12	600028	中国石化	1,378,886.00	29.69
13	605020	永和股份	1,271,859.00	27.39
14	002001	新和成	1,047,699.00	22.56
15	000589	贵州轮胎	1,044,455.00	22.49
16	000975	山金国际	951,222.00	20.48
17	601866	中远海发	803,520.00	17.30
18	000100	TCL 科技	749,868.00	16.15
19	600426	华鲁恒升	731,307.00	15.75
20	600346	恒力石化	669,648.00	14.42
21	601600	中国铝业	665,501.00	14.33
22	603993	洛阳钼业	645,764.00	13.91
23	601168	西部矿业	600,474.00	12.93
24	601100	恒立液压	552,496.00	11.90
25	601766	中国中车	481,560.00	10.37
26	600557	康缘药业	480,848.00	10.35
27	603612	索通发展	479,512.00	10.33
28	300059	东方财富	320,705.00	6.91
29	601390	中国中铁	320,451.00	6.90
30	603596	伯特利	238,993.00	5.15
31	601666	平煤股份	169,851.96	3.66

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	600482	中国动力	1,422,622.00	30.63
2	600378	昊华科技	1,407,042.00	30.30
3	600160	巨化股份	1,104,954.00	23.79
4	002001	新和成	1,081,047.00	23.28
5	000589	贵州轮胎	1,010,362.00	21.76
6	605020	永和股份	1,007,664.00	21.70
7	601866	中远海发	813,079.00	17.51
8	600426	华鲁恒升	777,130.00	16.73
9	000100	TCL 科技	723,168.00	15.57
10	603379	三美股份	552,880.00	11.91
11	603612	索通发展	517,273.00	11.14
12	601100	恒立液压	514,903.00	11.09
13	601766	中国中车	458,265.00	9.87
14	600557	康缘药业	445,834.00	9.60
15	601390	中国中铁	325,241.00	7.00
16	300059	东方财富	312,865.00	6.74
17	603596	伯特利	245,614.00	5.29
18	600150	中国船舶	224,148.00	4.83
19	601666	平煤股份	160,995.23	3.47
20	002756	永兴材料	92,183.00	1.99

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	44,388,074.66
卖出股票收入（成交）总额	15,592,493.87

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

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	11,760,846.99	5.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,953,856.69	27.50
	其中：政策性金融债	51,798,216.69	22.99

4	企业债券	71,546,479.99	31.75
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	72,098,089.71	32.00
7	可转债（可交换债）	22,011,833.86	9.77
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	239,371,107.24	106.24

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	220220	22 国开 20	200,000	21,091,928.96	9.36
2	220008	22 附息国债 08	100,000	11,760,846.99	5.22
3	102381903	23 渝富资本 MTN002(科创票据)	100,000	10,672,196.72	4.74
4	200210	20 国开 10	100,000	10,528,005.48	4.67
5	149786	22 川能 01	100,000	10,423,498.63	4.63

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行曾出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内被监

管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

7.11.3 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	15,679.56
2	应收清算款	1,338,797.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,266.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,394,743.51

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113042	上银转债	2,499,680.42	1.11
2	113065	齐鲁转债	1,537,827.85	0.68
3	113062	常银转债	1,454,781.57	0.65
4	113021	中信转债	1,369,396.60	0.61
5	110083	苏租转债	1,350,056.56	0.60
6	123132	回盛转债	1,252,459.63	0.56
7	111001	山玻转债	1,061,589.82	0.47
8	113584	家悦转债	1,006,800.41	0.45
9	113033	利群转债	936,279.52	0.42
10	110087	天业转债	914,671.91	0.41
11	127025	冀东转债	902,397.68	0.40
12	113044	大秦转债	894,772.31	0.40
13	113060	浙 22 转债	893,230.82	0.40
14	127027	能化转债	858,429.41	0.38
15	113606	荣泰转债	774,384.23	0.34
16	123184	天阳转债	707,714.77	0.31
17	127020	中金转债	691,373.56	0.31
18	113052	兴业转债	673,113.92	0.30
19	118011	银微转债	536,609.97	0.24
20	128071	合兴转债	503,402.12	0.22
21	123113	仙乐转债	496,100.00	0.22
22	123223	九典转 02	474,085.27	0.21
23	113624	正川转债	222,675.51	0.10

7.11.5 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。

7.11.6 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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
292	739,915.95	210,195,438.68	97.29	5,860,019.16	2.71

8.2 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	870,951.35	0.4031

8.3 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 4 月 2 日) 基金份额总额	35,847,544.24
本报告期期初基金份额总额	4,651,260.42
本报告期基金总申购份额	231,410,781.32
减：本报告期基金总赎回份额	20,006,583.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	216,055,457.84

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华安证券	3	59,362,519.86	99.32	58,604.28	99.48	-
国海证券	1	295,006.92	0.49	220.06	0.37	-
西南证券	2	113,533.00	0.19	84.67	0.14	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券公司	2	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
中银国际	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)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。

3)本报告期本基金退租申港证券等席位。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华安证券	259,695,320.83	98.76	1,841,945,000.00	99.79	-	-
国海证券	1,381,568.90	0.53	3,888,000.00	0.21	-	-
西南证券	1,883,228.93	0.72	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华富基金管理有限公司关于旗下基金2023年度最后一日基金份额净值及基	中国证监会指定披露媒 介	2024年1月1日

	金份额累计净值的公告		
2	华富基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 12 日
3	华富安福债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 22 日
4	华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 24 日
5	华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 15 日
6	华富安福债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 30 日
7	华富安福债券型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 2 日
8	华富安福债券型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 3 日
9	华富安福债券型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 3 日
10	华富安福债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 3 日
11	华富安福债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 20 日
12	华富安福债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 27 日

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华富安福债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富安福债券型证券投资基金托管协议》
- 3、《华富安福债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、报告期内华富安福债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日