

# 华富强化回报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

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 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              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9         |
| 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             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 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                    | 42        |
| 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      | 43        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 43        |
| 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 ..... | 43        |
| 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 .....    | 43        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 43        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 43        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 45        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 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情况 .....      | 46        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 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 .....      | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 46        |
| 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 .....                           | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>48</b> |
| 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 .....    | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 48        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 49        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 49        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 基金名称         | 华富强化回报债券型证券投资基金  |
| 基金简称         | 华富强化回报债券         |
| 场内简称         | 华富强债             |
| 基金主代码        | 164105           |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式         |
| 基金合同生效日      | 2010 年 9 月 8 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   | 384,012,479.06 份 |
| 基金合同存续期      | 不定期              |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所          |
| 上市日期         | 2010 年 10 月 11 日 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。  |
| 投资策略   | 本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素，研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险，以确定各类金融资产的配置比例。 |
| 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低风险品种，预期风险和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<br>负责人 | 姓名                                 | 林之懿                   |
|             | 联系电话                               | 021-68886996          |
|             | 电子邮箱                               | linzy@hffund.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      | 《上海证券报》               |
| 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 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## § 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       | -35,167,580.03                      |
| 本期利润          | -5,209,522.48                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0104                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.62%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.48%                               |
| 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      | 209,837,667.93                      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5464                              |
| 期末基金资产净值      | 648,862,450.41                      |
| 期末基金份额净值      | 1.690                               |
| 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   | 137.54%                             |

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

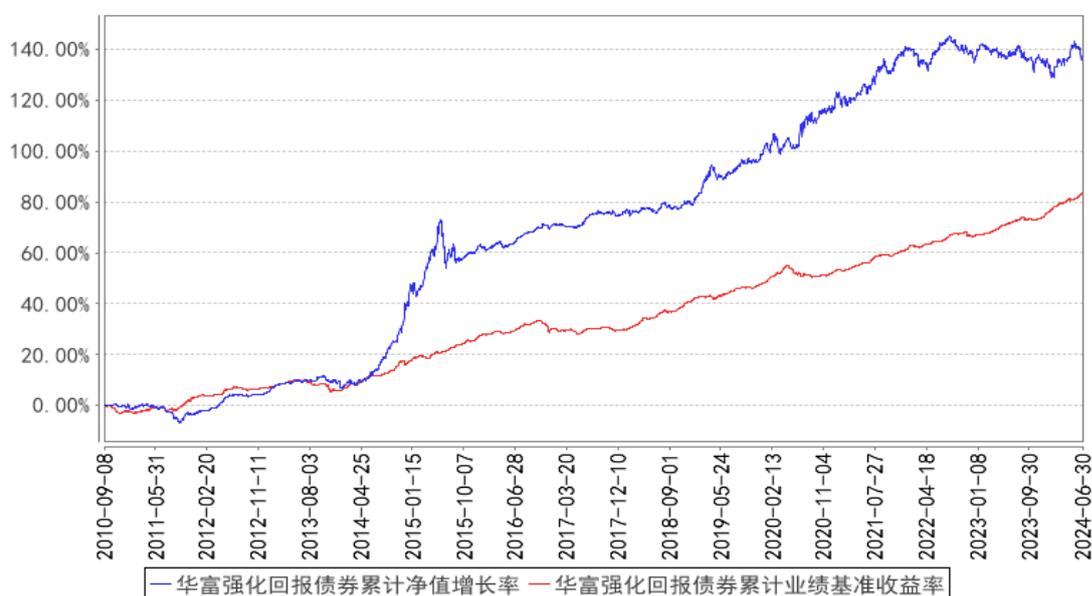
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -1.34%   | 0.34%       | 0.99%      | 0.04%         | -2.33% | 0.30% |

|            |         |       |        |       |         |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三个月      | 1.02%   | 0.29% | 1.92%  | 0.08% | -0.90%  | 0.21% |
| 过去六个月      | 0.48%   | 0.31% | 4.31%  | 0.08% | -3.83%  | 0.23% |
| 过去一年       | -0.35%  | 0.28% | 6.59%  | 0.07% | -6.94%  | 0.21% |
| 过去三年       | 5.49%   | 0.25% | 17.29% | 0.06% | -11.80% | 0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 137.54% | 0.29% | 83.29% | 0.08% | 54.25%  | 0.21% |

注：业绩比较基准收益率 = 中证全债指数

### 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

华富强化回报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：本基金建仓期为 2010 年 9 月 8 日到 2011 年 3 月 8 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《华富强化回报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 |     |  |
|-----|--|-----------|------|-----|--|
| 尹培俊 | 本基金基金经理、公司副总经理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会联席主席 | 2014年3月6日 | -    | 十九年 | 兰州大学工商管理硕士，硕士研究生学历。历任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012年7月加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用研究员、总监助理、副总监、公司总经理助理，自2014年3月6日起任华富强化回报债券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2018年8月28日起任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理，自2021年1月28日起任华富安华债券型证券投资基金基金经理，自2021年8月26日起任华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自2021年11月8日起任华富吉丰60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，自2022年6月6日起任华富安业一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自2023年7月28日起任华富荣盛一年持有期混合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。

#### 4.2 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 年上半年宏观经济运行平稳，稳中有进，实现 GDP 同比增长 5%。分季度看，一季度同比增长 5.3%，二季度同比增长 4.7%，二季度经济复苏动能有所放缓。从拉动经济的“三驾马车”看：出口依然具有韧性，根据统计局数据，上半年货物和服务净出口对经济增长的贡献率为 13.9%；投资方面，主要受到制造业拉动（固定资产投资完成额累计同比（制造业）从 2023 年底的 6.5% 升至 2024 年上半年的 9.5%），且基建投资较为稳定（固定资产投资完成额累计同比（基础建设投资）基本在 5.5%-6%），但房地产投资仍处于回落趋势；消费方面，一季度韧性较强，但二季度有所放缓，主要由于汽车消费影响，居民收入预期有待提高。

海外方面，2024 年上半年，海外经济有所放缓，通胀小幅回落。一季度，美联储维持利率不变，但是二季度开始，美国经济数据和通胀有所反复，美联储降息预期多次起伏，10Y 美债收益率在 4.2%-4.7% 的区间内震荡；其他经济体欧洲方面的降息已开启、日本央行的加息一直不及预期，叠加地缘政治局势的变化，美元指数整体波动上行。

2024 年上半年，在宏观经济缓复苏同时资金偏宽松的背景下，债券市场整体表现较好，收益率持续下行，具有代表性的十年期国债收益率从 2024 年初的 2.56% 一度降至 2.22%，三十年国债收益率从年初的 2.83% 下行至 2.5% 以内，十年以内各期限下行幅度更大。信用债方面，一方面跟随于利率债走势持续下行，另一方面，在信用债整体供给收缩需求持续增长的背景下，信用债整体表现强于利率债，各期限均呈现大幅下行趋势，且信用利差、期限利差和等级利差均持续收窄。可转债方面，上半年转债市场一波三折。年初权益市场的下跌，转债跟随调整，中证转债指数跌至 2022 年以来低点。2024 年 2-5 月，随着正股行情修复叠加流动性宽松，转债市场迎来一波修复。但随着 5 月下旬开始权益市场的回调、交易所对部分个股问询函增多，新制度下退市政策的收紧，转债评级下调事件增多等多重影响，6 月份的可转债市场又出现了快速调整，2024 年上半

年中证转债指数累计下跌 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较好，低价低等级转债表现较差。权益市场方面，上半年呈现先抑后扬然后高位震荡的格局。年初在经济基本面改善较弱同时流动性压力显现之下市场出现急速下跌，随着 2 月监管层出手维护市场流动性之后，A 股整体企稳回升，3 月开始随着经济基本面出现改善的预期以及数据的验证，以沪深 300 为代表的与总量经济相关的大盘股涨幅明显，但随后由于社融等经济数据走弱后，市场风险偏好下行，主要股指分化严重且呈现震荡整理格局，上半年沪深 300 上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%，科创 50 下跌 16.42%。

本基金在上半年保持中短久期信用债和三年左右二永债配置，虽提供稳定高收益但久期不足；股票部分保持较高仓位，在股票市场上涨阶段净值回升较快，但 5 月份开始股票和转债市场的下跌又抹去了前期的上涨。组合净值在上半年的整体表现冲高回落，不及预期。

#### 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 1.690 元，累计基金份额净值为 2.141 元。报告期，本基金份额净值增长率为 0.48%，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 年三季度，随着前期政策逐步落地，预计宏观数据或继续结构性修复。结构上，前期增发国债项目继续施工，三季度地方专项债加速发行进一步促开工，政府支出可能仍然是三季度宏观经济最重要的拉动因素之一。此外，地产“517”新政后，多地城市跟进，政策出台的节奏均快于市场预期。目前二手房销售已经出现企稳迹象，未来房地产市场有望按照二手房销售→房价→新开工→新房销售→投资的顺序逐步阶段性修复。另外，工业品价格初期回升后，有望引导部分企业利润走出困境。

海外宏观经济方面，预计通胀降温有一定进展，美债市场目前演绎 9 月降息预期明显升温，但叠加近期美国大选变数较多，市场对于资产定价的逻辑变化较大，“降息交易”、“美国贸易条件收紧推升通胀”、“地缘降温”、“美元长期走弱”、“中美贸易摩擦加剧”等多重逻辑交错，未来一段时间内全球风险资产预计呈现波动率放大的特征。

在资产配置上，由于市场对经济增长的预期仍然不足，债券市场的胜率仍在，但现阶段赔率不高，在保持基础久期和仓位的情况下，可考虑等待市场调整之后再积极配置，考虑流动性和利差水平，利率或高等级品种或优于中低等级品种。而股票市场仍然处于中长期低位区间，市场情绪逐步修复，整体估值水平很低，风险溢价水平充分。此前监管层推出暂缓 IPO 和大股东减持，严格退市制度等措施，都有助于股票市场长期供需格局的稳定，另外，新“国九条”站在投资者立场，重点提出“加大退市监管、强化分红、改善盈利质量”等要求，这都是中长期利好 A

股的制度建设。行业配置层面，目前仍相对看好低估值蓝筹、资源（油气、煤炭、有色、贵金属、交运等）、关注具有海外产能建设和扩张，以及行业竞争格局稳定、盈利回升的价值成长类品种，主题机会适当关注 AI 应用方向。可转债方面，转债的信用违约率定价处于高位区间，低价券修复策略仍有可为；截至六月末跌破债底的转债占比超 20%，远高于信用债市场违约率，违约定价水平已达到历史的极值水平，低价券定价水平较不合理；随着资金逐渐平稳，评级披露风险释放较为充分，市场筹码在恢复和重构中，理性定价会逐步回归，此外，条款博弈的机会也陆续出现。目前整体性价比较高，将以较为积极的双低增强的思路，挖掘非对称性收益机会。

本基金股票和转债仓位有所提升，整体风格偏均衡；纯债部分将继续提升票息策略强度，考虑适度拉长久期。中期而言，本基金将根据性价比进一步平衡股债配置，股票仓位仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念，寻找具有估值优势或拥有优势赛道具备长期成长性的企业。本基金仍将坚持在较低风险程度下，认真研究各个投资领域潜在的机会，相对积极地做好配置策略，均衡投资，降低业绩波动，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

#### 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》、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

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，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

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合规守信、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：华富强化回报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<br>2024 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 234,963.60                     | 2,470,471.17                     |
| 结算备付金         |            | 11,858,416.07                  | 57,213,471.64                    |
| 存出保证金         |            | 57,406.40                      | 94,504.25                        |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 746,180,051.13                 | 1,639,167,213.98                 |
| 其中：股票投资       |            | 117,020,918.43                 | 176,315,837.90                   |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 625,103,622.56                 | 1,462,851,376.08                 |
| 资产支持证券投资      |            | 4,055,510.14                   | -                                |
| 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    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | 185,938.18                     | 40,032,374.27                    |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 29,936.76                      | 117,520.99                       |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 758,546,712.14                 | 1,739,095,556.30                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> |

|             |         |                |                  |
|-------------|---------|----------------|------------------|
| <b>负债：</b>  |         |                |                  |
| 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   |         | 108,500,000.00 | 443,896,977.42   |
| 应付清算款       |         | 5,683.55       | 41,306,464.62    |
| 应付赎回款       |         | 589,194.16     | 2,019,326.55     |
| 应付管理人报酬     |         | 325,275.52     | 742,211.62       |
| 应付托管费       |         | 108,425.15     | 247,403.87       |
| 应付销售服务费     |         | -              | -                |
| 应付投资顾问费     |         | -              | -                |
| 应交税费        |         | 37,952.76      | 85,712.64        |
| 应付利润        |         | -              | -                |
| 递延所得税负债     |         | -              | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 117,730.59     | 226,907.82       |
| 负债合计        |         | 109,684,261.73 | 488,525,004.54   |
| <b>净资产：</b> |         |                |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 384,012,479.06 | 743,448,358.09   |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 264,849,971.35 | 507,122,193.67   |
| 净资产合计       |         | 648,862,450.41 | 1,250,570,551.76 |
| 负债和净资产总计    |         | 758,546,712.14 | 1,739,095,556.30 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.690 元，基金份额总额 384,012,479.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华富强化回报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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|---------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>    |         | 682,046.18                               | 55,521,935.59                                 |
| 1. 利息收入           |         | 252,377.59                               | 799,567.10                                    |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.9 | 251,588.55                               | 792,403.32                                    |
| 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        |         | 789.04                                   | 7,163.78                                      |
| 其他利息收入            |         | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |         | -29,589,478.46                           | 19,842,783.93                                 |

|                                 |            |                      |                      |
|---------------------------------|------------|----------------------|----------------------|
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.10   | -35,071,368.07       | -10,375,493.88       |
| 基金投资收益                          |            | -                    | -                    |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.11   | 3,839,845.14         | 28,266,987.10        |
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 6.4.7.12   | 42,631.78            | 127,468.16           |
| 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   | 1,599,412.69         | 1,823,822.55         |
| 其他投资收益                          |            | -                    | -                    |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）      | 6.4.7.16   | 29,958,057.55        | 34,372,887.88        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）          |            | -                    | -                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）          | 6.4.7.17   | 61,089.50            | 506,696.68           |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | <b>5,891,568.66</b>  | <b>26,812,326.86</b> |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 2,488,360.97         | 11,012,949.75        |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 829,453.65           | 3,670,983.22         |
| 3. 销售服务费                        |            | -                    | -                    |
| 4. 投资顾问费                        |            | -                    | -                    |
| 5. 利息支出                         |            | 2,419,736.60         | 11,862,901.33        |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |            | 2,419,736.60         | 11,862,901.33        |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.18   | -                    | -                    |
| 7. 税金及附加                        |            | 33,557.71            | 145,963.16           |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.19   | 120,459.73           | 119,529.40           |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |            | <b>-5,209,522.48</b> | <b>28,709,608.73</b> |
| 减：所得税费用                         |            | -                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |            | <b>-5,209,522.48</b> | <b>28,709,608.73</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后<br/>净额</b>       |            | <b>-</b>             | <b>-</b>             |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | <b>-5,209,522.48</b> | <b>28,709,608.73</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华富强化回报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 | 743,448,358.09                  | -      | 507,122,193.67 | 1,250,570,551.7 |

|  |  |        |                  |                   |
|--|--|--------|------------------|-------------------|
| 资产                                       |  |        |                  | 6                 |
| 二、本期期初净资产                                | 743,448,358.09                             | -      | 507,122,193.67   | 1,250,570,551.76  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -359,435,879.03                            | -      | -242,272,222.32  | -601,708,101.35   |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | -5,209,522.48    | -5,209,522.48     |
| (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)      | -359,435,879.03                            | -      | -237,062,699.84  | -596,498,578.87   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 32,920,327.25                              | -      | 23,088,619.75    | 56,008,947.00     |
| 2. 基金赎回款                                 | -392,356,206.28                            | -      | -260,151,319.59  | -652,507,525.87   |
| (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                                | 384,012,479.06                             | -      | 264,849,971.35   | 648,862,450.41    |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 2,815,272,135.56                           | -      | 1,939,776,462.16 | 4,755,048,597.72  |
| 二、本期期初净资产                                | 2,815,272,135.56                           | -      | 1,939,776,462.16 | 4,755,048,597.72  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -1,227,047,298.73                          | -      | -833,794,613.70  | -2,060,841,912.43 |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | 28,709,608.73    | 28,709,608.73     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数                    | -1,227,047,298.73                          | -      | -862,504,222.43  | -2,089,551,521.16 |

|  |                   |   |                  |                   |
|--|-------------------|---|------------------|-------------------|
| (净资产减少以“-”号填列)                           |                   |   |                  |                   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 147,199,909.06    | - | 104,311,628.80   | 251,511,537.86    |
| 2. 基金赎回款                                 | -1,374,247,207.79 | - | -966,815,851.23  | -2,341,063,059.02 |
| (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                                | 1,588,224,836.83  | - | 1,105,981,848.46 | 2,694,206,685.29  |

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>赵万利</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

华富强化回报债券型证券投资基金(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【2010】989号)2010年7月23日核准,基金合同于2010年9月8日生效。本基金为创新型封闭式,本基金合同生效后三年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易,基金合同生效满三年后,转为上市开放式基金(LOF)。设立时募集资金到位情况经天健正信会计师事务所审验,并出具《验资报告》(天健正信验(2010)综字第020119号)。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人为华富基金管理有限公司,基金份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。

### 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<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 234,963.60             |
| 等于：本金          | 234,706.52             |
| 加：应计利息         | 257.08                 |
| 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     | 234,963.60 |

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<br>2024年6月30日 |                |                |                |                |
|---------------|-------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
|               | 成本                | 应计利息           | 公允价值           | 公允价值变动         |                |
| 股票            | 143,148,467.05    | -              | 117,020,918.43 | -26,127,548.62 |                |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -              | -              | -              |                |
| 债券            | 交易所市场             | 417,658,198.14 | 4,042,131.26   | 408,020,011.13 | -13,680,318.27 |
|               | 银行间市场             | 211,043,940.77 | 3,557,811.43   | 217,083,611.43 | 2,481,859.23   |
|               | 合计                | 628,702,138.91 | 7,599,942.69   | 625,103,622.56 | -11,198,459.04 |
| 资产支持证券        | 4,000,000.00      | 43,910.14      | 4,055,510.14   | 11,600.00      |                |
| 基金            | -                 | -              | -              | -              |                |
| 其他            | -                 | -              | -              | -              |                |
| 合计            | 775,850,605.96    | 7,643,852.83   | 746,180,051.13 | -37,314,407.66 |                |

#### 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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 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<br>2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 162.91            |

|           |            |
|-----------|------------|
| 应付证券出借违约金 | -          |
| 应付交易费用    | 8,813.78   |
| 其中：交易所市场  | 7,071.28   |
| 银行间市场     | 1,742.50   |
| 应付利息      | -          |
| 应付审计费     | 39,781.56  |
| 中债账户维护费   | 4,500.00   |
| 应付信息披露费   | 59,672.34  |
| 上清账户维护费   | 4,800.00   |
| 合计        | 117,730.59 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 743,448,358.09             | 743,448,358.09  |
| 本期申购          | 32,920,327.25              | 32,920,327.25   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -392,356,206.28            | -392,356,206.28 |
| 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           | 384,012,479.06             | 384,012,479.06  |

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           | 440,300,952.13  | 66,821,241.54  | 507,122,193.67  |
| 本期期初           | 440,300,952.13  | 66,821,241.54  | 507,122,193.67  |
| 本期利润           | -35,167,580.03  | 29,958,057.55  | -5,209,522.48   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -195,295,704.17 | -41,766,995.67 | -237,062,699.84 |
| 其中：            | 17,817,066.75   | 5,271,553.00   | 23,088,619.75   |

|                                 |                 |                |                 |
|---------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 基金<br>申购<br>款                   |                 |                |                 |
| 金<br>赎<br>回<br>款                | -213,112,770.92 | -47,038,548.67 | -260,151,319.59 |
| 本<br>期<br>已<br>分<br>配<br>利<br>润 | -               | -              | -               |
| 本<br>期<br>末                     | 209,837,667.93  | 55,012,303.42  | 264,849,971.35  |

#### 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  | 10,023.67            |
| 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 | 240,894.51           |
| 其他        | 670.37               |
| 合计        | 251,588.55           |

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 | -35,071,368.07       |
| 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               | -35,071,368.07       |

##### 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   | 74,198,498.98        |
| 减：卖出股票成本总额 | 109,158,421.21       |

|          |                |
|----------|----------------|
| 减：交易费用   | 111,445.84     |
| 买卖股票差价收入 | -35,071,368.07 |

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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 11,069,826.24              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -7,229,981.10              |
| 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                           | 3,839,845.14               |

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<br>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   | 1,088,595,604.87           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,081,432,899.60           |
| 减：应计利息总额               | 14,373,791.77              |
| 减：交易费用                 | 18,894.60                  |
| 买卖债券差价收入               | -7,229,981.10              |

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

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入         | 42,631.78                  |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | -                          |

|                    |           |
|--------------------|-----------|
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入 | -         |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入 | -         |
| 合计                 | 42,631.78 |

**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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,599,412.69               |
| 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            | 1,599,412.69               |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 29,958,057.55              |
| 股票投资       | 20,491,340.46              |
| 债券投资       | 9,455,117.09               |
| 资产支持证券投资   | 11,600.00                  |
| 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                     | 29,958,057.55 |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 61,089.50                  |
| 合计      | 61,089.50                  |

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 39,781.56                  |
| 信息披露费   | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 2,405.83                   |
| 账户维护费   | 18,600.00                  |
| 合计      | 120,459.73                 |

#### 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、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     |

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） |
| 华安证券  | 72,452,016.98              | 97.65                   | 71,466,674.81                   | 100.00                  |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例（%） | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例（%） |
| 华安证券  | 415,413,114.30             | 46.75                   | 1,066,746,854.13                | 56.95                   |

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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                               | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                               |
|-------|----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|-------------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回<br>购<br>成交总额的比<br>例（%） | 成交金额                            | 占当期债券回<br>购<br>成交总额的比<br>例（%） |
| 华安证券  | 21,063,569,000.00          | 87.33                         | 114,155,500,000.00              | 98.25                         |

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<br>2024年1月1日至2024年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 华安证券  | 67,935.48                       | 97.63              | 5,419.43     | 76.64                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 华安证券  | 66,067.95                       | 100.00             | 16,540.00    | 100.00               |

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年<br>6月30日 |
|----------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费       | 2,488,360.97                   | 11,012,949.75                       |
| 其中：应支付销售机构的客户维护<br>费 | 540,127.14                     | 2,183,356.82                        |
| 应支付基金管理人的净管理费        | 1,948,233.83                   | 8,829,592.93                        |

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.6% 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<br>2024年1月1日至2024年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 829,453.65                     | 3,670,983.22                        |

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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>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 | 234,963.60                 | 10,023.67 | 1,548,144.75                    | 44,695.30 |

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 108,500,000.00 元，于 2024 年 07 月 01 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风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
|        |                        |                          |

|        |   |               |
|--------|---|---------------|
| A-1    | - | -             |
| A-1 以下 | - | -             |
| 未评级    | - | 10,107,391.26 |
| 合计     | - | 10,107,391.26 |

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 4,055,510.14      | -                   |
| 合计     | 4,055,510.14      | -                   |

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 9,859,967.80      | -                   |
| 合计     | 9,859,967.80      | -                   |

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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 308,502,923.51    | 1,029,687,646.05    |
| AAA 以下 | 271,325,105.22    | 358,219,375.62      |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 579,828,028.73    | 1,387,907,021.67    |

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 4,055,510.14      | -                   |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 4,055,510.14      | -                   |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 9,859,967.80      | -                   |

|        |              |   |
|--------|--------------|---|
| AAA 以下 | -            | - |
| 未评级    | -            | - |
| 合计     | 9,859,967.80 | - |

### 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<br>期<br>末<br>202<br>4<br>年<br>6<br>月<br>30<br>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     | 234,963.60    | -             | -              | -              | - | -              | 234,963.60     |
| 结算备付金    | 11,858,416.07 | -             | -              | -              | - | -              | 11,858,416.07  |
| 存出保证金    | 57,406.40     | -             | -              | -              | - | -              | 57,406.40      |
| 交易性金融资产  | 64,946,527.78 | 70,321,876.55 | 297,121,439.67 | 196,769,288.70 | - | 117,020,918.43 | 746,180,051.13 |
| 衍生金融资产   | -             | -             | -              | -              | - | -              | -              |
| 买入返售金融资产 | -             | -             | -              | -              | - | -              | -              |
| 债权投资     | -             | -             | -              | -              | - | -              | -              |
| 应收股利     | -             | -             | -              | -              | - | -              | -              |
| 应收       | -             | -             | -              | -              | - | 29,936.76      | 29,936.76      |

|         |                |               |                |                |   |                |                |
|---------|----------------|---------------|----------------|----------------|---|----------------|----------------|
| 申购款     |                |               |                |                |   |                |                |
| 应收清算款   | -              | -             | -              | -              | - | 185,938.18     | 185,938.18     |
| 其他资产    | -              | -             | -              | -              | - | -              | -              |
| 资产总计    | 77,097,313.85  | 70,321,876.55 | 297,121,439.67 | 196,769,288.70 | - | 117,236,793.37 | 758,546,712.14 |
| 负债      |                |               |                |                |   |                |                |
| 应付赎回款   | -              | -             | -              | -              | - | 589,194.16     | 589,194.16     |
| 应付管理人报酬 | -              | -             | -              | -              | - | 325,275.52     | 325,275.52     |
| 应付托管费   | -              | -             | -              | -              | - | 108,425.15     | 108,425.15     |
| 应付清算款   | -              | -             | -              | -              | - | 5,683.55       | 5,683.55       |
| 卖出回购金   | 108,500,000.00 | -             | -              | -              | - | -              | 108,500,000.00 |

|         |                |               |                |                |       |                |                |
|---------|----------------|---------------|----------------|----------------|-------|----------------|----------------|
| 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    | -              | -             | -              | -              | -     | 37,952.76      | 37,952.76      |
| 其他负债    | -              | -             | -              | -              | -     | 117,730.59     | 117,730.59     |
| 负债总计    | 108,500,000.00 | -             | -              | -              | -     | 1,184,261.73   | 109,684,261.73 |
| 利率敏感度缺口 | -31,402,686.15 | 70,321,876.55 | 297,121,439.67 | 196,769,288.70 | -     | 116,052,531.64 | 648,862,450.41 |
| 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        | 2,470,471.17  | -              | -              | -              | -             | -              | 2,470,471.17     |
| 结算备付金       | 57,213,471.64 | -              | -              | -              | -             | -              | 57,213,471.64    |
| 存出保证金       | 94,504.25     | -              | -              | -              | -             | -              | 94,504.25        |
| 交易性金融资产     | 30,175,099.62 | 138,037,188.47 | 584,958,073.67 | 699,180,888.29 | 10,500,126.03 | 176,315,837.90 | 1,639,167,213.98 |
| 衍生金融资产      | -             | -              | -              | -              | -             | -              | -                |
| 买入返售金融资产    | -             | -              | -              | -              | -             | -              | -                |
| 债           | -             | -              | -              | -              | -             | -              | -                |

|         |               |                |                |                |               |                |                  |
|---------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 股权投资    |               |                |                |                |               |                |                  |
| 应收股利    | -             | -              | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应收申购款   | -             | -              | -              | -              | -             | 117,520.99     | 117,520.99       |
| 应收清算款   | -             | -              | -              | -              | -             | 40,032,374.27  | 40,032,374.27    |
| 其他资产    | -             | -              | -              | -              | -             | -              | -                |
| 资产总计    | 89,953,546.68 | 138,037,188.47 | 584,958,073.67 | 699,180,888.29 | 10,500,126.03 | 216,465,733.16 | 1,739,095,556.30 |
| 负债      |               |                |                |                |               |                |                  |
| 应付赎回款   | -             | -              | -              | -              | -             | 2,019,326.55   | 2,019,326.55     |
| 应付管理人报酬 | -             | -              | -              | -              | -             | 742,211.62     | 742,211.62       |
| 应付托管费   | -             | -              | -              | -              | -             | 247,403.87     | 247,403.87       |
| 应       | -             | -              | -              | -              | -             | 41,306,464.    | 41,306,464.6     |

|           |                 |                |                |                |               |                |                  |
|-----------|-----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 付清算款      |                 |                |                |                |               | 62             | 2                |
| 卖出回购金融资产款 | 443,896,977.42  | -              | -              | -              | -             | -              | 443,896,977.42   |
| 应付销售服务费   | -               | -              | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付投资顾问费   | -               | -              | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付利润      | -               | -              | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应交税费      | -               | -              | -              | -              | -             | 85,712.64      | 85,712.64        |
| 其他负债      | -               | -              | -              | -              | -             | 226,907.82     | 226,907.82       |
| 负债总计      | 443,896,977.42  | -              | -              | -              | -             | 44,628,027.12  | 488,525,004.54   |
| 利率        | -353,943,430.74 | 138,037,188.47 | 584,958,073.67 | 699,180,888.29 | 10,500,126.03 | 171,837,706.04 | 1,250,570,551.76 |

|                       |  |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------|--|--|--|--|--|--|--|
| 敏<br>感<br>度<br>缺<br>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        | 2,873,180.81                | 6,832,269.60      |
|    | 市场利率上升25基点        | -2,846,884.02               | -6,742,691.48     |

#### 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债券等固定收益类资产和少量因在一级市场申购所形成的股票及因可转债转股所形成的股票等权益类资产，这里的其他价格风险主要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<br>2024年6月30日 |              | 上年度末<br>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 | 117,020,918.43    | 18.03        | 176,315,837.90      | 14.10        |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                 | -            | -                   | -            |

|               |                |        |                  |        |
|---------------|----------------|--------|------------------|--------|
| 交易性金融资产—债券投资  | 625,103,622.56 | 96.34  | 1,462,851,376.08 | 116.97 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -              | -      | -                | -      |
| 衍生金融资产—权证投资   | -              | -      | -                | -      |
| 其他            | 4,055,510.14   | 0.63   | -                | -      |
| 合计            | 746,180,051.13 | 115.00 | 1,639,167,213.98 | 131.07 |

#### 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          | 5,405,476.93                | 9,971,915.46           |
|    | 沪深 300 指数下降百分之五          | -5,405,476.93               | -9,971,915.46          |

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 355,074,290.93         | 533,611,115.52           |
| 第二层次          | 391,105,760.20         | 1,093,871,971.52         |

|      |                |                  |
|------|----------------|------------------|
| 第三层次 | -              | 11,684,126.94    |
| 合计   | 746,180,051.13 | 1,639,167,213.98 |

#### 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              | 117,020,918.43 | 15.43         |
|    | 其中：股票             | 117,020,918.43 | 15.43         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 629,159,132.70 | 82.94         |
|    | 其中：债券             | 625,103,622.56 | 82.41         |
|    | 资产支持证券            | 4,055,510.14   | 0.53          |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 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      | 12,093,379.67  | 1.59          |
| 8  | 其他各项资产            | 273,281.34     | 0.04          |
| 9  | 合计                | 758,546,712.14 | 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         | 12,864,315.80  | 1.98         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 62,069,958.79  | 9.57         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 34,474,143.84  | 5.31         |
| 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              | 7,612,500.00   | 1.17         |
| 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               | 117,020,918.43 | 18.03        |

### 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  | 600900 | 长江电力 | 1,192,052 | 34,474,143.84 | 5.31         |
| 2  | 603477 | 巨星农牧 | 448,234   | 12,864,315.80 | 1.98         |
| 3  | 300638 | 广和通  | 626,159   | 10,707,318.90 | 1.65         |
| 4  | 002706 | 良信股份 | 1,500,000 | 10,290,000.00 | 1.59         |
| 5  | 601677 | 明泰铝业 | 840,000   | 9,710,400.00  | 1.50         |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 750,000   | 7,612,500.00  | 1.17         |
| 7  | 600690 | 海尔智家 | 250,000   | 7,095,000.00  | 1.09         |
| 8  | 603225 | 新凤鸣  | 447,284   | 6,973,157.56  | 1.07         |
| 9  | 603596 | 伯特利  | 140,000   | 5,446,000.00  | 0.84         |
| 10 | 002891 | 中宠股份 | 225,000   | 4,695,750.00  | 0.72         |
| 11 | 002050 | 三花智控 | 200,000   | 3,816,000.00  | 0.59         |
| 12 | 601966 | 玲珑轮胎 | 179,109   | 3,290,232.33  | 0.51         |
| 13 | 688981 | 中芯国际 | 1,000     | 46,100.00     | 0.01         |

## 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  | 600900 | 长江电力 | 29,372,161.28 | 2.35           |

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  | 300059 | 东方财富 | 28,621,500.15 | 2.29           |
| 2  | 300580 | 贝斯特  | 10,909,615.10 | 0.87           |
| 3  | 002050 | 三花智控 | 7,512,105.04  | 0.60           |
| 4  | 300687 | 赛意信息 | 7,272,468.00  | 0.58           |
| 5  | 002706 | 良信股份 | 7,226,400.05  | 0.58           |
| 6  | 603596 | 伯特利  | 6,927,303.00  | 0.55           |
| 7  | 603939 | 益丰药房 | 5,475,871.62  | 0.44           |
| 8  | 603233 | 大参林  | 253,236.02    | 0.02           |

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 | 29,372,161.28 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 74,198,498.98 |

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      | 25,390,376.71  | 3.91         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 34,062,716.56  | 5.25         |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,025,249.32  | 1.55         |
| 4  | 企业债券      | 142,542,721.11 | 21.97        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 6  | 中期票据      | 175,194,467.88 | 27.00 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 238,053,372.50 | 36.69 |
| 8  | 同业存单      | 9,859,967.80   | 1.52  |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 625,103,622.56 | 96.34 |

### 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  | 123107    | 温氏转债             | 320,000 | 40,383,693.15 | 6.22         |
| 2  | 019709    | 23 国债 16         | 250,000 | 25,390,376.71 | 3.91         |
| 3  | 102101539 | 21 京城投<br>MTN002 | 200,000 | 21,185,387.98 | 3.27         |
| 4  | 102382296 | 23 胶州湾<br>MTN001 | 200,000 | 20,958,977.05 | 3.23         |
| 5  | 102281958 | 22 镇国投<br>MTN003 | 200,000 | 20,881,726.78 | 3.22         |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 143955 | 融惠 15 优 | 40,000 | 4,055,510.14 | 0.63         |

### 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本期未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。

### 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 | 57,406.40  |
| 2  | 应收清算款 | 185,938.18 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 29,936.76  |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 273,281.34 |

### 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  | 123107 | 温氏转债    | 40,383,693.15 | 6.22          |
| 2  | 113044 | 大秦转债    | 19,843,740.82 | 3.06          |
| 3  | 127045 | 牧原转债    | 17,752,401.37 | 2.74          |
| 4  | 113060 | 浙 22 转债 | 15,012,282.74 | 2.31          |
| 5  | 113623 | 凤 21 转债 | 12,726,431.85 | 1.96          |
| 6  | 113641 | 华友转债    | 12,074,574.63 | 1.86          |
| 7  | 123076 | 强力转债    | 10,389,719.43 | 1.60          |
| 8  | 113050 | 南银转债    | 10,032,966.58 | 1.55          |
| 9  | 127076 | 中宠转 2   | 8,986,254.77  | 1.38          |
| 10 | 110085 | 通 22 转债 | 8,461,361.10  | 1.30          |
| 11 | 127031 | 洋丰转债    | 6,525,127.12  | 1.01          |
| 12 | 123119 | 康泰转 2   | 6,353,012.33  | 0.98          |
| 13 | 113061 | 拓普转债    | 5,934,930.14  | 0.91          |
| 14 | 113633 | 科沃转债    | 5,871,076.71  | 0.90          |
| 15 | 110073 | 国投转债    | 5,411,983.56  | 0.83          |
| 16 | 113052 | 兴业转债    | 5,410,883.56  | 0.83          |
| 17 | 123109 | 昌红转债    | 5,056,486.85  | 0.78          |
| 18 | 123144 | 裕兴转债    | 4,855,091.85  | 0.75          |
| 19 | 123179 | 立高转债    | 3,577,059.45  | 0.55          |
| 20 | 127041 | 弘亚转债    | 3,141,088.60  | 0.48          |
| 21 | 123159 | 崧盛转债    | 3,072,386.85  | 0.47          |
| 22 | 123147 | 中辰转债    | 2,935,886.82  | 0.45          |
| 23 | 110082 | 宏发转债    | 2,610,877.19  | 0.40          |
| 24 | 113579 | 健友转债    | 2,590,245.65  | 0.40          |
| 25 | 110086 | 精工转债    | 2,495,735.89  | 0.38          |

|    |        |         |              |      |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 26 | 118038 | 金宏转债    | 2,230,589.59 | 0.34 |
| 27 | 113639 | 华正转债    | 2,138,155.62 | 0.33 |
| 28 | 118031 | 天 23 转债 | 2,016,728.78 | 0.31 |
| 29 | 113048 | 晶科转债    | 1,890,136.99 | 0.29 |
| 30 | 118027 | 宏图转债    | 1,543,054.79 | 0.24 |
| 31 | 128144 | 利民转债    | 1,475,164.24 | 0.23 |
| 32 | 113640 | 苏利转债    | 1,353,453.29 | 0.21 |
| 33 | 118028 | 会通转债    | 1,152,768.49 | 0.18 |
| 34 | 118039 | 煜邦转债    | 1,002,091.78 | 0.15 |
| 35 | 123133 | 佩蒂转债    | 952,578.45   | 0.15 |
| 36 | 127075 | 百川转 2   | 509,997.26   | 0.08 |

### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>例 (%) | 持有份额           | 占总份额比<br>例 (%) |
| 81,430       | 4,715.86      | 180,998,574.32 | 47.13          | 203,013,904.74 | 52.87          |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                       | 持有份额 (份)     | 占上市总份额比例 (%) |
|----|-----------------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国家电网公司东北分部企业年金计划—招商银行股份有限公司 | 4,000,000.00 | 70.40        |
| 2  | 刘万华                         | 129,000.00   | 2.27         |
| 3  | 孙靖国                         | 117,956.00   | 2.08         |
| 4  | 黄侃                          | 95,796.00    | 1.69         |
| 5  | 蒋家亮                         | 92,011.00    | 1.62         |
| 6  | 林建勇                         | 74,700.00    | 1.31         |
| 7  | 许剑虹                         | 71,100.00    | 1.25         |
| 8  | 喻金连                         | 70,223.00    | 1.24         |
| 9  | 朱红                          | 69,709.00    | 1.23         |
| 10 | 郑丽华                         | 55,500.00    | 0.98         |

注：本表所列的持有份额为持有人持有的本基金可在深圳证券交易所上市交易部分的份额。

**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 | 80,299.79 | 0.0209      |

**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<br>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                    | 0~10              |

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

|                              |                  |
|------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2010年9月8日）基<br>金份额总额 | 1,999,206,694.42 |
| 本报告期期初基金份额总额                 | 743,448,358.09   |
| 本报告期基金总申购份额                  | 32,920,327.25    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                | 392,356,206.28   |
| 本报告期基金拆分变动份额                 | -                |
| 本报告期末基金份额总额                  | 384,012,479.06   |

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 | 2      | 72,452,016.98 | 97.65            | 67,935.48 | 97.63          | -  |
| 国联证券 | 2      | 1,746,482.00  | 2.35             | 1,651.85  | 2.37           | -  |

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)本报告期本基金交易单元没有发生变化。

### 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 | 415,413,114.30 | 46.75            | 21,063,569,000.00 | 87.33              | -    | -                |
| 国联证券 | 473,156,537.58 | 53.25            | 3,057,300,000.00  | 12.67              | -    | -                |

## 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 | 中国证监会指定披露媒 | 2024年1月1日 |

|   |                                       |             |                 |
|---|---------------------------------------|-------------|-----------------|
|   | 2023 年度最后一日基金份额净值及基金份额累计净值的公告         | 介           |                 |
| 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 | 华富强化回报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 | 华富强化回报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 | 华富强化回报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 |
| 8 | 华富强化回报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     | 1              | 20240101-20240630       | 90,145,366.64 | 0.00 | 0.00 | 90,145,366.64 | 23.47    |
| 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 |
|---|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华富强化回报债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富强化回报债券型证券投资基金托管协议》

3、《华富强化回报债券型证券投资基金招募说明书》

4、报告期内华富强化回报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