

华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券
投资基金
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 1 月 1 日起至 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
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.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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.....	12
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.11 投资组合报告附注.....	37
§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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的情况	39
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	39
§9 开放式基金份额变动.....	39
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	42
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	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§12 备查文件目录.....	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	华商鸿益一年定期开放债券发起式
基金主代码	008721
交易代码	008721
基金运作方式	<p>契约型、定期开放式</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即以封闭期和开放期相结合的方式运作。</p> <p>本基金以一年为一个封闭运作周期，每个封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或每个到期开放期结束之日次日起（包括该日）至一年后的对应日的前一日（包括该日）为止，如无该对应日或该对应日为非工作日的，则顺延至下一工作日的前一日止。在每个封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回，也不上市交易。</p> <p>每个封闭期结束后第一个工作日起（包括该日），本基金进入到开放期。本基金每个开放期时长为 10 至 20 个工作日。</p>
基金合同生效日	2020 年 6 月 8 日
基金管理人	华商基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	409,998,500.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略 本基金结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。（二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。具体投资策略详见基金合同。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，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		华商基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高敏	朱巍
	联系电话	010-58573600	0571-87659806
	电子邮箱	gaom@hsfund.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		4007008880	95527
传真		010-58573520	0571-88268688
注册地址		北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	杭州市延安路 368 号
邮政编码		100035	310006
法定代表人		陈牧原	沈仁康

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.hsfund.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	华商基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层

§ 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(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,030,327.50
本期利润	1,659,676.80
加权平均基金份额本期利润	0.0084
本期加权平均净值利润率	0.82%
本期基金份额净值增长率	0.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-10,698,173.23
期末可供分配基金份额利润	-0.0261

期末基金资产净值	410,182,161.91
期末基金份额净值	1.0004
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.48%

注：1. 上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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 对期末可供分配利润，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余额的孰低数。

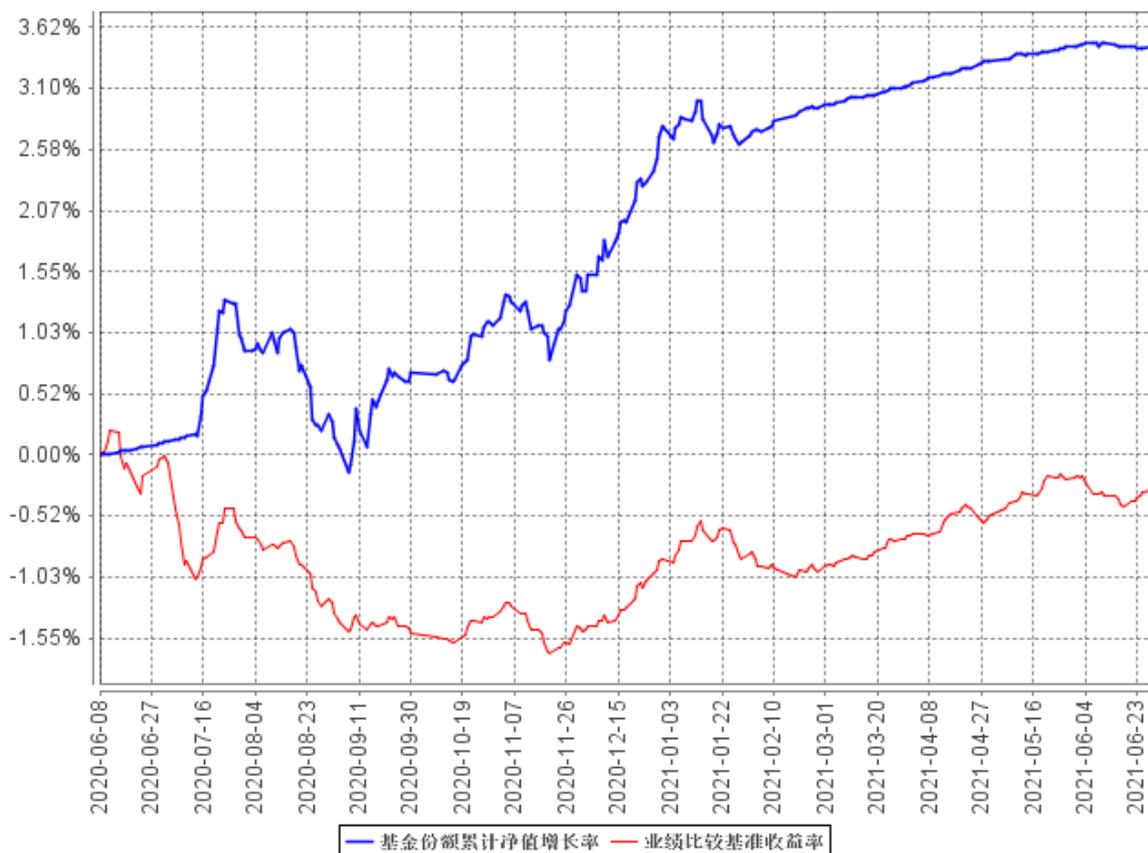
3.2 基金净值表现

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	0.02%	0.01%	-0.04%	0.03%	0.06%	-0.02%
过去三个月	0.35%	0.01%	0.45%	0.03%	-0.10%	-0.02%
过去六个月	0.68%	0.03%	0.65%	0.04%	0.03%	-0.01%
过去一年	3.38%	0.08%	-0.20%	0.06%	3.58%	0.02%
自基金合同生效起至今	3.48%	0.08%	-0.24%	0.06%	3.72%	0.02%

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

基金份额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本基金合同生效日为 2020 年 6 月 8 日。

②根据《华商鸿益一年定期开放债券型发起式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债券（包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：债券的比例不低于基金资产的 80%；但在本基金开放期开始前 1 个月、开放期结束后的 1 个月内以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华商基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]160 号文批准设立，于 2005 年 12 月 20 日成立，注册资本为 1 亿元人民币，注册地北京。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理六十一只基金产品，分别为华商领先企业混合型开放式证券投资基金、华商盛世成长混合型证券投资基金、华商收益增强债券型证券投资基金、华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华商产业升级混合型证券投资基金、华商稳健双利债券型证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华商稳定增利债券型证券投资基金、华商价值精选混合型证券投资基金、华商主题精选混合型证券投资基金、华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华商现金增利货币市场基金、华商价值共享灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金、华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金、华商优势行业灵活配置混合型证券投资基金、华商双债丰利债券型证券投资基金、华商创新成长灵活配置混合型发起式证券投资基金、华商新量化灵活配置混合型证券投资基金、华商新锐产业灵活配置混合型证券投资基金、华商未来主题混合型证券投资基金、华商健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金、华商双翼平衡混合型证券投资基金、华商新常态灵活配置混合型证券投资基金、华商信用增强债券型证券投资基金、华商双驱优选灵活配置混合型证券投资基金、华商新动力混合型证券投资基金、华商智能生活灵活配置混合型证券投资基金、华商乐享互联灵活配置混合型证券投资基金、华商新兴活力灵活配置混合型证券投资基金、华商万众创新灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞鑫定期开放债券型证券投资基金、华商丰利增强定期开放债券型证券投资基金、华商润丰灵活配置混合型证券投资基金、华商元亨灵活配置混合型证券投资基金、华商瑞丰短债债券型证券投资基金、华商研究精选灵活配置混合型证券投资基金、华商鑫安灵活配置混合型证券投资基金、华商可转债债券型证券投资基金、华商上游产业股票型证券投资基金、华商改革创新股票型证券投资基金、华商消费行业股票型证券投资基金、华商电子行业量化股票型发起式证券投资基金、华商计算机行业量化股票型发起式证券投资基金、华商高端装备制造股票型证券投资基金、华商医药医疗行业股票型证券投资基金、华商恒益稳健混合型证券投资基金、华商科技创新混合型证券投资基金、华商龙头优势混合型证券投资基金、华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华商鸿畅 39 个月定期开放利率债债券型证券投资基金、华商转债精选债券型证券投资基金、华商量化优

质精选混合型证券投资基金、华商双擎领航混合型证券投资基金、华商景气优选混合型证券投资基金、华商甄选回报混合型证券投资基金、华商鸿盈 87 个月定期开放债券型证券投资基金、华商均衡成长混合型证券投资基金、华商嘉悦平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华商远见价值混合型证券投资基金。

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		
胡中原	基金经理，公司公募业务固收投资决策委员会委员	2020 年 6 月 8 日	-	6.9	男，中国籍，工程硕士，具有基金从业资格。2014 年 7 月加入华商基金管理有限公司，曾任证券交易部债券交易员；2018 年 1 月转入投资管理部，2018 年 1 月 2 日至 2019 年 12 月 19 日担任华商现金增利货币市场基金的基金经理助理；2018 年 9 月转入固定收益部；2019 年 3 月 19 日起至今担任华商润丰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 5 月 10 日起至今担任华商元亨灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 6 月 5 日起至今担任华商瑞丰短债债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 20 日起至今担任华商现金增利货币市场基金的基金经理；2020 年 3 月 10 日至 2020 年 8 月 5 日担任华商稳固添利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 8 日起至今担任华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 19 日起至今担任华商双翼平衡混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 9 月 25 日起

					至今担任华商鸿畅 39 个月定期开放利率债债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 1 月 20 日起至今担任华商鸿盈 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影

响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

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

上半年我国外贸保持强劲，通胀压力上行与偏弱的社融数据相叠加，工业、投资和消费同比数据冲高后下行，复合同比增速来看工业依然强劲，投资持续改善，消费仍待进一步修复，经济展现较强韧性，同时必须承认经济恢复不均衡、基础不稳固，消费距离疫情前仍有距离，经济尚无过热风险，在此基础上央行稳健的货币政策更加灵活适度，保持流动性合理充裕。DR007 围绕政策利率 2.20%窄幅波动，债券市场收益率在经历 1 月下旬的上行调整之后，随后在 2 月中旬后逐步下行，债券市场上半年整体偏强运行。2021 年上半年采取适度久期利率债投资策略，规避信用风险，实现了稳健的业绩回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金份额净值为 1.0004 元，份额累计净值为 1.0348 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.68%，同期基金业绩比较基准的收益率为 0.65%，基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率 0.03 个百分点。

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 2021 年下半年，经济韧性较强，通胀压力在基数抬升下逐步减弱，央行稳健的货币政策要灵活精准、合理适度，保持货币供应量和社会融资规模增速同名义经济增速基本匹配，保持宏观杠杆率基本稳定，货币市场工具收益率大概率维持稳定；同时债券尤其国债和地方债上半年发行节奏相对较慢，下半年发行加快供给增加，资金由银行间市场短暂流入财政体系将会对特定时点流动性产生冲击，相较上半年 2021 年下半年债券市场收益率波动可能增大。本基金将继续以利率债投资为主，力争为投资者提供稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、定期审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值小组成员包括总经理、督察长、分管基金运营部的高管、分管投研部门的高管、固定收益部负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人、风险控制部负责人或上述部门负责人指定人员，由总经理任估值小组负责人，由基金运营部负责人任估值小组秘书。估值小组关于调整投资品种估值方法的决策，需经 1/2 以上的小组成员同意。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，当对估值原则及技术有异议时，本基金托管人有义务要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。会计师事务所在对基金年度财务报告出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易的债券品种的估值数据，以及流通受限股票的流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。本报告期内收益分配情况如下：

本基金以截至 2021 年 5 月 27 日基金可分配收益 7,227,003.22 元为基准，以 2021 年 6 月 3 日为权益登记日、除息日，于 2021 年 6 月 7 日向本基金的基金持有人派发第一次分红，每 10 份基金份额派发红利 0.3440 元。

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定，开放式基金的基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。发起式基金在基金合同生效三年后继续存续的，依

照前款规定执行。

本基金为发起式基金，截至本报告期末基金合同生效未满三年。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金的管理人——华商基金管理有限公司在华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 7,224,326.80 元，符合基金合同的规定。

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

本托管人依法对华商基金管理有限公司编制和披露的华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,333,931.23	1,379,661.84
结算备付金		155,014.05	-
存出保证金		792.95	929.86
交易性金融资产	6.4.7.2	237,494,000.00	286,985,952.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		237,494,000.00	286,985,952.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	159,917,839.88	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,431,731.80	3,724,713.74
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		410,333,309.91	292,091,257.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		-	75,999,766.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,529.11	54,383.10
应付托管费		11,843.02	18,127.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,215.72	10,038.98
应交税费		-	-
应付利息		-	16,391.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,560.15	134,734.00
负债合计		151,148.00	76,233,441.03
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	409,998,500.00	210,009,500.00
未分配利润	6.4.7.10	183,661.91	5,848,316.41
所有者权益合计		410,182,161.91	215,857,816.41
负债和所有者权益总计		410,333,309.91	292,091,257.44

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0004 元，基金份额总额 409,998,500.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 6 月 8 日(基金 合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,248,680.70	265,287.77
1.利息收入		3,225,686.40	265,287.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	39,081.28	12,488.53
债券利息收入		2,961,694.74	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		224,910.38	252,799.24
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,393,645.00	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,393,645.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,370,650.70	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		589,003.90	65,358.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	304,146.94	37,885.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	101,382.28	12,628.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	7,564.73	-
5. 利息支出		69,649.80	-
其中：卖出回购金融资产支出		69,649.80	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	106,260.15	14,844.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,659,676.80	199,929.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,659,676.80	199,929.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	210,009,500.00	5,848,316.41	215,857,816.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,659,676.80	1,659,676.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	199,989,000.00	-100,004.50	199,888,995.50
其中：1.基金申购款	399,998,000.00	-	399,998,000.00
2.基金赎回款	-200,009,000.00	-100,004.50	-200,109,004.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-7,224,326.80	-7,224,326.80
五、期末所有者权益(基金净值)	409,998,500.00	183,661.91	410,182,161.91
项目	上年度可比期间 2020 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	210,009,500.00	-	210,009,500.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	199,929.50	199,929.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	210,009,500.00	199,929.50	210,209,429.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.3 财务报表由下列负责人签署：

<u> 王小刚 </u>	<u> 程蕾 </u>	<u> 程蕾 </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

华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]2720号《关于准予华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由华商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集209,998,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0469号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2020年6月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,009,500.00份基金份额,其中认购资金利息折合11,500.00份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,500.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

本基金以一年为一个封闭运作周期,每个封闭期为自基金合同生效日起(包括基金合同生效之日)或每个到期开放期结束之日次日起(包括该日)至一年后的对应日的前一日(包括该日)为止,如无该对应日或该对应日为非工作日的,则顺延至下一工作日的前一日止。本基金在每个封闭期结束后第一个工作日起(包括该日)进入到期开放期。本基金的每个开放期时长为10至20个工作日。开放期的具体期间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、货币市场工具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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不直接投资股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或

监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，但在本基金开放期前 1 个月、开放期结束后的 1 个月内以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开

营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	9,333,931.23
定期存款	-
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	-
合计：	9,333,931.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,332,658.70	9,332,000.00
	银行间市场	228,126,860.00	228,162,000.00
	合计	237,459,518.70	237,494,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	237,459,518.70	237,494,000.00	34,481.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	159,917,839.88	-
合计	159,917,839.88	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	375.04
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	69.80
应收债券利息	3,343,060.93
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	60,225.75
应收申购款利息	27,999.88
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.40
合计	3,431,731.80

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	5,215.72
合计	5,215.72

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	98,560.15
应付其他	-
合计	98,560.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,009,500.00	210,009,500.00
本期申购	399,998,000.00	399,998,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-200,009,000.00	-200,009,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	409,998,500.00	409,998,500.00

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,443,184.41	2,405,132.00	5,848,316.41
本期利润	4,030,327.50	-2,370,650.70	1,659,676.80
本期基金份额交易产生的变动数	-10,947,358.34	10,847,353.84	-100,004.50
其中：基金申购款	-10,582,124.25	10,582,124.25	-
基金赎回款	-365,234.09	265,229.59	-100,004.50
本期已分配利润	-7,224,326.80	-	-7,224,326.80
本期末	-10,698,173.23	10,881,835.14	183,661.91

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	10,322.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	27,999.88
结算备付金利息收入	755.93
其他	2.75
合计	39,081.28

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内未发生股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,393,645.00
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	1,393,645.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	556,886,438.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	544,626,860.00
减：应收利息总额	10,865,933.52
买卖债券差价收入	1,393,645.00

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未发生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未发生衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内未发生股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,370,650.70
——股票投资	-
——债券投资	-2,370,650.70
——资产支持证券投资	-
——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	-2,370,650.70

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内未发生其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	14.73
银行间市场交易费用	7,550.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	7,564.73

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	17,000.00
合计	106,260.15

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
华商基金管理有限公司（“华商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人、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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均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

本基金本报告期及上年度可比期间内均未有应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年6月8日(基金合同生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	304,146.94	37,885.36
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年6月8日(基金合同生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	101,382.28	12,628.45

注：支付基金托管人浙商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

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

单位：人民币元

本期						
2021年1月1日至2021年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浙商银行	-	30,045,960.00	-	-	-	-
上年度可比期间						
2020年6月8日(基金合同生效日)至2020年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浙商银行	-	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年6月8日(基金合同生效日)至2020年6月30日
基金合同生效日(2020年6月8日)持有的基金份额	10,000,500.00	10,000,500.00
报告期初持有的基金份额	10,000,500.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,500.00	10,000,500.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.4392%	4.7619%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2021年6月30日		2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
浙商银行	-	-	200,009,000.00	95.2381%

注：浙商银行投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 6 月 8 日 (基金合同生效日) 至 2020 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
浙商银行	9,333,931.23	10,322.72	1,136,977.63	12,488.53

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券的买卖。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 6 月 3 日	-	2021 年 6 月 3 日	0.3440	7,224,326.80	-	7,224,326.80	
合计	-	-	-	0.3440	7,224,326.80	-	7,224,326.80	

6.4.12 期末（2021 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

本基金本期末无因认购新发/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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告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

本基金为债券型证券投资基金，在证券投资基金中属于较低风险的品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金投资的金融工具主要为包括债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1)第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2)第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理小组、投资决策委员会、监察稽核部和风险控制部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理小组对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部和风险控制部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3)第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浙商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 18.95%(2020 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%，于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流动暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,333,931.23	-	-	-	9,333,931.23
结算备付金	155,014.05	-	-	-	155,014.05
存出保证金	792.95	-	-	-	792.95
交易性金融资产	177,194,000.00	60,300,000.00	-	-	237,494,000.00
买入返售金融资产	159,917,839.88	-	-	-	159,917,839.88
应收利息	-	-	-	3,431,731.80	3,431,731.80
资产总计	346,601,578.11	60,300,000.00	-	3,431,731.80	410,333,309.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	35,529.11	35,529.11
应付托管费	-	-	-	11,843.02	11,843.02
应付交易费用	-	-	-	5,215.72	5,215.72
其他负债	-	-	-	98,560.15	98,560.15
负债总计	-	-	-	151,148.00	151,148.00
利率敏感度缺口	346,601,578.11	60,300,000.00	-	3,280,583.80	410,182,161.91
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,379,661.84	-	-	-	1,379,661.84
存出保证金	929.86	-	-	-	929.86
交易性金融资产	-	286,985,952.00	-	-	286,985,952.00
应收利息	-	-	-	3,724,713.74	3,724,713.74
资产总计	1,380,591.70	286,985,952.00	-	3,724,713.74	292,091,257.44
负债					
卖出回购金融资产款	75,999,766.00	-	-	-	75,999,766.00
应付管理人报酬	-	-	-	54,383.10	54,383.10
应付托管费	-	-	-	18,127.71	18,127.71
应付交易费用	-	-	-	10,038.98	10,038.98
应付利息	-	-	-	16,391.24	16,391.24
其他负债	-	-	-	134,734.00	134,734.00
负债总计	75,999,766.00	-	-	233,675.03	76,233,441.03
利率敏感度缺口	-74,619,174.30	286,985,952.00	-	3,491,038.71	215,857,816.41

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-842, 588. 46	-2, 409, 096. 34
2. 市场利率下降 25 个基点	850, 260. 91	2, 435, 571. 29	

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市场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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 237, 494, 000. 00 元，无属于第一或第三层次的余额。（2020 年 12 月 31 日：第二层次 286, 985, 952. 00 元，无第一或第三层次）。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	237,494,000.00	57.88
	其中：债券	237,494,000.00	57.88
	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	159,917,839.88	38.97
	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	9,488,945.28	2.31
8	其他各项资产	3,432,524.75	0.84
9	合计	410,333,309.91	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期内未有股票投资。

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

本基金本报告期内未有股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未发生股票投资收益。

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	9,332,000.00	2.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	150,416,000.00	36.67
	其中：政策性金融债	150,416,000.00	36.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	77,746,000.00	18.95
9	其他	-	-
10	合计	237,494,000.00	57.90

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	210201	21 国开 01	700,000	70,042,000.00	17.08
2	200212	20 国开 12	600,000	60,300,000.00	14.70
3	112106149	21 交通银行 CD149	300,000	29,154,000.00	7.11
3	112117110	21 光大银行 CD110	300,000	29,154,000.00	7.11
4	190202	19 国开 02	200,000	20,074,000.00	4.89
5	112103065	21 农业银行 CD065	200,000	19,438,000.00	4.74

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

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

本基金本报告期末投资贵金属投资。

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

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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

21 光大银行 CD110

2020 年 8 月 25 日，光大银行因为涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局罚款，警告，没收违法所得；2020 年 10 月 20 日，光大银行因涉嫌违反法律法规等原因被国家外汇管理局罚款；2020 年 11 月 6 日，银行间交易商协会针对“永煤债违约事件”开展自律调查，作为债务融资工具主承销商，在相关债务融资工具的簿记建档过程中未妥善保存工作底稿，未就簿记建档工作建立有效的内部监督制度，违反了银行间市场相关自律管理规则，被交易商协会谈话并责令整改；2020 年 11 月 19 日，作为永煤债券的承销商，光大银行存在涉嫌违法银行间债券市场自律管理规则的行为，被交易商协会启动自律调查；2021 年 1 月 15 日，银行间交易商协会公布自律处分信息，一是光大银行未对永煤控股独立性开展进一步核查并在尽职调查报告中体现，未能充分保证尽职调查质量；二是永煤控股 DFI 项目尽职调查工作开展不规范。交易商协会对其予以诫勉谈话，并责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改；2021 年 2 月 3 号，光大银行因为违规经营，被银保监会责令改正。

21 国开 01、20 国开 12、19 国开 02

2020 年 12 月 25 日，国开行因涉及 24 项违规，被银保监会罚款 4880 万元。

21 农业银行 CD065

2020 年 7 月 13 日，农业银行因为内部制度不完善，涉嫌违反法律法规，违规经营，未依法履行职责等，被银保监会罚款和没收违法所得 5315.6 万元；2020 年 12 月 7 日，农业银行因违规经营被银保监会罚款和没收违法所得 198.36 万元；2021 年 1 月 19 号，农业银行因为涉嫌违反法律法规，被银保监会罚款 420 万元；2021 年 6 月 21 号，农业银行被央行监管谈话。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股票。

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	792.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,431,731.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,432,524.75

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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
3	136,666,166.67	409,998,500.00	100.00%	0.00	0.00%

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	0.00	0.0000%

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的情况

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,000,500.00	2.44	10,000,500.00	2.44	三年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,500.00	2.44	10,000,500.00	2.44	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年6月8日）基金份额总额	210,009,500.00
本报告期期初基金份额总额	210,009,500.00
本报告期基金总申购份额	399,998,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	200,009,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	409,998,500.00

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自 2020 年 6 月 8 日（基金合同生效日）起至今为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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	
东吴证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

- ① 证券经营机构财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进。
- ② 证券经营机构具有较强的研究能力：有较强的研究分析能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务。

③ 证券经营机构能提供最优惠合理的佣金率：与其他证券经营机构相比，该证券经营机构能够提供最优惠、最合理的佣金率。

(2) 选择程序

- ①基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券交易单元的证券经营机构；
- ②基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券交易单元租用协议。

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
东吴证券	14,504,613.70	100.00%	202,000,000.00	100.00%	-	-

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	华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 22 日
2	华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第四季度报告提示性公告	证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 1 月 22 日
3	华商基金管理有限公司关于开展网上直销系统定投费率优惠的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 2 月 3 日
4	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 9 日
5	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 23 日
6	华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 23 日
7	华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新)	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 23 日
8	华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 23 日
9	华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 23 日

10	华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 3 月 31 日
11	华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
12	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 4 月 22 日
13	华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 22 日
14	华商基金管理有限公司关于华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金第一次开放申购、赎回、转换业务公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报	2021 年 6 月 1 日
15	华商基金管理有限公司关于华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年第一次分红公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报	2021 年 6 月 2 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	2021-06-09 至 2021-06-23	10,000,500.00	0.00	0.00	10,000,500.00	2.44%
	2	2021-01-01 至 2021-06-08	200,009,000.00	0.00	200,009,000.00	0.00	0.00%
	3	2021-06-24 至 2021-06-30	0.00	199,999,000.00	0.00	199,999,000.00	48.78%
	4	2021-06-25 至 2021-06-30	0.00	199,999,000.00	0.00	199,999,000.00	48.78%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%及以上的情况，由于持有人相对集中，本基金可能面临基金净值大幅波动的风险、延迟或暂停赎回的风险，且根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定本基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的风险。

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. 中国证监会批准华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；
2. 《华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 《华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 报告期内华商鸿益一年定期开放债券型发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

除基金合同和托管协议存放于基金管理人、基金托管人处外，其余文件存放于基金管理人处。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010-58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日