华宸未来稳健添利债券型证券投资基金
2020年中期报告

2020年6月30日

基金管理人：华宸未来基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020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及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金由华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金变更注册而来。2018 年 7 月 30 日至 2018 年 8 月 21 日期间，华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金召开基金份额持有人大会，基金份额持有人大会计票日期为 2018 年 8 月 22 日。会议审议通过了《关于华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金变更的议案》，内容包括华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金调整基金投资范围、投资策略、投资限制、基金费用、估值方法、增设收取销售服务费的 C 类份额，并根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规修订基金合同等，同意将“华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金”更名为“华宸未来稳健添利债券型证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决之日起生效。自 2018 年 8 月 24 日起，《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》生效，《华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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.....6

2.1 基金基本情况.....6

2.2 基金产品说明.....6

2.3 基金管理人和基金托管人.....7

2.4 信息披露方式.....7

2.5 其他相关资料.....7

§3 主要财务指标和基金净值表现.....9

3.1 主要会计数据和财务指标.....9

3.2 基金净值表现.....9

3.3 其他指标.....12

§4 管理人报告.....13

4.1 基金管理人及基金经理情况.....13

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....14

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....14

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.....14

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....14

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....15

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....15

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.....15

§5 托管人报告.....16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....16

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.....16

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.....16

§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....17

6.1 资产负债表.....17

6.2 利润表.....18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....19
6.4 报表附注.....20
§7 投资组合报告.....48
7.1 期末基金资产组合情况.....48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....48
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.....48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....49
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.....49
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.....49
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.....49
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.....49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....49
7.11 投资组合报告附注.....50
§8 基金份额持有人信息.....51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....51
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.....51
§9 开放式基金份额变动.....53
§10 重大事件揭示.....54
10.1 基金份额持有人大会决议.....54
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.....54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....54
10.4 基金投资策略的改变.....54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....54
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.....54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....54
10.8 其他重大事件.....55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....57
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.....57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....57

§12 备查文件目录.....58

12.1 备查文件目录.....58

12.2 存放地点.....58

12.3 查阅方式.....58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金	
基金简称	华宸稳健债券	
场内简称	-	
基金主代码	000104	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 24 日	
基金管理人	华宸未来基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	58,050,967.86 份	
基金合同存续期	-	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称：	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码：	000104	006258
报告期末下属分级基金的份额总额	1,476,236.79 份	56,574,731.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	资产配置策略。本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政政策、货币政策、宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的方法，在研究分析信用风险、流动性风险、收益率水平、市场环境等因素基础上，自下而上的精选投资品种。 普通债券投资策略。本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。 可转换债券投资策略。可转换债券不同于一般的公司债券，该债券赋予投资者在一定条件下将可转换债券转换成股票的权利，投资者可能还具有回售等其他权利，因此从这方面看可转换债券的理论价值应等于普通债券的基础价值和可转换债券自身内含的期权价值之和。本基金在合理地给出可转换债券估值的基础上，尽量有效地挖掘出投资价值较高的可转换债券。 回购套利策略。本基金重要的操作策略之一，把信用产品投资和回购交易结合起来，管理人根据信用产品的特征，在信用风险和流动性风险可控的前提下，或者通过回购融资来获得超额收益，或者通过回购的不断滚动来获取信用债收

	益率和资金成本的利差。 资产支持证券投资策略。本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。	
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，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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		华宸未来基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋小龙	郭明
	联系电话	021-26066866	010-66105799
	电子邮箱	songxl@hcmiraefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009200699	95588
传真		021-65870287	010-66105798
注册地址		上海市虹口区四川北路 859 号中信广场 1608 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市虹口区四川北路 859 号中信广场 1608 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200085	100140
法定代表人		赵澍堂	陈四清

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.hcmirae.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、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	华宸未来基金管理有限公司	上海市虹口区四川北路 859 号中信广场 1608 室
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	43,241.53	1,512,107.06
本期利润	22,082.55	831,952.16
加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0118
本期加权平均净值利润率	1.05%	1.04%
本期基金份额净值增长率	1.06%	0.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	185,114.26	7,184,938.66
期末可供分配基金份额利润	0.1254	0.1270
期末基金资产净值	1,661,351.05	64,224,196.57
期末基金份额净值	1.1254	1.1352
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	6.17%	13.52%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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、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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的"期末"均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宸稳健债券 A

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①－③	②－④

	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-0.60%	0.09%	-0.94%	0.12%	0.34%	-0.03%
过去三个月	-0.56%	0.08%	-1.04%	0.12%	0.48%	-0.04%
过去六个月	1.06%	0.09%	0.79%	0.11%	0.27%	-0.02%
过去一年	3.54%	0.08%	1.87%	0.08%	1.67%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.17%	0.09%	4.26%	0.07%	1.91%	0.02%

华宸稳健债券 C

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	-0.67%	0.09%	-0.94%	0.12%	0.27%	-0.03%
过去三个月	-0.67%	0.08%	-1.04%	0.12%	0.37%	-0.04%
过去六个月	0.87%	0.09%	0.79%	0.11%	0.08%	-0.02%
过去一年	3.23%	0.08%	1.87%	0.08%	1.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	13.52%	0.36%	4.26%	0.07%	9.26%	0.29%

注：转型后的合同生效日：2018 年 8 月 24 日 。

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

A级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、本基金业绩比较基准为中债综合全价指数；

2、本基金转型日期为 2018 年 8 月 24 日。截至本报告期末，本基金转型后基金合同生效已满一年。

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末建仓期已结束。

3.3 其他指标

§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

华宸未来基金管理有限公司是经证监许可[2012]370 号文批准于 2012 年 6 月 20 日成立。截至本报告期末，公司股东由华宸信托有限责任公司、韩国未来资产基金管理公司、咸阳长涛电子科技有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司注册资本 2 亿元人民币。公司秉承“规范创造价值，创新推动成长”的经营理念，贯彻投资人利益优先原则，树立长期价值投资理念，专心致力于细分市场的经营战略，从公司品牌、运行机制、企业文化和团队建设等方面构筑公司核心竞争力，努力做到“沉得下来不浮躁，专得下去不浮浅”，将公司打造成为受尊重的资产管理人。

截至本报告期末，本基金管理人管理 2 只开放式基金：华宸未来稳健添利债券型证券投资基金、华宸未来价值先锋混合型发起式证券投资基金。

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		
应晓立	本基金基金经理	2018 年 8 月 24 日	-	10	2010 年 1 月至 2011 年 12 月 30 日在中信期货公司交易部任交易员，2012 年 1 月至 2013 年 1 月以及 2014 年 3 月至 2015 年 6 月在上海归富投资管理有限公司研究部任资深研究员及研究总监，2013 年 1 月至 2014 年 2 月在上海紫石投资有限公司任行业研究员及专户基金经理，2015 年 7 月加入华宸未来基金管理有限公司投研部担任行业研究员。 2016 年 2 月 2 日起任华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 8 月 24 日起担任华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

在本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易的情形，未发生所有投资组合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。

本报告期内，基金管理人未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2020 年上半年，债券市场大幅波动，稳健添利债券基金在采取灵活久期策略对利率债进行配置的同时对信用风险可控的信用债进行了持仓优化，以此为投资人创造了稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华宸稳健债券 A 基金份额净值为 1.1254 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.06%；截至本报告期末华宸稳健债券 C 基金份额净值为 1.1352 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.87%；同期业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年突如其来的新冠疫情给中国的宏观经济蒙上了一层阴影，但在党和政府的领导下，中国迅速控制住了疫情，并有序组织复工复产，使得宏观经济快速复苏，展望下半年，预计

宏观经济持续向好的趋势不变，但中美关系的反复仍需关注。

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，本基金管理人严格按照本公司制订的《基金会计制度》、《基金会计管理制度》、《证券投资基金估值制度》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的会计准则、业务指引、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，由总经理、督察长、基金事务部负责人、研究发展部负责人、投资部门负责人、产品管理部负责人、风险管理部负责人、监察稽核部负责人、信息技术部负责人等相关专业人士组成。估值委员会专门负责基金估值工作，直接向公司管理层负责，在确定公司旗下基金的估值方法、估值模型选择、估值模型假设及估值政策和程序的建立等方面为公司管理层提供参考意见，为业务部门的操作提供指导意见并对执行情况进行监督。在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

注：本报告期内，本基金未进行利润分配。

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 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，不存在连续 20 个工作日基金份额持有人数不满 200 人的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华宸未来稳健添利债券型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，不存在任何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，华宸未来稳健添利债券型证券投资基金的管理人—华宸未来基金管理有限公司在华宸未来稳健添利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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，华宸未来稳健添利债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华宸未来基金管理有限公司编制和披露的华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2020 年半年度报告中财务指标、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核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

报告截止日： 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,534,126.36	30,583,784.52
结算备付金		511,432.67	405,800.73
存出保证金		13,288.55	16,953.24
交易性金融资产	6.4.7.2	61,884,374.90	121,085,857.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		61,884,374.90	121,085,857.20
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	1,500,000.00	11,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,143,279.62	2,478,754.72
应收股利		-	-
应收申购款		400.00	10,440,400.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		66,586,902.10	176,011,550.41
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		57,975.25	26,580,500.67
应付赎回款		861.31	318,662.54
应付管理人报酬		22,305.28	26,862.97
应付托管费		11,152.63	13,431.49
应付销售服务费		16,286.40	19,583.96
应付交易费用	6.4.7.7	11,793.53	50,323.33
应交税费		503,903.08	502,625.11

应付利息		-	-846.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	77,077.00	35,210.56
负债合计		701,354.48	27,546,354.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	58,050,967.86	131,941,714.53
未分配利润	6.4.7.10	7,834,579.76	16,523,481.82
所有者权益合计		65,885,547.62	148,465,196.35
负债和所有者权益总计		66,586,902.10	176,011,550.41

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1350 元，基金份额总额 58,050,967.86 份，其中华宸稳健债券 A 基金份额净值 1.1254 元，份额总额 1,476,236.79 份；华宸稳健债券 C 基金份额净值 1.1352 元，份额总额 56,574,731.07 份；

6.2 利润表

会计主体：华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		1,347,691.66	1,491,967.36
1.利息收入		1,636,233.21	891,165.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,001.98	19,583.56
债券利息收入		1,583,393.35	855,949.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,837.88	15,632.13
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		400,818.28	-140,155.15
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	400,818.28	-140,155.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	-701,313.88	735,901.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	11,954.05	5,055.92
减：二、费用		493,656.95	249,539.87
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	165,681.92	85,551.35
2．托管费	6.4.10.2.2	82,841.01	42,775.63
3．销售服务费	6.4.10.2.3	121,127.22	45,419.93
4．交易费用	6.4.7.19	29,557.14	20,576.86
5．利息支出		1,986.70	34,920.29
其中：卖出回购金融资产支出		1,986.70	34,920.29
6．税金及附加		3,736.25	1,633.90
7．其他费用	6.4.7.20	88,726.71	18,661.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		854,034.71	1,242,427.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		854,034.71	1,242,427.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宸未来稳健添利债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 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）	131,941,714.53	16,523,481.82	148,465,196.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	854,034.71	854,034.71
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）	-73,890,746.67	-9,542,936.77	-83,433,683.44
其中：1.基金申购款	20,809,142.52	2,867,038.34	23,676,180.86
2.基金赎回款	-94,699,889.19	-12,409,975.11	-107,109,864.30
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）	58,050,967.86	7,834,579.76	65,885,547.62
项目	**上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	27,340,898.59	1,796,515.67	29,137,414.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,242,427.49	1,242,427.49
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）	90,868,974.80	8,631,950.41	99,500,925.21
其中：1.基金申购款	122,756,966.15	11,338,384.16	134,095,350.31
2.基金赎回款	-31,887,991.35	-2,706,433.75	-34,594,425.10
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）	118,209,873.39	11,670,893.57	129,880,766.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

宋小龙	宋小龙	陈婉琪
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

华宸未来稳健添利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金转型而成。华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金系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[2013]177 号文《关于核准华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人华宸未来基金管理有限公司向社会

公开发行募集。基金合同于 2013 年 8 月 20 日正式生效。首次设立募集规模为 197,981,907.82 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华宸未来基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》及《关于华宸未来信用增利债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2018 年 8 月 24 日起转型并更名为华宸未来稳健添利债券型证券投资基金。

本基金将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金的 A 类基金份额在申购时收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费；C 类基金份额不收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

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（国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券、可分离债券）、同业存单、资产支持证券、债券回购等金融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、权证等权益类资产，但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票、权证，本基金应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有的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、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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以持续经营假设为基础列报。

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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前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为债券投资；

本基金目前持有的其他金融资产分类为贷款和应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债；

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款项和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2)回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列

示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入“未分配利润”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额

入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位各类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各基金份额类别分别制定收益分配方案，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期内无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额

计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,534,126.36
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：	1,534,126.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 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	61,978,193.54	61,884,374.90	-93,818.64
	银行间市场	-	-	-
	合计	61,978,193.54	61,884,374.90	-93,818.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		61,978,193.54	61,884,374.90	-93,818.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	204.67
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	207.09
应收债券利息	1,142,862.46
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	5.40
合计	1,143,279.62

注：表中“其他”指结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,793.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,793.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	77,077.00
合计	77,077.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华宸稳健债券 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,999,308.79	1,999,308.79
本期申购	88,870.72	88,870.72
本期赎回(以"-"号填列)	-611,942.72	-611,942.72
- 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	1,476,236.79	1,476,236.79

金额单位：人民币元

华宸稳健债券 C	
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	129,942,405.74	129,942,405.74
本期申购	20,720,271.80	20,720,271.80
本期赎回(以"-"号填列)	-94,087,946.47	-94,087,946.47
- 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	56,574,731.07	56,574,731.07

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华宸稳健债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	238,840.65	-11,665.75	227,174.90
本期利润	43,241.53	-21,158.98	22,082.55
本期基金份额交易产生的变动数	-71,833.30	7,690.11	-64,143.19
其中：基金申购款	11,520.34	-14.25	11,506.09
基金赎回款	-83,353.64	7,704.36	-75,649.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	210,248.88	-25,134.62	185,114.26

单位：人民币元

华宸稳健债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,762,334.06	2,533,972.86	16,296,306.92
本期利润	1,512,107.06	-680,154.90	831,952.16
本期基金份额交易产生的变动数	-8,089,502.46	-1,389,291.12	-9,478,793.58
其中：基金申购款	2,359,512.81	496,019.44	2,855,532.25
基金赎回款	-10,449,015.27	-1,885,310.56	-12,334,325.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,184,938.66	464,526.84	7,649,465.50

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,718.94
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	4,151.00
其他	1,132.04
合计	20,001.98

注：表中“其他”为直销申购款利息收入及保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

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 2020年1月1日至2020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	400,818.28
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	400,818.28

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	199,025,925.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	194,598,173.86
减：应收利息总额	4,026,933.04
买卖债券差价收入	400,818.28

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具投资。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-701,313.88

——股票投资	-
——债券投资	-701,313.88
——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	-701,313.88

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	11,954.05
合计	11,954.05

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	29,557.14
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	29,557.14

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
债券帐户服务费	9,000.00
其他	-
银行汇划费用	2,649.71
合计	88,726.71

6.4.7.21 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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
华宸未来基金管理有限公司（“华宸未来”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
华宸信托有限责任公司	基金管理人的股东
咸阳长涛电子科技有限公司	基金管理人的股东
韩国未来资产基金管理公司	基金管理人的股东
上海华宸未来资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

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

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	165,681.92	85,551.35
其中：支付销售机构的客户维护费	7,081.71	4,656.89

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	82,841.01	42,775.63

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C	合计
华宸未来基金管理有限公司	-	101,875.60	101,875.60
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	-	-	-
合计	-	101,875.60	101,875.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C	合计
华宸未来基金管理有限公司	-	39,708.92	39,708.92
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	-	-	-
合计	-	39,708.92	39,708.92

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.3%年费率计提，计算方法如下：

H＝E×0.3%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销

售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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：本基金本报告期内未发生与关联方进行的银行间同业市场债券（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

无。

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

无。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
基金合同生效日（ 2018 年 8 月 24 日 ）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
基金合同生效日（ 2018 年	10,000,000.00	-

8 月 24 日 ）持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
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	3,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	7,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.9200%	-

注：(1)期间申购/买入总份额含转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

(2)关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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：本基金本报告期内未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
中国工商银行	1,534,126.36	14,718.94	5,642,599.00	10,045.18

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：本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销证券。

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（2020 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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有因暂时停牌而流通受限的股票。

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

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未从事交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金金融工具的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，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。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。管理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。公司内设风险控制委员会，协助管理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设，确定风险管理原则、目标和方法，审议风险管理制度和流程，指导重大风险事件的处理。督察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况，评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性，并向董事会报告。公司各部门是风险控制措施的执行部门，负责识别和控制业务活动中潜

在风险，做好风险的事先防范与控制，作为一线责任人将风险控制在最小范围内。同时，公司设立监察稽核部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控与分析，并向管理层汇报。

本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。同时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，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该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。

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，并通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自基金份额持有人随时可以赎回其持有的份额，另一方面来自于投资品种所处的市场交易不活跃所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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产

的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在 6.4.12 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，本期末本基金持有的证券均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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、买入返售金融资产、部分应收申购款及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,534,126.36	-	-	-	-	-	1,534,126.36
结算备付金	511,432.67	-	-	-	-	-	511,432.67
存出保证金	13,288.55	-	-	-	-	-	13,288.55
交易性金融资产	-	10,171,650.80	8,836,624.40	30,999,747.10	11,876,352.60	-	61,884,374.90
买入返售金融资产	1,500,000.00	-	-	-	-	-	1,500,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,143,279.62	1,143,279.62
应收申购款	-	-	-	-	-	400.00	400.00

资产总计	3,558,847.58	10,171,650.80	8,836,624.40	30,999,747.10	11,876,352.60	1,143,679.62	66,586,902.10
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	57,975.25	57,975.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	861.31	861.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,305.28	22,305.28
应付托管费	-	-	-	-	-	11,152.63	11,152.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16,286.40	16,286.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,793.53	11,793.53
应交税费	-	-	-	-	-	503,903.08	503,903.08
其他负债	-	-	-	-	-	77,077.00	77,077.00
负债总计	-	-	-	-	-	701,354.48	701,354.48
利率敏感度缺口	3,558,847.58	10,171,650.80	8,836,624.40	30,999,747.10	11,876,352.60	442,325.14	65,885,547.62
上年度末 2019 年 12 月 31 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							
银行存款	30,583,784.52	-	-	-	-	-	30,583,784.52
结算备付金	405,800.73	-	-	-	-	-	405,800.73
存出保证金	16,953.24	-	-	-	-	-	16,953.24
交易性金融资产	20,316,670.00	1,003,600.00	33,945,419.10	46,675,598.20	19,144,569.90	-	121,085,857.20
买入返售金融资产	11,000,000.00	-	-	-	-	-	11,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,478,754.72	2,478,754.72
应收申购款	8,800,000.00	-	-	-	-	1,640,400.00	10,440,400.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	71,123,208.49	1,003,600.00	33,945,419.10	46,675,598.20	19,144,569.90	4,119,154.72	176,011,550.41
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	26,580,500.67	26,580,500.67
应付赎回款	-	-	-	-	-	318,662.54	318,662.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,862.97	26,862.97
应付托管费	-	-	-	-	-	13,431.49	13,431.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,583.96	19,583.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,323.33	50,323.33
应付利息	-	-	-	-	-	-846.57	-846.57
应交税费	-	-	-	-	-	502,625.11	502,625.11
其他负债	-	-	-	-	-	35,210.56	35,210.56
负债总计	-	-	-	-	-	27,546,354.06	27,546,354.06
利率敏感度缺口	71,123,208.49	1,003,600.00	33,945,419.10	46,675,598.20	19,144,569.90	-23,427,199.34	148,465,196.35

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；		
	利率变动范围合理。		
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（ 2020 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	基准点利率增加 0.1%	-143,601.16	-326,280.66
	基准点利率减少 0.1%	143,601.16	326,280.66

注：1、上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响；

2、本期末时间为 2020 年 6 月 30 日；

3、资产负债表日基金资产净值的影响金额单位为人民币元。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	61,884,374.90	93.93	121,085,857.20	81.56
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	61,884,374.90	93.93	121,085,857.20	81.56

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
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（ 2020 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准增加 1%	493,239.20	1,345,752.03
	业绩比较基准减少 1%	-493,239.20	-1,345,752.03

注：1、本基金管理人运用资本-资产定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响；

2、本期末时间为 2020 年 6 月 30 日；

3、资产负债表日基金资产净值的影响金额单位为人民币元。

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 2020 年 06 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一层次的余额为 0.00 元，属于第二层次的余额为 61,884,374.90 元，属于第三层次的余额为 0.00 元；于 2019 年 12 月 31 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

产中属于第一层次的余额为 0.00 元，属于第二层次的余额为 121,085,857.20 元，属于第三层次的余额为 0.00 元。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌 停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日 期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据 估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允 价值应属第二层次还是第三层次。

(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 2020 年 06 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(2019 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	61,884,374.90	92.94
	其中：债券	61,884,374.90	92.94
	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	1,500,000.00	2.25
	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	2,045,559.03	3.07
8	其他各项资产	1,156,968.17	1.74
9	合计	66,586,902.10	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	4,710,422.20	7.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,201,528.40	9.41
	其中：政策性金融债	6,201,528.40	9.41
4	企业债券	50,972,424.30	77.37
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,884,374.90	93.93

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	019627	20 国债 01	34,000	3,401,700.00	5.16
2	122374	14 招商债	30,500	3,253,435.00	4.94
3	018007	国开 1801	31,000	3,104,650.00	4.71
4	018012	国开 2003	30,870	3,096,878.40	4.70
5	136771	16 沪宁 01	30,500	3,056,405.00	4.64

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金投资范围不包括国债期货投资。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	13,288.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,143,279.62
5	应收申购款	400.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,156,968.17

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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

份额级别	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
华宸稳健债券 A	150	9,841.58	-	-	1,476,236.79	100.00%
华宸稳健债券 C	200	282,873.66	41,698,774.46	73.71%	14,875,956.61	26.29%
合计	350	165,859.91	41,698,774.46	71.83%	16,352,193.40	28.17%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华宸稳健债券 A	54,552.92	3.6954%
	华宸稳健债券 C	2,741,415.87	4.8456%
	合计	2,795,968.79	4.8164%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	华宸稳健债券 A	0~10
	华宸稳健债券 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华宸稳健债券 A	0~10
	华宸稳健债券 C	0~10

	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宸稳健债券 A	华宸稳健债券 C
基金合同生效日（2018 年 8 月 24 日）基金份额总额	12,574,950.54	-
本报告期期初基金份额总额	1,999,308.79	129,942,405.74
本报告期基金总申购份额	88,870.72	20,720,271.80
减:本报告期基金总赎回份额	611,942.72	94,087,946.47
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	1,476,236.79	56,574,731.07

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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

（1）报告期内基金管理人重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生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

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

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，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金选择代理证券买卖的证券经营机构并租用其专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场

走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；2、基金租用专用交易单元的程序：本基金管理人根据上述标准考察证券经营机构，考察结果经公司领导审批后，与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》并办理基金专用交易单元租用手续；交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

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
海通证券	297,314,397.72	100.00%	343,200,000.00	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	华宸未来基金管理有限公司关于旗下证券投资基金 2019 年度最后一个市场交易日基金份额净值和基金份额累计净值公告	本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 1 日
2	华宸未来基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京肯特瑞基金销售有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 17 日
3	华宸未来基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	上海证券报	2020 年 1 月 21 日
4	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 21 日
5	华宸未来基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告	本公司网站	2020 年 1 月 31 日
6	华宸未来基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加联储证券有限责任公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 2 月 20 日

7	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2019 年度报告	本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 30 日
8	华宸未来基金管理有限公司旗下基金 2019 年度报告提示性公告	上海证券报	2020 年 3 月 30 日
9	华宸未来基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	上海证券报、本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 21 日
10	华宸未来稳健添利债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	本公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
11	华宸未来基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	上海证券报	2020 年 4 月 22 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	20200109-20200630	24,872,561.00	8,764,241.89	1,828,962.51	31,807,840.38	54.79%
个人	1	-	-	-	-	-	100.00%
产品	2	20200204-20200204	44,436,544.62	-	44,436,544.62	-	0.00%
产品	1	20200101-20200114	44,436,544.62	-	44,436,544.62	-	0.00%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的基金净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险。							

注：本年度管理人旗下所管理的产品，作为一致行动人进行合并计算。

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、中国证监会批准本基金设立的文件；

2、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金基金合同》；

3、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金托管协议》；

4、《华宸未来稳健添利债券型证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批准文件、营业执照和公司章程；

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登陆基金管理人互联网站（http://www.hcmirae.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查询。

华宸未来基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日