

华富恒利债券型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 22 日

§ 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为 2019 年 7 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|-------------|
| 基金简称 | 华富恒利债券 | |
| 基金主代码 | 001086 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 8 月 31 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 227,543,308.98 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。 | |
| 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。 | |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华富恒利债券 A | 华富恒利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001086 | 001087 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 227,502,749.66 份 | 40,559.32 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2019年7月1日—2019年9月30日） | |
|-----------------|---------------------------|-----------|
| | 华富恒利债券 A | 华富恒利债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 1,771,058.31 | 494.56 |
| 2. 本期利润 | 5,867,976.08 | 843.10 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0257 | 0.0063 |
| 4. 期末基金资产净值 | 243,680,776.09 | 42,610.66 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.071 | 1.051 |

- 注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、所述基金业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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华富恒利债券 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 2.59% | 0.38% | 1.50% | 0.04% | 1.09% | 0.34% |

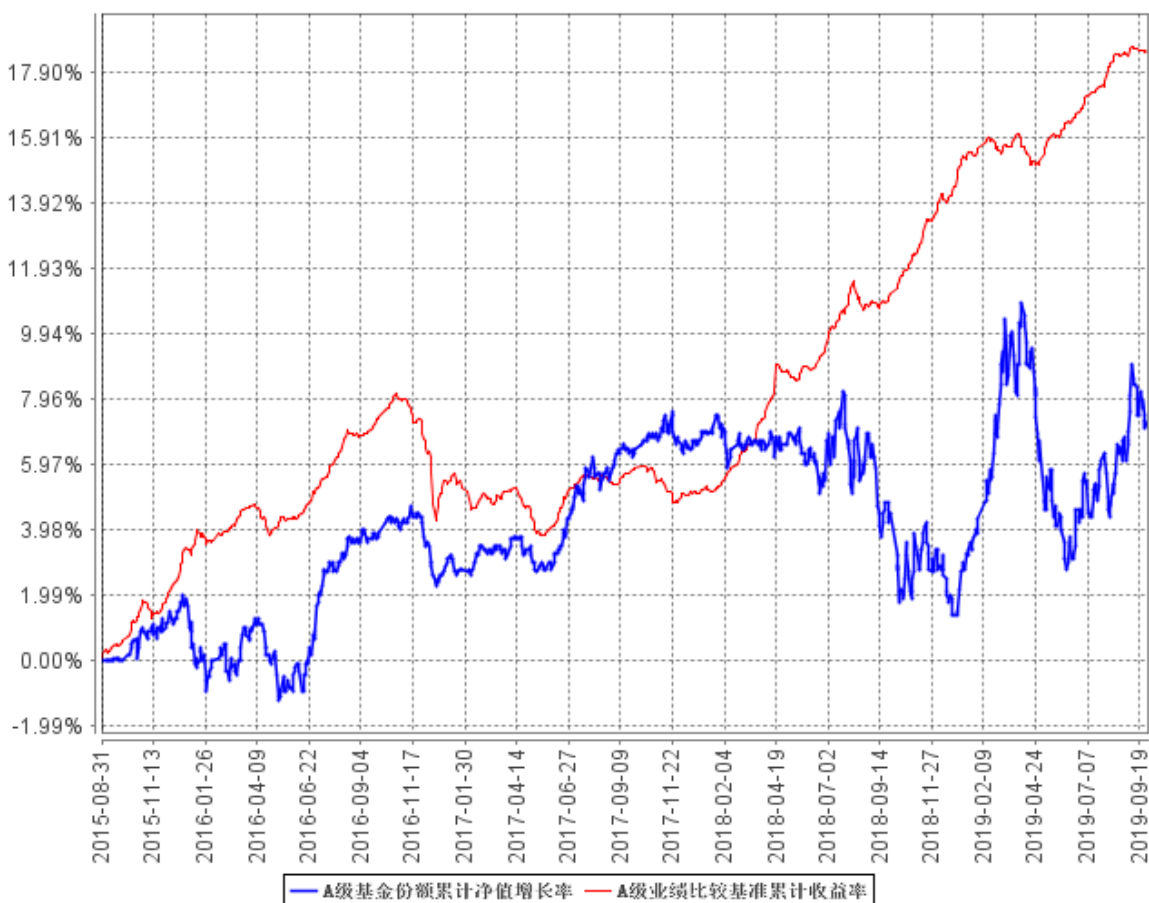
华富恒利债券 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 2.34% | 0.39% | 1.50% | 0.04% | 0.84% | 0.35% |

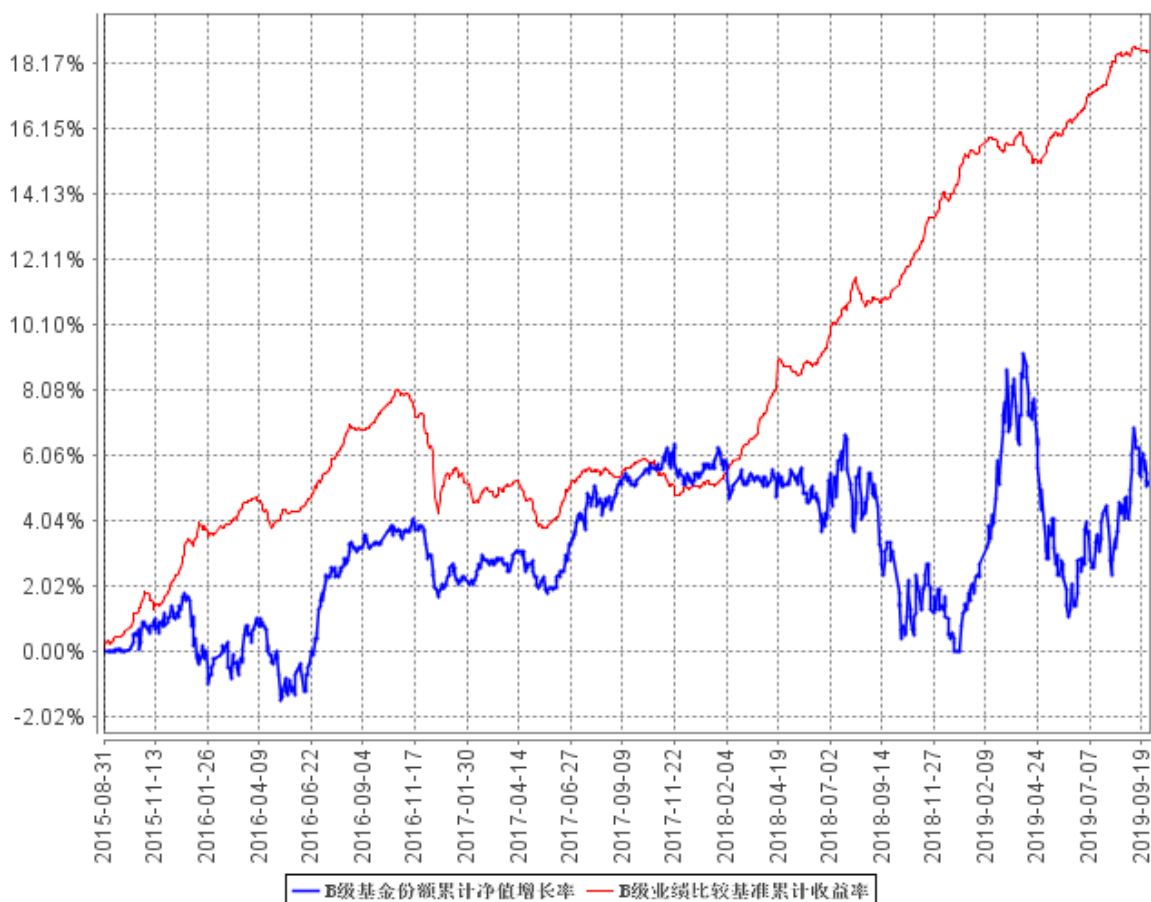
注：业绩比较基准收益率=中证全债指数，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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



B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：根据《华富恒利债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；投资于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%。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。本基金建仓期为 2015 年 8 月 31 日到 2016 年 2 月 29 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《华富恒利债券型证券投资基金基金合同》的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张惠 | 华富恒利债券型基金基金经理、华富安鑫债券型基金基金经理、华富安享债券型基金基金经理、华富安福债券型基金基金经理、华富星玉衡一年定期开放混合型基金经理、华富益鑫灵活配置混合型基金经理、华富弘鑫灵活配置混合型基金经理 | 2015 年 8 月 31 日 | - | 十二年 | 合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历，2007 年 6 月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究发展部助理行业研究员、行业研究员、固收研究员，2012 年 5 月 21 日至 2014 年 3 月 19 日任华富策略精选混合型基金经理助理，2014 年 3 月 20 日至 2014 年 11 月 18 日任华富保本混合型基金经理助理，2016 年 6 月 28 日至 2017 年 7 月 5 日任华富灵活配置混合型基金经理，2015 年 3 月 16 日至 2018 年 3 月 22 日任华富旺财保本混合型基金经理，2016 年 11 月 17 日至 2018 年 6 月 19 日任华富永鑫灵活配置混合型基金经理，2016 年 8 月 26 日至 2018 年 8 月 1 日任华富元鑫灵活配置混合型基金经理。 |

注：这里的任职日期指该基金成立之日，胡伟的离职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，证券从业的含义遵从行业协会《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

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年三季度，国内经济依旧在寻底的过程，制造业 PMI 继续处于荣枯线下方。9 月数据出现短期反弹，季节性供需回暖或是环比改善的主因。但是三季度以来，随着猪肉价格持续上涨，通胀继续回升。由于目前母猪存栏量仍在下降，考虑到生猪存栏到出栏的时滞，预计未来半年的猪价仍将在高位运行，而 CPI 在短期或将继续回升。在生产资料价格方面，9 月以来煤价、油价、钢价等见底反弹，PPI 环比有望止跌。总体来看，三季度经济基本面继续寻底等待复苏。政策方面，央行三季度货币政策例会指出经济下行压力加大，要加大逆周期调节力度。稳健的货币政策要松紧适度，要下大力气疏通货币政策传导，坚持用市场化改革办法促进实际利率水平明显降低。总体来看，三季度货币政策中性宽松，市场流动性充裕。国际方面，三季度以美欧为代表的全球经济均有所放缓，在美联储降息周期下全球央行开始了新一轮的宽松。中美贸易战方面，三季度贸易战有所反复，但是依然进行了谈判，并在十月初达成了一定成果。资本市场改革政策方面，三季度科创板顺利开板并稳健运行。

三季度，经济数据底部震荡，经济下行压力有所加大，7-8 月债券表现较好，受益于海外降息潮延续、中美贸易摩擦加剧、避险情绪升温、经济金融数据低于预期等因素，十年期国债和国开债收益率均创年内新低。但是 9 月份，国内经济数据出现反弹，通胀压力开始显现，央行多次表态当前利率较为合适抑制了进一步宽松的空间，利率债出现一定程度的调整。相比利率债，信用债受益于持续宽松的流动性，走势更为平稳，低等级信用债仍然面临利差走阔的压力。三季度，

受到权益市场整体风险偏好有所提升，可转债市场整体表现较好，估值提升比较明显。特别是几个存量较大的转债个券均在三季度实现了促转股，大部分低价转债也回归面值附近。

三季度，经济数据低位徘徊，通胀压力初步显现，货币政策再次宽松，权益市场走势有所分化。整体来看，今年以来备受内外资青睐的“核心资产”依然表现较好，同时受益于全球科技周期见底叠加国内 5G 换机需求超预期带来的电子、芯片、计算机等科技股涨幅较大，而受到经济数据不佳的金融周期类个股表现较差。

三季度，本基金配置了部分估值合理的消费电子个股，保持了相对较高的股票和转债类风险资产仓位，债券资产以中短久期高等级信用债票息策略为主，受到权益资产表现较好的影响，本季度产品净值有所上涨。

展望四季度，我们倾向于认为基本面仍会在低位徘徊，但在政策托底的情况下经济失速的风险在显著下降。地产融资收紧、制造业投资乏力，经济上行空间狭窄，基本面处底部区域；中美贸易摩擦难以预测但是向好的概率在提升，货币政策仍将继续保持宽松。但是，我们也看到当前国内通胀预期不断增强，PMI 数据显示经济活动短期回暖，国内货币政策难有超预期宽松，四季度资金价格存在季节性上行，同时为了托底经济明年专项债也可能提前发行，长端利率短期依然面临上行风险。中长期来看，全球经济有所衰退，国内经济难以独善其身，调整后的长久期利率有望成为明年较好的配置品种。权益资产方面，经济数据短期反弹，财政货币政策短期内未发生大的基调变化，外部环境相对稳定。今年景气度很高的消费和景气出现改善的科技股将面临即将到来的三季报检验，业绩较好的行业和个股有望延续上涨的行情，同时受益于托底政策下的金融地产板块也有望出现一波估值修复。

从资产配置角度，我们认为短期基本面和货币政策对风险资产偏有利，但是由于 9 月份长端利率债下跌后性价比有所提升，也值得关注。本基金将继续保持债券偏中短久期的组合，以获取票息收入为主的策略，风险资产仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念进行配置。

本基金将继续把流动性管理和风险控制放在首位，在较低风险程度下，认真研究各个潜在投资领域的机会，发挥管理人的综合优势，积极稳健地做好配置策略，均衡投资，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2015 年 8 月 31 日正式成立。截止到 2019 年 9 月 30 日，华富恒利债券 A 类基金份额净值为 1.071 元，累计份额净值为 1.071 元，本报告期的份额累计净值增长率为 2.59%，同期业绩比较基准收益率为 1.50%；华富恒利债券 C 类基金份额净值为 1.051 元，累计份额净值为 1.051

元，本报告期的份额累计净值增长率 2.34%，同期业绩比较基准收益率为 1.50%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2017 年 5 月 17 日起至本报告期末（2019 年 9 月 30 日），本基金份额持有人数量存在连续六十个工作日不满二百人的情形，至本报告期期末（2019 年 9 月 30 日）基金份额持有人数量仍不满二百人。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 42,530,204.13 | 15.26 |
| | 其中：股票 | 42,530,204.13 | 15.26 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 228,700,778.19 | 82.03 |
| | 其中：债券 | 228,700,778.19 | 82.03 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 1,939,314.05 | 0.70 |
| 8 | 其他资产 | 5,619,995.74 | 2.02 |
| 9 | 合计 | 278,790,292.11 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 2,015,735.91 | 0.83 |
| C | 制造业 | 27,783,482.50 | 11.40 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,089,055.32 | 0.86 |
| 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 | 8,186,935.00 | 3.36 |
| K | 房地产业 | 2,454,995.40 | 1.01 |
| 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 | 42,530,204.13 | 17.45 |

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 600741 | 华域汽车 | 198,335 | 4,660,872.50 | 1.91 |
| 2 | 300567 | 精测电子 | 75,400 | 3,524,950.00 | 1.45 |
| 3 | 601138 | 工业富联 | 235,000 | 3,384,000.00 | 1.39 |
| 4 | 601688 | 华泰证券 | 171,000 | 3,264,390.00 | 1.34 |
| 5 | 600201 | 生物股份 | 138,600 | 2,615,382.00 | 1.07 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 140,900 | 2,469,977.00 | 1.01 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 171,678 | 2,454,995.40 | 1.01 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 109,100 | 2,452,568.00 | 1.01 |
| 9 | 300078 | 思创医惠 | 206,000 | 2,426,680.00 | 1.00 |
| 10 | 300450 | 先导智能 | 71,500 | 2,409,550.00 | 0.99 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 15,004,500.00 | 6.16 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| | 其中：政策性金融债 | 15,004,500.00 | 6.16 |
| 4 | 企业债券 | 101,578,896.00 | 41.68 |
| 5 | 企业短期融资券 | 7,017,000.00 | 2.88 |
| 6 | 中期票据 | 20,248,000.00 | 8.31 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 84,852,382.19 | 34.82 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 228,700,778.19 | 93.84 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 180410 | 18 农发 10 | 150,000 | 15,004,500.00 | 6.16 |
| 2 | 122203 | 12 海螺 02 | 100,000 | 10,474,000.00 | 4.30 |
| 3 | 143529 | 18 海通 02 | 100,000 | 10,269,000.00 | 4.21 |
| 4 | 143685 | 18 中证 G1 | 100,000 | 10,238,000.00 | 4.20 |
| 5 | 143576 | 18 光证 G2 | 100,000 | 10,216,000.00 | 4.19 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 68,899.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,676,152.30 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,874,943.88 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,619,995.74 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1 | 113011 | 光大转债 | 8,269,932.00 | 3.39 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 7,370,666.80 | 3.02 |
| 3 | 113017 | 吉视转债 | 4,299,144.30 | 1.76 |
| 4 | 128020 | 水晶转债 | 3,415,534.65 | 1.40 |
| 5 | 113020 | 桐昆转债 | 2,965,530.30 | 1.22 |
| 6 | 113519 | 长久转债 | 2,776,267.00 | 1.14 |
| 7 | 128010 | 顺昌转债 | 2,671,576.59 | 1.10 |
| 8 | 110045 | 海澜转债 | 2,667,860.00 | 1.09 |
| 9 | 113525 | 台华转债 | 2,660,347.50 | 1.09 |
| 10 | 113021 | 中信转债 | 2,585,570.40 | 1.06 |
| 11 | 127011 | 中鼎转 2 | 2,413,338.60 | 0.99 |
| 12 | 128028 | 赣锋转债 | 2,382,158.05 | 0.98 |
| 13 | 113522 | 旭升转债 | 2,343,161.10 | 0.96 |
| 14 | 110034 | 九州转债 | 2,081,684.00 | 0.85 |
| 15 | 132004 | 15 国盛 EB | 2,058,598.50 | 0.84 |
| 16 | 110033 | 国贸转债 | 1,794,915.50 | 0.74 |
| 17 | 132011 | 17 浙报 EB | 1,662,906.00 | 0.68 |
| 18 | 132013 | 17 宝武 EB | 1,583,539.10 | 0.65 |
| 19 | 128018 | 时达转债 | 1,485,192.52 | 0.61 |
| 20 | 110041 | 蒙电转债 | 1,340,161.20 | 0.55 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 21 | 128058 | 拓邦转债 | 1,254,477.00 | 0.51 |
| 22 | 128059 | 视源转债 | 1,239,207.84 | 0.51 |
| 23 | 128019 | 久立转 2 | 1,158,406.20 | 0.48 |
| 24 | 128044 | 岭南转债 | 1,006,880.03 | 0.41 |
| 25 | 113016 | 小康转债 | 999,171.00 | 0.41 |
| 26 | 128022 | 众信转债 | 572,243.30 | 0.23 |
| 27 | 128042 | 凯中转债 | 567,069.60 | 0.23 |
| 28 | 113014 | N 林洋转 | 370,762.00 | 0.15 |
| 29 | 128035 | 大族转债 | 196,493.60 | 0.08 |
| 30 | 127012 | 招路转债 | 180,196.80 | 0.07 |
| 31 | 128057 | 博彦转债 | 111,200.40 | 0.05 |
| 32 | 123020 | 富祥转债 | 98,952.60 | 0.04 |
| 33 | 113528 | 长城转债 | 77,454.30 | 0.03 |
| 34 | 123023 | 迪森转债 | 51,911.60 | 0.02 |
| 35 | 110056 | 亨通转债 | 44,234.10 | 0.02 |
| 36 | 113022 | 浙商证券 | 43,952.00 | 0.02 |
| 37 | 110051 | 中天转债 | 41,581.80 | 0.02 |
| 38 | 123017 | 寒锐转债 | 39,828.15 | 0.02 |
| 39 | 123022 | 长信转债 | 32,195.80 | 0.01 |
| 40 | 110054 | 通威转债 | 31,787.60 | 0.01 |
| 41 | 110052 | 贵广转债 | 29,536.80 | 0.01 |
| 42 | 123009 | 星源转债 | 2,284.80 | 0.00 |

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华富恒利债券 A | 华富恒利债券 C |
|---------------------------|----------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 203,371,043.56 | 260,252.58 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 28,438,173.54 | 24,957.08 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,306,467.44 | 244,650.34 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 227,502,749.66 | 40,559.32 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 7.1-9.30 | 193,001,872.35 | 0.00 | 0.00 | 193,001,872.35 | 84.82% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

无

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、华富恒利债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富恒利债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富恒利债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富恒利债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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。