

# 华富安福债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 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

报告送出日期：2022 年 4 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 04 月 21 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。

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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 华富安福债券  |
| 基金主代码      | 002412  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2019 年 4 月 2 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 5,270,660.12 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。本基金投资组合中债券类、权益类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。 |
| 业绩比较基准     | 中证全债指数收益率   |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。   |
| 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  |

## § 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（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | -219,644.65                         |
| 2. 本期利润         | -576,485.59                         |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1086                             |
| 4. 期末基金资产净值     | 6,360,232.51                        |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.2067                              |

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

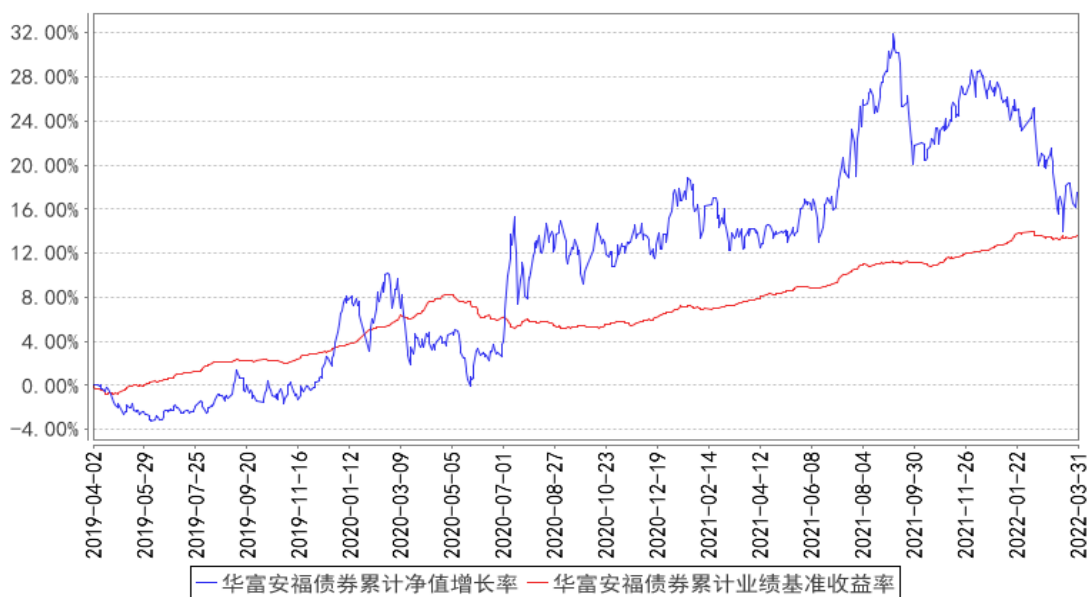
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -8.25%     | 0.81%         | 0.78%          | 0.07%                 | -9.03% | 0.74% |
| 过去六个月          | -3.92%     | 0.70%         | 2.16%          | 0.06%                 | -6.08% | 0.64% |
| 过去一年           | 3.00%      | 0.76%         | 5.44%          | 0.06%                 | -2.44% | 0.70% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 17.04%     | 0.70%         | 13.61%         | 0.07%                 | 3.43%  | 0.63% |

注：本基金业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华富安福债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金转型前为华富安福保本混合型证券投资基金。根据《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定，基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金建仓期为 2019 年 4 月 2 日到 2019 年 10 月 2 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富安福债券型证券投资基金基金合同》的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（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 | 本基金基金经理、固定收益部总监助理 | 2019 年 4 月 2 日 | -    | 十五年    | 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，曾任研究发展部助理行业研究员、行业研究员，固定收益部固收研究员、基金经理助理，自 2014 年 11 月 19 日起任华富保本混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 8 月 31 日起任华富恒利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 9 月 7 日起任华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 1 月 30 日起任华富安享债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 28 日起任华富星 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 玉衡一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 4 月 2 日起任华富安福债券型证券投资基金基金经理，自 2019 年 4 月 15 日起任华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 12 日起任华富安鑫债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 11 月 9 日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 16 日起任华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年一季度，国内经济走势呈现“先扬后抑”，3 月开始受国内疫情多点爆发影响较大。

具体来说，在政策前置发力的影响下，1 至 2 月国内经济整体向好，多项经济数据超出市场预期，其中消费、投资表现亮眼，出口则韧性较足。但进入 3 月，国内疫情形势再度严峻，各地多采取封锁等措施以控制疫情传播，国内经济景气度出现边际放缓。通胀方面，一季度因国内需求恢复仍慢，叠加猪周期下半场猪价惯性偏弱，以 CPI 为代表的居民端通胀水平仍低。但工业品方面，一季度全球供应链仍然紧张，叠加俄乌爆发战争，西方对俄采取的制裁措施使得供给端进一步承压，最终结果是以 PPI 为代表的工业品价格持续维持高位。

宏观政策方面，2022 年一季度，为实现稳增长目标，无论是货币政策、财政政策及产业政策均表现积极。货币政策端，央行于 1 月下调公开市场操作利率 10bp，同时于随后召开的 2021 年金融统计数据新闻发布会上释放宽松信号，给市场注入信心。财政政策端，一季度地方债提前发行，重大项目密集开工。产业政策端，一季度地产政策持续纠偏，部分城市下调房贷利率以促进地产景气度回暖。

从国内资本市场的表现来看，一季度债券市场维持震荡。1 月受降息及央行宽松信号利好，债券市场情绪较好，10 年期国债收益率震荡下行。进入 2 月，央行公布的 1 月金融数据大幅超出市场预期，叠加四大行下调广州房贷利率，债券市场加剧对宽信用的担忧，10 年期国债收益率持续回调。进入 3 月，官方公布的 2 月金融数据偏弱但经济数据偏强，债券市场窄幅震荡。随后金稳会召开，对货币政策表态仍然偏暖，债券市场情绪重归稳定。一季度权益市场在跨年行情中未出现预期内的春季躁动行情，反而出现了较多超预期利空因素导致指数出现大幅下跌。国内方面，一方面稳增长预期较为充分但是政策或有时滞，从而使得市场对稳增长效果充满疑虑导致风险偏好整体下行，另一方面自 2 月下旬开始，国内多地疫情爆发，特别是深圳、上海等一线城市的封锁措施对整个经济的负面冲击不断超出预期，使得全年经济增长以及上市公司业绩均出现较大不确定。海外方面，一方面受到通胀高企的压力，美联储加息预期大幅提前，对全球流动性担忧加剧；另一方面，局部战争的爆发对全球政治经济的不利影响日益显现，并大幅增加了全球通胀的压力。在内外多重利空的影响下，一季度主要股指均出现了 10% 以上的跌幅，仅有煤炭、房地产、银行等少数行业有正收益。可转债市场跟随权益资产也出现了较大跌幅，中证转债指数出现了接近 10% 的跌幅。

回顾一季度，我们对内外多重负面因素的预估显著不足，本基金产品风险资产仓位较高，净值回撤较大，需要进一步反思操作的失误。在年末对 2022 年全年的展望中，我们预判一季度将维持宽松的流动性环境，叠加稳增长政策的发力，同时考虑股债性价比相对均衡，所以超配了风险资产，中性配置了债券资产。在行业选择上我们配置了短期受益于稳增长发力的金融、地产等行业，中期有望困境反转的养殖、消费等行业，长期看代表经济转型方向的光伏、风电、新能源车

等行业，在结构上平衡了短期与中长期矛盾，但是市场实际的演绎是在海外加息、地缘战争以及国内疫情反复等多重利空下，风险偏好大幅下行，较高的股票仓位承受了净值大幅回撤的风险。债券资产上，可转债主要以精选个券为主，主要配置周期、新能源、金融等行业个券，其余债券资产主要为低价债性转债，受到转债和股票的双重大幅下跌，本基金一季度表现较差。

展望 2022 年二季度，预计疫情对国内经济的影响将边际缓和，基本面在宽信用政策的托底下或边际企稳。具体来说，首先，随着国内疫情逐步得到控制，当前被压制的居民消费需求或率先出现修复。其次，目前各地市纷纷出台鼓励房地产销售的措施，预计也将对二季度地产投资及销售构成正面影响。最后，积极的财政政策是今年的政策主旋律，预计二季度基建投资强度仍然会维持高位。

在资产配置上，债券的核心变量依然是经济及政策。短期来看，虽然国内经济受疫情影响相对低迷，但年内稳增长的决心依然较大，预计后续将有更多的宽信用政策出台，对债市的影响可能偏负面。但从货币政策来说，在没有实现经济明确企稳前，流动性大概率会保持宽松，对应债券市场出现大幅调整的风险并不高。整体来说，对二季度债券市场持偏中性的态度，关注政策变化带来的交易性机会。

权益市场方面，随着主要城市疫情边际好转，二季度市场风险偏好有望恢复，宽信用的传导效果也可能会逐渐显现。受到疫情影响一季度经济压力较大，二季度开始稳增长政策加码的预期也将有所提高，部分受益政策加码，业绩改善的板块也有望出现结构性机会。

在市场大幅下跌，估值压力得到缓解后，本基金短期仍将维持偏高的风险资产配置思路，主要根据公司盈利和估值匹配程度来进行个股的选择，在稳增长发力的方向找寻投资机会，同时在超跌的消费以及中长期行业格局较好代表经济转型方向的子板块寻找投资机会；转债资产依然以低估值银行公用事业为主要配置方向；纯债部分将继续保持以获取票息收入为主的中短久期债券配置思路。中期而言，将考虑逐步增加偏债品种配置，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。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 1.2067 元，累计份额净值为 1.2067 元。报告期，本基金份额净值增长率为-8.25%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2019 年 3 月 29 日起至本报告期末（2022 年 03 月 31 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于 5000 万元的情形，至本报告期期末（2022 年 03 月 31 日）基金资产净值仍低于 5000 万元。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份额持有人数量不满二百人的情形。

## § 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              | 1,186,350.91 | 18.23        |
|    | 其中：股票             | 1,186,350.91 | 18.23        |
| 2  | 基金投资              | -            | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 5,240,803.82 | 80.52        |
|    | 其中：债券             | 5,240,803.82 | 80.52        |
|    | 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      | 79,620.10    | 1.22         |
| 8  | 其他资产              | 1,896.44     | 0.03         |
| 9  | 合计                | 6,508,671.27 | 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         | 153,298.00 | 2.41         |
| B  | 采矿业              | -          | -            |
| C  | 制造业              | 571,960.25 | 8.99         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | 46,656.00  | 0.73         |
| 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           | 45,441.00  | 0.71         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 124,362.94 | 1.96         |
| J  | 金融业              | 195,320.72 | 3.07         |



|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| K | 房地产业          | 49,312.00    | 0.78  |
| 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            | 1,186,350.91 | 18.65 |

## 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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  | 300059 | 东方财富  | 7,708 | 195,320.72 | 3.07         |
| 2  | 300498 | 温氏股份  | 3,600 | 79,380.00  | 1.25         |
| 3  | 002714 | 牧原股份  | 1,300 | 73,918.00  | 1.16         |
| 4  | 600406 | 国电南瑞  | 2,300 | 72,427.00  | 1.14         |
| 5  | 603986 | 兆易创新  | 400   | 56,412.00  | 0.89         |
| 6  | 300122 | 智飞生物  | 400   | 55,200.00  | 0.87         |
| 7  | 000596 | 古井贡酒  | 300   | 51,408.00  | 0.81         |
| 8  | 000069 | 华侨城 A | 6,700 | 49,312.00  | 0.78         |
| 9  | 688187 | 时代电气  | 899   | 49,220.25  | 0.77         |
| 10 | 000977 | 浪潮信息  | 1,800 | 48,870.00  | 0.77         |

## 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      | 1,416,317.46 | 22.27        |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 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） | 3,824,486.36 | 60.13        |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 5,240,803.82 | 82.40        |

**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  | 019654 | 21 国债 06 | 9,340 | 954,961.01 | 15.01        |
| 2  | 113044 | 大秦转债     | 4,710 | 511,827.96 | 8.05         |
| 3  | 110079 | 杭银转债     | 3,890 | 476,418.53 | 7.49         |
| 4  | 132015 | 18 中油 EB | 4,540 | 473,072.73 | 7.44         |
| 5  | 019547 | 16 国债 19 | 4,680 | 461,356.45 | 7.25         |

**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是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、光大银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、东方财富信息股份有限公司在本报告期内出现被监管部门处罚，或在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.10.2 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。

**5.10.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |         |          |
|---|---------|----------|
| 1 | 存出保证金   | 1,616.65 |
| 2 | 应收证券清算款 | -        |
| 3 | 应收股利    | -        |
| 4 | 应收利息    | -        |
| 5 | 应收申购款   | 279.79   |
| 6 | 其他应收款   | -        |
| 7 | 其他      | -        |
| 8 | 合计      | 1,896.44 |

#### 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  | 113044 | 大秦转债     | 511,827.96 | 8.05         |
| 2  | 110079 | 杭银转债     | 476,418.53 | 7.49         |
| 3  | 132015 | 18 中油 EB | 473,072.73 | 7.44         |
| 4  | 110053 | 苏银转债     | 243,311.99 | 3.83         |
| 5  | 113011 | 光大转债     | 235,678.50 | 3.71         |
| 6  | 113042 | 上银转债     | 184,352.48 | 2.90         |
| 7  | 113620 | 傲农转债     | 168,573.15 | 2.65         |
| 8  | 113502 | 嘉澳转债     | 152,597.86 | 2.40         |
| 9  | 123117 | 健帆转债     | 142,041.90 | 2.23         |
| 10 | 127013 | 创维转债     | 127,996.14 | 2.01         |
| 11 | 132018 | G 三峡 EB1 | 116,495.48 | 1.83         |
| 12 | 128129 | 青农转债     | 113,456.16 | 1.78         |
| 13 | 110075 | 南航转债     | 84,229.76  | 1.32         |
| 14 | 127005 | 长证转债     | 78,438.44  | 1.23         |
| 15 | 127042 | 嘉美转债     | 78,259.03  | 1.23         |
| 16 | 123073 | 同和转债     | 73,563.37  | 1.16         |
| 17 | 123078 | 飞凯转债     | 70,129.58  | 1.10         |
| 18 | 113516 | 苏农转债     | 64,815.09  | 1.02         |
| 19 | 123107 | 温氏转债     | 64,151.64  | 1.01         |
| 20 | 123060 | 苏试转债     | 64,054.69  | 1.01         |
| 21 | 113017 | 吉视转债     | 62,249.73  | 0.98         |
| 22 | 113037 | 紫银转债     | 58,403.18  | 0.92         |
| 23 | 128137 | 洁美转债     | 56,039.33  | 0.88         |
| 24 | 113626 | 伯特转债     | 54,026.41  | 0.85         |
| 25 | 113025 | 明泰转债     | 53,729.24  | 0.84         |
| 26 | 110081 | 闻泰转债     | 7,108.45   | 0.11         |
| 27 | 127045 | 牧原转债     | 1,288.10   | 0.02         |
| 28 | 110080 | 东湖转债     | 1,178.03   | 0.02         |
| 29 | 118002 | 天合转债     | 1,166.32   | 0.02         |
| 30 | 127025 | 冀东转债     | 1,132.69   | 0.02         |
| 31 | 123108 | 乐普转 2    | 1,130.92   | 0.02         |

### 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的情况。

### 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

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 5,321,858.38 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 101,547.46   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 152,745.72   |
| 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               | 5,270,660.12 |

## § 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申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

### 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运用固有资金投资本基金。

## § 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 (%) |
|       | 产品特有风险         |                         |      |      |            |      |          |
|       | 无              |                         |      |      |            |      |          |

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

### 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。

华富基金管理有限公司

2022 年 4 月 22 日