

华富安鑫债券型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 21 日

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 月 20 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华富安鑫债券
基金主代码	000028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 日
报告期末基金份额总额	45,705,432.91 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	以宏观面分析和信用分析为基础，根据经济发展的不同阶段的特点，选择高质量的债券类固定收益资产构建组合，以期通过研究获得长期稳定、高于业绩基准的收益。
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，属于证券市场中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于一般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	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）
--------	-------------------------------------

1. 本期已实现收益	-494,453.34
2. 本期利润	1,101,613.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0242
4. 期末基金资产净值	48,528,575.23
5. 期末基金份额净值	1.0618

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

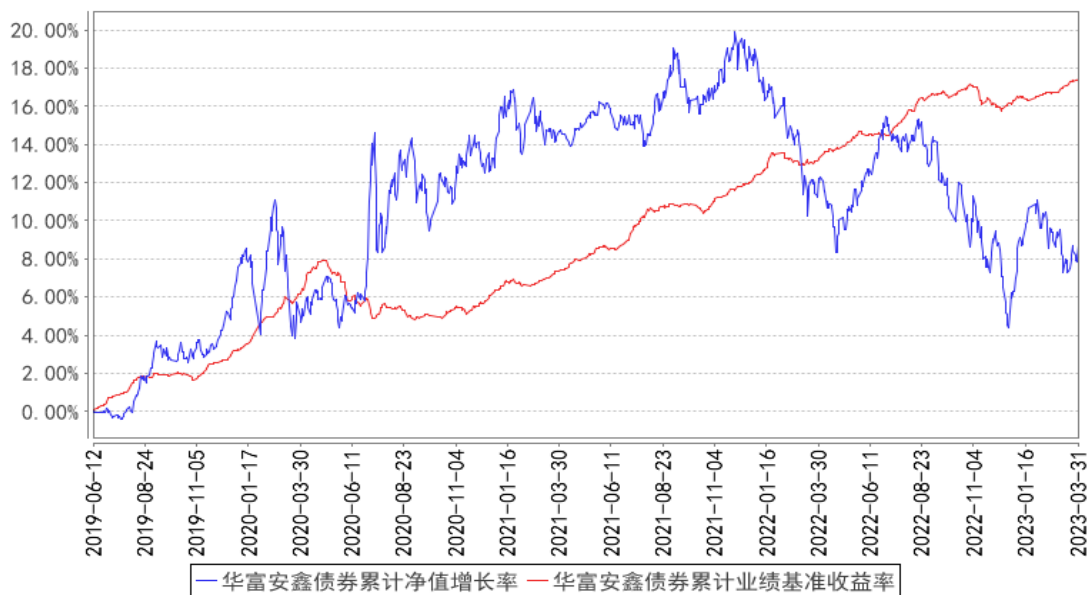
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 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	2.28%	0.43%	0.98%	0.04%	1.30%	0.39%
过去六个月	-1.79%	0.47%	0.84%	0.07%	-2.63%	0.40%
过去一年	-2.91%	0.42%	3.69%	0.06%	-6.60%	0.36%
过去三年	3.87%	0.46%	10.54%	0.07%	-6.67%	0.39%
自基金合同 生效起至今	8.75%	0.45%	17.44%	0.07%	-8.69%	0.38%

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

华富安鑫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：本基金由华富保本混合型证券投资基金 2019 年 6 月 12 日转型而来。根据《华富安鑫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：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。本基金合同生效未满一年。本基金建仓期为 2019 年 6 月 12 日到 2019 年 12 月 12 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《华富安鑫债券型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§ 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、固定收益部副总监	2019 年 6 月 12 日	-	十六年	合肥工业大学产业经济学硕士、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 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 02 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 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。
戴弘毅	本基金的基金经理	2022 年 9 月 23 日	-	六年	中国社会科学院研究生院金融学硕士、硕士研究生学历。2017 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部行业研究员、固定收益部固收研究员、固定收益部基金经理助理。自 2022 年 9 月 23 日起任华富安鑫债券型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 23 日起任华富可转债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中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

国内方面，经历了 2022 年末的疫情闯关，2023 年 1 季度国内逐步步入疫后修复阶段。1-3 月制造业 PMI 均高于荣枯线。其中，1 月受疫情影响，制造业 PMI 相对平稳。但 2 月开始，随着内需逐步升温，制造业 PMI 明显高于荣枯线，经济出现明显改善。一季度非制造业的表现较制造业更好，与疫后线下消费场景恢复有较大的关系，1-2 月社零同比增速攀升至 3.5%，较去年 12 月明显改善。地产端，受积压需求释放及居民购房信心回暖影响，核心城市一手房、二手房成交面积逐月回升，地产景气度边际修复。与经济数据相匹配的是，一季度融资数据表现较好，受企业中长贷拉动，2 月人民币贷款增速较去年末抬升 0.5pct 至 11.6%。与国内形成反差的是，出口端整体弱势，海外边际降温、国内边际回暖的格局还在延续。通胀方面，1-2 月 CPI 同比、PPI 同比较为温和，核心 CPI 也处于历史低位，疫后通胀反弹的迹象尚不明显。政策端，政府工作报告将 GDP 预期目标定为“5.0%左右”，既考虑了“稳中求进”的工作总基调，又反映了新政府对经济质的诉求高于量。货币政策方面，央行于四季度货币政策执行报告重提引导市场利率围绕政策利率波动，或有意将去年偏宽松的流动性适度回收。同时央行于三月中旬超预期降准，致力于缓解银行负债端压力，推动金融系统更好的支持实体经济增长。整体来说，一季度银行间流动性保持在合理适度的状态。

海外方面，一季度两条主线分别指向流动性和避险情绪。一方面，美国通胀的紧张状态正在边际放缓，CPI 与 PCE 通胀在逐月下行，美联储紧缩周期逐渐接近尾声。此外，美国劳动力市场的强劲以及劳动供给的改善支撑了经济的软着陆可能性。往后看，美国通胀下行趋势基本确立，而新增就业与失业率将会市场关注的焦点。另一方面，硅谷银行破产、瑞信被瑞银收购等黑天鹅事件显示出欧美金融体系的问题，体现为银行的资产端亏损与负债端流动性不足。尤其是在紧缩周期下，相对脆弱的中小型银行以及长期亏损的大型银行在受到挤兑后爆发危机极为迅速；对此，各国央行也相继及时出手，暂时避免了风险的大面积传播。在通胀降温与金融风险频发的背景下，市场降息预期大幅升温，黄金、美债受到利好涨幅明显，非银行板块海外的风险资产也在

流动性预期改善下有所反弹。

2023 年一季度，债券市场整体温和平稳，股票市场整体反弹，结构性上涨明显，可转债市场跟随权益有所上行。国内债券市场方面，一季度在资金中枢抬升、经济温和复苏的影响下，利率债收益率曲线小幅熊平。一季度 1、5、10 年期国债收益率分别上行 14bp、4bp、2bp，收益率曲线小幅熊平，一月份，经济进入疫后恢复期，票据利率上行显示信贷需求旺盛，叠加资金利率偏紧，收益率小幅上行。进入二月，《商业银行资本管理办法（征求意见稿）》发布，叠加 EPMI 超季节性回升，市场做空情绪释放，债市继续调整。进入三月，央行超预期降准提振市场情绪，在流动性的支撑下，债市小幅走强。股票市场，一季度全 A 指数上涨 6.47%，上证涨 5.94%，沪深 300 涨 4.63%，创业板指涨 2.25%，科创 50 涨 12.67%，各板块之前差异显著。一季度在国内大兴数字经济叠加 ChatGPT 引爆全球 AI 产业热情的背景下，TMT 板块表现异常优秀，计算机、传媒、通信、电子板块分别上涨 38.7%、34.3%、28.9%和 16.9%，此外，在“中特估”的推动下，建筑、石油石化行业也涨幅超 10%，相反，由于市场缺乏增量资金，在存量博弈下，房地产、消费者服务、银行和电力设备新能源等板块一季度收跌，中证新能指数一季度收跌 3.6%。可转债市场，由于权益市场的上行，带动可转债整体上行，并小幅消化了一定转股溢价率，可转债对应正股指数上涨 9.12%的情况下，中证转债指数一季度收涨 3.53%，等权可转债指数收涨 6.38%。

回顾 2023 年一季度，本基金基于年初对于大类资产上超配权益资产的判断，将大类资产配置逐渐从无风险资产向风险资产移动，考虑通过哑铃型可转债组合增厚整个投资组合的含权量。从结果上看，由于超配权益和偏股型可转债，本基金于一季度获取一定的正收益于超额，对于大类资产配置的判断没有问题，但对于行业板块配置上还有许多需要反思的地方。由于市场缺乏增量资金，新能源为代表的高端制造板块由于相对高位、筹码拥挤，以及在业绩真空期缺乏相对优势，在市场整体反弹过程中被一定程度充当“提款机”；另一方面，ChatGPT 被视为跨越人工智能奇点的产品问世，人工智能产业逐渐成为新的中长期景气方向。本基金在行业上于年初对于大消费（餐饮链为主、地产链为辅）和医药（创新药和中药）的配置，预计一季度获得相对超额，但在二月在市场集中在“中特估”与数字经济板块阶段出现回撤，此后本基金甄选了 AI 算力相关的光通信板块、大模型与应用侧、半导体先进封装等领域的标的进行配置，同时也超配了黄金板块，使得整个组合围绕中长期业绩与估值相匹配的专精特新、人工智能、医药和大消费以及贵金属的相对平衡的配置。

展望 2023 年二季度，从大类资产配置的角度维持超配权益类风险资产的预判。

国内方面，市场对于宏观经济弱复苏的方向与级别基本没有太大分歧，对于经济复苏的方向

普遍认可而对复苏的高度也普遍谨慎。从我们自己的宏观时钟来看，国内经济预计维持在小级别弱复苏的环境中。上市公司业绩方面，4 月进入一季报披露期，预计一季度为全年低点，二三四季度逐级回升，业绩小幅增长为权益市场的提供了小幅上行的基础。

海外方面，预计二季度美国劳动力市场继续降温，通胀的制约也逐渐缓解，美联储二季度较高概率，最后一次加息结束。叠加近期中国在外交与人民币结算方面动作相对积极，预计二季度仍然会呈现人民币资产较强、美元走弱的格局。然而市场当前对于美联储三季度转向降息的预期相对较满，需要警惕的是年内降息阶段性后移或落空对资产的扰动。

资产赔率角度，截至一季度末，全 A 非金融石油石化的股权风险溢价大概是 0.55%，历史 74%、近五年 49%、近三年 66%分位，权益资产略便宜一些，全 A 非金融石油石化 PE 29 倍，PB 是 2.4 倍，处在 30-40%的分位。可转债百元修正溢价率为 32.1%，处于近一年 37%分位，但仍处在 20 年以来 76%分位，以及历史的 89%分位，性价比上比股票相对弱一些。

在资产配置上，债券的胜率仍不低，但性价比不算有吸引力，且随着疫后复苏存在胜率走低的可能，更多的是围绕票息收入与把握阶段性长端利率的机会，而股票与可转债市场基本处于中长期底部区间，预计在上市公司一季报后投资主线会更加清晰，现阶段仍维持对风险资产的高度重视。

债券市场方面，经济弱复苏背景下，央行维持暖意，债券市场还未出现打破低波动的边际信号，短期内震荡概率偏高，建议保持中性久期、中性杠杆，本基金还是以票息收入为主。

权益市场方面，在“海外流动性与经济衰退担忧、国内具备防火墙负向冲击有限但受益于加息提前结束”的框架下，风险偏好与估值仍有修复空间，根据历史回归沪深 300 隐含未来一年仍有近 20%以上的回报率。由于前期缺乏增量资金叠加年底业绩真空期，市场以存量博弈为主，在一季报落地后，预计二季度开始盈利回升、宏观经济“去疫情化”回归周期，国内被动去库存周期，权益市场仍会有“复苏交易”的机会。从行业配置上，需要注意的是本轮 AIGC 的产业升级规格是很高的，高于 18-19 年 5G 的级别，甚至可以和 13-15 年“互联网+”以及 19-21 年新能源的级别相媲美，那么在主题投资热情退却后，人工智能领域相对景气度明确或商业模式清晰的细分领域和标的仍是值得去积极把握的。除此之外，具备中国优势的高端制造、消费与医疗领域的白马资产在一季报后预计也能赚到“业绩的钱”。本基金为围绕高端制造（光伏、储能、机器人、军工等）、消费（餐饮链、出行链）、医药（创新药、中药）、人工智能（光通信、大模型、应用端）以及贵金属板块相对平衡配置。

可转债方面，整体性价比不算高但也没有明显的泡沫，根据我们研究团队拟合的 100 平价溢价率于一季度末大概略高于 30%水平，在过去一年里处于中低位水平，但也处在历史高位。中长

期来看，资产荒时代下固收+资金对于可转债的配置需求仍较高，可转债性价比从中长期看应该持续处于紧平衡的状态。可转债面临的潜在风险点都是“利率何时出现调整、潜在的赎回潮和中小盘成长风格走弱”，这三个因素在接近年期都有一定的出清。积极的当面在于，一方面权益市场政策底、盈利最低点已过，另一方面部分可转债票息甚至高于同期限的信用债，性价比凸显。2023 年将在控制整体组合溢价率的情况下把握结构性机会，围绕选股思路的正股替代与中低价位的纯债替代两个维度展开：一是高票息的底仓类转债，可以选股息收益高、溢价率相对低的品种，但需要对评级相对谨慎；二是半年内不赎回、溢价率较低的“专精特新”风格进攻品种（主要围绕在新能源、医药和数字经济品种），需要根据一季度业绩的相对确定性去筛选与聚焦。

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，华富安鑫债券份额净值为 1.0618 元，累计份额净值为 1.4753 元。报告期，华富安鑫债券份额净值增长率为 2.28%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2022 年 11 月 8 日起至 2023 年 1 月 13 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形，2023 年 1 月 16 日起至 2023 年 2 月 2 日本基金基金资产净值已满 5000 万，从 2023 年 2 月 3 日起至本报告期末（2023 年 3 月 31 日），本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形，至本报告期末（2023 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	9,685,800.00	17.49
	其中：股票	9,685,800.00	17.49
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	43,656,176.82	78.84
	其中：债券	43,656,176.82	78.84
	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	1,992,202.96	3.60
8	其他资产	37,984.13	0.07
9	合计	55,372,163.91	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	895,060.00	1.84
C	制造业	5,232,503.00	10.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	371,200.00	0.76
F	批发和零售业	792,896.00	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	585,165.00	1.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	706,176.00	1.46
J	金融业	520,992.00	1.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	311,508.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	270,300.00	0.56
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	9,685,800.00	19.96

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	600009	上海机场	10,500	585,165.00	1.21
2	601601	中国太保	20,100	520,992.00	1.07
3	600547	山东黄金	21,500	473,860.00	0.98
4	300316	晶盛机电	7,000	457,030.00	0.94
5	300751	迈为股份	1,400	427,000.00	0.88
6	600489	中金黄金	40,000	421,200.00	0.87
7	000999	华润三九	7,200	413,640.00	0.85
8	603233	大参林	10,700	398,361.00	0.82
9	003020	立方制药	9,500	394,535.00	0.81
10	000858	五粮液	2,000	394,000.00	0.81

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	8,909,731.46	18.36
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）	34,746,445.36	71.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,656,176.82	89.96

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	019547	16 国债 19	50,000	5,050,021.92	10.41
2	019674	22 国债 09	37,910	3,859,709.54	7.95
3	113044	大秦转债	17,530	1,979,429.97	4.08
4	132026	G 三峡 EB2	15,000	1,603,149.45	3.30
5	127058	科伦转债	8,000	1,391,218.19	2.87

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**5.9.1 本期国债期货投资政策**

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

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，财通证券股份有限公司曾出现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	7,709.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,274.64
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	37,984.13

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	1,979,429.97	4.08
2	127058	科伦转债	1,391,218.19	2.87
3	128140	润建转债	1,177,011.30	2.43
4	127012	招路转债	1,107,837.42	2.28
5	113043	财通转债	1,085,630.41	2.24
6	111000	起帆转债	1,085,102.26	2.24
7	113042	上银转债	1,050,696.50	2.17
8	113052	兴业转债	1,013,532.88	2.09
9	113037	紫银转债	1,001,403.27	2.06
10	113027	华钰转债	999,580.27	2.06
11	128108	蓝帆转债	985,666.16	2.03
12	113056	重银转债	976,198.74	2.01
13	110053	苏银转债	954,471.04	1.97
14	113057	中银转债	882,694.20	1.82
15	123025	精测转债	851,197.33	1.75
16	123098	一品转债	835,146.37	1.72
17	113626	伯特转债	750,653.63	1.55
18	113055	成银转债	730,262.32	1.50
19	127005	长证转债	726,134.43	1.50
20	128131	崇达转 2	625,633.29	1.29
21	113053	隆 22 转债	578,426.99	1.19
22	110068	龙净转债	540,348.90	1.11
23	110062	烽火转债	540,020.34	1.11
24	128138	侨银转债	531,936.86	1.10
25	113584	家悦转债	521,787.67	1.08
26	123049	维尔转债	513,453.77	1.06
27	113021	中信转债	508,743.36	1.05
28	113049	长汽转债	481,252.38	0.99
29	127006	敖东转债	479,733.15	0.99
30	123148	上能转债	472,003.36	0.97
31	110061	川投转债	420,292.29	0.87
32	118012	微芯转债	414,920.14	0.86
33	113598	法兰转债	387,518.55	0.80
34	110090	爱迪转债	358,537.33	0.74
35	123145	药石转债	333,391.52	0.69
36	127024	盈峰转债	327,516.62	0.67
37	127043	川恒转债	315,733.21	0.65

38	128078	太极转债	286,953.90	0.59
39	128074	游族转债	240,709.32	0.50
40	128025	特一转债	205,297.64	0.42
41	128106	华统转债	138,033.17	0.28
42	132022	20 广版 EB	21,224.73	0.04
43	127027	靖远转债	1,214.95	0.00
44	110073	国投转债	1,039.30	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	44,439,950.3
报告期期间基金总申购份额	4,388,209.09
减：报告期期间基金总赎回份额	3,121,971.21
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	45,705,432.91

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,333,828.13
报告期期间买入/申购总份额	109,991.54

报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,443,819.67
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	7.53

注：

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	红利再投资	2023-1-20	109,991.54	118,350.90	0
合计			109,991.54	118,350.90	

§ 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	2023.1.1-2023.1.20	20,420,007.28	673,708.42	0.00	21,093,715.70	46.1500

		3.3						
		.31						
个人	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险								
无								

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、华富安鑫债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富安鑫债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富安鑫债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富安鑫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

2023 年 4 月 21 日