

# 华富安鑫债券型证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 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 7 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 07 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 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 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	45,749,755.44 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 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
--------	-------------------------------------

1. 本期已实现收益	253,150.52
2. 本期利润	579,346.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0126
4. 期末基金资产净值	47,757,493.82
5. 期末基金份额净值	1.0439

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

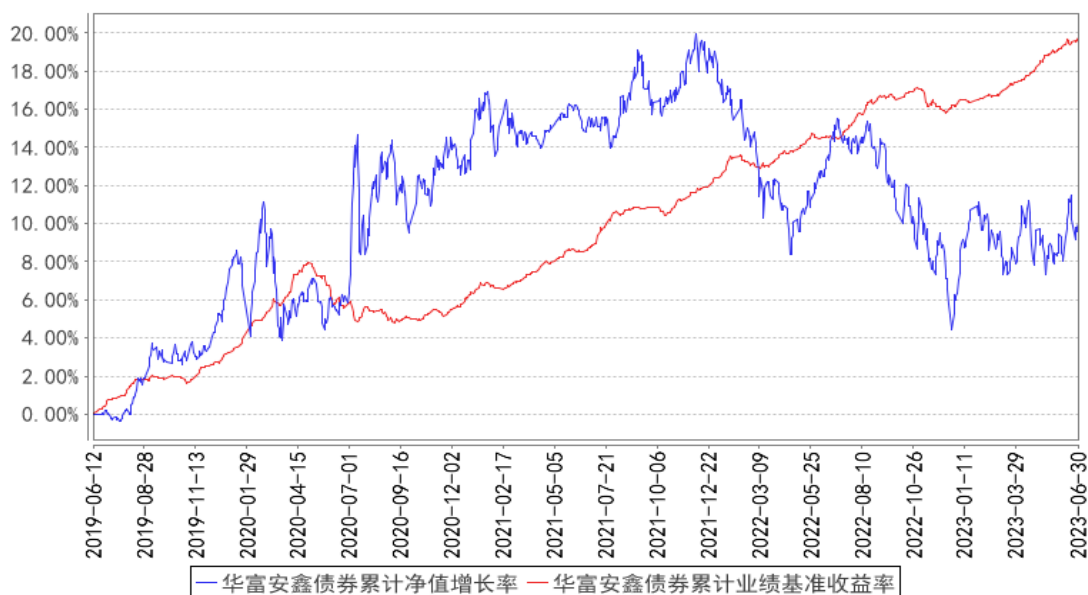
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.17%	0.52%	1.98%	0.05%	-0.81%	0.47%
过去六个月	3.48%	0.48%	2.98%	0.05%	0.50%	0.43%
过去一年	-4.44%	0.45%	4.58%	0.06%	-9.02%	0.39%
过去三年	3.48%	0.47%	13.17%	0.06%	-9.69%	0.41%
自基金合同 生效起至今	10.03%	0.46%	19.76%	0.07%	-9.73%	0.39%

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，二季度宏观经济总体趋于疲软降温，随着疫情带来的补偿性需求逐步释放，总体宏观环境重回衰退特征。结构上，二季度消费增速仍然保持在双位数的增长，消费是宏观经济中表现较稳的部分但并未超预期。地产端整体低迷，二季度商品房销售边际回落，叠加地产投资维持低迷，整体行业景气度较一季度有明显的回落。基建端则相对平稳，投资增速保持在较好的水平。出口端，受制于欧美需求回落，外贸整体承压，“一带一路”沿线国家出口仍有韧性，使得二季度出口增速依然有支撑。信贷方面，一季度天量信贷投放后，二季度新增信贷明显降温，部分或因一季度超额投放透支了短期需求。通胀方面，二季度 CPI、PPI 继续走弱，核心 CPI 维持低位，国内通胀整体低迷。

海外方面，二季度出现了美国经济韧性增强和紧缩预期再度升温的两个重要趋势。一方面，银行的存款流失情况得到显著改善，美联储通过结构流动性补充降低了银行业危机的风险。另一方面，从预期、消费和就业等各项指标来看，欧美国家实体经济的韧性仍然较强，通胀放缓的速度不及预期。美国经济的基本面主要受到居民财务状况良好的支撑，这也导致美联储的紧缩进程再次延长。目前，美国经济的薄弱之处主要在制造业方面，而由于核心通胀回落的速度较慢，加息预期的上升将导致企业信贷持续收缩。在金融风险缓释、经济超预期的背景下，市场逐步修正了前期的降息预期并提升了加息预期，这对于黄金、美债等流动性敏感的资产有较大打击，海外风险资产抱团业绩确定性较高的科技权重股。

资产表现方面，2023 年二季度国内债市总体走强，二季度随着宏观经济边际降温，利率债收益率出现了明显的下行，期间 10 年期国开债收益率下行约 25bp。具体来说，4 月部分地区中小行跟进去年存款利率下调，带动债市情绪转向积极。而后 4 月末票据利率大幅下行，市场预期 4 月信贷需求转弱，在乐观情绪的带领下，长端利率稳步回落。进入 5 月，统计局公布的 4 月制造业 PMI 回落至荣枯线以下，叠加 4 月经济数据低于市场预期，债市对经济的悲观预期加剧，长债收益率继续下行。进入 6 月，国有大行开展新一轮存款利率下调，同时央行超预期降低 OMO 利

率 10bp，触发各期限收益率明显回落。但 6 月 16 日，国常会提及研究推动经济持续回升向好的一批政策措施，债市对稳增长政策的担忧开始加剧，叠加季末资金利率偏紧，债市吐回部分涨幅。股票市场方面，二季度股市基本全线下跌，全 A 指数下跌 3.20%，上证跌 2.16%，沪深 300 跌 5.15%，创业板指跌 7.69%，科创 50 跌 7.06%，各板块均有不同程度的跌幅。二季度在全球 AI 产业仍是全球市场的主线，国内 TMT 板块表现则出现分化，通信算力板块表现相对强势、下游 AIGC 应用端也有不俗的表现，初次之外，工业母机与机器人板块也出现逆势上涨，二季度中信一级行业指数涨幅前五的行业分别是通信、家电、传媒、机械，涨幅分别为 12.83%、7.12%、6.86%、5.24%，相反，由于市场仍缺乏增量资金与宏观主线，在存量博弈下，顺周期、地产链与消费板块表现最弱，二季度跌幅最大的行业分别是建材、农林牧渔、食品饮料、消费者服务，分别录得-10.38%、-10.72%、-11.34%、-23.89%。可转债市场，整体权益市场的下跌带动了二季度可转债整体回调，由于调整度小于股票市场，小幅抬高了转股溢价率，可转债对应正股指数下跌 2.48%的情况下，中证转债指数二季度小幅下跌 0.15%，等权可转债指数下跌 0.84%。

回顾 2023 年二季度，本基金维持年初对于大类资产上超配权益资产的判断，大类资产配置仍是以风险资产超配为主，但也考虑到权益市场整体缺乏增量资金，因此整体配置行业方向上做了一定调整，增配了以光通信为主的算力方向与半导体国产替代方向。从结果上看，与一季度不同，本基金在行业方向配置上获得一定的收益与超额，但由于超配权益和偏股型可转债，本基金于二季度亦受到一定拖累，对于大类资产配置的判断还是有了一定偏差，还有许多需要反思的地方。由于市场缺乏增量资金、宏观主线较弱，整体权益与可转债的  $\beta$  表现比较差，一方面，国内在宏观经济动能放缓的同时，政策层面也未像以往周期中的较强力度的稳增长政策，另一方面，美国服务业经济、劳动力市场以及通胀的韧性均明显高于年初的判断，因此本期望的海外货币周期的观点似乎要推迟到明年才能到来，这无疑对于全球普遍的风险资产是个利空。本基金在行业上于二季度甄选了 AI 算力相关的光通信板块、具身智能与边缘算力、大模型与应用侧、半导体先进封装与设备国产替代等领域的标的进行配置，同时对于黄金板块、创新药板块进行了小幅的获利了结，使得整个组合围绕人工智能产业、半导体国产替代、新能源与机器人、医药与消费等中长期景气度与成长性相对明晰的方向中进行均衡配置。

展望 2023 年三季度，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，展望三季度，预计经济降温最快的阶段已经过去，但考虑到现有的政策力度偏温和，同时预期新增的政策可能意在托底经济而非刺激经济，三季度经济环比也难有明显升温，但也不会继续快速降温，大概率维持震荡。上市公司业绩方面，7 月将进入中报披露期，预计二季

度相较于一季度 A 股整体业绩有环比回落的压力，但后面三、四季度仍会有所回升，全年维度看不超上市公司业绩会相对疲弱的宏观经济走出  $\alpha$ ，全年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，美国的居民超额储蓄最早可以维持到明年年初，良好的财务状况将对其经济有所支撑。目前的基准假设依旧是 7 月加息后不再继续加息，但同时美联储预计仍会坚持鹰派立场，并逐步确认以保持高利率水平，预计降息的时间点将推迟至明年年初。对于相关资产而言，美债短端收益率的下行空间有限，且期限利差的倒挂状况预计将得到改善；流动性方面的宽松政策推迟以及经济增长超出预期，对黄金的上涨空间将受到限制；海外风险资产方面，企业的盈利周期已接近相对底部，但由于紧缩预期的扰动依旧较大，盈利改善的不确定性较大。

资产赔率角度，截至二季度末，全 A 非金融石油石化的股权风险溢价大概是 0.85%，历史 82%、近五年 74%、近三年 84%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 2.3 倍，处在 30-35%的分位。可转债百元修正溢价率为 28%，处于近一年 23%分位，但仍处在 20 年以来 70%分位，以及历史的 85%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，预计在上市公司中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，近期“国内外基本面与流动性比较”的框架下反复至悲观点，“海外实体经济韧性较强，国内复苏力度较弱”+“加息终点延后，俄乌局势升级”，因此权益市场赚钱效应仍未显著好转，总体估值仍在低位区间，根据历史回归沪深 300 隐含未来一年仍有近 34%+的回报率。二季度宏观经济中微观数据走弱，市场缺少宏观  $\beta$ ，主线主要在政策与全球产业逻辑上，市场似乎过于就纠结在宏观的长期悲观、但忽视了部分企业的长期竞争力。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中报落地预计也能赚到“业绩的钱”。本基金为围绕人工智能以及其带动的产业升级（光模块、服务器、先进存储、边缘算力、具身智能、大模型应用等，以及带动的 Chiplet 与半导体国产替代）、高端制造（光伏、储能、机器人、军工



等)、消费(新消费、悦己消费)、医药(创新药、中药)以及再次处于左侧的贵金属板块几个方向进行配置。

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 平价溢价率于二季度末大概略低于 30%水平,在过去一年里处于偏低位水平,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“利率调整、潜在的赎回潮、退市风险、信用风险”等,一季度后蓝盾、搜特等个券风险事件、大批股票被 ST,可转债估值一度明显压缩,百元溢价率一度净压缩近一年 10%分位左右,但近期权益市场重新回到底部位置,且中小市值再度跑赢大盘股,可转债的“看涨期权”价值有所修复。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。今年下半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,本基金份额净值为 1.0439 元,累计基金份额净值为 1.4879 元。报告期,本基金份额净值增长率为 1.17%,同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2023 年 02 月 03 日起至本报告期末(2023 年 06 月 30 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(2023 年 06 月 30 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	9,319,506.50	18.71
	其中：股票	9,319,506.50	18.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,084,205.88	80.46
	其中：债券	40,084,205.88	80.46
	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	360,874.42	0.72
8	其他资产	55,780.80	0.11
9	合计	49,820,367.60	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	741,926.00	1.55
C	制造业	5,141,852.60	10.77
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	1,002,806.90	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	476,910.00	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,087,977.00	2.28
J	金融业	415,680.00	0.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	211,854.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	148,980.00	0.31
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	91,520.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	9,319,506.50	19.51

## 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	300308	中际旭创	3,500	516,075.00	1.08
2	300316	晶盛机电	7,000	496,300.00	1.04
3	600009	上海机场	10,500	476,910.00	1.00
4	002050	三花智控	15,000	453,900.00	0.95
5	002230	科大讯飞	6,400	434,944.00	0.91
6	000858	五粮液	2,600	425,282.00	0.89
7	601601	中国太保	16,000	415,680.00	0.87
8	003020	立方制药	11,050	408,960.50	0.86
9	000999	华润三九	6,400	388,224.00	0.81
10	600547	山东黄金	16,200	380,376.00	0.80

## 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	8,849,652.82	18.53
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）	31,234,553.06	65.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,084,205.88	83.93

## 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	019679	22 国债 14	56,000	5,700,681.86	11.94
2	019547	16 国债 19	30,000	3,148,970.96	6.59
3	113044	大秦转债	17,530	2,024,998.36	4.24
4	132026	G 三峡 EB2	15,000	1,660,148.63	3.48
5	113037	紫银转债	10,660	1,114,738.98	2.33

## 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：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 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，上海银行股份有限公司、兴业证券股份有限公司、重庆银行股份有限公司、中国长江三峡集团有限公司、蓝帆医疗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	8,038.53
2	应收证券清算款	47,006.77
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	735.50
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	55,780.80

#### 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	2,024,998.36	4.24
2	132026	G 三峡 EB2	1,660,148.63	3.48
3	113037	紫银转债	1,114,738.98	2.33
4	113042	上银转债	1,073,504.35	2.25
5	113052	兴业转债	1,017,130.68	2.13
6	113056	重银转债	1,014,812.04	2.12
7	128108	蓝帆转债	972,442.27	2.04
8	123025	精测转债	788,557.19	1.65
9	113064	东材转债	669,146.30	1.40
10	127074	麦米转 2	663,319.76	1.39
11	127058	科伦转债	661,402.19	1.38
12	110090	爱迪转债	627,636.45	1.31
13	128140	润建转债	573,724.52	1.20
14	118025	奕瑞转债	553,633.15	1.16
15	113634	珀莱转债	551,663.70	1.16
16	113063	赛轮转债	548,673.86	1.15
17	118027	宏图转债	536,473.97	1.12
18	113053	隆 22 转债	535,775.89	1.12
19	113584	家悦转债	531,427.40	1.11
20	113663	新化转债	531,321.21	1.11
21	128138	侨银转债	529,938.98	1.11
22	113021	中信转债	529,527.30	1.11
23	127006	敖东转债	489,648.77	1.03
24	123158	宙邦转债	485,914.78	1.02
25	113049	长汽转债	466,734.23	0.98
26	113057	中银转债	390,920.38	0.82
27	111000	起帆转债	389,319.86	0.82
28	113626	伯特转债	387,127.01	0.81
29	113027	华钰转债	376,617.67	0.79
30	118013	道通转债	376,246.19	0.79
31	118023	广大转债	375,064.85	0.79
32	127037	银轮转债	363,205.21	0.76
33	123142	申昊转债	335,662.67	0.70
34	127024	盈峰转债	320,983.60	0.67

35	127064	杭氧转债	308,595.40	0.65
36	110058	永鼎转债	305,540.72	0.64
37	123164	法本转债	291,803.62	0.61
38	113588	润达转债	291,652.05	0.61
39	128074	游族转债	284,807.67	0.60
40	110068	龙净转债	278,123.22	0.58
41	113065	齐鲁转债	246,884.52	0.52
42	127046	百润转债	245,802.74	0.51
43	118020	芳源转债	245,383.48	0.51
44	123075	贝斯转债	235,407.33	0.49
45	110073	国投转债	217,441.30	0.46
46	127051	博杰转债	175,495.81	0.37
47	113602	景 20 转债	152,425.97	0.32
48	123138	丝路转债	137,215.64	0.29
49	113648	巨星转债	124,936.30	0.26
50	113530	大丰转债	123,719.42	0.26
51	127063	贵轮转债	119,292.04	0.25
52	123130	设研转债	118,524.82	0.25
53	113619	世运转债	116,122.56	0.24
54	128081	海亮转债	114,794.88	0.24
55	113639	华正转债	113,857.67	0.24
56	111002	特纸转债	113,674.19	0.24
57	110080	东湖转债	113,413.81	0.24
58	110045	海澜转债	113,216.23	0.24
59	123059	银信转债	112,643.38	0.24
60	128132	交建转债	112,377.08	0.24
61	110062	烽火转债	112,287.33	0.24
62	127052	西子转债	110,436.41	0.23
63	128049	华源转债	109,050.16	0.23
64	128044	岭南转债	108,338.77	0.23
65	113609	永安转债	108,063.00	0.23
66	113651	松霖转债	108,024.76	0.23
67	123104	卫宁转债	107,995.07	0.23
68	113058	友发转债	107,722.73	0.23
69	110070	凌钢转债	105,927.34	0.22
70	113045	环旭转债	105,296.84	0.22
71	128131	崇达转 2	104,391.86	0.22
72	127016	鲁泰转债	102,665.59	0.21
73	113623	凤 21 转债	101,838.70	0.21
74	110047	山鹰转债	101,738.84	0.21
75	110064	建工转债	101,615.42	0.21
76	123056	雪榕转债	100,397.71	0.21

77	127044	蒙娜转债	97,217.63	0.20
78	128129	青农转债	91,164.21	0.19
79	127027	能化转债	1,206.15	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：本基金本报告期末指数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	45,705,432.91
报告期期间基金总申购份额	1,986,621.85
减：报告期期间基金总赎回份额	1,942,299.32
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	45,749,755.44

## § 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	3,443,819.67
报告期期间买入/申购总份额	100,436.51
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	3,544,256.18

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	7.75
---------------------------	------

**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	2023-04-20	100,436.51	105,036.50	0
合计			100,436.51	105,036.50	

**§ 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	2023.4.1-2023.6.30	21,093,715.70	615,182.95	0.00	21,708,898.65	47.4500
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 7 月 21 日