

华富安鑫债券型证券投资基金 2023 年中期报告

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

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、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，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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 06 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 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 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 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| § 7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 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 | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 46 |
| 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 | 47 |

| | |
|--|-----------|
| 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..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 47 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 47 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 50 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 50 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 50 |
| 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情况..... | 50 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 50 |
| § 10 重大事件揭示..... | 51 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 51 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 51 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 51 |
| 10.8 其他重大事件..... | 53 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 53 |
| § 12 备查文件目录..... | 53 |
| 12.1 备查文件目录..... | 53 |
| 12.2 存放地点..... | 54 |
| 12.3 查阅方式..... | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 华富安鑫债券型证券投资基金 |
| 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 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 45,749,755.44 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券类固定收益品种，在严格管理投资风险的基础上，追求资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 资产配置策略采取定量评估与性分析相结合的方式。主要依据公司开发的“估值驱动战略资产配置模型”，通过对市场未来 1-3 个月整体估值水平进行预测，实现基金在股票、债券及之间的合理配置。模型从市场估值的驱动因素出发，运用神经网络和分层回归等技术从市场子库中寻找与市场走势相关性最大的因子组合，从而构建趋预测模型。定性分析则主要由基金经理依据公司股票投资、固定收益以及研究部的策略讨论建议，进行综合研判。 |
| 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。 |

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 | 华富基金管理有限公司 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 满志弘 |
| | 联系电话 | 021-68886996 |
| | 电子邮箱 | manzh@hffund.com |
| 客户服务电话 | 400-700-8001 | 95528 |
| 传真 | 021-68887997 | 021-63602540 |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层 | 上海市中山东一路 12 号 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼 | 上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋 |
| 邮政编码 | 200120 | 200126 |
| 法定代表人 | 赵万里 | 郑杨 |

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.hffund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及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 | 华富基金管理有限公司 | 上海市浦东新区栖霞路 18 号 陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -241,302.82 |
| 本期利润 | 1,680,959.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0368 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.48% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.48% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 1,936,199.21 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0423 |
| 期末基金资产净值 | 47,757,493.82 |
| 期末基金份额净值 | 1.0439 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 10.03% |

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) 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，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

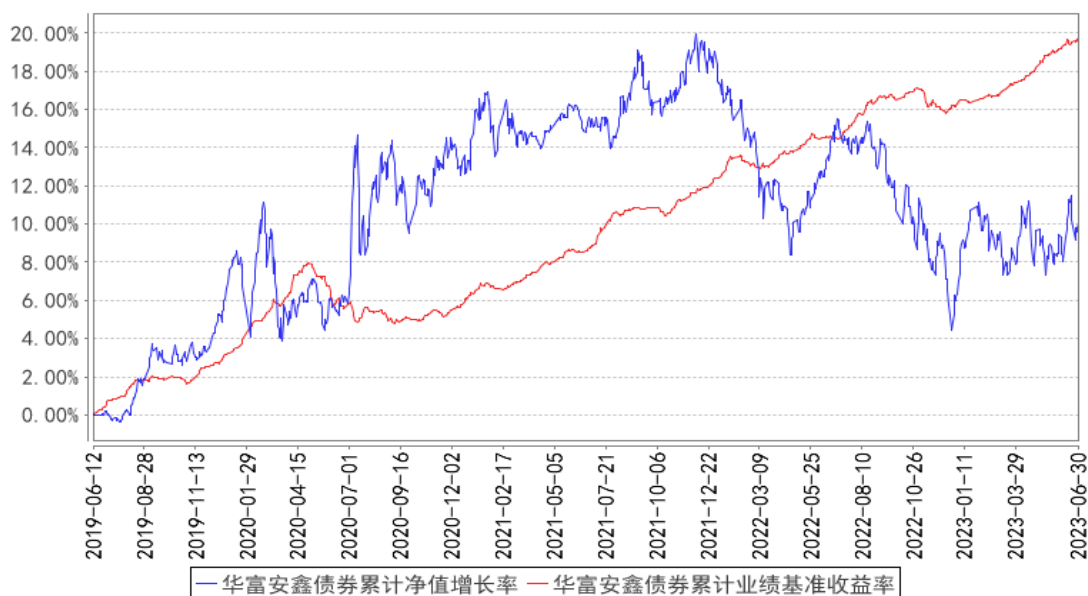
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 1.47% | 0.53% | 0.55% | 0.06% | 0.92% | 0.47% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 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，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

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：对债券、货币市场工具等固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，基金保留不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。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》的规定。

§ 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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起

式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金共六十只基金。

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 | | |
| 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 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

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 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

国内方面，上半年，疫情限制措施放松、补偿性需求逐步释放，这促进了国内宏观经济格局的小幅复苏和回归平衡。结构上，由于基数偏低与疫情影响消退的原因，消费增长相对亮眼，上半年社零持续保持两位数增长率。地产数据方面则不尽如人意，房地产销售走势呈现先反弹后逐渐放缓的趋势，竣工相对投资韧性更好一些，整体行业情绪相对较冷。基建领域则保持了持续稳定的投资增速。外部方面，虽然欧美市场需求呈现下滑趋势，但新兴经济体表现出可圈可点的韧性，为出口持续扩张提供了支撑。在信贷融资领域，第一季度的新增信贷在随后二季度中明显放缓，可能主要原因是供给端的释放后回落，而尚未出现明显的融资需求。值得注意的是，从 CPI 和 PPI 走势来看，通胀压力依然较低，核心 CPI 长期维持低位运行状态。货币政策取向上，央行在 3 月、6 月分别降准降息，整体维持稳定偏松的基调，加上实体宽信用受阻，上半年资金利率相对宽松。

海外方面，全球上半年的关键词分别是避险情绪和美国经济软着陆。在通胀边际放缓，美联储紧缩周期逐渐接近尾声的过程中，由于资产端亏损与负债端流动性不足，欧美部分中小型银行

接连破产。这也迫使海外央行暂缓加息、采取结构流动性补充，金融风险得到控制。然而，欧美实体经济并未受到太大影响，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。

资产表现方面，国内债市表现强劲，上半年利率债收益率呈现出震荡下行的走势，尤其是经历了一季度对经济复苏斜率的预期提升，在信贷逐渐转弱、宏观经济边际降温的背景下，二季度收益率出现了明显的下行。具体来说，1-3月在信贷需求一次性冲高之后，4、5月末票据利率大幅下行，后续的信贷需求逐月转弱，在乐观情绪的带领下，长端利率稳步回落。金融数据以外，通胀及制造业 PMI 表明内需不足、景气度有待提振，同时外需放缓背景下进出口数据相对疲弱。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。而后，自 6 月 16 日的国常会提及稳增长政策开始，市场担忧后续政策加码，叠加季末资金利率偏紧，债市吐回部分涨幅。股票市场方面，上半年股市先涨后跌，年初在疫情放开与国内经济复苏预期、海外流动性改善等多重因素下，A 股多数板块上涨，但在春节后开始市场赚钱效应逐渐收缩，主要集中在中特估和数字经济两条线，进入二季度赚钱效应进一步收缩，整体下跌。具体来看，上半年全 A 指数上涨 3.06%，上证涨 3.65%，沪深 300 跌 0.75%，创业板指跌 5.61%，科创 50 涨 4.71%，其中二季度各板块均有不同程度的跌幅。上半年表现较好的板块主要集中在受益于 AI 的 TMT 和中特估板块，以及后续延伸出来的机器人和自动驾驶等板块，而表现较差的板块主要集中在前几年受到机构青睐的新能源、消费、医药等板块，以及旅游景区等疫情放开收益品种、政策博弈较强的房地产板块，上半年中信一级行业指数涨幅前五的行业分别是通信、传媒、计算机、家电、机械，涨幅分别为 45.41%、43.43%、32.27%、17.42%、12.97%，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，上半年跌幅最大的行业分别是建材、农林牧渔、综合、房地产、消费者服务，分别录得-8.98%、-9.21%、-11.77%、-14.07%、-27.92%。可转债市场，受益于股票于债券市场均有正向收益，可转债市场上半年整体上涨，可转债对应正股指数上涨 6.42%的情况下，中证转债指数涨 3.37%，等权可转债指数涨 5.49%，一季度股市上行正向消化转股溢价率，而二季度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，则再度抬高了转股溢价率。

回顾 2023 年上半年，本基金保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，结构方面，一季度延续了去年的配置结构，在一季度末发现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，本基金在一二季度均有做得不足的地方需要反思，

一季度初本基金在超配风险资产上获得了一定超额收益，但结构上没有做相对于去年的及时调整，而二季度，本基金在行业方向配置和选股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。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 β 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，因此原本期望的海外货币周期的拐点大概率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，因此整个上半年市场的赚钱效应其实是偏弱的，缺少类似过去几年的景气趋势行情，而是需要灵活的仓位调整以及严格的止盈纪律。本基金在行业配置上于一季度主要以泛新能源、消费、医药与贵金属几个方向为主，于一季度后半段甄选了 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。

4.4.2 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 3.48%，同期业绩比较基准收益率为 2.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，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，展望下半年，预计市场信心最坏的阶段已经过去，但考虑到中国经济结构转型的现实，因此对于经济增长应该预期“高质量”而非“粗放发展”。上市公司业绩方面，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，全年维度看还是会有不少上市公司业绩会相对宏观经济走出 α ，全年业绩小幅增长为权益市场提供了小幅上行的基础。

海外方面，美国的居民超额储蓄与服务业市场仍支撑美国经济软着陆，由于通胀放缓的速度较慢，目前看来大概率加息周期基本接近尾声，预计降息的时间点将推迟至明年一季度。流动性方面的宽松政策推迟以及经济增长超出预期，对于海外风险资产方面，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，截至年中，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 PE29 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，长期“资产荒”预期下，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，保持中性久期、中性杠杆，本基金还是以票息收入为主。

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。权益市场方面，此前市场对于中长期信心不足，市场缺少宏观 β ，主线主要在政策与全球产业逻辑上，市场似乎过于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后预计也能赚到“业绩的钱”。本基金仍将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 Chiplet 与半导体自主可控）、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 平价溢价率于年中大概处在 28%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。可转债需要考虑的风险在于随着注册制以及退市制度的完善，可转债的主体不再是 0 信用风险了，需要关注主体的资质，积极的一面在于，一方面权益市场政策底、盈利最低点接近明晰，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。

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主

席为公司总经理，成员包括总经理、督察长、副总经理、基金运营部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富安鑫债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内共进行两次利润分配，分配金额合计为 2,986,315.66 元，符合基金合同相关约定。本期利润为 1,680,959.63 元，期末可供分配利润为 1,936,199.21 元，滚存至下一期进行分配。

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

从 2022 年 11 月 08 日起至 2023 年 01 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，从 2023 年 01 月 16 日至 2023 年 02 月 02 日，本基金基金资产净值已不存在低于 5000 万元的情形。

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 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富安鑫债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富安鑫债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复

核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：华富安鑫债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 21,898.94 | 289,685.55 |
| 结算备付金 | | 338,975.48 | 1,347,974.18 |
| 存出保证金 | | 8,038.53 | 6,124.76 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 49,403,712.38 | 58,152,259.00 |
| 其中：股票投资 | | 9,319,506.50 | 9,440,068.64 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 40,084,205.88 | 48,712,190.36 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收清算款 | | 47,006.77 | 31,615.86 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 735.50 | 1,301.18 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 49,820,367.60 | 59,828,960.53 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 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 | | 1,999,264.11 | 12,008,277.85 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 912.71 | 262.91 |

| | | | |
|-------------|---------|---------------|---------------|
| 应付管理人报酬 | | 27,452.54 | 28,655.64 |
| 应付托管费 | | 7,843.59 | 8,187.28 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 852.02 | 1,023.15 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 26,548.81 | 127,858.39 |
| 负债合计 | | 2,062,873.78 | 12,174,265.22 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 45,821,294.61 | 44,508,789.08 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 1,936,199.21 | 3,145,906.23 |
| 净资产合计 | | 47,757,493.82 | 47,654,695.31 |
| 负债和净资产总计 | | 49,820,367.60 | 59,828,960.53 |

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0439 元，基金份额总额 45,749,755.44 份。

6.2 利润表

会计主体：华富安鑫债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 2,008,733.72 | -1,194,525.64 |
| 1. 利息收入 | | 7,575.82 | 5,017.47 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 7,575.82 | 5,017.47 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 76,626.25 | -810,170.71 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -814,431.59 | -1,469,259.73 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 815,022.21 | 593,006.42 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|--------------|---------------|
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 76,035.63 | 66,082.60 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 1,922,262.45 | -390,371.31 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 2,269.20 | 998.91 |
| 减：二、营业总支出 | | 327,774.09 | 367,208.31 |
| 1. 管理人报酬 | | 167,725.87 | 173,712.77 |
| 2. 托管费 | | 47,921.67 | 49,632.23 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 82,578.70 | 73,190.22 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 82,578.70 | 73,190.22 |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 335.86 | 1,436.27 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 29,211.99 | 69,236.82 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,680,959.63 | -1,561,733.95 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,680,959.63 | -1,561,733.95 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,680,959.63 | -1,561,733.95 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华富安鑫债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | | |
|--------------|---------------------------------|--------|--------------|---------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金 | 44,508,789.08 | - | 3,145,906.23 | 47,654,695.31 |

| | | | | |
|-------------------------------------|---------------|---|---------------|---------------|
| 净值) | | | | |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 44,508,789.08 | - | 3,145,906.23 | 47,654,695.31 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 1,312,505.53 | - | -1,209,707.02 | 102,798.51 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 1,680,959.63 | 1,680,959.63 |
| （二）、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） | 1,312,505.53 | - | 95,649.01 | 1,408,154.54 |
| 其中： 1. 基金申购款 | 6,384,723.31 | - | 412,545.17 | 6,797,268.48 |
| 2. 基金赎回款 | -5,072,217.78 | - | -316,896.16 | -5,389,113.94 |
| （三）、本期向基金份额持有 | - | - | -2,986,315.66 | -2,986,315.66 |

| | | | | |
|---|--|--------|---------------|---------------|
| 人分配 利润产生 的基金净 值变动 (净值 减少以 “-”号 填列) | | | | |
| (四)、 其他综 合收益 结转留 存收益 | - | - | - | - |
| 四、本 期期末 净资产 (基金 净值) | 45,821,294.61 | - | 1,936,199.21 | 47,757,493.82 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上 期期末 净资产 (基金 净值) | 43,742,545.10 | - | 8,685,490.92 | 52,428,036.02 |
| 加：会 计政策 变更 | - | - | - | - |
| 前期 差错 更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本 期期初 净资产 (基金 净值) | 43,742,545.10 | - | 8,685,490.92 | 52,428,036.02 |
| 三、本 期增减 变动额 (减少 以“-” | 1,318,006.25 | - | -1,500,026.90 | -182,020.65 |

| | | | | |
|--|---------------|---|---------------|---------------|
| 号填列) | | | | |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -1,561,733.95 | -1,561,733.95 |
| (二)、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) | 1,318,006.25 | - | 61,707.05 | 1,379,713.30 |
| 其中: | | | | |
| 1. 基金申购款 | 4,440,999.71 | - | 485,149.98 | 4,926,149.69 |
| 2. 基金赎回款 | -3,122,993.46 | - | -423,442.93 | -3,546,436.39 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 45,060,551.35 | - | 7,185,464.02 | 52,246,015.37 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|------------|-----------|
| <u>赵万里</u> | <u>曹华玮</u> | <u>邵恒</u> |
| 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

华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。华富保本混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（[2013]69 号）核准。基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（天健验（2013）6-3 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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：对债券、货币市场工具等固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，基金保留不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3% 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

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，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本报告期本基金会计政策无变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号）、《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》（财税〔2012〕85号）、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2014〕81号）、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2016〕127号）、《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》（财税〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36号）、《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》（财税〔2016〕46号）、《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》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2016〕70号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品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。

（二）对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

（三）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。

（四）对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

（五）主要税种及税率列示如下：

| 税种 | 计税依据 | 税率 |
|---------|------------------|----|
| 增值税 | 以按税法规定计算的金融服务销售额 | 3% |
| 城市维护建设税 | 实际缴纳的流转税税额 | 7% |
| 教育费附加 | 实际缴纳的流转税税额 | 3% |
| 地方教育附加 | 实际缴纳的流转税税额 | 2% |

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 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 21,898.94 |
| 等于：本金 | 21,891.83 |
| 加：应计利息 | 7.11 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 21,898.94 |

注：“其他存款”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | |
|-------------------|------------------------|---------------|--------------|---------------|------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 9,107,773.86 | - | 9,319,506.50 | 211,732.64 | |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 39,513,442.25 | 205,659.78 | 40,084,205.88 | 365,103.85 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 39,513,442.25 | 205,659.78 | 40,084,205.88 | 365,103.85 |

| | | | | |
|--------|---------------|------------|---------------|------------|
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 48,621,216.11 | 205,659.78 | 49,403,712.38 | 576,836.49 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 0.41 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 7,331.41 |
| 其中：交易所市场 | 7,331.41 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付审计费 | 9,916.99 |
| 中债账户维护费 | 4,500.00 |
| 上清账户维护费 | 4,800.00 |
| 合计 | 26,548.81 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 44,439,195.03 | 44,508,789.08 |
| 本期申购 | 6,374,830.94 | 6,384,723.31 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,064,270.53 | -5,072,217.78 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 45,749,755.44 | 45,821,294.61 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 6,364,568.13 | -3,218,661.90 | 3,145,906.23 |
| 本期利润 | -241,302.82 | 1,922,262.45 | 1,680,959.63 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 158,579.74 | -62,930.73 | 95,649.01 |
| 其中：基金申购款 | 678,008.04 | -265,462.87 | 412,545.17 |
| 基金赎回款 | -519,428.30 | 202,532.14 | -316,896.16 |
| 本期已分配利润 | -2,986,315.66 | - | -2,986,315.66 |
| 本期末 | 3,295,529.39 | -1,359,330.18 | 1,936,199.21 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 881.25 |
| 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 | 6,631.82 |
| 其他 | 62.75 |
| 合计 | 7,575.82 |

注：“其他存款利息收入”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款利息收入。“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -814,431.59 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | -814,431.59 |

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 14,497,713.89 |
| 减：卖出股票成本总额 | 15,269,420.70 |
| 减：交易费用 | 42,724.78 |
| 买卖股票差价收入 | -814,431.59 |

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 280,629.70 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 534,392.51 |
| 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 | 815,022.21 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 74,072,807.34 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 73,061,964.58 |
| 减：应计利息总额 | 471,991.63 |
| 减：交易费用 | 4,458.62 |
| 买卖债券差价收入 | 534,392.51 |

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 76,035.63 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 76,035.63 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 1,922,262.45 |
| 股票投资 | 497,208.75 |
| 债券投资 | 1,425,053.70 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 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 | 1,922,262.45 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 2,268.66 |
| 基金转换费收入 | 0.54 |
| 合计 | 2,269.20 |

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 审计费用 | 9,916.99 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 695.00 |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 29,211.99 |

6.4.7.20 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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本管理人于2023年7月11日发布的分红公告，本基金于2023年7月12日（除权日）进行本年度第三次分红。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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 |
|--------------------|---------------------|
| 华富基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华安证券股份有限公司（“华安证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 上海华富利得资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) |
| 华安证券 | 17,965,179.80 | 63.93 | 6,665,962.59 | 18.68 |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
| | 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 成交总额的比例 (%) |
| 华安证券 | 87,659,972.64 | 66.13 | 10,268,309.08 | 12.54 |

注：本表中“当期债券成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券交易成交总额。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) |
| 华安证券 | 680,750,000.00 | 96.65 | - | - |

注：本表中“当期债券回购成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券回购成交总额。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 华安证券 | 16,677.13 | 64.11 | 5,679.69 | 77.47 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 华安证券 | 6,074.45 | 18.43 | - | - |

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 2023年1月1日至2023年6 月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 167,725.87 | 173,712.77 |
| 其中：支付销售机构的客户维护 费 | 33,583.30 | 38,453.44 |

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6 月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 47,921.67 | 49,632.23 |

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生转融通证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无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。

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 | 上年度可比期间 |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 基金合同生效日（2019年6月12日）持有的基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 3,333,828.13 | 0.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 210,428.05 | 2,646,054.54 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 3,544,256.18 | 2,646,054.54 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 7.7500% | 5.8800% |

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 | | 上年度末 | |
|----------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|
| | 2023年6月30日 | | 2022年12月31日 | |
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |
| 上海华富利得资产管理有限公司 | 21,708,898.65 | 47.4500 | 20,420,007.28 | 45.9500 |

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

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 | 上年度可比期间 |
|-------|----------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | 2022年1月1日至2022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 |
|----------------|-----------|--------|-----------|----------|
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 21,898.94 | 881.25 | 97,012.82 | 1,226.80 |

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

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：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

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

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|-----------------|-----|-----------------|---------------|--------------|--------------|--------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2023 年 1 月 19 日 | - | 2023 年 1 月 19 日 | 0.3550 | 720,476.43 | 886,709.27 | 1,607,185.70 | - |
| 2 | 2023 年 4 月 20 日 | - | 2023 年 4 月 20 日 | 0.3050 | 590,130.74 | 788,999.22 | 1,379,129.96 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.6600 | 1,310,607.17 | 1,675,708.49 | 2,986,315.66 | - |

6.4.12 期末（2023 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：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 1,999,264.11 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准

券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，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。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 9,381,329.22 | 20,292,545.72 |
| AAA 以下 | 21,853,223.84 | 18,739,215.71 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 31,234,553.06 | 39,031,761.43 |

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险**6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中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，其余均能及时变现。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投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 202 3 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 | 21,898.94 | - | - | - | - | - | 21,898.94 |
| 结 算 备 付 金 | 338,975.48 | - | - | - | - | - | 338,975.48 |
| 存 出 保 证 金 | 8,038.53 | - | - | - | - | - | 8,038.53 |
| 交 易 性 金 融 资 产 | 7,742,992.70 | 2,309,657.90 | 25,222,435.69 | 1,660,148.63 | 3,148,970.96 | 9,319,506.50 | 49,403,712.38 |
| 衍 生 金 融 资 产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买 入 返 售 金 融 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---------|--------------|--------------|---------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 债权投资 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 735.50 | 735.50 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 47,006.77 | 47,006.77 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 8,111,905.65 | 2,309,657.90 | 25,222,435.69 | 1,660,148.63 | 3,148,970.96 | 9,367,248.77 | 49,820,367.60 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 912.71 | 912.71 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 27,452.54 | 27,452.54 |
| 应付托 | - | - | - | - | - | 7,843.59 | 7,843.59 |

| | | | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---|---|-----------|--------------|
| 管费 | | | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 1,999,264.11 | - | - | - | - | - | 1,999,264.11 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 852.02 | 852.02 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 26,548.81 | 26,548.81 |
| 负债总计 | 1,999,264.11 | - | - | - | - | 63,609.67 | 2,062,873.78 |

| | | | | | | | |
|------|--------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| 计 | | | | | | | |
| 利率敏感 | 6,112,641.54 | 2,309,657.90 | 25,222,435.69 | 1,660,148.63 | 3,148,970.96 | 9,303,639.10 | 47,757,493.82 |
| 度缺口 | | | | | | | |
| 上 | | | | | | | |
| 年度末 | | | | | | | |
| 2022 | 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 |
| 年 | | | | | | | |
| 12 | | | | | | | |
| 月 | | | | | | | |
| 31 | | | | | | | |
| 日 | | | | | | | |
| 资 | | | | | | | |
| 产 | | | | | | | |
| 银 | 289,685.55 | - | - | - | - | - | 289,685.55 |
| 行 | | | | | | | |
| 存 | | | | | | | |
| 款 | | | | | | | |
| 结 | 1,347,974.18 | - | - | - | - | - | 1,347,974.18 |
| 算 | | | | | | | |
| 备 | | | | | | | |
| 付 | | | | | | | |
| 金 | | | | | | | |
| 存 | 6,124.76 | - | - | - | - | - | 6,124.76 |
| 出 | | | | | | | |
| 保 | | | | | | | |
| 证 | | | | | | | |
| 金 | | | | | | | |
| 交 | 1,041,579.34 | 12,054,777.81 | 28,193,080.28 | 1,582,003.56 | 5,840,749.37 | 9,440,068.64 | 58,152,259.00 |
| 易 | | | | | | | |
| 性 | | | | | | | |
| 金 | | | | | | | |
| 融 | | | | | | | |
| 资 | | | | | | | |
| 产 | | | | | | | |
| 衍 | - | - | - | - | - | - | - |
| 生 | | | | | | | |
| 金 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------------------------------------|--------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| 融 资 产 | | | | | | | |
| 买 入 返 售 金 融 资 产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 债 权 投 资 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应 收 股 利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应 收 申 购 款 | - | - | - | - | - | 1,301.18 | 1,301.18 |
| 应 收 清 算 款 | - | - | - | - | - | 31,615.86 | 31,615.86 |
| 其 他 资 产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资 产 总 计 | 2,685,363.83 | 12,054,777.81 | 28,193,080.28 | 1,582,003.56 | 5,840,749.37 | 9,472,985.68 | 59,828,960.53 |
| 负 债 | | | | | | | |
| 应 付 赎 回 款 | - | - | - | - | - | 262.91 | 262.91 |
| 应 | - | - | - | - | - | 28,655.64 | 28,655.64 |

| | | | | | | | |
|---|-------------------|---|---|---|---|----------|-------------------|
| 付 管 理 人 报 酬 | | | | | | | |
| 应 付 托 管 费 | - | - | - | - | - | 8,187.28 | 8,187.28 |
| 应 付 清 算 款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖 出 回 购 金 融 资 产 款 | 12,008,277. 85 | - | - | - | - | - | 12,008,277. 85 |
| 应 付 销 售 服 务 费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应 付 投 资 顾 问 费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应 付 利 润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应 交 | - | - | - | - | - | 1,023.15 | 1,023.15 |

| | | | | | | | |
|---------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| 税费 | | | | | | | |
| 其他负债 | | | | | | 127,858.39 | 127,858.39 |
| 负债总计 | 12,008,277.85 | | | | | 165,987.37 | 12,174,265.22 |
| 利率敏感度缺口 | 9,322,914.02 | 12,054,777.81 | 28,193,080.28 | 1,582,003.56 | 5,840,749.37 | 9,306,998.31 | 47,654,695.31 |

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 除利率外其他市场变量保持不变 | | |
|----|-------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 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（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 市场利率上升 25 基点 | -434,554.93 | -442,882.10 |
| | 市场利率下降 25 基点 | 445,267.50 | 458,293.42 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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其他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，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2023年6月30日 | | 上年度末 2022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 | 9,319,506.50 | 19.51 | 9,440,068.64 | 19.81 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 40,084,205.88 | 83.93 | 48,712,190.36 | 102.22 |
| 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 | 49,403,712.38 | 103.45 | 58,152,259.00 | 122.03 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变 | | |
|-----------|-----------------------------|-----------------------|------------|
| 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 (2023年6月30日) | 上年度末 (2022年12月31日) | |
| 分析 | 沪深 300 指数上升 百分之五 | 417,850.62 | 93,561.44 |
| | 沪深 300 指数下降 百分之五 | -417,850.62 | -93,561.44 |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

| 假设 | 1. 置信区间(95%) | | |
|----|-------------------|---------------------|-----------------------|
| | 2. 观察期(1年) | | |
| | - | | |
| 分析 | 风险价值 (单位：人民币元) | 本期末 (2023年6月30日) | 上年度末 (2022年12月31日) |
| | | 合计 | 4,073,502.23 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 38,893,910.93 | 36,207,146.32 |
| 第二层次 | 10,509,801.45 | 21,945,112.68 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 49,403,712.38 | 58,152,259.00 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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 | 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 | 其他各项资产 | 55,780.80 | 0.11 |
| 9 | 合计 | 49,820,367.60 | 100.00 |

7.2 报告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

金额单位：人民币元

| 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 |

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投资股票。

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

金额单位：人民币元

| 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 |
| 11 | 300820 | 英杰电气 | 4,500 | 370,710.00 | 0.78 |
| 12 | 600489 | 中金黄金 | 35,000 | 361,550.00 | 0.76 |
| 13 | 603233 | 大参林 | 12,840 | 359,648.40 | 0.75 |
| 14 | 603444 | 吉比特 | 700 | 343,777.00 | 0.72 |
| 15 | 300751 | 迈为股份 | 1,920 | 325,209.60 | 0.68 |
| 16 | 002409 | 雅克科技 | 4,400 | 320,672.00 | 0.67 |
| 17 | 002156 | 通富微电 | 14,000 | 316,400.00 | 0.66 |
| 18 | 688521 | 芯原股份 | 4,300 | 309,256.00 | 0.65 |
| 19 | 300274 | 阳光电源 | 2,600 | 303,238.00 | 0.63 |
| 20 | 300638 | 广和通 | 11,000 | 249,480.00 | 0.52 |
| 21 | 001270 | 铖昌科技 | 2,800 | 244,440.00 | 0.51 |
| 22 | 000963 | 华东医药 | 5,400 | 234,198.00 | 0.49 |
| 23 | 300171 | 东富龙 | 10,000 | 227,500.00 | 0.48 |
| 24 | 603259 | 药明康德 | 3,400 | 211,854.00 | 0.44 |
| 25 | 600703 | 三安光电 | 12,000 | 206,880.00 | 0.43 |
| 26 | 000739 | 普洛药业 | 9,800 | 173,852.00 | 0.36 |
| 27 | 000888 | 峨眉山A | 13,000 | 148,980.00 | 0.31 |
| 28 | 000596 | 古井贡酒 | 500 | 123,690.00 | 0.26 |
| 29 | 300291 | 百纳千成 | 13,000 | 91,520.00 | 0.19 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1 | 600547 | 山东黄金 | 720,080.00 | 1.51 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 515,282.00 | 1.08 |
| 3 | 300274 | 阳光电源 | 468,096.00 | 0.98 |
| 4 | 600009 | 上海机场 | 429,399.00 | 0.90 |
| 5 | 003020 | 立方制药 | 415,557.00 | 0.87 |
| 6 | 000999 | 华润三九 | 400,361.00 | 0.84 |
| 7 | 601117 | 中国化学 | 399,857.40 | 0.84 |
| 8 | 002050 | 三花智控 | 391,525.00 | 0.82 |
| 9 | 600489 | 中金黄金 | 386,750.00 | 0.81 |
| 10 | 300820 | 英杰电气 | 382,859.00 | 0.80 |
| 11 | 688521 | 芯原股份 | 376,690.74 | 0.79 |
| 12 | 000719 | 中原传媒 | 356,571.81 | 0.75 |
| 13 | 002230 | 科大讯飞 | 345,055.00 | 0.72 |
| 14 | 002043 | 兔宝宝 | 341,974.46 | 0.72 |
| 15 | 605117 | 德业股份 | 330,750.00 | 0.69 |
| 16 | 300454 | 深信服 | 320,642.00 | 0.67 |
| 17 | 002156 | 通富微电 | 320,448.00 | 0.67 |
| 18 | 603259 | 药明康德 | 318,000.00 | 0.67 |
| 19 | 002409 | 雅克科技 | 303,411.00 | 0.64 |
| 20 | 688385 | 复旦微电 | 297,250.00 | 0.62 |

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1 | 600547 | 山东黄金 | 470,883.00 | 0.99 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 442,297.00 | 0.93 |
| 3 | 601117 | 中国化学 | 429,274.72 | 0.90 |
| 4 | 000733 | 振华科技 | 426,299.00 | 0.89 |
| 5 | 688599 | 天合光能 | 417,079.11 | 0.88 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 408,000.00 | 0.86 |
| 7 | 300737 | 科顺股份 | 382,811.00 | 0.80 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 354,600.00 | 0.74 |
| 9 | 000719 | 中原传媒 | 338,225.91 | 0.71 |
| 10 | 300759 | 康龙化成 | 315,200.00 | 0.66 |
| 11 | 002043 | 兔宝宝 | 310,278.92 | 0.65 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 12 | 300999 | 金龙鱼 | 308,420.00 | 0.65 |
| 13 | 600487 | 亨通光电 | 305,770.00 | 0.64 |
| 14 | 300438 | 鹏辉能源 | 304,865.00 | 0.64 |
| 15 | 300760 | 迈瑞医疗 | 299,801.00 | 0.63 |
| 16 | 603517 | 绝味食品 | 296,449.00 | 0.62 |
| 17 | 601689 | 拓普集团 | 295,797.00 | 0.62 |
| 18 | 600195 | 中牧股份 | 284,571.00 | 0.60 |
| 19 | 688202 | 美迪西 | 280,191.19 | 0.59 |
| 20 | 600584 | 长电科技 | 280,085.00 | 0.59 |

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 14,651,649.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 14,497,713.89 |

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

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 | 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 |

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 | 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 |

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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、兴业银行股份有限公司、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。

7.11.2 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。

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 | 8,038.53 |
| 2 | 应收清算款 | 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 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|-----------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 55,780.80 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 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 |

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 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。

§ 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

| 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 (%) |
| 2,267 | 20,180.75 | 25,263,080.87 | 55.22 | 20,486,674.57 | 44.78 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 17,903.34 | 0.0391 |

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情况

| 项目 | 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2019年6月12日) 基金份额总额 | 107,228,241.96 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 44,439,195.03 |
| 本报告期基金总申购份额 | 6,374,830.94 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 5,064,270.53 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 45,749,755.44 |

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. 本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。
2. 本基金本报告期内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

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，管理人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

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 (%) | |
| 华安证券 | 2 | 17,965,179.80 | 63.93 | 16,677.13 | 64.11 | - |
| 浙商证券 | 1 | 10,135,523.29 | 36.07 | 9,337.77 | 35.89 | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 民生证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2)此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3)本报告期本基金新增国信证券交易单元。

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(%) |
| 华安证券 | 87,659,972.64 | 66.13 | 680,750,000.00 | 96.65 | - | - |
| 浙商证券 | 34,991,562.05 | 26.40 | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | 23,600,000.00 | 3.35 | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 9,896,875.71 | 7.47 | - | - | - | - |
| 首创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 华富安鑫债券型证券投资基金 2023 年第一次分红公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 1 月 18 日 |
| 2 | 华富安鑫债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 3 | 华富安鑫债券型证券投资基金 2022 年度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 4 | 华富安鑫债券型证券投资基金 2023 年第二次分红公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 4 月 19 日 |
| 5 | 华富安鑫债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2023 年 4 月 21 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 | 2023. 1. 1-2023. 6. 30 | 20, 420, 007. 28 | 1, 288, 891. 37 | 0. 00 | 21, 708, 898. 65 | 47. 4500 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 无 | | | | | | | |

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、《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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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 8 月 30 日