

华富安鑫债券型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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 10 月 24 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 07 月 01 日起至 2023 年 09 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	45,724,518.34 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
--------	-------------------------------------

1. 本期已实现收益	-1,177,456.73
2. 本期利润	-2,104,348.02
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0459
4. 期末基金资产净值	44,625,320.07
5. 期末基金份额净值	0.9760

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。

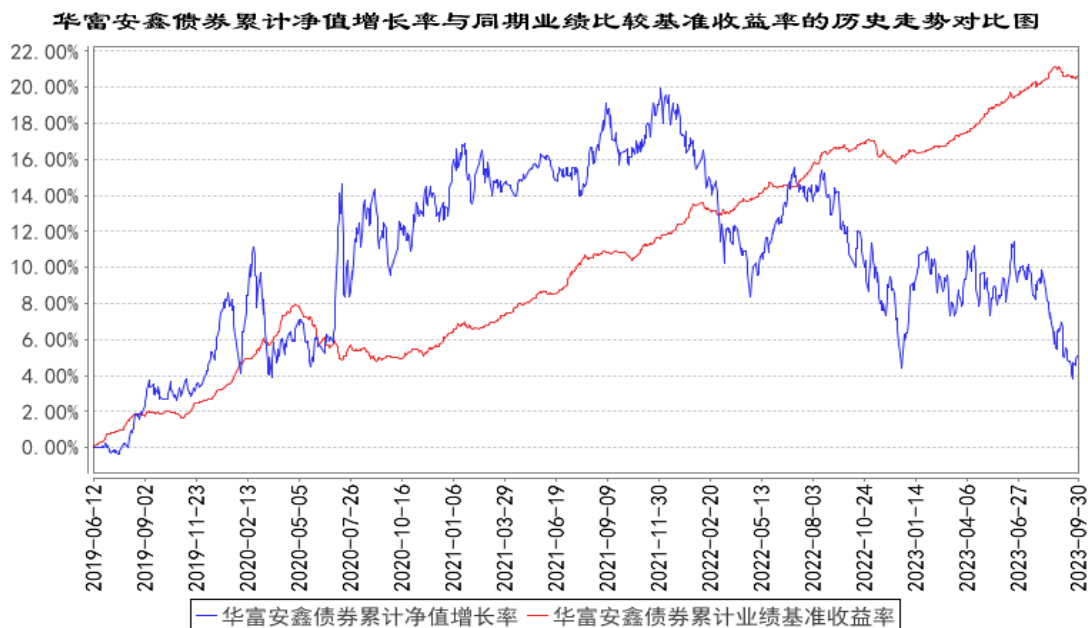
3.2 基金净值表现

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	-4.49%	0.41%	0.73%	0.06%	-5.22%	0.35%
过去六个月	-3.37%	0.47%	2.73%	0.06%	-6.10%	0.41%
过去一年	-5.10%	0.47%	3.59%	0.06%	-8.69%	0.41%
过去三年	-4.52%	0.42%	14.89%	0.06%	-19.41%	0.36%
自基金合同 生效起至今	5.09%	0.45%	20.64%	0.07%	-15.55%	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



注：1、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。

2、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		
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，自 2023 年 9 月 12 日起任华富安业一年持有期债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
张惠	本基金基金经理、固	2019 年 6 月 12 日	2023 年 9 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

	定收益 部副总 监			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 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 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，自 2023 年 9 月 12 日起任华富富鑫一年定期开放债券型发起式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，三季度整体宏观环境呈现经济动能维持弱势、政策逐渐发力的组合。实际数据方面，经历了二季度数据的边际转弱，在政策的持续托底下，三季度数据整体平稳且呈现小幅回升的势头，7、8、9 月官方制造业 PMI 分别录得 49.3、49.7 和 50.2，库存周期逐渐进入被动去库存后期。不过结构性的问题仍然存在，地产市场的悲观预期还未完全修复，城投债务问题的妥善解决还需进一步努力。政策层面，政策端较二季度更为积极，货币、财政、产业政策相继出台以托底经济：货币端，央行 OMO 降息 10bp、MLF 降息 15bp，进一步压低企业融资成本；财政端，地方再融资债重启发行，有助于缓解地方债务风险；地产方面，政治局会议强调适时调整优化房地产政策，而后一二线城市不同程度地对地产限贷限购政策松绑，叠加央行指导银行调整存量房贷利率，政策组合拳有助于地产市场重归平稳。

海外方面，三季度海外并不太平，惠誉、穆迪下调美国国债及中小银行的评级，日本放松 YCC，美国政府停摆风波及多地罢工潮，然而美国经济整体韧性依旧较强，结构上出现分化，制造业触底企稳、服务业震荡放缓；核心通胀则延续小幅放缓的态势，但能源上涨对整体通胀有一定的扰动。居民超额储蓄出现了消耗见底迹象，低收入人群信用卡债务扩张、违约率上升，但由于房贷负担与成本可控，居民整体财务状况尚可持续。货币政策上，美联储在 7 月加息之后 9 月暂停，目前市场仍对加息周期终止与否存在分歧。

资产表现方面，三季度债券市场整体小幅调整，受资金利率抬升影响，短端收益率上行幅度高于长端，收益率曲线形态平坦化。8 月 15 日央行超预期宣布降息，将债市情绪推升至最高点，10 年国债收益率快速下行至 2.55% 附近，但随后证监会发布活跃资本市场相关措施、资金利率转紧、地产政策继续放松，多重利空因素驱动下收益率回吐前期涨幅。9 月开始，央行发文提出降低首付比例和下调存量按揭利率，推动收益率继续上行。虽然月中央行降准 25bp 释放流动性，但资金面偏紧的局面未有改变，债市震荡偏弱。股票市场方面，三季度整体 A 股市场赚钱效应仍低迷，呈现明显的风格分化，权重蓝筹相对抗跌，红利资产甚至有小幅上涨，而科创、创业为代表的偏成长的板块则有一定程度下跌。具体来看，上半年全 A 指数下跌 4.33%，上证跌 2.86%，沪深 300 跌 3.98%，创业板指跌 9.53%，科创 50 跌 11.67%，三季度中信一级行业指数涨

幅前五的行业分别是煤炭、非银行金融、石油石化、银行、房地产，涨幅分别为 10.37%、6.48%、5.79%、5.2%、1.55%，高股息资产与权重蓝筹显著占优，同时，由于 7-8 月“活跃资本市场”与地产放松等一系列政策落地，非银与地产板块也有不俗的表现；相反，前期超额较大的 AI 板块与机构筹码仍重的新能源等板块则大幅下跌，跌幅最大的行业分别是机械、国防军工、电力设备及新能源、计算机、传媒，分别录得-9.13%、-9.32%、-13.53%、-13.88%、-14.19%。可转债市场，受到股票的负向拖累，可转债市场三季度整体下跌，可转债对正股指数下跌 4.23%的情况下，可转债尤其是大盘中低价转债相对抗跌，中证转债指数跌 0.52%，可转债指数跌 1.98%，再度抬高了转股溢价率。

回顾 2023 年三季度，本基金年初基于对于大类资产上超配权益资产的判断，维持以权益资产与平衡型可转债资产高仓位、叠加可转债高 YTM 底仓与长端利率债的组合，主要的调整在于降低了整体可转债资产的“股性”，将较多的股性可转债替换成中价位和低价位可转债，同时适度增加了高股息资产的配置，但在配置结构方面仍有不足，最大的问题在于没有充分认识到权益市场赚钱效应低迷的风险，以至于整体投资组合的防守性仍不足。本基金在二季度对于 AI 算力类资产与半导体等科技股进行了甄选和超配并取得一定超额，但三季度该类资产出现显著的补跌，相反则是高股息、资源股等权重蓝筹板块具备相对超额，对于大类资产配置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，政策层面也未有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下半年才能到来，这无疑对于全球普遍的风险资产是个利空，因此即使在“活跃资本市场”等政策出台之后，权益类市场赚钱效应仍弱，且前期具备超额的板块出现显著的补跌，短期看市场需要灵活的调整以及严格的止盈纪律。本基金在行业配置上总体维持之前风格，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进行均衡配置，同时在多元资产配置维度，在配置贵金属板块之外，增加了高速等高股息资产。可转债品种策略上维持了一定仓位对于低价与波动率配合的量化择券，用该类策略一定程度上替代了传统高等级大盘转债。

展望 2023 年四季度，从大类资产配置的角度维持略超配权益类风险资产的预判。

国内方面，展望四季度，预计市场信心最坏的阶段已经过去，从国内经济自身周期看，制造业四季度有望从被动去库逐渐出现结构性弱补库。但由于这次属于缺少房地产的弱复苏，且社会投资与消费倾向较低迷，经济总量 β 预计较弱。上市公司业绩方面，预计三季度相较于二季度 A 股整体业绩增速环比持平或弱改善，四季度会有小幅回升，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，往后看美联储继续加息的可能性不大，大概率加息终点已过，但更多需要判断利率维持的时间，这之中就业市场的演绎是关键，需要关注后续制造业恢复情况及罢工博弈或信用卡违约扩大的风险，同时巴以冲突的突然升温也对能源和贵金属价格、乃至海外货币周期带来一定不确定性。目前来看，市场预期高利率水平会维持到明年年中，之后开始降息周期。

资产赔率角度，截至三季度末，全 A 非金融石油石化的股权风险溢价（美债定价修正后）在 0.70% 左右，处于历史 72% 分位水平，近 5 年的 61% 分位，近 3 年的 66% 分位，权益资产略便宜一些，全 A 非金融石油石化 PE 28 倍，PB 是 2.2 倍，处在 30-35% 的分位，而股息率则在近 1.7% 的水平，处于历史极高分位。可转债百元修正溢价率为 30%，处于近一年 44% 分位，但仍处在 20 年以来 79% 分位，以及历史的 90% 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，债券类资产的胜率仍不低，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，更多地是把握长期的票息收入。

股票与可转债市场基本处于中长期底部区间，现阶段仍维持对风险资产的高度重视。在 7.24 政治局会议“活跃资本市场”之后 8.27 降印花税兑现，“政策底”已经明显确立，“估值结构性底”主要在足够高的 A 股整体股息率水平上，当前处“政策底”→“市场底”的煎熬磨底过程中。充分认识到当前是中期的底部，短期来看具备危机思维也是必要的，由于仍缺少宏观 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，本基金仍认为本轮 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的中长期性价比逐渐凸显。本基金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（机器人、自动驾驶）、消费（新消费、悦己消费）、医药以及再次处于左侧的贵金属板块和高股息资产几个方向进行配置。

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 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，同时年底前债券市场波动也会对可转债市场出现资金面的冲击。积极的一

面在于，一方面中长期看权益市场政策底、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。今年四季度将在控制整体组合溢价率的情况下把握结构性机会，本基金仍会用一定仓位进行低价与波动率配合的量化择券，预计该类策略相对于传统高等级大盘转债有更好的长期回报，同时对于安全边际高的转债品种进一步积极挖掘，同时在控制整体可转债组合价位的基础上，甄选风险收益比相对较高的平衡型转债资产。

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 0.9760 元，累计基金份额净值为 1.4420 元。报告期，本基金份额净值增长率为-4.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

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 09 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 09 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	8,867,730.50	18.20
	其中：股票	8,867,730.50	18.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,334,420.89	80.74
	其中：债券	39,334,420.89	80.74
	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	364,800.34	0.75
8	其他资产	152,967.33	0.31

9	合计	48,719,919.06	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	734,982.00	1.65
C	制造业	4,937,496.00	11.06
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	315,919.50	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	914,120.00	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,146,599.00	2.57
J	金融业	387,714.00	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	430,900.00	0.97
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	8,867,730.50	19.87

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	000063	中兴通讯	22,700	741,836.00	1.66
2	600350	山东高速	70,000	501,200.00	1.12
3	002050	三花智控	15,000	445,500.00	1.00
4	603259	药明康德	5,000	430,900.00	0.97

5	002158	汉钟精机	17,000	422,280.00	0.95
6	600012	皖通高速	37,200	412,920.00	0.93
7	600547	山东黄金	16,200	406,782.00	0.91
8	600030	中信证券	17,900	387,714.00	0.87
9	300308	中际旭创	3,200	370,560.00	0.83
10	000999	华润三九	7,200	360,864.00	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	8,651,829.75	19.39
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）	30,682,591.14	68.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,334,420.89	88.14

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	48,000	4,990,481.10	11.18
2	019688	22 国债 23	25,000	2,538,504.79	5.69
3	127005	长证转债	22,000	2,399,316.99	5.38
4	113044	大秦转债	17,530	2,063,943.78	4.63
5	132026	G 三峡 EB2	15,000	1,680,401.10	3.77

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、长江证券股份有限公司、江苏紫金农村商业银行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	8,005.97
2	应收证券清算款	136,660.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,300.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	152,967.33

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	127005	长证转债	2,399,316.99	5.38
2	113044	大秦转债	2,063,943.78	4.63
3	132026	G 三峡 EB2	1,680,401.10	3.77
4	113053	隆 22 转债	1,166,614.19	2.61
5	113037	紫银转债	1,128,426.71	2.53

6	113042	上银转债	1,081,960.81	2.42
7	113056	重银转债	1,041,197.54	2.33
8	113052	兴业转债	1,031,937.26	2.31
9	128108	蓝帆转债	987,986.19	2.21
10	123128	首华转债	940,333.04	2.11
11	128017	金禾转债	671,926.19	1.51
12	113049	长汽转债	621,712.32	1.39
13	123119	康泰转 2	553,009.32	1.24
14	118031	天 23 转债	547,670.41	1.23
15	113021	中信转债	535,853.50	1.20
16	128138	侨银转债	534,163.98	1.20
17	113584	家悦转债	531,289.73	1.19
18	127058	科伦转债	506,282.46	1.13
19	127006	敖东转债	504,021.92	1.13
20	123025	精测转债	480,972.82	1.08
21	123182	广联转债	469,987.62	1.05
22	118013	道通转债	371,739.45	0.83
23	111000	起帆转债	366,884.79	0.82
24	128023	亚太转债	332,068.36	0.74
25	113063	赛轮转债	331,163.71	0.74
26	127024	盈峰转债	323,877.15	0.73
27	118023	广大转债	317,046.33	0.71
28	113588	润达转债	279,376.99	0.63
29	113065	齐鲁转债	257,135.34	0.58
30	113631	皖天转债	251,693.37	0.56
31	113060	浙 22 转债	250,171.12	0.56
32	127065	瑞鹤转债	246,953.10	0.55
33	113662	豪能转债	240,027.67	0.54
34	118020	芳源转债	235,731.15	0.53
35	110045	海澜转债	230,050.11	0.52
36	110073	国投转债	225,222.48	0.50
37	118032	建龙转债	224,372.22	0.50
38	127044	蒙娜转债	220,001.64	0.49
39	113652	伟 22 转债	190,966.04	0.43
40	111012	福新转债	190,705.07	0.43
41	113066	平煤转债	190,375.85	0.43
42	127068	顺博转债	164,258.63	0.37
43	127074	麦米转 2	155,474.53	0.35
44	123174	精锻转债	138,739.92	0.31
45	113634	珀莱转债	137,295.48	0.31
46	113057	中银转债	133,497.45	0.30
47	113064	东材转债	132,209.75	0.30

48	118009	华锐转债	131,798.49	0.30
49	110068	龙净转债	118,760.96	0.27
50	113648	巨星转债	118,628.19	0.27
51	128081	海亮转债	118,082.10	0.26
52	128132	交建转债	116,993.34	0.26
53	123130	设研转债	116,545.56	0.26
54	127046	百润转债	115,504.38	0.26
55	113628	晨丰转债	113,953.93	0.26
56	111002	特纸转债	113,944.93	0.26
57	113524	奇精转债	113,740.25	0.25
58	113058	友发转债	112,493.47	0.25
59	123126	瑞丰转债	112,272.85	0.25
60	110070	凌钢转债	108,908.70	0.24
61	113045	环旭转债	105,216.73	0.24
62	110064	建工转债	102,869.38	0.23
63	110047	山鹰转债	102,416.79	0.23
64	123104	卫宁转债	102,344.55	0.23
65	128129	青农转债	91,833.58	0.21
66	118021	新致转债	91,293.07	0.20
67	110074	精达转债	89,401.89	0.20
68	127027	能化转债	1,262.17	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	45,749,755.44
报告期期间基金总申购份额	974,316.19
减：报告期期间基金总赎回份额	999,553.29
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	45,724,518.34

§ 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	3,544,256.18
报告期期间买入/申购总份额	76,775.94
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	3,621,032.12
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	7.92

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	2023-7-13	76,775.94	77,973.64	0
合计			76,775.94	77,973.64	

注：

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

		到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	2023.7.1-2023.9.30	21,708,898.65	470,259.72	0.00	22,179,158.37	48.5100
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 10 月 25 日