

华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证  
券投资基金  
2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华富吉丰 60 天滚动持有期中短债
基金主代码	013522
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 8 日
报告期末基金份额总额	3,799,773,985.98 份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合流动性、估值水平、风险偏好等因素，综合评价各类资产的风险收益水平。本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心，在动态避险的基础上，追求适度收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金投资组合中债券类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。</p> <p>2、纯固定收益投资策略</p> <p>本基金纯固定收益类资产投资策略主要基于华富宏观利率检测体系的观测指标和结果，通过久期控制、期限结</p>

构管理、类属资产选择实施组合战略管理，同时利用个券选择、跨市场套利、骑乘策略、息差策略等战术性策略提升组合的收益率水平。

本基金买入信用债（不含可交换债券、可转换债券）的债项评级不得低于 AA+。其中投资债项评级 AA+ 的信用债比例不高于债券资产的 50%，投资债项评级 AAA 的信用债比例不低于债券资产的 50%。本基金投资的信用债若无债项评级的，参照主体信用评级。基金持有信用债期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

#### （1）华富宏观利率监测体系

华富宏观利率监测体系主要是通过对影响债券市场收益率变化的诸多因素进行跟踪，逐一评价各相应指标的影响程度并据此判断未来市场利率的趋势及收益率曲线形态变化。具体执行中将结合定性的预测和定量的因子分析法、时间序列回归等诸多统计手段来增强预测的科学性和准确性。

#### （2）战略管理

组合战略管理是在华富宏观利率检测体系对基础利率、债券收益率变化趋势及收益率曲线变化对固定收益组合实施久期控制、期限结构管理、类属资产选择，以实现组合主要收益的稳定。

久期控制：根据华富宏观利率检测体系对利率水平的预期对组合的久期进行积极的管理，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期（包括买入浮动利率债券），以规避债券价格下降的风险。

期限结构管理：通过对债券收益率曲线形状变化（即不同期限的债券品种受到利率变化影响不一样大）的预期，选择相应的投资策略如子弹型、哑铃型或梯形的不同期限债券的组合形式，获取因收益率曲线的形变所带来的投资收益。

类属资产选择：通过提高相对收益率较高类属、降低相对收益率较低类属以取得较高的总回报。由于信用差异、流动性差异、税收差异等诸多因素导致固定收益品种中同一期限的国债、金融债、企业债、资产支持证券等收益率之间价差在不同的时点价差出现波动。通过把握经济周期变化、不同投资主体投资需求变化等，分析不同固定收益类资产之间相对收益率价差的变化趋势，选择相对低估、收益率相对较高的类属资产进行配置，择机减持相对高估、收益率相对较低的类属资产。

#### （3）组合战术性策略

本基金纯固定收益组合在战略管理基础上，利用个券选择、跨市场套利、骑乘策略、息差策略等战术性策略提升组合的收益率水平。

	<p>个券选择：由于各发债主体信用等级，发行规模、担保人等因素导致同一类属资产的收益率水平存在差异，本基金在符合组合战略管理的条件下，综合考虑流动性、信用风险、收益率水平等因素后优先选择综合价值低估的品种。</p> <p>跨市场套利：由于国内债券市场被分割为交易所市场和银行间市场，不同市场投资主体差异化、市场资金面的供求关系导致现券、回购等相同或相近的交易中存在显著的套利，本基金将充分利用市场的套利机会，积极进行跨市场回购套利、跨市场债券套利等。</p> <p>骑乘策略：主要是利用收益率曲线陡峭特征，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券持有一段时间后获得因期限缩短而导致的收益下滑进而带来的资本利得。中国债券市场收益率曲线在不同时期不同期限表现出来的陡峭程度不一，为本基金实施骑乘策略提供了有利的市场环境。</p> <p>息差策略：息差策略是通过正回购融资放大交易策略，其主要目标是获得票息大于回购成本而产生的收益。一般而言市场回购利率普遍低于中长期债券的收益率，为息差交易提供了机会，不过由于可能导致的资本利差损失，因此本基金将根据对市场回购利率走势的判断，适当地选择杠杆比率，谨慎地实施息差策略，提高投资组合的收益水平。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债综合全价（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款基准利率（税后）×20%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。</p>

基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富吉丰 60 天滚动持有中短债 A	华富吉丰 60 天滚动持有中短债 C
下属分级基金的交易代码	013522	013523
报告期末下属分级基金的份额总额	346,274,176.85 份	3,453,499,809.13 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）	
	华富吉丰 60 天滚动持有中短债 A	华富吉丰 60 天滚动持有中短债 C
1. 本期已实现收益	3,270,754.75	21,827,404.13
2. 本期利润	-4,716,583.42	-33,916,758.83
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0084	-0.0082
4. 期末基金资产净值	364,750,578.00	3,626,776,298.65
5. 期末基金份额净值	1.0534	1.0502

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

华富吉丰 60 天滚动持有中短债 A

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	-0.67%	0.05%	-0.51%	0.05%	-0.16%	0.00%
过去六个月	0.98%	0.04%	-0.36%	0.04%	1.34%	0.00%
过去一年	4.54%	0.04%	-0.18%	0.03%	4.72%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.34%	0.04%	0.05%	0.03%	5.29%	0.01%

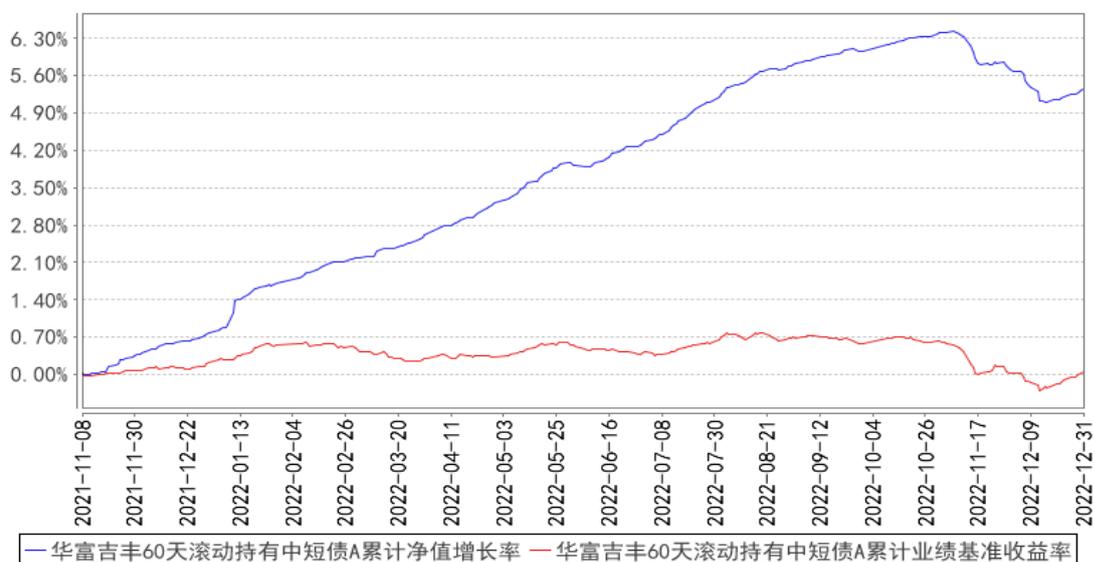
华富吉丰 60 天滚动持有中短债 C

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	-0.73%	0.05%	-0.51%	0.05%	-0.22%	0.00%
过去六个月	0.87%	0.04%	-0.36%	0.04%	1.23%	0.00%
过去一年	4.24%	0.04%	-0.18%	0.03%	4.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.02%	0.04%	0.05%	0.03%	4.97%	0.01%

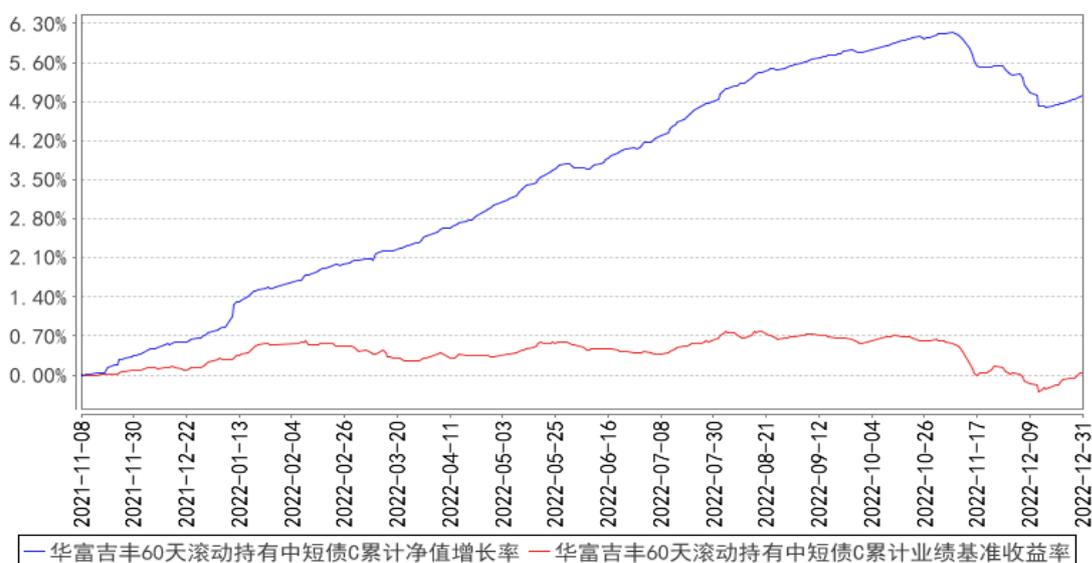
注：业绩比较基准=中债综合全价（1-3 年）指数收益率\*80%+一年期定期存款基准利率（税后）\*20%。

### 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

华富吉丰60天滚动持有中短债A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



华富吉丰60天滚动持有中短债C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：根据《华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》的约定，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不投资于股票等权益资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2021 年 11 月 8 日至 2022 年 5 月 7 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《华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
倪莉莎	本基金的基金经理	2021 年 11 月 8 日	-	八年	英国曼彻斯特大学管理学硕士，硕士研究生学历。2014 年 2 月加入华富基金管理有限公司，曾任集中交易部助理交易员、交易员，固定收益部基金经理助理，自 2018 年 3 月 29 日起任华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 11 月 20 日起任华富恒盛纯债债券型证券投资基金经理，自 2019 年 6 月 5 日起任华富货币市

					<p>场基金基金经理，自 2019 年 10 月 31 日起任华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 8 日起任华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 1 日起任华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 27 日起任华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理，自 2022 年 3 月 29 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，自 2022 年 11 月 17 日起任华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。</p>
尹培俊	<p>本基金基金经理、公司总经理助理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会委员</p>	<p>2021 年 11 月 8 日</p>	-	十六年	<p>兰州大学工商管理硕士，硕士研究生学历。曾任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任信用研究员、固定收益部总监助理、固定收益部副总监，自 2014 年 3 月 6 日起任华富强化回报债券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 日起任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 28 日起任华富可转债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 28 日起任华富安华债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 26 日起任华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 8 日起任华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 6 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。</p>

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 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

国内经济方面，四季度经济仍处于弱修复的探底阶段。11 月需求依旧偏弱，固定资产投资受地产投资拖累，剔除基数后延续下行趋势，地产销售、消费也进一步下滑。生产端，11 月工业生产剔除基数后明显回落，就业形势也依旧严峻。总体而言，11 月经济整体处于疲软的状态，地产与疫情的拖累可能仍是主要原因。随着疫情防控不断优化，疫情扰动可能逐步消除，消费有望于明年回稳。基建和制造业投资热度不减，地产端随着“三支箭”、稳地产金融 16 条等政策落地见效，明年一季度地产投资有望触底企稳。

通胀方面，11 月 CPI 增速放缓，PPI 下降，面临内需不足。11 月 CPI 低位运行，食品项也是涨幅大幅收窄。除了有 2021 年 11 月基数较其他月份较高原因，内需不足也是影响 CPI 的主要因素，如核心 CPI 延续一致的弱势，PPI 降幅也是与前值持平。11 月天气寒冷，多地受疫情影响较大，线下消费均低迷。

政策方面，财政政策年末主要消化前期的政策支持，包括政策性开发性金融工具的落地，专项债限额空间的使用等，增量政策有限。货币政策方面，从 11 月债券大跌之后公开市场操作、降准等一系列动作看出，央行在主动操作上仍以维持合理充裕为主基调。11 月之后社融低迷主要是债市调整的拖累，理财产品的赎回补充了居民和非银机构的存款量，M2 与社融存量同比增速差扩大，流动性淤积在银行系统，未来的改善程度还需要关注地产和疫情走向。

债券市场方面，四季度债券市场先涨后跌，跌幅较近年来较大。11 月市场收益率大幅上行调整，10 年国债上行 25bp。信用债方面 11 月债市信用利差走扩，各条曲线均上行 50-80bp。等级利差分化，期限利差收窄，曲线走向熊平。虽然基本面并未在一个月内发生质的变化，但由于预期变化，债市的核心逻辑发生变化。11 月中上旬疫情防控优化政策与支持房地产发展十六条措施先后公布，前期压制经济基本面的两座“大山”松动，预期发生转向，带动利率迅速上行，引发理财赎回风波，加剧市场踩踏情绪。12 月债券抛压缓解，但赎回负循环仍很难打破，叠加配置力量较弱，信用债弱勢震荡。

本季度，华富吉丰中短债基金于三季度末开始主动缩短久期，降低组合杠杆，提高组合抗风险能力。同时在债券市场发生踩踏行情时，也进行部分资产的变现，以预防逐渐到期的赎回压力的累积。虽然本季度本基金相较于之前的操作转向保守，但由于债券市场短期调整幅度很大，也超过了部分持有人的预期，因此在充分理解持有人的风险偏好的同时，也将继续将控制波动作为组合管理重要的部分。

本轮下跌行情本质是由于资金边际收紧叠加防疫与地产政策发生优化，导致货币政策预期与基本面预期双双反转，带动市场情绪走弱。叠加年底机构考核压力和散户净值化教育欠缺，负向反馈难以快速打破。因此短期来看，中短债产品仍将以防守方式应对。经济基本面四季度的走弱已经在预期之中，防疫和地产政策的刺激效果短时间也无法被证伪。从传统分析框架看，2.9 以上的 10 年国债绝对位置已经超出年初水平、明显高于 MLF 利率，收益率定价相对较高。且从历史来说，10 年期国债收益率明显向上突破 MLF 利率的时期，往往伴随着经济数据好转、货币政策收紧，目前暂不支持，从理性角度经验上，后续长债上行的空间有限。展望一季度，我们认为预期和基本面仍有互相修正的空间，债券波段机会仍然不少，同时由于前期调整幅度大，短债的性价比提升明显，待开门红资金回归，短端的确定性提高，仍有波段机会。

本基金将以短久期、合理杠杆的配置，在债券市场震荡中精选已经调整出性价比的资产，同时调整组合各类资产配比，在兼顾流动性的基础之上，利用信用债阶段性抛压机会，合理提高组合静态，降低久期，提高收益的确定性，提高抗风险能力。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富吉丰 60 天滚动持有中短债 A 份额净值为 1.0534 元，累计份额净值为 1.0534 元。报告期，华富吉丰 60 天滚动持有中短债 A 份额净值增长率为-0.67%，同期业绩比较基准收益率为-0.51%。

截止本期末，华富吉丰 60 天滚动持有中短债 C 份额净值为 1.0502 元，累计份额净值为 1.0502 元。报告期，华富吉丰 60 天滚动持有中短债 C 份额净值增长率为-0.73%，同期业绩比较基准收益率为-0.51%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,889,782,542.88	98.86
	其中：债券	4,889,782,542.88	98.86
	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	8,084,054.88	0.16
8	其他资产	48,232,975.93	0.98
9	合计	4,946,099,573.69	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	262,724,268.50	6.58
	其中：政策性金融债	212,027,967.13	5.31
4	企业债券	1,487,605,911.10	37.27
5	企业短期融资券	1,208,138,389.02	30.27
6	中期票据	1,931,313,974.26	48.39
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,889,782,542.88	122.50

### 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	102000942	20 建邺高科 MTN001	700,000	71,133,789.04	1.78
2	200202	20 国开 02	700,000	70,917,421.92	1.78
3	220206	22 国开 06	700,000	70,733,638.36	1.77
4	012283432	22 中原资产 SCP002	700,000	70,583,128.77	1.77
5	220211	22 国开 11	700,000	70,376,906.85	1.76

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行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	135,679.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	48,097,296.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	48,232,975.93

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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

项目	华富吉丰 60 天滚动持有中短债 A	华富吉丰 60 天滚动持有中短债 C
报告期期初基金份额总额	519,137,120.15	3,918,426,366.91

报告期期间基金总申购份额	255,521,485.83	3,304,081,430.14
减:报告期期间基金总赎回份额	428,384,429.13	3,769,007,987.92
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	346,274,176.85	3,453,499,809.13

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金托管协议

- 3、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富吉丰 60 天滚动持有中短债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 1 月 20 日