

华富安盈一年持有期债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 21 日

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|--|---------------|
| 基金简称 | 华富安盈一年持有期债券 | |
| 基金主代码 | 013211 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 8 月 26 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,412,403,372.50 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 | 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。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5% | |
| 风险收益特征 | 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。 本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华富安盈一年持有期债券 A | 华富安盈一年持有期债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013211 | 013212 |

| | | |
|---------------------|--------------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 1,311,132,684.68 份 | 101,270,687.82 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 (20 23 年1 月1 日- 2023 年3 月 31 日) |
|------------------------|---|
| | 华富 安盈 一年 持有 期 债券 A |
| 1. 本 期已 实现 收益 | 14,035,428.168 |
| 2. 本 期利 润 | 34,209,845.4 |

| | | |
|-----------------|--------------|----------------|
| | | 2 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0002 | 0.0007 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,228,065.13 | 953,351,147.90 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9476 | 0.9415 |

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

华富安盈一年持有期债券 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 | -0.02% | 0.29% | 0.57% | 0.11% | -0.59% | 0.18% |
| 过去六个月 | -0.31% | 0.37% | 0.85% | 0.14% | -1.16% | 0.23% |
| 过去一年 | 0.62% | 0.36% | 0.68% | 0.13% | -0.06% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | -5.24% | 0.35% | -0.39% | 0.13% | -4.85% | 0.22% |

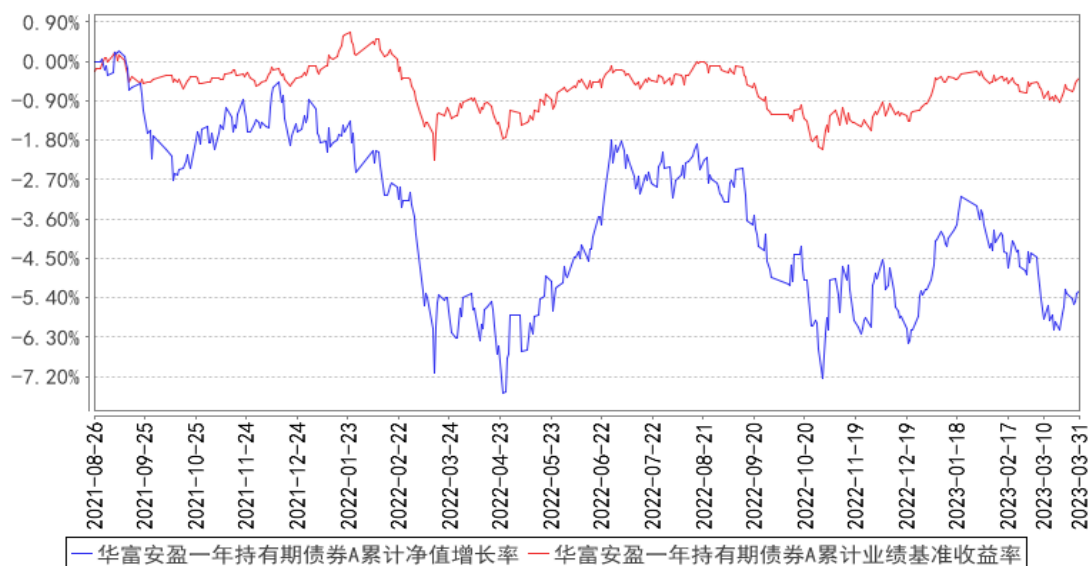
华富安盈一年持有期债券 C

| 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 | -0.13% | 0.29% | 0.57% | 0.11% | -0.70% | 0.18% |
| 过去六个月 | -0.51% | 0.37% | 0.85% | 0.14% | -1.36% | 0.23% |
| 过去一年 | 0.21% | 0.36% | 0.68% | 0.13% | -0.47% | 0.23% |
| 自基金合同 生效起至今 | -5.85% | 0.35% | -0.39% | 0.13% | -5.46% | 0.22% |

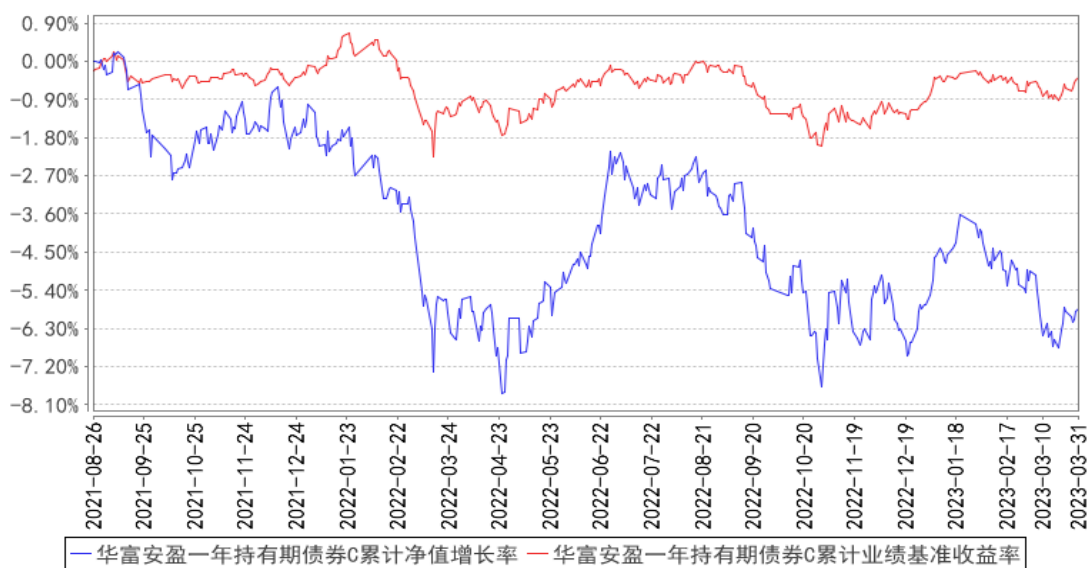
注：本基金业绩比较基准=中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*5%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%。

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

华富安盈一年持有期债券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



华富安盈一年持有期债券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图



注：根据《华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通投资标的股票的比例占股票资产的比例为 0%-50%）；每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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；本基金投资可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券的比例不高于基金资产的 20%。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。本基金建仓期为 2021 年 8 月 26 日到 2022 年 2 月 26 日，建仓期结束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《华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的各项规定。

§ 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 | | |
| 尹培俊 | 本基金基金经理、公司总经理助理、固 | 2021 年 8 月 26 日 | - | 十七年 | 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 |

| | | | | |
|--|-----------------------------|--|--|---|
| | <p>定收益部总监、公司公募投资决策委员会委员</p> | | | <p>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《证券投资基金经营机构董事、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

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

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

流动性预期改善下有所反弹。

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

本基金在一季度以两年左右中高等级中短久期信用债为底仓配置，股票资产整体保持较高仓位，但风格上以 A 股新能源、白马军工等成长制造方向和港股互联网平台、低估值周期品、地产链和疫后复苏方向为主均衡配置，但在 A 股存量博弈的市场环境下，配置方向和以 TMT 为主的行情表现有较大的偏差，港股市场也出现显著调整，导致股票仓位负向贡献；转债部分以银行、券商、水电、交运等低估值和中低价位品种作为底仓配置，同样受到股市风格的不利影响。由于风险资产结构负向拖累显著，组合净值在一季度的表现显著不及预期。

展望 2023 年二季度，从大类资产配置的角度维持超配权益类风险资产的预判。国内方面，市场对于宏观经济弱复苏的方向与级别基本没有太大分歧，对于经济复苏的方向普遍认可而对复苏的高度也普遍谨慎。海外方面，预计二季度美国劳动力市场继续降温，通胀的制约也逐渐缓解，美联储二季度较高概率，最后一次加息结束。叠加近期中国在外交与人民币结算方面动作相对积极，预计二季度仍然会呈现人民币资产较强、美元走弱的格局。

在资产配置上，债券的胜率仍不低，但性价比不算有吸引力，债券市场在经济弱复苏背景下，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，且随着疫后复苏存在胜率走低的可能，更多的是围绕票息收入与把握阶段性长端利率的机会。而股票与可

转债市场基本处于中长期底部区间，预计在上市公司一季报后投资主线会更加清晰，现阶段仍维持对风险资产的高度重视。权益市场方面，在“海外流动性与经济衰退担忧、国内具备防火墙负向冲击有限但受益于加息提前结束”的框架下，风险偏好与估值仍有修复空间。从行业配置上，需要注意的是本轮 AIGC 的产业升级规格是很高的，高于 18-19 年 5G 的级别，甚至可以和 13-15 年“互联网+”以及 19-21 年新能源的级别相媲美，那么在主题投资热情退却后，人工智能领域相对景气度明确或商业模式清晰的细分领域和标的仍是值得去积极把握的。除此之外，具备中国优势的高端制造、消费与医疗领域的白马资产在一季报后预计也能赚到“业绩的钱”。本基金对于行业配置做了一定的调整，以 TMT、高端制造（光储、军工等）、地产、周期、大消费板块相对平衡配置。可转债方面，整体性价比不算高但也没有明显的泡沫，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。

本基金仍然以 2 年左右的高等级信用债配置为主，票息策略优于久期策略；股票配置重于均衡，保持较高港股仓位，转债以平衡型和精选中低价为主要配置方向，加强低溢价偏股个券挖掘机会。中期而言，本基金将根据性价比进一步平衡股债配置比例，股票仓位仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念，寻找具有估值优势或拥有优势赛道具备长期成长性的企业。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，稳健地做好配置策略，均衡投资，降低业绩波动，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，华富安盈一年持有期债券 A 份额净值为 0.9476 元，累计份额净值为 0.9476 元。报告期，华富安盈一年持有期债券 A 份额净值增长率为-0.02%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%。截止本期末，华富安盈一年持有期债券 C 份额净值为 0.9415 元，累计份额净值为 0.9415 元。报告期，华富安盈一年持有期债券 C 份额净值增长率为-0.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%。

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基金持有人数不足 200 人或基金资产净值低于 5000 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 | 265,652,645.77 | 14.45 |
| | 其中：股票 | 265,652,645.77 | 14.45 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,504,092,980.16 | 81.84 |
| | 其中：债券 | 1,504,092,980.16 | 81.84 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 56,540,242.89 | 3.08 |
| 8 | 其他资产 | 11,518,911.88 | 0.63 |
| 9 | 合计 | 1,837,804,780.70 | 100.00 |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 111,821,450.55 元，占期末净值比例为 8.36%。

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 | - | - |
| C | 制造业 | 105,147,834.30 | 7.86 |
| 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 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 15,601,760.92 | 1.17 |
| J | 金融业 | 12,018,000.00 | 0.90 |
| K | 房地产业 | 4,572,000.00 | 0.34 |
| L | 租赁和商务服务业 | 16,491,600.00 | 1.23 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 153,831,195.22 | 11.50 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 基础材料 | - | - |
| 非日常生活消费品 | 40,367,343.63 | 3.02 |
| 日常消费品 | 7,610,814.54 | 0.57 |
| 能源 | - | - |
| 金融 | 16,034,009.56 | 1.20 |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | 9,229,964.12 | 0.69 |
| 信息技术 | - | - |
| 通信服务 | 23,641,322.46 | 1.77 |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | 14,937,996.24 | 1.12 |
| 合计 | 111,821,450.55 | 8.36 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 00700 | 腾讯控股 | 70,000 | 23,641,322.46 | 1.77 |
| 2 | 601888 | 中国中免 | 90,000 | 16,491,600.00 | 1.23 |
| 3 | 00688 | 中国海外发展 | 900,000 | 14,937,996.24 | 1.12 |
| 4 | 02020 | 安踏体育 | 125,000 | 12,474,592.50 | 0.93 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 600,000 | 12,018,000.00 | 0.90 |
| 6 | 688599 | 天合光能 | 220,000 | 11,459,800.00 | 0.86 |
| 7 | 03690 | 美团-W | 87,000 | 10,929,056.15 | 0.82 |
| 8 | 09922 | 九毛九 | 620,000 | 10,138,648.46 | 0.76 |
| 9 | 600426 | 华鲁恒升 | 280,000 | 9,870,000.00 | 0.74 |
| 10 | 300687 | 赛意信息 | 239,932 | 9,311,760.92 | 0.70 |

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 | 70,205,161.23 | 5.25 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 991,280,127.68 | 74.10 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| 6 | 中期票据 | 184,322,049.77 | 13.78 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 258,285,641.48 | 19.31 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,504,092,980.16 | 112.43 |

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 | 188607 | 21 沪盛 01 | 700,000 | 71,199,876.71 | 5.32 |
| 2 | 152826 | 21 浦集 01 | 600,000 | 61,999,019.18 | 4.63 |
| 3 | 149530 | 21 赣水 01 | 500,000 | 51,420,109.59 | 3.84 |
| 4 | 102101323 | 21 萧山国资 MTN001 | 500,000 | 51,332,391.78 | 3.84 |
| 5 | 102101415 | 21 东浩兰生 MTN001（权益出 资） | 500,000 | 51,212,293.15 | 3.83 |

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

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 | 42,937.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | 11,465,770.32 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 10,204.39 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 11,518,911.88 |

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 | 110079 | 杭银转债 | 30,995,830.79 | 2.32 |
| 2 | 113044 | 大秦转债 | 29,358,345.21 | 2.19 |
| 3 | 132018 | G 三峡 EB1 | 27,314,246.58 | 2.04 |
| 4 | 127020 | 中金转债 | 19,422,949.93 | 1.45 |
| 5 | 110073 | 国投转债 | 17,668,113.97 | 1.32 |
| 6 | 113057 | 中银转债 | 15,114,626.71 | 1.13 |
| 7 | 110075 | 南航转债 | 14,952,402.47 | 1.12 |
| 8 | 123107 | 温氏转债 | 12,834,657.53 | 0.96 |
| 9 | 128131 | 崇达转 2 | 12,285,162.74 | 0.92 |
| 10 | 127032 | 苏行转债 | 11,243,811.41 | 0.84 |
| 11 | 113050 | 南银转债 | 10,607,044.93 | 0.79 |
| 12 | 113043 | 财通转债 | 10,408,728.77 | 0.78 |
| 13 | 127012 | 招路转债 | 8,279,801.37 | 0.62 |
| 14 | 128142 | 新乳转债 | 7,286,276.71 | 0.54 |
| 15 | 113025 | 明泰转债 | 7,239,612.33 | 0.54 |
| 16 | 113048 | 晶科转债 | 7,085,498.10 | 0.53 |
| 17 | 127031 | 洋丰转债 | 6,666,920.55 | 0.50 |
| 18 | 127052 | 西子转债 | 4,732,695.89 | 0.35 |
| 19 | 128074 | 游族转债 | 2,407,093.15 | 0.18 |
| 20 | 113633 | 科沃转债 | 1,326,852.53 | 0.10 |

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 | 华富安盈一年持有期债券 A | 华富安盈一年持有期债券 C |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,445,275,901.51 | 106,289,941.86 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 144,393.04 | 121,203.78 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 134,287,609.87 | 5,140,457.82 |
| 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 | 1,311,132,684.68 | 101,270,687.82 |

§ 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 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 |

| | | 比例达到或者超过 20% 的时间区间 | | | | | |
|--------|---|--------------------|---|---|---|---|---|
| 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、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富安盈一年持有期债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2023 年 4 月 21 日