

华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	5,837,313,658.19 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。</p>

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的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。

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。

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

	<p>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；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标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>	
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%	
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。	
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	307,075,875.56 份	5,530,237,782.63 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 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)	
	华富吉丰 60 天滚动持有期中短债 A	华富吉丰 60 天滚动持有期中短债 C
1. 本期已实现收益	1,467,886.95	18,540,781.97
2. 本期利润	4,425,197.20	57,607,380.88
3. 加权平均基金份额	0.0150	0.0142

额本 期利 润		
4. 期 末基 金资 产净 值	32,807,134.62	5,887,560.28
5. 期 末基 金份 额净 值	1.0684	1.0646

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	1.42%	0.02%	0.20%	0.02%	1.22%	0.00%
过去六个月	0.74%	0.04%	-0.31%	0.04%	1.05%	0.00%
过去一年	4.12%	0.04%	-0.04%	0.03%	4.16%	0.01%
自基金合同 生效起至今	6.84%	0.04%	0.25%	0.03%	6.59%	0.01%

华富吉丰 60 天滚动持有中短债 C

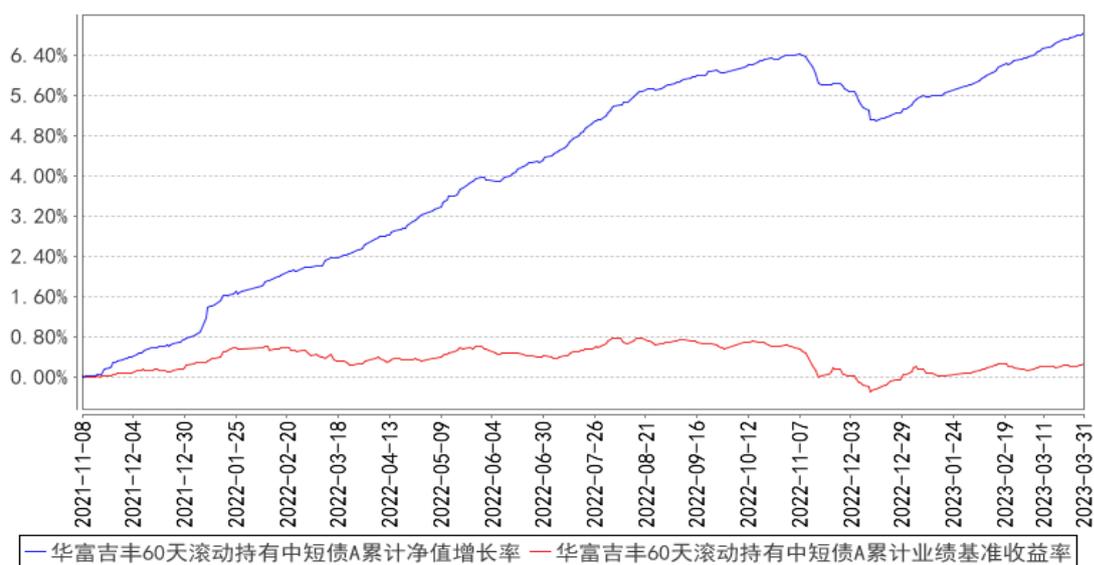
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
----	--------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

				准差④		
过去三个月	1.37%	0.02%	0.20%	0.02%	1.17%	0.00%
过去六个月	0.63%	0.04%	-0.31%	0.04%	0.94%	0.00%
过去一年	3.90%	0.04%	-0.04%	0.03%	3.94%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.46%	0.04%	0.25%	0.03%	6.21%	0.01%

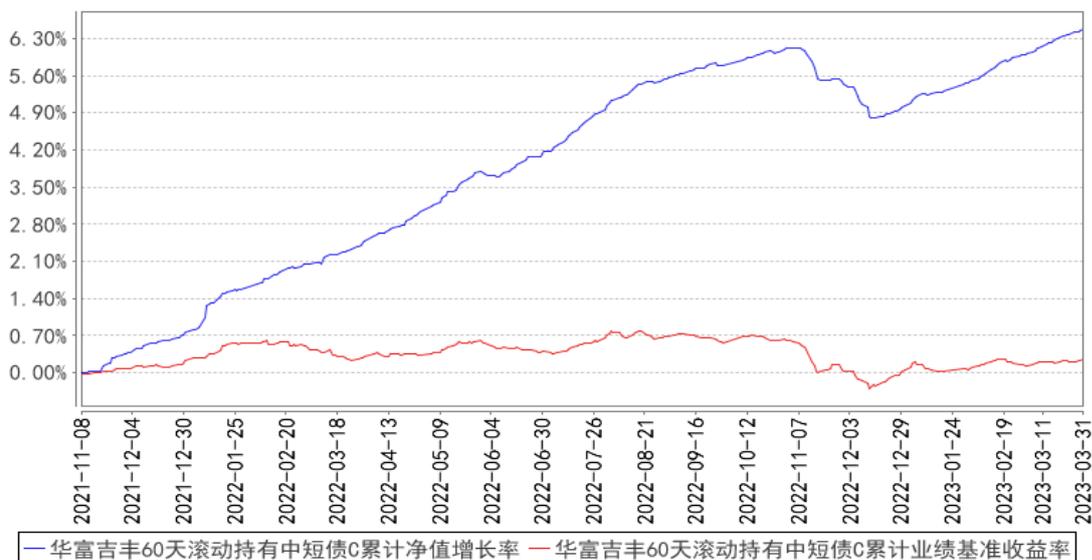
注：业绩比较基准=中债综合全价（1-3 年）指数收益率*80%+一年期定期存款基准利率（税后）*20%。

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		
尹培俊	本基金基金经理、公司总经理助理、固定收益部总监、公	2021 年 11 月 8 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

	<p>司公募 投资决 策委员 会委员</p>			<p>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>
<p>倪莉莎</p>	<p>本基金的 基金 经理</p>	<p>2021 年 11 月 8 日</p>	<p>-</p>	<p>九年 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基金经理，自 2019 年 6 月 5 日起任华富货币市场基金基金经理，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</p>

					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。
--	--	--	--	--	------------------------------

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

国内经济方面，继 1-2 月经济活动普遍迎来疫后复苏后，随着生活服务业等领域的受抑制需求进一步释放，3 月国内经济延续回暖态势。去年疫情防控措施收紧产生的低基数有望对大多数经济数据的同比表现形成提振。1-2 月工业增加值、固定资产投资和社零同比增速将分别为 2.4%、5.5% 和 3.5%。同期出口同比增速下滑为 -6.8%。目前住房销售回暖主要集中在大城市，而市场整体信心仍然相当低迷。国内出口继续面临外需疲软和地缘政治局势持续动荡带来的阻力。汽车制造商之间掀起价格战，意味着购车需求较为疲弱。

海外方面，美国 CPI 和 PCE 通胀读数的逐渐下行给予市场做紧缩结束和衰退开始的交易机会。但美国劳动力市场表现强劲，劳动供给改善，也反应了美国经济和通胀的韧性，二季度市场需更加关注美国通胀下行趋势的持续性以及就业情况的变化。另一方面，硅谷银行和瑞信银行带来的黑天鹅事件冲击，也反应在加息周期中欧美金融体系的问题，虽然各国央行积极采取行动避免了风险的进一步传导，但仍然降低了市场风险偏好，黄金和美债涨幅较大。

国内债券市场方面，一季度，国内、国际形势导致投资者风险偏好下降，对债券等低风险资产需求上升，债市成交活跃度同比上涨，而受春节假期因素影响，债市成交金额环比下降。信用利差方面，利差水平与去年同期相近，较 2022 年四季度信用利差整体向下修复，季末，在央行实现小幅回笼及降准落地的双重影响下，资金面平稳跨季，基本面升势放缓，利率债和信用债收益率呈现不同幅度的下行趋势，信用利差低位运行；后续信用利差或维持低位振荡，债券二级市场交易热点将跟随基本面修复方向和节奏展开。产业债方面，市场成交呈现相对保守的“短久期”特征以应对当前修复节奏偏慢且修复主线有待验证的基本面形势，成交产业债主体仍以 AAA 级别为主。城投债方面，成交特征表现为“短久期”和适度“资质下沉”，市场热点区域的省级平台以及高资质区县级平台债券成为投资热点。一季度，成交城投债的短久期投资特征较产业债更为明显。从重点区域来看，江苏、浙江等东部沿海城投债发行大省交易最为活跃，市场热点区域的省级平台以及高资质区县级平台债券为成交活跃标的。

利率债方面，一季度债市走势呈现出区间震荡的特征，最低点为 2.81%，最高点为 2.93%；1 年期国债收益率上涨明显，为 17.63bp，收益率曲线呈现出熊平走势。具体原因是，市场对经济复苏斜率进行了重新定价，从春节前较为乐观，到春节后平稳修复。公布的政策及经济数据表现喜忧参半，政府工作报告对经济增速目标及财政赤字率、专项债额度的设定均低于市场预期，通胀及进出口数据表明内需不足，但金融数据较好。1-3 月央行全口径净回笼资金，信贷投放较好，利率债净融资额高于过去两年同期，均会消耗银行的超储。资金利率从去年显著宽松到边际收敛，到在政策利率附近波动。

一季度，吉丰 60 天持有期中短债基金，坚持配置中高等级信用债。以票息策略为主，辅以信用债品种选择、波段操作和杠杆策略，为持有人在持有期内获取合理的收益。本基金管理人利用其信用研究团队深耕行业和个券，以及宏观利率研究团队对债券市场走势的判断，从自下而上和自上而下两个维度，提升组合的表现和控制波动，为持有人争取较好的持有体验。

展望二季度，目前经济复苏的斜率和持续性仍存在分歧，市场预期也是跟着各项数据的公布不断做出调整。核心原因在于房地产价格预期的改变及居民端风险偏好的降低，对需求持续释放强度的存疑。从社融存量月同比增速看，整体呈现出稳信用的特征。结合政府工作报告提出今年

的经济增长预期目标为 5%左右，预计二季度经济延续平稳修复逻辑。3 月央行超额续作 MLF，超预期降准落地，及跨季连续大额逆回购投放，均表明央行对流动性的呵护。二季度资金面或仍在政策利率附近波动，可期待结构性货币政策工具的出台。

本基金将继续利用多元的债券策略，精选个券与行业，严控融资成本，灵活使用杠杆和久期策略，在保持产品稳定性的同时，提升纯债产品流动性。提升持有人体验。

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 1.0684 元，累计份额净值为 1.0684 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 1.42%，同期业绩比较基准收益率为 0.20%。截止本期末，华富吉丰 60 天滚动持有中短债 C 份额净值为 1.0646 元，累计份额净值为 1.0646 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 1.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.20%。

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	6,254,431,892.73	98.86
	其中：债券	6,254,431,892.73	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	2,000,349.08	0.03
	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	13,971,384.38	0.22
8	其他资产	56,036,768.35	0.89
9	合计	6,326,440,394.54	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	838,740,906.57	13.49
	其中：政策性金融债	331,344,443.28	5.33
4	企业债券	1,833,453,572.96	29.50
5	企业短期融资券	1,351,895,598.48	21.75
6	中期票据	2,121,770,731.26	34.14
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	108,571,083.46	1.75
9	其他	-	-
10	合计	6,254,431,892.73	100.62

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	132280013	22 金融城建 GN001(可持续挂钩)	1,400,000	140,933,527.67	2.27
2	188854	21 兴业 C1	900,000	92,174,449.31	1.48
3	220308	22 进出 08	900,000	90,412,520.55	1.45
4	220216	22 国开 16	900,000	90,310,684.93	1.45
5	102280829	22 鄂联投 MTN003A	800,000	82,454,667.40	1.33

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

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中，国家开发银行、中国进出口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	124,998.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	55,911,769.52
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	56,036,768.35
---	----	---------------

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	346,274,176.85	3,453,499,809.13
报告期期间基金总申购份额	142,478,818.44	4,508,070,022.27
减：报告期期间基金总赎回份额	181,677,119.73	2,431,332,048.77
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	307,075,875.56	5,530,237,782.63

§ 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	期初	申购	赎回	持有份额

		有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	份额	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 4 月 21 日