

华富安业一年持有期债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 22 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 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 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华富安业一年持有期债券	
基金主代码	014385	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 6 日	
报告期末基金份额总额	125,513,418.45 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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富安业一年持有期债券 A	华富安业一年持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	014385	014386

报告期末下属分级基金的份额总额	96,154,300.76 份	29,359,117.69 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 10 月 1 日 - 2023 年 12 月 31 日)	
	华富安业一年持有期债券 A	华富安业一年持有期债券 C
1. 本期已实现收益	93,300,602.84	5,285.58
2. 本期利润	63,208,842.43	0.30080

3. 加权平均基金份额本期利润	0.005763	
4. 期末基金资产净值	9328,8485,7,99911.6.482	
5. 期末基金份额净值	0.097976403	

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

华富安业一年持有期债券 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	-0.50%	0.14%	0.13%	0.11%	-0.63%	0.03%
过去六个月	-0.91%	0.17%	-0.35%	0.10%	-0.56%	0.07%
过去一年	-1.22%	0.20%	0.71%	0.10%	-1.93%	0.10%
自基金合同 生效起至今	-2.36%	0.17%	0.44%	0.11%	-2.80%	0.06%

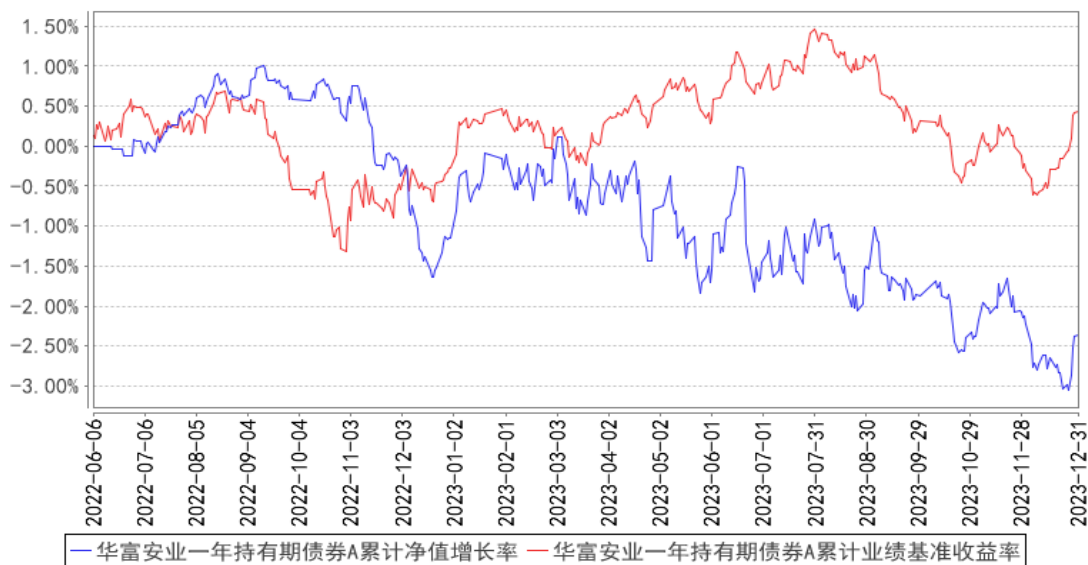
华富安业一年持有期债券 C

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	-0.59%	0.14%	0.13%	0.11%	-0.72%	0.03%
过去六个月	-1.10%	0.17%	-0.35%	0.10%	-0.75%	0.07%
过去一年	-1.62%	0.20%	0.71%	0.10%	-2.33%	0.10%
自基金合同 生效起至今	-2.97%	0.17%	0.44%	0.11%	-3.41%	0.06%

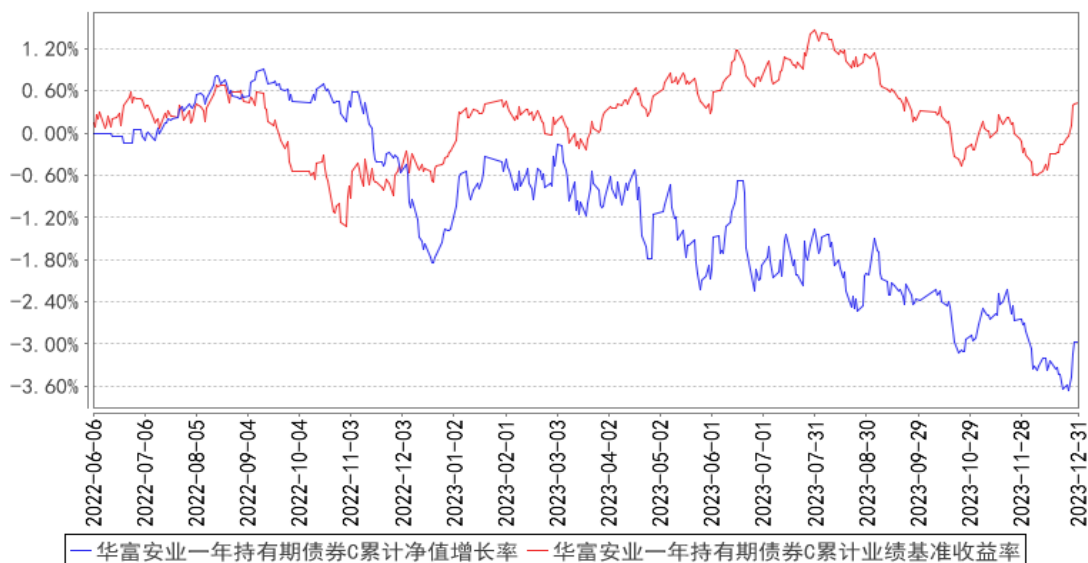
注：业绩比较基准收益率=中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收
益率（使用估值汇率调整）×5%

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

华富安业一年持有期债券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



华富安业一年持有期债券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：本基金建仓期为 2022 年 6 月 6 日至 2022 年 12 月 5 日，建仓期结束各项资产配置比例符合合同的约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富安业一年持有期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		
尹培俊	本基金基金经理、公司副总经理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会联席主席	2022 年 6 月 6 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 月加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用研究员、总监助理、副总监、公司总经理助理，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 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，自 2023 年 7 月 28 日起任华富荣盛一年持有期混合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	2023 年 9 月 12 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。

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

国内方面，2023 年四季度宏观环境有企稳迹象但仍处在衰退末期，被动去库存周期的尾部，仍面临一些阶段性的压力。从数据来说，10、11、12 月官方制造业 PMI 分别为 49.5、49.4 和 49，尚处于荣枯线以下，其中，既有外部环境复杂性、严峻性、不确定性上升的拖累，也有国内有效需求不足的影响。但也能看到，政策端及时加大扶持力度。12 月政治局会议重提“先立后破”，或意在短期纠偏。具体政策上，财政端于四季度增发国债 1 万亿，用于 2023 年及 2024 年，货币端新增 PSL 投放 3500 亿以支持项目建设，产业端地产政策适度松绑，宏观政策一致性明显增强，持续释放偏积极的信号。

海外方面，全球结束加息周期，逐渐进入宽松定价阶段。自 23 年 9 月美联储议息会议暂停加息以来，四季度美国经济活动在韧性中边际放缓。失业率、通胀回落的趋势延续。在能源和房租分项回落的带动下，CPI 自 9 月 3.7% 的同比显著下行至 11 月的 3.1%。10 月在美债供给冲击较大、而需求较弱的情况下，金融条件紧缩，但随着 11 月 FOMC 会议开始释放鸽派信号、12 月联储主席提及降息展望，市场迅速大幅打入降息预期，10 年美债利率自 5% 左右持续下行至 3.7%。

资产表现方面，四季度市场延续了债强股弱的趋势。四季度债券市场波动较大，收益率先上后下，整体小幅下行。具体来说，10 月至 11 月，受特殊再融资债发行节奏加快影响，银行负债紧缺，银行间流动性边际紧张，叠加地产政策边际放松、宽信用预期升温，收益率曲线小幅上行。进入 12 月，多家国有大行开启新一轮存款利率下调，市场对后续央行公开市场降息的预期显著升温，推动收益率快速下行。尤其部分配置型机构出于考核等因素，对超长久期增配，导致超长端利率迅速下行。股票市场方面，四季度整体 A 股市场赚钱效应仍低迷，呈现明显的补跌甚至普跌行情，权重股跌幅相对显著，风格切换和行业轮动都很快，小盘股和尾盘股则表现不俗。具体来看，四季度全 A 指数下跌 3.84%，上证跌 4.36%，沪深 300 跌 7.00%，创业板指跌 5.62%，科创

50 跌 4.03%，四季度中信一级行业指数中仅四个行业收正，表现前五的行业分别是综合、煤炭、电子、农林牧渔、医药，涨幅分别为 5.69%、4.47%、3.95%、1.76%、-0.05%，煤炭为代表的红利资产以及生猪养殖板块、机构重仓的电子与医药是为数不多的亮点，跌幅最大的行业分别是建筑、电力设备及新能源、消费者服务、建材、房地产，分别录得-9.06%、-9.35%、-11.12%、-13.2%、-13.83%。可转债市场，由于权益市场赚钱效应持续低于预期，可转债市场四季度出现了一定程度的补跌，可转债对应正股指数下跌 0.07%的情况下，中证转债指数跌 3.22%，可转债指数跌 2.74%，转股溢价率净压缩了超过 2%的水平。条款博弈方面，强赎意愿陡然增强，12 月强赎概率一度高达 90%，并且近乎所有公告强赎的品种均实现负收益，在这种亏损概率加持下，高价趋势券的参与难度非常大，130 元平价附近的标的一度呈现负凸性特征。

本基金在下半年之后开始转型为低波固收+策略，四季度延续了此策略运行，主要目标是追求高 Calmar 比、净值中枢逐渐抬升，为追求尽量在多数情况下季度实现正回报，依照 CPPI 策略方式构建组合。首先，构建纯债底仓，底仓票息静态收益作为安全垫，因此本基金增加信用债底仓；其次，设置止损容忍度，即 3 个月内含权资产最大的回撤止损线，本基金设为含权资产 10% 止损；最后每 3 个月调整，通过底仓静态收益倒算含权资产仓位，本基金在四季度保持了目标仓位。但最终在市场持续赚钱效应低于预期的情况下，录得 0.5% 的负收益，反思原因在于持仓结构不够均衡、对权益敞口尤其是成长类资产还是稍微正向暴露、低估市场向下的力度，因此减仓不够坚决，未能在四季度实现基金正收益，未来的运作中一定会吸取教训。

国内方面，展望 2024 年一季度，预计在宏观政策持续发力的支持下，宏观数据或边际企稳回升，库存周期出现结构性被动补库存的态势。首先，结构上，保障性住房建设、“平急两用”公共基础设施建设、城中村改造等“三大工程”的快速推进或将成为经济企稳回升的重要动力。其次，财政或继续加力，地方政府专项债再度提前发放，去年 1 万亿增发国债大部分也将在今年投入使用，PSL 大概率还将继续投放。再次，人民币汇率已经稳定，通胀较低，都有利于央行继续放松货币政策。另外，2023 年一季度由于春节靠前，导致第二产业基数较低，加之今年一季度企业可能开启补库存，都有利于制造业复苏。最后，在“房住不炒”大基调下，地产政策近期再次适度松绑，也有利于地产相关数据短期企稳。

海外方面，美国经济预计一季度降息交易会有一定反复。由于居民部门获得了大量超额储蓄持续支撑零售销售的强劲，美国经济虽然注定衰退，但时间可能较市场预期（4-5 月份）偏晚。在不考虑提前降息的情况下，CPI 核心通胀预计至 2024 年 5 月下行至 2.2% 的低位，另一方面由于当前的劳动力仍处于供需紧平衡，缺口较疫情前有 100 万左右的余量，这将在短期对失业率的平稳起到安全垫的作用。整体看，美国 6 月进入大选后，不排除总统倒逼美联储提前降息，但我

们研究团队判断全年降息幅度依然可能不及当前美国 OIS 市场预期的近 120BP 的幅度。

资产赔率角度，截至 24 年第一周，A 股剔除金融、石油石化后的股权风险溢价（美债定价修正后）为 1.15%，处历史 87%分位，近 5 年 95%分位，近 3 年 99%分位；股债收益差（美债定价修正后）为-0.91%，处历史 94%分位，近 5 年 100%分位，近 3 年 100%分位；权益资产略便宜一些，全 A 非金融石油石化 PE26 倍，PB 是 2.0 倍，处在 10-30%的分位，而股息率则在近 1.75%的水平，处于历史极高分位。恒生指数 PE 为 8.1 倍，中短期与长期均处 5%分位以内。可转债百元修正溢价率为 25.3%，处于近一年 6%分位，但仍处在 20 年以来 60%分位，以及历史的 79%分位，性价比上比股票相对弱一些。

股票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。在去年 7-8 月“政策底”已经确立，“估值结构性底”主要在足够高的 A 股整体股息率水平上，当前处在“政策底”→“市场底”的磨底过程中。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，当前市场面临的比较棘手的问题在于：①海外资金的不认可；②国内资金尤其是机构资金负债端的压力；③政策预期不明晰。但当前资产的估值的确处在低位，市场似乎过于纠结于宏观层面的长期悲观、但忽视了部分企业的长期竞争力。另外 H 股估值横向与纵向均处于低洼处，仍具较好的配置价值。

可转债方面，整体性价比逐步提高，根据我们研究团队拟合的 100 平价溢价率于年中大概处在 25-26%水平，中位数 118 元的水平给反弹留有空间。但考虑到影响经济基本面和权益趋势性反转的核心因素还未出现明显向好信号，形成趋势性上涨合力还比较难，倾向于市场围绕估值中枢区间震荡，所以需要把握交易节奏。风险在于一些尾部个券出现信用风险，可能导致转债急跌，不过市场的学习效应很强，可能很快调整到位企稳，但遇到这种超跌时也是很好的交易机会。

信用债与利率债方面，从赔率角度看，当前利率债绝对收益率及期限利差均处于历史低位，历史维度下，利率债赔率偏低，信用债整体利差水平也较低，期限利差、等级利差、银行二永和非金融永续债等品种利差均已压缩到历史较低的水平，继续单边压缩空间不大。但考虑到当前经济企稳回升的动力还不强劲，货币政策仍需要为经济企稳回升提供协助，预计一段时间内低利率的环境还会持续。目前以中性杠杆、中性久期、票息策略为主。

在整体资产配置上，本基金后续计划保持低波固收+定位，保持 CPPI 策略框架，根据底仓票息的安全垫动态控制含权资产的仓位，基于目前静态收益安全垫，计划控制权益仓位在 10%上下，并于未来每个季度内对于权益仓位保持严格的止损指令，吸取 23 年四季度在运作上的一些教训，争取 24 年一季度获得稳健回报。

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，华富安业一年持有期债券 A 份额净值为 0.9764 元，累计份额净值为 0.9764 元。报告期，华富安业一年持有期债券 A 份额净值增长率为-0.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.13%。截止本期末，华富安业一年持有期债券 C 份额净值为 0.9703 元，累计份额净值为 0.9703 元。报告期，华富安业一年持有期债券 C 份额净值增长率为-0.59%，同期业绩比较基准收益率为 0.13%。

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	15,369,182.73	10.35
	其中：股票	15,369,182.73	10.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,638,280.35	80.56
	其中：债券	116,577,090.21	78.50
	资产支持证券	3,061,190.14	2.06
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,999,091.78	2.69
	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	3,463,363.70	2.33
8	其他资产	6,033,314.04	4.06
9	合计	148,503,232.60	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 6,136,299.73 元，占期末净值比例为 5.01%。

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	362,384.00	0.30

B	采矿业	1,677,540.00	1.37
C	制造业	5,492,995.00	4.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	329,500.00	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	294,000.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	367,680.00	0.30
J	金融业	163,615.00	0.13
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	123,079.00	0.10
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	422,090.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	9,232,883.00	7.55

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	1,485,611.76	1.21
日常消费品	-	-
能源	942,468.80	0.77
金融	978,965.33	0.80
医疗保健	1,089,412.38	0.89
工业	-	-
信息技术	271,412.89	0.22
通信服务	1,366,134.62	1.12
公用事业	2,293.95	0.00
房地产	-	-
合计	6,136,299.73	5.01

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	00883	中国海洋石油	80,000	942,468.80	0.77
2	601088	中国神华	30,000	940,500.00	0.77
3	00700	腾讯控股	3,500	931,231.67	0.76
4	600489	中金黄金	74,000	737,040.00	0.60
5	000063	中兴通讯	26,900	712,312.00	0.58
6	01299	友邦保险	9,000	555,014.44	0.45
7	02020	安踏体育	8,000	549,169.32	0.45
8	002050	三花智控	18,000	529,200.00	0.43
9	01316	耐世特	100,000	446,766.46	0.37
10	00941	中国移动	7,406	434,902.95	0.36

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	7,146,513.92	5.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,078,227.32	8.24
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	39,746,055.08	32.48
5	企业短期融资券	4,043,298.36	3.30
6	中期票据	50,494,602.19	41.26
7	可转债（可交换债）	5,068,393.34	4.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	116,577,090.21	95.27

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	092280108	22 中行二级资本债 02A	100,000	10,078,227.32	8.24
2	019709	23 国债 16	70,000	7,036,630.14	5.75
3	102382045	23 西永电子 MTN002	60,000	6,101,757.38	4.99
4	102380955	23 赣州建投 MTN001	50,000	5,266,510.93	4.30
5	102000486	20 西安高新 MTN001	50,000	5,208,470.49	4.26

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	199386	首城 01 优	30,000	3,061,190.14	2.50

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，中国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	28,681.64
2	应收证券清算款	6,003,632.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	999.52
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	6,033,314.04

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	1,468,784.11	1.20
2	127045	牧原转债	510,398.88	0.42
3	113044	大秦转债	407,158.55	0.33
4	113053	隆 22 转债	401,218.32	0.33
5	113056	重银转债	398,966.05	0.33
6	113052	兴业转债	397,452.74	0.32
7	110062	烽火转债	368,769.58	0.30
8	127058	科伦转债	344,096.40	0.28
9	123108	乐普转 2	275,017.81	0.22
10	113049	长汽转债	269,273.97	0.22
11	113045	环旭转债	227,256.93	0.19

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	华富安业一年持有期债券 A	华富安业一年持有期债券 C
报告期期初基金份额总额	137,154,004.40	38,182,269.09
报告期期间基金总申购份额	44,037.40	31,477.39
减：报告期期间基金总赎回份额	41,043,741.04	8,854,628.79
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	96,154,300.76	29,359,117.69

§ 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、华富安业一年持有期债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富安业一年持有期债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富安业一年持有期债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富安业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

2024 年 1 月 22 日