

华富安鑫债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：2022 年 10 月 26 日

§ 1 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 2022 年 10 月 25 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 07 月 01 日起至 2022 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	45,181,064.74 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-772,851.38

2. 本期利润	-1,986,494.63
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0444
4. 期末基金资产净值	50,463,966.56
5. 期末基金份额净值	1.1169

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

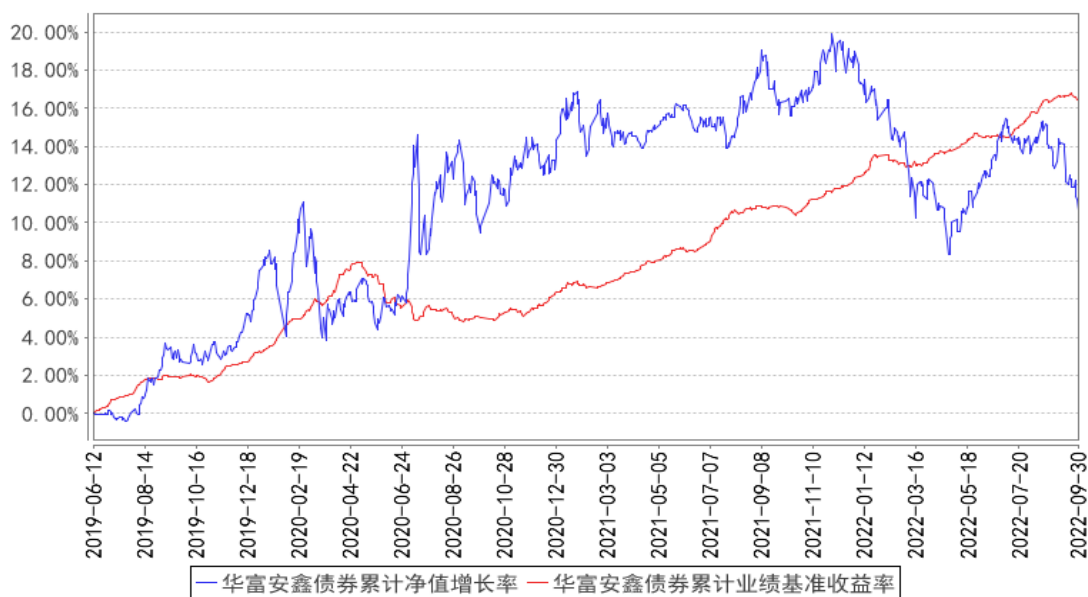
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.82%	0.33%	1.70%	0.06%	-5.52%	0.27%
过去六个月	-1.14%	0.36%	2.82%	0.06%	-3.96%	0.30%
过去一年	-4.82%	0.40%	5.05%	0.06%	-9.87%	0.34%
过去三年	7.81%	0.47%	14.29%	0.07%	-6.48%	0.40%
自基金合同 生效起至今	11.69%	0.45%	16.46%	0.07%	-4.77%	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

华富安鑫债券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：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。根据《华富安鑫债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；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	本基金的基金经理	2022 年 9 月 23 日	-	五年	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 日任华富可转债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、固定收益	2019 年 6 月 12 日	-	十五年	合肥工业大学产业经济学硕士、研究生学历，2007 年 6 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部助理行业研究员、

	部副总监			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 2018 年 8 月 28 日起任华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 4 月 02 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 2019 年 6 月 12 日起任华富安鑫债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 11 月 9 日起任华富永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，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

经济基本面方面，三季度国内持续处于衰退后期，经济景气度低迷、通胀结构分化而总体可控。国内疫情形势趋于严峻，叠加烂尾楼盘断贷风波，经济景气度整体处于偏低迷的状态。分结构来看，消费增速、地产投资增速分别受疫情管控、地产信用风险影响较大，二者的环比增速均低于历史同期水平。出口方面，三季度海外 PMI 加速下滑，受此影响，国内出口增速明显回落，对经济形成边际拖累。基建方面，受益于政策性金融工具投放及信贷政策宽松，基建资金较为充裕，基建投资增速持续位于双位数以上，是目前经济中最重要的拉动因素。国内通胀方面，CPI 方面，一方面受猪肉价格回升影响，CPI 同比增速逐步攀升，表观通胀较强。但如剔除猪肉等因素，另一方面，核心 CPI 同比增速并未超过 1.0%，反映经济偏弱背景下内需承压；PPI 方面，受全球衰退预期强化、国内景气度低迷影响，商品价格整体承压，对应 PPI 同比增速呈现明显的回落。

海外方面，全球仍陷入滞胀阶段。一方面，俄乌局势仍旧严峻，全球能源紧张格局持续，欧美央行持续加息，美联储 9 月 FOMC 会议加息 75BP，美元与美债收益率持续上升，且由于美国就业市场好于预期、核心 CPI 由于薪资与收入粘性高居不下，年内持续加息预期持续升温；另一方面，能源紧张与各国央行流动性收缩已经导致欧美经济持续走弱，欧洲制造业 PMI 三季度下滑至荣枯线下方，美国 9 月 PMI 下滑至接近荣枯线，总体而言，海外滞胀环境较为严峻。

从国内资本市场的表现来看，三季度利率债市场小幅走强而股票与可转债资产整体承压。7 月，国内疫情小幅反弹，烂尾楼断供停贷事件持续发酵，叠加总理公开讲话表示“不会为了过高增长目标而出台超大规模刺激措施”，债券市场对经济预期转为悲观，收益率持续下行。全月来看，10 年期国债收益率下行 5BP 至 2.76%。进入 8 月，佩洛西访台、PMI 回落、资金面宽松等一系列因素对债券市场形成支撑，收益率低位震荡。直至 8 月中旬，央行超预期降息点燃债市做多热情，当日各期限收益率明显下行。全月来看，10 年期国债收益率下行 14BP 至 2.62%。进入 9 月，受海外货币政策收紧影响，各类资产价格均出现一定程度的调整，债券也难免受到波及。同时由于 MLF 缩量、跨季等因素，资金利率有所抬升，也对债券市场形成了边际压力。综合来看，9 月收益率整体呈现震荡上行的特征。国内 A 股市场三季度各大指数持续向下调整，上证指数、沪

深 300、创业板指分别下跌 11.01%、15.16%、18.56%。从结构上看，7 月至 8 月上半月，中小市值股票持续上行而大市值板块已经出现回调，中证 1000 涨逾 4%而上证 50 跌逾 9%，8 月下半月开始至季度末，中小市值出现明显补跌，上证 50 跌 6.2%而中证 1000 跌接近 16%。行业表现方面，能源主线表现相对较好，成长主线、消费主线有所回调，申万一级行业指数涨跌幅居前 5 位的依次为煤炭、综合、公用事业、石油石化、通信，涨跌幅分别为 0.97%、-1.12%、-4.54%、-4.91%、-6.41%；下跌方面，建筑材料、电力设备、电子、汽车、传媒跌幅居前，涨跌幅分别为-23.98%、-18.01%、-17.58%、-17.10%、-16.64%。可转债方面，跟随权益市场调整，中证转债、可转债等权指数三季度分别下跌 3.82%和 4.97%，其中 8 月中之后分别下跌 6.3%和 10.4%，由于多数可转债对应正股为中小盘成长股，因此三季度先是延续上涨后快速补跌。权益市场下跌阶段可转债显现出一定的抗跌属性，全市场转股溢价率中位数也相应显著抬高，于 9 月底最高至接近 46%，达到历史 96%分位水平。

回顾三季度，组合于二季度净值反弹之后进行了结构型的微调，但预计中长期对于风险资产较高赔率的观点，未显著降低风险资产的仓位，而在 9 月出现了净值的再度回撤。7 月组合根据权益市场风格与行业配置观点，对于权益结构上向光伏设备、海上风电、储能、汽车智能化等中长期景气度具备相对优势的新能源板块稍作倾斜，也适度增加了煤炭、油运等传统能源板块，适度降低了医药、大金融等板块，在 7 月至 8 月中上旬取得了一定相对收益，但也在 9 月承受了一定程度的补跌。当前资产上新、老能源与消费、医药等板块为主。债券资产上，我们依然坚持以高等级信用债票息策略为主适度杠杆为辅的策略，可转债资产主要配置了低价位高票息的纯债替代品种，同时也在股性品种上对新能源设备类为代表的专精特新风格品种做了一定倾斜，同样在三季度前半段有所受益而在后半段有所受损。

展望四季度基本面，经济基本面预计维持国内衰退后期、海外滞胀后期的格局。国内经济或在偏弱的增速下企稳，上有消费、地产、出口制约，下有基建支撑。具体来说，消费端仍然受到消费场景缺失的约束，地产端也仍然受到地产信用风险的抑制，目前经济主要的堵点还需政策进一步的疏解。出口端，海外政策收紧的影响正逐步显现，预计四季度出口端可能对国内经济形成进一步的拖累。基建端，国常会新增 3000 亿政策性金融工具额度，要求依法用好 5000 多亿元专项债地方结存限额，预计四季度基建投资增速仍然可以维持在较高的水平。通胀方面，目前内需疲软的现实没有太多改变，预计后续核心 CPI 大概率围绕 1%中枢波动。PPI 则主要取决于国际大宗商品的走势，目前来看，海外央行整体表态偏鹰，预计商品价格仍然承压，对应 PPI 同比大概率易下难上。

海外方面，地缘政治格局依然复杂，大国博弈持续存在，主要经济体仍处在货币收紧阶段，

全球经济滞胀风险仍高，可以观测的变量包括俄乌局势与 11 月美国中期选举，年底至明年，预期全球将有滞胀环境逐步走向衰退，流动性也将边际宽松。

在资产配置上，债券的胜率仍高，但性价比不算有吸引力，更多的是围绕票息收入与把握阶段性长端利率的机会，而股票乃至可转债市场基本处于中长期底部区间，预计在年底前会处在摸底并出现胜率改善，现阶段仍维持对风险资产的高度重视。

债券市场方面，预计经济偏弱、货币偏松的格局不会有太多改变，债券仍然处于偏舒适的环境中。需要关注的是，海外政策收紧、国内潜在的政策变化均可能对债券市场形成扰动。但在流动性合理偏松的环境下，预计上述扰动对利率债市场的冲击不会太大。从绝对收益率层面，利率债经历了 9 月的调整，长端收益率上升至较为合理的水平，未来收益率继续向上大幅调整的空间并不大。策略上，重点关注后续长端利率调整后“跌出来的机会”。

权益市场整体赔率较高，股票的性价比优于债券，截止三季度末，全 A 非金融石油石化的股权风险溢价在 1.15% 左右，处于历史 91% 分位水平，近 5 年的 86% 分位，近 3 年的 94 分位。A 股剔除金融、石油石化后 TTM 的 PE 估值为 26.09 倍，处于历史 26% 分位；PB 为 2.27 倍，处于历史 27 分位。根据历史回归，沪深 300 隐含未来一年 40% 左右的回报率，当前 A 股从交易情绪和资产比价、估值面均进入底部区间。外部看，当前基本是流动性收紧斜率最高、滞胀预期强烈的阶段，地缘冲突近期再升级加上中美脱钩预期悲观，内部看，盈利底基本出现，像是 4 月的多重利空共振的组合，但国内的盈利底基本已经探明，年底至明年各项因素进一步恶化的概率已经很低，因此 A 股向下空间有限，当前阶段更建议根据三季报“布局明年”，尤其重视中国“比较优势资产”（具备优势的高端制造、成本压力与疫情影响减弱后的必需消费品）。结构上，围绕三个方面，一是具备中长期景气度优势的新能源相关的优势制造板块，包括光伏、风电、储能、电动车智能化，也包括军工、机器人等，需要关注需求仍旺盛，且产业链供给短板不明显的领域，结合半年报考察估值与业绩的匹配度，二是疫后消费复苏板块，也需要业绩基本相对有优势或反转确定性高的标的，三是全球商品大通胀的环境有所缓解后，受益于原材料见顶回落后甄选供给缺口缓解、毛利率回升的产业链中下游。

可转债方面，截止三季度末，可转债全市场转股溢价率中位数为 45.7%，近三年 92% 分位，纯债溢价率中位数为 24.5%，历史 59% 分位，近三年 25% 分位。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，可转债性价比略高于（也很难回到）合理水平。短期来看，当前需要警惕的风险点是需提防的是“信用下沉何时到尽头”、潜在的赎回潮和中小盘成长风格持续走弱，而积极的当面在于，一方面权益市场政策底、盈利最低点已过，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。下半年将在控制整体组合溢价率的情况下把握结构性机

会，围绕选股思路的正股替代与中低价位的纯债替代两个维度展开：一是高票息的底仓类转债，可以选股息收益高、溢价率相对低的品种，但需要对评级相对谨慎；二是半年内不赎回、溢价率较低的“专精特新”风格进攻品种（多集中在新能源、周期涨价品），需根据季报的景气度聚焦。

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 1.1169 元，累计份额净值为 1.4949 元。报告期，本基金份额净值增长率为-3.82%，同期业绩比较基准收益率为 1.70 %。

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	9,924,103.26	18.10
	其中：股票	9,924,103.26	18.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,124,061.09	78.64
	其中：债券	43,124,061.09	78.64
	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	791,565.56	1.44
8	其他资产	994,250.26	1.81
9	合计	54,833,980.17	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	381,640.00	0.76
B	采矿业	586,461.00	1.16
C	制造业	6,138,666.26	12.16
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	373,902.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	515,592.00	1.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	773,334.00	1.53
K	房地产业	433,358.00	0.86
L	租赁和商务服务业	356,850.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	364,300.00	0.72
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	9,924,103.26	19.67

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	000596	古井贡酒	1,600	435,120.00	0.86
2	300316	晶盛机电	6,400	432,768.00	0.86
3	000568	泸州老窖	1,800	415,188.00	0.82
4	002714	牧原股份	7,000	381,640.00	0.76
5	600519	贵州茅台	200	374,500.00	0.74
6	603233	大参林	12,340	373,902.00	0.74
7	601088	中国神华	11,400	360,696.00	0.71
8	601888	中国中免	1,800	356,850.00	0.71
9	000333	美的集团	7,000	345,170.00	0.68
10	300751	迈为股份	700	338,772.00	0.67

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	15,542,640.38	30.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	9,802,571.79	19.42
5	企业短期融资券	3,067,680.82	6.08
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	14,711,168.10	29.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,124,061.09	85.46

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	91,680	9,294,367.69	18.42
2	019674	22 国债 09	61,910	6,248,272.69	12.38
3	149386	21 北港 01	35,000	3,687,601.92	7.31
4	188179	21 华创 01	30,000	3,088,524.66	6.12
5	012280576	22 高速地产 SCP001	30,000	3,067,680.82	6.08

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，上海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	5,100.41
2	应收证券清算款	216,717.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	772,432.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	994,250.26

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	120002	18 中原 EB	1,407,672.82	2.79
2	113044	大秦转债	1,084,982.48	2.15
3	113042	上银转债	1,057,934.30	2.10
4	113037	紫银转债	1,015,860.91	2.01
5	113056	重银转债	999,330.67	1.98
6	128138	侨银转债	535,529.95	1.06
7	123049	维尔转债	516,934.83	1.02
8	113584	家悦转债	508,421.33	1.01
9	113052	兴业转债	502,047.67	0.99
10	128108	蓝帆转债	500,926.96	0.99
11	123104	卫宁转债	496,622.72	0.98
12	132018	G 三峡 EB1	457,093.70	0.91
13	127036	三花转债	320,952.82	0.64
14	123121	帝尔转债	280,448.48	0.56
15	127058	科伦转债	263,895.76	0.52
16	113634	珀莱转债	253,775.78	0.50
17	113626	伯特转债	251,412.67	0.50
18	110056	亨通转债	234,722.10	0.47
19	113641	华友转债	204,673.12	0.41
20	127030	盛虹转债	193,038.99	0.38

21	128111	中矿转债	178,400.92	0.35
22	113025	明泰转债	173,076.84	0.34
23	128109	楚江转债	156,000.99	0.31
24	128140	润建转债	151,053.73	0.30
25	128106	华统转债	149,380.16	0.30
26	123108	乐普转 2	148,707.78	0.29
27	128121	宏川转债	147,455.36	0.29
28	123090	三诺转债	145,937.90	0.29
29	128017	金禾转债	138,910.25	0.28
30	127038	国微转债	134,969.55	0.27
31	113537	文灿转债	129,315.56	0.26
32	128029	太阳转债	111,525.31	0.22
33	128095	恩捷转债	110,123.46	0.22
34	113618	美诺转债	106,341.77	0.21
35	127050	麒麟转债	75,721.82	0.15
36	127037	银轮转债	72,293.19	0.14
37	123120	隆华转债	67,438.80	0.13
38	128141	旺能转债	34,085.85	0.07
39	132022	20 广版 EB	21,006.75	0.04
40	113047	旗滨转债	20,142.95	0.04
41	113050	南银转债	19,229.55	0.04
42	113030	东风转债	7,041.95	0.01
43	123105	拓尔转债	1,319.98	0.00
44	127027	靖远转债	1,307.98	0.00
45	127024	盈峰转债	1,054.73	0.00
46	110073	国投转债	1,043.01	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	44,990,079.22
报告期期间基金总申购份额	1,314,812.57
减：报告期期间基金总赎回份额	1,123,827.05
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	45,181,064.74

§ 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	2,646,054.54
报告期期间买入/申购总份额	687,773.59
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	3,333,828.13
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	7.38

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	基金转换入	2022-9-30	687,773.59	772,025.85	0
合计			687,773.59	772,025.85	

§ 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	1	2022.7.1-2022.9.30	20,420,007.28	0.00	0.00	20,420,007.28	45.2000
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

2022 年 10 月 26 日