

# 华富恒利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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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            | 华富恒利债券  |              |
| 基金主代码           | 001086  |              |
| 基金运作方式          | 契约型开放式  |              |
| 基金合同生效日         | 2015 年 8 月 31 日   |              |
| 报告期末基金份额总额      | 50,325,348.93 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            | 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，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于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           | 招商银行股份有限公司  |              |
| 下属分级基金的基金简称     | 华富恒利债券 A  | 华富恒利债券 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 001086  | 001087       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 50,152,920.53 份   | 172,428.40 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 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日） |            |
|-----------------|-------------------------------------|------------|
|                 | 华富恒利债券 A                            | 华富恒利债券 C   |
| 1. 本期已实现收益      | 68,435.33                           | -2,130.58  |
| 2. 本期利润         | -6,353,465.45                       | -14,389.46 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0584                             | -0.0697    |
| 4. 期末基金资产净值     | 55,053,532.62                       | 183,315.93 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.098                               | 1.063      |

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

华富恒利债券 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      | -6.71% | 0.47%     | 1.70%      | 0.06%         | -8.41%  | 0.41% |
| 过去六个月      | -5.83% | 0.41%     | 2.82%      | 0.06%         | -8.65%  | 0.35% |
| 过去一年       | -7.26% | 0.38%     | 5.05%      | 0.06%         | -12.31% | 0.32% |
| 过去三年       | 6.53%  | 0.39%     | 14.29%     | 0.07%         | -7.76%  | 0.32% |
| 过去五年       | 7.23%  | 0.38%     | 27.99%     | 0.07%         | -20.76% | 0.31% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.09% | 0.33%     | 35.49%     | 0.07%         | -21.40% | 0.26% |

华富恒利债券 C

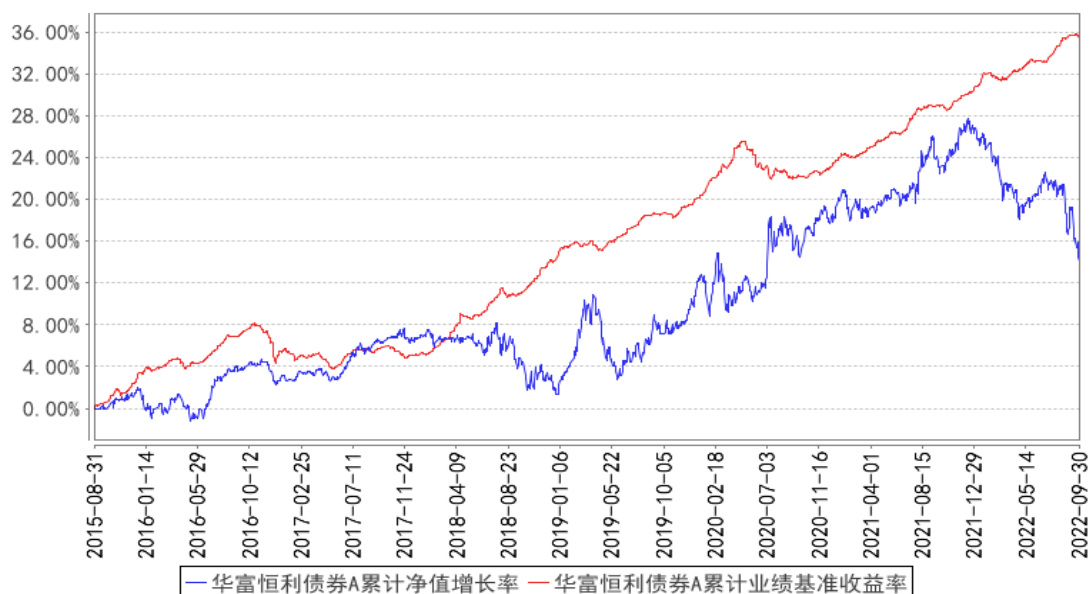
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -6.84% | 0.48%     | 1.70%      | 0.06%         | -8.54% | 0.42% |
| 过去六个月 | -6.10% | 0.42%     | 2.82%      | 0.06%         | -8.92% | 0.36% |

|                |        |       |        |       |         |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去一年           | -7.73% | 0.38% | 5.05%  | 0.06% | -12.78% | 0.32% |
| 过去三年           | 3.07%  | 0.40% | 14.29% | 0.07% | -11.22% | 0.33% |
| 过去五年           | 2.88%  | 0.38% | 27.99% | 0.07% | -25.11% | 0.31% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 8.33%  | 0.34% | 35.49% | 0.07% | -27.16% | 0.27% |

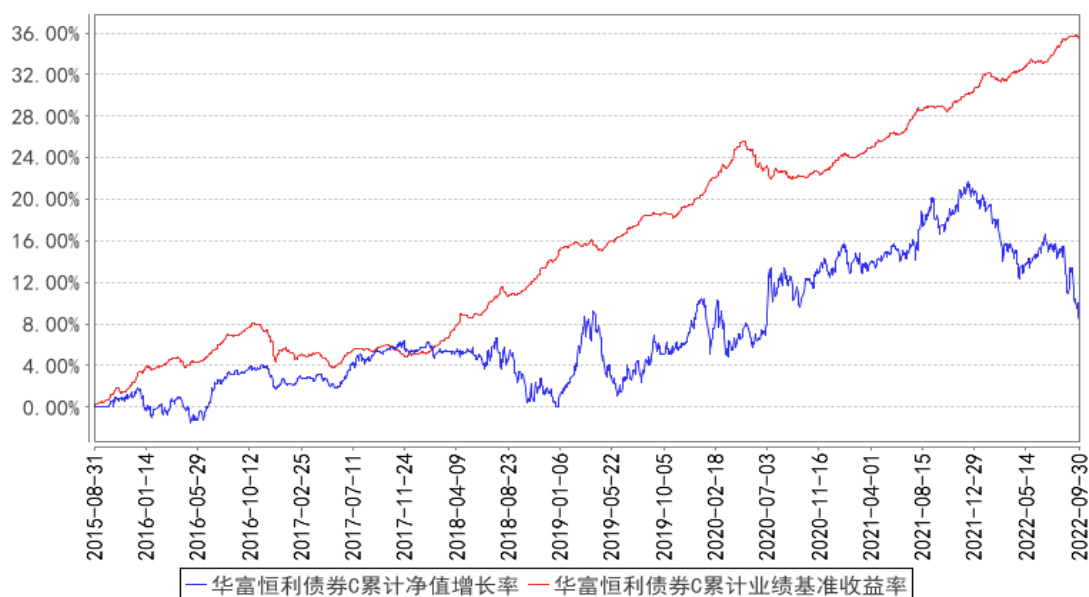
注：本基金业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率。

### 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

华富恒利债券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



华富恒利债券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对比图



注：根据《华富恒利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：投资于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%；投资于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%。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 2015 年 8 月 31 日到 2016 年 2 月 29 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《华富恒利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 |        |  |
| 张惠 | 本基金基金经理、固定收益部副总监 | 2015 年 8 月 31 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、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

2022 年三季度，国内疫情有所反复，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。出口受到海外 PMI 加速下滑的冲击，增速明显回落，对经济形成边际拖累。消费和地产投资增速分别受到疫情管控、地产信用风险影响较大，环比增速均低于历史同期水平。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，在经济偏弱且内外承压的环境下，整体没有压力。

海外方面，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，三季度国内经济压力进一步显现，海外流动性收紧加剧，地缘战争导致的全球能源危机愈演愈烈，国内以我为主的货币、财政政策持续宽松，在此背景下，债

券市场表现较好而风险资产表现较差。三季度受到国内疫情反复，烂尾楼断供停贷事件发酵的影响，叠加弱经济环境下资金面持续宽松，长端债券收益率出现一波下行，直至 9 月，受海外货币政策收紧影响，收益率才出现小幅调整。三季度权益市场表现较差，A 股所有指数均持续向下调整。以汽车、新能源为代表的成长板块在调整中跌幅较大，而以金融地产为代表的价值板块由于其低估值保护而相对抗跌，受到全球能源危机影响的能源板块成为季度中唯一的正收益行业。可转债市场跟随权益表现也出现调整，全市场转股溢价率中位数也相应显著抬高，达到历史绝对高位。

回顾三季度，由于本基金前期一直保持了较高的风险资产仓位，因此跟随权益市场的下跌净值回撤较大。在行业配置上，基于目前复杂的国内外环境，我们一方面选择了中长期景气度向好业绩高增长的光伏、军工、风电等行业，一方面选择了低估值并且稳增长政策发力的银行地产以及地产产业链等行业，另一方面选择了困境反转叠加业绩边际改善的食品饮料、旅游、养殖等行业，使得风险资产组合相对均衡。债券资产上，由于本基金规模较小，我们主要以可转债替代策略进行配置。一方面配置了高票息低估值的公用事业、银行、交运等转债作为底仓，另一方面配置了低溢价率，行业景气较好的偏股型转债。但是由于本季度转债市场跟随权益大幅下跌，因此产品净值回撤较大，我们也对持有人深深地表示抱歉。

展望四季度，随着多项稳经济政策相继出台并实施，地产销售有望弱修复，基建投资继续维持高位运行，在疫情防控 and 经济发展平衡中消费边际改善，国内经济将有望企稳并维持弱复苏。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，

在资产配置上，债券的核心变量依然是经济及政策。展望四季度，我们预计经济偏弱、货币政策偏松的格局不会有太多改变，债券依然处于偏优的配置环境。需要关注的是，海外滞胀的压力、国内潜在的政策变化均可能对债券市场形成扰动，但在目前流动性合理偏松的环境下，可以重点关注后续长端利率调整后“跌出来的机会”。

权益市场方面，展望四季度，市场依然面临复杂的内外部环境。从外部看，全球滞胀交易的环境依然严峻；从内部看，稳增长政策陆续落地但效果依然有待观察、疫情的反复对消费以及经济的影响和压力始终存在。但是经过三季度的大幅下跌后，市场整体估值已经处于历史低位，同时当前 A 股从交易情绪和资产比价看均处于底部区间，赔率较高，我们关注边际改善的增量信息，进一步加配风险资产。我们重点关注三个方向，一是具备中长期景气度优势的高端制造业板块，二是疫后消费复苏板块，三是受益于原材料见顶回落后中下游制造业毛利率持续回升的板块。

可转债市场方面，短期来看，反弹后转债溢价率略有收敛但整体性价比仍不高。中长期看，

资产荒时代下固收+资金对于可转债的配置需求仍较高，因此我们继续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，把握结构性机会。

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，华富恒利债券 A 份额净值为 1.098 元，累计份额净值为 1.142 元。报告期，本基金份额净值增长率为-6.71%，同期业绩比较基准收益率为 1.70%。

截止本期末，华富恒利债券 C 份额净值为 1.063 元，累计份额净值为 1.084 元。报告期，本基金份额净值增长率为-6.84%，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              | 10,620,709.84 | 17.45        |
|    | 其中：股票             | 10,620,709.84 | 17.45        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 47,490,521.72 | 78.03        |
|    | 其中：债券             | 47,490,521.72 | 78.03        |
|    | 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      | 2,701,022.46  | 4.44         |
| 8  | 其他资产              | 48,877.47     | 0.08         |
| 9  | 合计                | 60,861,131.49 | 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         | -             | -     |
| B | 采矿业              | 861,126.00    | 1.56  |
| C | 制造业              | 7,530,545.84  | 13.63 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -     |
| E | 建筑业              | 473,088.00    | 0.86  |
| F | 批发和零售业           | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 254,180.00    | 0.46  |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 146,972.00    | 0.27  |
| J | 金融业              | -             | -     |
| K | 房地产业             | 978,123.00    | 1.77  |
| L | 租赁和商务服务业         | 376,675.00    | 0.68  |
| 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               | 10,620,709.84 | 19.23 |

### 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  | 600809 | 山西汾酒 | 2,000   | 605,780.00 | 1.10         |
| 2  | 603345 | 安井食品 | 3,800   | 590,064.00 | 1.07         |
| 3  | 601088 | 中国神华 | 17,700  | 560,028.00 | 1.01         |
| 4  | 000002 | 万科 A | 30,900  | 550,947.00 | 1.00         |
| 5  | 002459 | 晶澳科技 | 8,500   | 544,340.00 | 0.99         |
| 6  | 688408 | 中信博  | 5,510   | 528,960.00 | 0.96         |
| 7  | 688599 | 天合光能 | 8,024   | 514,418.64 | 0.93         |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 16,400  | 482,160.00 | 0.87         |
| 9  | 601868 | 中国能建 | 211,200 | 473,088.00 | 0.86         |
| 10 | 300896 | 爱美客  | 900     | 441,288.00 | 0.80         |

### 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      | 1,021,057.81  | 1.85  |
| 2  | 央行票据      | -             | -     |
| 3  | 金融债券      | 8,139,289.86  | 14.74 |
|    | 其中：政策性金融债 | 8,139,289.86  | 14.74 |
| 4  | 企业债券      | 2,054,180.38  | 3.72  |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -     |
| 6  | 中期票据      | 1,067,090.41  | 1.93  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 35,208,903.26 | 63.74 |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 47,490,521.72 | 85.98 |

### 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  | 210308 | 21 进出 08 | 80,000 | 8,139,289.86 | 14.74        |
| 2  | 113044 | 大秦转债     | 36,940 | 4,098,083.12 | 7.42         |
| 3  | 110053 | 苏银转债     | 26,840 | 3,393,737.11 | 6.14         |
| 4  | 128048 | 张行转债     | 26,590 | 3,201,486.99 | 5.80         |
| 5  | 113052 | 兴业转债     | 26,720 | 2,848,134.58 | 5.16         |

### 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，南京银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、中国进出口银行、江苏苏州农村商业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、江苏张家港农村商业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   | 45,879.07 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 2,998.40  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 48,877.47 |

### 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  | 113044 | 大秦转债     | 4,098,083.12 | 7.42         |
| 2  | 110053 | 苏银转债     | 3,393,737.11 | 6.14         |
| 3  | 128048 | 张行转债     | 3,201,486.99 | 5.80         |
| 4  | 113052 | 兴业转债     | 2,848,134.58 | 5.16         |
| 5  | 110079 | 杭银转债     | 2,721,366.64 | 4.93         |
| 6  | 113050 | 南银转债     | 2,683,724.01 | 4.86         |
| 7  | 132018 | G 三峡 EB1 | 2,571,152.05 | 4.65         |
| 8  | 113516 | 苏农转债     | 1,831,736.69 | 3.32         |
| 9  | 123107 | 温氏转债     | 1,166,402.10 | 2.11         |
| 10 | 123064 | 万孚转债     | 1,079,536.33 | 1.95         |
| 11 | 123121 | 帝尔转债     | 974,189.46   | 1.76         |
| 12 | 113634 | 珀莱转债     | 851,466.27   | 1.54         |
| 13 | 127058 | 科伦转债     | 693,261.29   | 1.26         |
| 14 | 110056 | 亨通转债     | 573,765.12   | 1.04         |
| 15 | 128046 | 利尔转债     | 554,847.60   | 1.00         |
| 16 | 110076 | 华海转债     | 496,888.94   | 0.90         |
| 17 | 123123 | 江丰转债     | 484,914.96   | 0.88         |
| 18 | 110052 | 贵广转债     | 455,805.25   | 0.83         |
| 19 | 123085 | 万顺转 2    | 401,553.91   | 0.73         |

|    |        |          |            |      |
|----|--------|----------|------------|------|
| 20 | 113637 | 华翔转债     | 397,693.14 | 0.72 |
| 21 | 113602 | 景 20 转债  | 386,519.58 | 0.70 |
| 22 | 123132 | 回盛转债     | 345,338.53 | 0.63 |
| 23 | 132021 | 19 中电 EB | 322,015.63 | 0.58 |
| 24 | 127036 | 三花转债     | 263,834.10 | 0.48 |
| 25 | 128109 | 楚江转债     | 257,401.63 | 0.47 |
| 26 | 128145 | 日丰转债     | 250,009.77 | 0.45 |
| 27 | 113619 | 世运转债     | 227,904.35 | 0.41 |
| 28 | 113537 | 文灿转债     | 215,525.94 | 0.39 |
| 29 | 132022 | 20 广版 EB | 157,550.63 | 0.29 |
| 30 | 128125 | 华阳转债     | 73,690.30  | 0.13 |
| 31 | 123108 | 乐普转 2    | 59,366.02  | 0.11 |
| 32 | 113053 | 隆 22 转债  | 55,538.06  | 0.10 |
| 33 | 128078 | 太极转债     | 1,201.06   | 0.00 |
| 34 | 128138 | 侨银转债     | 354.26     | 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

| 项目                        | 华富恒利债券 A       | 华富恒利债券 C   |
|---------------------------|----------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 191,182,653.49 | 549,807.33 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 11,272.46      | 94,731.33  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 141,041,005.42 | 472,110.26 |
| 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               | 50,152,920.53  | 172,428.40 |

### § 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     | 1              | 2022.7.1-2022.9.30      | 33,097,290.64 | 0.00 | 0.00 | 33,097,290.64 | 65.7700  |
|        | 2              | 2022.7.1-2022.9.30      | 16,352,412.10 | 0.00 | 0.00 | 16,352,412.10 | 32.4900  |
| 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、华富恒利债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富恒利债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富恒利债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富恒利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