

华富恒利债券型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 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：2023 年 7 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 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 04 月 01 日起至 2023 年 06 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	1,627,936.81 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	605,691.20 份	1,022,245.61 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 4 月 1 日-2023 年 6 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	-7,054.22	-12,414.66
2. 本期利润	-4,191.99	-11,549.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0070	-0.0118
4. 期末基金资产净值	621,345.79	621,345.79

		34
5. 期 末基 金份 额净 值	1. 0. 0299 9 4	

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	-0.77%	0.59%	1.98%	0.05%	-2.75%	0.54%
过去六个月	-1.06%	0.43%	2.98%	0.05%	-4.04%	0.38%
过去一年	-12.57%	0.48%	4.58%	0.06%	-17.15%	0.42%
过去三年	-4.79%	0.41%	13.17%	0.06%	-17.96%	0.35%
过去五年	0.21%	0.42%	27.01%	0.07%	-26.80%	0.35%
自基金合同 生效起至今	6.92%	0.35%	39.33%	0.07%	-32.41%	0.28%

华富恒利债券 C

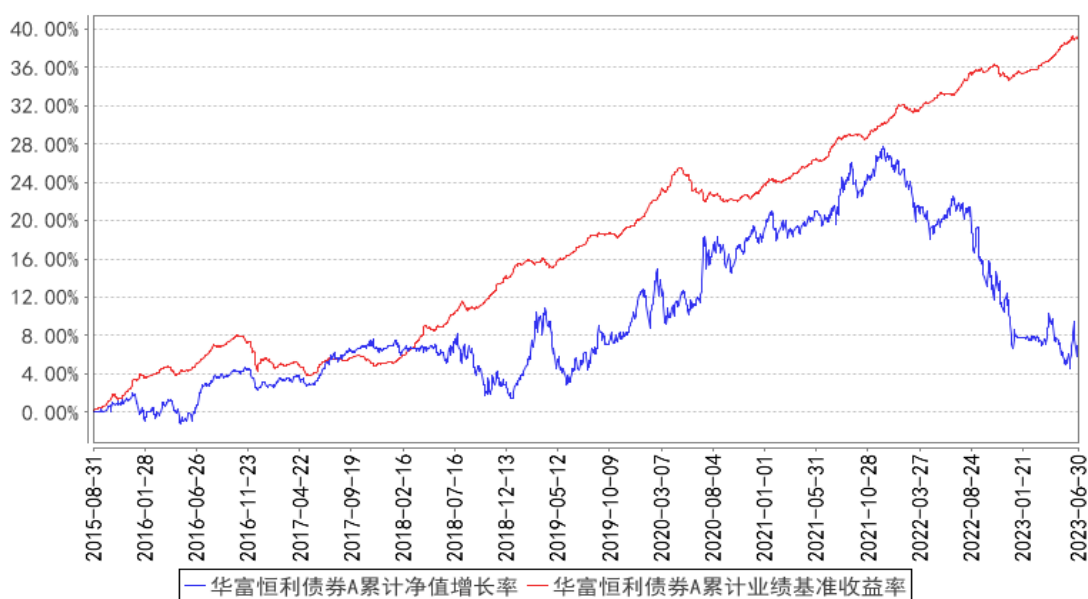
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.80%	0.59%	1.98%	0.05%	-2.78%	0.54%
过去六个月	-1.19%	0.43%	2.98%	0.05%	-4.17%	0.38%
过去一年	-12.88%	0.49%	4.58%	0.06%	-17.46%	0.43%

过去三年	-5.94%	0.41%	13.17%	0.06%	-19.11%	0.35%
过去五年	-3.80%	0.42%	27.01%	0.07%	-30.81%	0.35%
自基金合同生效起至今	1.30%	0.35%	39.33%	0.07%	-38.03%	0.28%

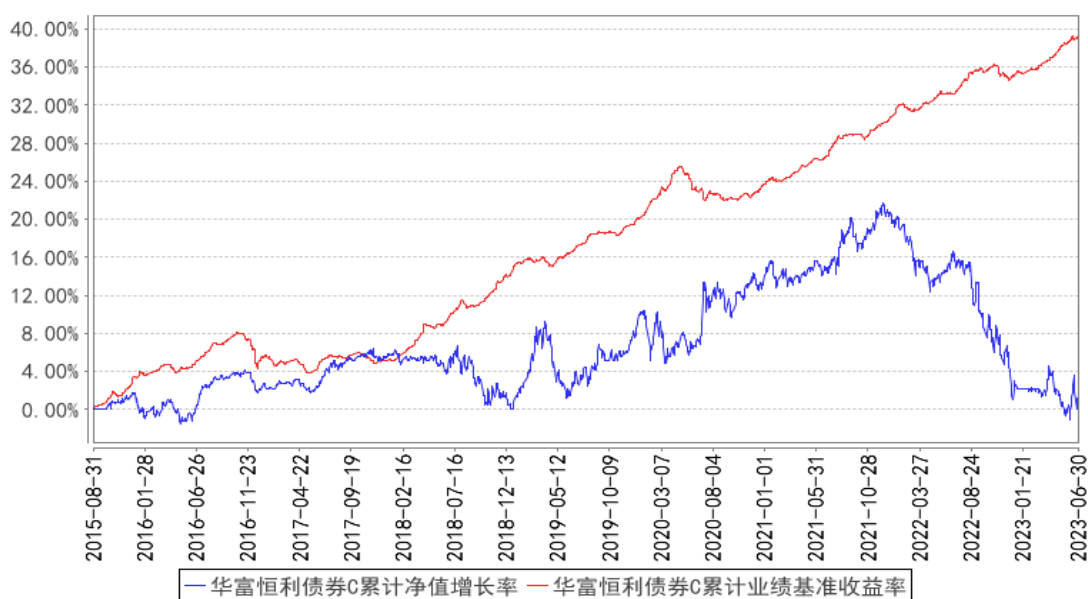
注：本基金业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率。

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	-	十六年	合肥工业大学产业经济学硕士、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 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

二季度，随着疫后复苏的需求集中释放后，国内宏观经济出现一定放缓的迹象。分结构看，国内基建投资相对平稳，增速保持在较好的水平，但是由于二季度商品房销售边际回落，叠加地产投资维持低迷，房地产行业景气度较一季度出现了明显的回落。出口数据依然维持高位，虽然受制于欧美需求回落后的需求不足，但由于“一带一路”沿线国家出口保持高韧性，使得二季度出口增速依然有支撑。消费增速边际放缓但依然保持了双位数的增长。信贷投放方面，在一季度天量信贷投放后，二季度新增信贷出现了明显回落。通胀方面，二季度 CPI、PPI 继续走弱，核心 CPI 维持低位，国内通胀整体低迷。在国内经济基本面边际降温的背景下，财政稳增长政策持续发力，货币政策保持宽松，6 月的降息为实体经济提供了流动性支持。

海外方面，美国实体经济依旧具有韧性，且金融风险有所缓释。居民端的良好财务状况给予了经济基本面强劲支撑，充裕的超额储蓄使得从预期、消费、就业各项指标较强。美国通胀中服务通胀依旧保持在 5% 以上的增速，放缓速度不及预期，促使美联储的紧缩进程再度延长。在此背景下，市场对加息的延续预期大幅升温，黄金、美债均出现下跌，美股则受益于人工智能产业

趋势的兴起出现结构性牛市景象。

二季度，随着宏观经济边际降温，债券市场进一步下行，其中利率债收益率出现了明显的下行，期间 10 年期国开债收益率下行约 25bp。股票市场也出现不同程度下跌，主要指数均有所回调，上证指数、沪深 300、创业板指涨跌幅分别为-2.16%、-5.15%、-7.69%。行业表现方面，分化继续加剧。受益于全球人工智能新产业周期开启的相关通信、传媒、计算机等板块取得了明显的正收益，反之受到总量经济边际放缓影响的消费者服务、食品饮料、建材等板块则出现较大幅度下跌。可转债市场方面，受到退市转债引发的低价转债信用风险担忧影响，二季度可转债整体估值先出现一波快速压缩，随后又在 6 月逐渐恢复到前期高位，二季度中证转债指数微跌 0.15%。

回顾二季度，本基金继续以追求绝对收益为目标，在大类资产配置上优先配置了高等级信用债，以票息为主杠杆为辅的债券策略给组合贡献了正向的票息和杠杆收益。在风险资产上，4 月份随着地产销售数据改善的放缓，我们开始对经济复苏的预期进行下修，也适当降低了部分顺周期板块的配置比例，但是基于对全球人工智能产业周期的共振趋势判断，我们进一步增加了通信、计算机的配置比例，同时组合中保留了以半导体为代表的电子行业配置，组合整体维持较高仓位。在二季度权益市场整体下行的节奏中，虽然以 TMT 为代表的部分仓位有一定相对收益，但是组合的高仓位依然贡献了负收益，对净值影响较大。可转债我们主要配置哑铃型策略，一方面选取低价有绝对票息的大金融、公用事业等个券，另一方面选取行业景气度较高，溢价率较低的偏股型个股来获取超额收益。二季度受到转债整体估值压缩的影响，较高的转债仓位对组合贡献了较多负收益。

展望三季度，全球经济增速或将继续放缓，出口增长面临压力，中国经济增长仍将主要取决于内需的恢复程度。在促消费政策、服务消费加快释放的带动下，消费有望保持温和修复，基建投资继续较快增长，高技术产业投资对制造业投资增长带来支撑，房地产市场逐步探底修复，房地产开发投资降幅缓慢收窄。总体来说，我们认为经济边际下行最快的阶段已经过去，但考虑到现有的政策力度偏温和，同时在经济转型的当下预期新增的政策可能意在托底经济而非传统强刺激，因此预计三季度经济仍将维持目前震荡的局面。金融形势方面，鉴于复苏基础尚不牢固，预计央行仍将灵活使用公开市场操作、各类借贷便利工具确保流动性合理充裕，维持稳健略宽的流动性环境。

在资产配置上，虽然当前债券市场绝对赔率偏低，但是在经济维持目前震荡格局下胜率依然不低，仍然需要重视票息收入和把握阶段性长端利率的机会。而股票市场在经历了二季度下跌后已经较充分反应经济复苏偏弱的悲观预期，随着 6 月份部分经济数据的筑底企稳以及对政策预期的强化，目前整体赔率较高，胜率取决于政策的发力点以及对复苏斜率抬升交易的重启。

债券市场方面，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，组合依然保持中性久期、中性杠杆，本基金还是以票息收入杠杆为辅的策略。

权益市场方面，随着 6 月份 PMI 整体好于预期，市场对经济的悲观预期开启了弱修复。同时各项呵护经济政策陆续出台进一步提升了市场对复苏斜率的预期。随着二季度业绩的落地，市场开始对前期过度悲观定价有所修正，我们重点关注四个方向：一是本轮人工智能的产业趋势是明确的，随着主题投资热情退却后，我们依然看好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，同时在国家战略中属于大安全和自主可控领域，具备核心竞争力以及中长期景气度优势的通信、计算机、电子板块；二是具备国际比较优势的高端制造业，包括新能源车、光伏、机械制造等中报业绩依然高增，并且能够分享全球产业趋势的优势板块；三是前期调整充分，预期悲观的可选消费板块，我们看好下半年经济修复逻辑下业绩确定性强的细分领域和公司；四是具备长期高分红能力的央企、国企，看好在新一轮央国企改革与重估中胜出的公司。

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 1.029 元，累计份额净值为 1.073 元。报告期，华富恒利债券 A 份额净值增长率为-0.77%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%。截止本期末，华富恒利债券 C 份额净值为 0.994 元，累计份额净值为 1.015 元。报告期，华富恒利债券 C 份额净值增长率为-0.80%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2022 年 12 月 29 日起至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于 5000 万元的情形，至本报告期期末（2023 年 06 月 30 日）基金资产净值仍低于 5000 万元。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

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	317,776.40	18.11
	其中：股票	317,776.40	18.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,388,587.81	79.15
	其中：债券	1,388,587.81	79.15
	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	31,467.95	1.79
8	其他资产	16,473.35	0.94
9	合计	1,754,305.51	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	-	-
C	制造业	203,121.40	12.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,160.00	0.80
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	75,285.00	4.59
J	金融业	-	-
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	-	-
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	26,210.00	1.60
S	综合	-	-
	合计	317,776.40	19.39

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	000063	中兴通讯	500	22,770.00	1.39
2	300499	高澜股份	1,100	19,382.00	1.18
3	002050	三花智控	600	18,156.00	1.11
4	002475	立讯精密	500	16,225.00	0.99
5	600487	亨通光电	1,100	16,126.00	0.98
6	002401	中远海科	600	15,792.00	0.96
7	603019	中科曙光	300	15,270.00	0.93
8	002463	沪电股份	700	14,658.00	0.89
9	002343	慈文传媒	1,900	14,402.00	0.88
10	300634	彩讯股份	500	13,200.00	0.81

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	470,429.34	28.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	918,158.47	56.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,388,587.81	84.71

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	019688	22 国债 23	3,500	353,917.41	21.59
2	019547	16 国债 19	1,110	116,511.93	7.11
3	113057	中银转债	540	70,365.67	4.29
4	110091	合力转债	220	34,321.69	2.09

5	113021	中信转债	290	33,383.24	2.04
---	--------	------	-----	-----------	------

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，中信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	5,387.45
2	应收证券清算款	9,955.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,129.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	16,473.35

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	113057	中银转债	70,365.67	4.29
2	110091	合力转债	34,321.69	2.09
3	113021	中信转债	33,383.24	2.04
4	123164	法本转债	27,721.34	1.69
5	128079	英联转债	24,996.27	1.52
6	118013	道通转债	22,574.77	1.38
7	110062	烽火转债	22,457.47	1.37
8	113594	淳中转债	21,581.61	1.32
9	110048	福能转债	21,573.93	1.32
10	127058	科伦转债	18,897.21	1.15
11	123048	应急转债	16,217.95	0.99
12	113024	核建转债	15,731.48	0.96
13	128140	润建转债	15,299.32	0.93
14	110043	无锡转债	15,296.35	0.93
15	123158	宙邦转债	15,271.61	0.93
16	123107	温氏转债	15,071.52	0.92
17	127012	招路转债	15,061.45	0.92
18	123071	天能转债	15,004.50	0.92
19	123050	聚飞转债	14,800.64	0.90
20	127045	牧原转债	14,171.96	0.86
21	113045	环旭转债	14,039.58	0.86
22	111010	立昂转债	13,722.56	0.84
23	123138	丝路转债	13,721.56	0.84
24	123115	捷捷转债	13,579.25	0.83
25	127065	瑞鹤转债	12,610.63	0.77
26	113061	拓普转债	12,152.19	0.74
27	118024	冠宇转债	11,849.44	0.72
28	110060	天路转债	11,071.10	0.68
29	123075	贝斯转债	10,985.68	0.67
30	113661	福 22 转债	10,894.22	0.66
31	113059	福莱转债	9,593.28	0.59

32	127046	百润转债	8,603.10	0.52
33	118021	新致转债	8,466.94	0.52
34	113663	新化转债	8,389.28	0.51
35	110090	爱迪转债	8,368.49	0.51
36	113530	大丰转债	8,247.96	0.50
37	128083	新北转债	7,893.05	0.48
38	111000	起帆转债	7,786.40	0.48
39	127029	中钢转债	7,753.07	0.47
40	113602	景 20 转债	7,621.30	0.46
41	128133	奇正转债	7,591.08	0.46
42	123161	强联转债	7,565.58	0.46
43	110080	东湖转债	7,560.92	0.46
44	118023	广大转债	7,501.30	0.46
45	123038	联得转债	7,485.02	0.46
46	127073	天赐转债	7,409.69	0.45
47	123112	万讯转债	7,366.21	0.45
48	113588	润达转债	7,291.30	0.44
49	127018	本钢转债	7,247.56	0.44
50	128044	岭南转债	7,222.58	0.44
51	110058	永鼎转债	7,189.19	0.44
52	123122	富瀚转债	7,108.83	0.43
53	118011	银微转债	7,097.24	0.43
54	118003	华兴转债	7,087.23	0.43
55	113055	成银转债	7,004.11	0.43
56	113604	多伦转债	6,946.32	0.42
57	123145	药石转债	6,943.73	0.42
58	123054	思特转债	6,905.14	0.42
59	110079	杭银转债	6,900.89	0.42
60	113063	赛轮转债	6,858.42	0.42
61	113062	常银转债	6,845.80	0.42
62	123170	南电转债	6,710.20	0.41
63	127056	中特转债	6,612.03	0.40
64	113039	嘉泽转债	6,599.27	0.40
65	128132	交建转债	6,243.17	0.38

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：本基金本报告期末指数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	628,593.61	959,904.87
报告期期间基金总申购份额	65,240.06	259,489.66
减：报告期期间基金总赎回份额	88,142.47	197,148.92
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	605,691.20	1,022,245.61

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）

		过 20% 的 时 间 区 间					
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	202 3.4 .1- 202 3.6 .30	771,72 0.93	0.00	0.00	771,720. 93	47.4 000
-	-	-	-	-	-	-	-
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

2023 年 7 月 21 日