

华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 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 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|--------------|
| 基金简称 | 华富弘鑫灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 003182 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 11 月 28 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 40,403,721.26 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金通过合理灵活的资产配置策略，同时结合行业配置策略、个股精选策略、债券投资策略等投资策略，积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇，在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中等收益风险特征的基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 华富基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华富弘鑫灵活配置混合 A | 华富弘鑫灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003182 | 003183 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 39,848,616.33 份 | 555,104.93 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7月1日-2023年9月30日) | |
|-----------------|-------------------------------|-------------|
| | 华富弘鑫灵活配置混合A | 华富弘鑫灵活配置混合C |
| 1. 本期已实现收益 | -18,693.75 | -18,878.08 |
| 2. 本期利润 | 152,202.13 | 152,994.34 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0038 | 0.0042 |
| 4. 期 | 51 | 70 |

| | | |
|------|-------|--|
| 末基 | , 21, | |
| 金资 | 5396 | |
| 产净 | , 79. | |
| 值 | 2088 | |
| | . 7 | |
| | 6 | |
| 5. 期 | | |
| 末基 | 1. 1. | |
| 金份 | 2826 | |
| 额净 | 6246 | |
| 值 | | |

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

华富弘鑫灵活配置混合 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 | 0.30% | 0.24% | -1.54% | 0.45% | 1.84% | -0.21% |
| 过去六个月 | 1.92% | 0.23% | -3.38% | 0.43% | 5.30% | -0.20% |
| 过去一年 | 1.15% | 0.30% | 0.40% | 0.49% | 0.75% | -0.19% |
| 过去三年 | 8.09% | 0.26% | -4.11% | 0.56% | 12.20% | -0.30% |
| 过去五年 | 27.44% | 0.27% | 17.45% | 0.63% | 9.99% | -0.36% |
| 自基金合同 生效起至今 | 33.98% | 0.23% | 18.90% | 0.59% | 15.08% | -0.36% |

华富弘鑫灵活配置混合 C

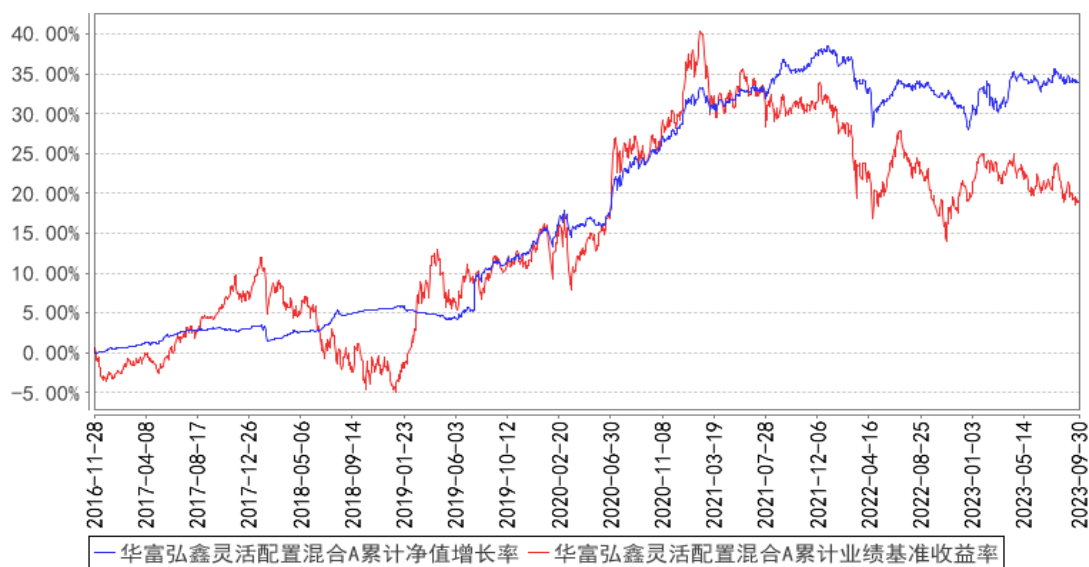
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.25% | 0.24% | -1.54% | 0.45% | 1.79% | -0.21% |
| 过去六个月 | 1.81% | 0.23% | -3.38% | 0.43% | 5.19% | -0.20% |
| 过去一年 | 0.87% | 0.30% | 0.40% | 0.49% | 0.47% | -0.19% |
| 过去三年 | 7.37% | 0.26% | -4.11% | 0.56% | 11.48% | -0.30% |
| 过去五年 | 25.99% | 0.27% | 17.45% | 0.63% | 8.54% | -0.36% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.78% | 0.23% | 18.90% | 0.59% | 12.88% | -0.36% |

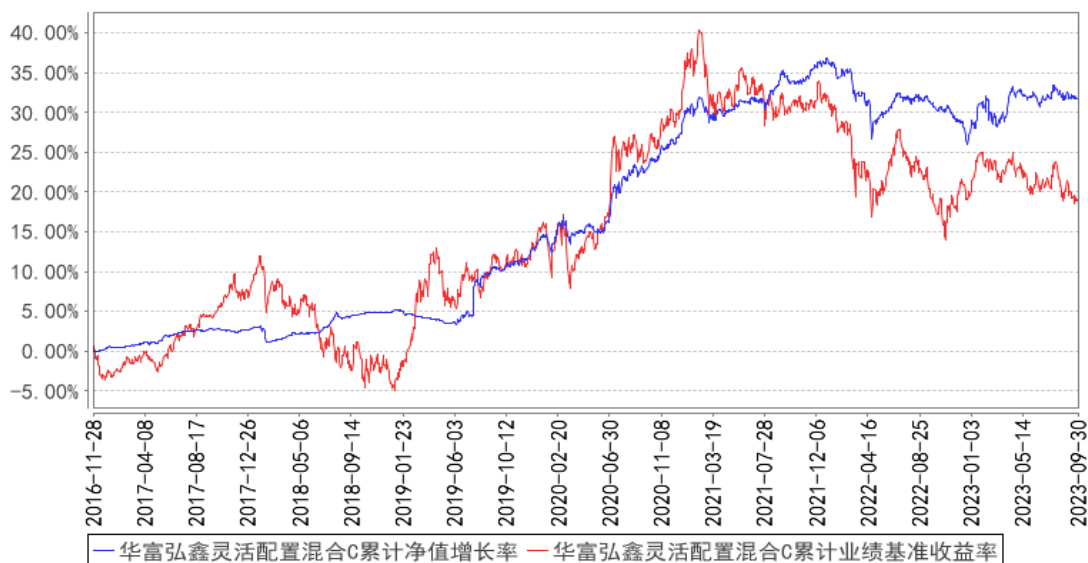
注：本基金业绩比较基准收益率=沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

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

华富弘鑫灵活配置混合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



华富弘鑫灵活配置混合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：本基金建仓期为 2016 年 11 月 28 日到 2017 年 5 月 28 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《华富弘鑫灵活配置混合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 | | |
| 张惠 | 本基金基金经理、固定收益部副总监 | 2019 年 4 月 15 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 2019 年 4 月 2 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 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，自 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 2023 年 9 月 12 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，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

三季度，随着经济增长动能放缓，国内逆周期调节政策开始发力，更为积极的货币、财政、产业政策相继出台。具体来说，货币政策方面央行超预期降息降准，在呵护宽松的流动性基础上进一步降低企业融资成本；财政政策方面地方债发行提速，特殊再融资债相继获批有助于缓解地方债务风险；地产方面，政治局会议强调适时调整优化房地产政策，随后一二线城市不同程度的对地产限贷限购政策松绑，叠加央行指导银行调整存量房贷利率，政策组合拳有助于地产市场重

归平稳。在一系列政策加码之后，8 月开始，主要经济数据出现企稳且小幅回升的势头，从 PMI 最新数据看，9 月制造业 PMI 回升至 50.2%，环比上升 0.5 个百分点，重回扩张区间，消费、出口数据也同步出现改善。

海外方面，三季度美国经济整体韧性依旧较强，结构上出现分化，制造业见底回升、服务业震荡放缓；核心通胀则延续逐渐放缓的态势，能源上涨对整体通胀有一定的扰动。居民超额储蓄逐渐消耗见底，低收入人群信用卡债务扩张、违约率上升，但由于房贷整体维持疫情期间的低利率，因此居民整体财务状况相对可持续。货币政策上，美联储在 7 月加息之后 9 月暂停，往后看，加息的可能性不大，更多需要判断利率维持的时间，这之中就业市场的演绎是关键，需要关注后续制造业恢复情况及罢工博弈或信用卡违约扩大的风险。

三季度，在一系列逆周期调节政策相继出台后，债券市场出现小幅调整，同时受资金利率抬升影响，短端收益率上行幅度高于长端，收益率曲线形态出现平坦化。股票市场由于偏弱的基本面数据叠加海外加息对流动性的冲击，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-2.86%、-3.98%、-9.53%。行业表现方面，受益于海外能源价格上涨以及国内逆周期调节政策催化的顺周期产业相对表现较好，而二季度表现较好的科技成长板块由于中报业绩表现一般并且受到美元指数上涨对全球流动性冲击的影响，风险偏好下行，相对表现较差。季度来看，行业指数涨跌幅居前 5 位的依次为煤炭、非银行金融、石油石化、银行、房地产，跌幅居前的是传媒、计算机、电力设备及新能源、国防军工、机械。可转债市场方面，受到股票的负向拖累，可转债市场三季度整体下跌，可转债对应正股指数下跌 4.23%的情况下，可转债尤其是大盘中低价转债相对抗跌，中证转债指数跌 0.52%，可转债指数跌 1.98%，再度抬高了转股溢价率。

回顾三季度，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。在风险资产配置上，基于当下全球处于高通胀低增长的大环境之中，我们偏中长期看好高股息资产的投资价值，同时叠加了基于政策推动下的央国企价值重估，因此我们主要配置了能源、金融、造船、交通运输、运营商等行业个股，但是由于三季度权益市场的整体下行组合净值小幅波动。

展望四季度，国内方面，三季度陆续出台的逆周期调节政策效果将逐步显现，经济修复动能有所提升，政治局会后多项呵护资本市场政策相继推出，市场信心有望触底修复。从国内经济自身周期看，制造业四季度有望从被动去库逐渐出现结构性补库，但由于这次缺少房地产行业的强复苏，且社会投资与消费有待改善，同时在经济结构转型的过程我们的发展将逐步从关注量转变为关注质，因此我们预计经济总量仍将为偏弱复苏。上市公司业绩方面，预计三季度相较于二季度 A 股整体业绩增速环比持平或弱改善，四季度会有小幅回升，全年维度看还是会有不少上市公

司业绩会相对宏观经济走出 α ，全年业绩小幅增长为权益市场提供了小幅上行的基础。海外方面，随着以原油为代表的商品价格走弱，美国经济动能边际放缓，未来美联储加息概率大幅下降，但是目前市场依然预期将维持一段时间高利率。

在资产配置上，对于债券来说，预计四季度经济回暖的斜率较为温和，在此背景下，国内货币政策转紧的概率偏低，对应收益率继续上行的空间有限。但四季度政府债券供给对市场的扰动仍然值得重视，如果资金面持续处于紧平衡状态，那么收益率也将缺乏修复的动能。整体来说，四季度收益率出现高位震荡的概率偏大，关注供给冲击后，收益率曲线潜在的修复性机会。对于股票来说，在经历了连续两个季度下跌后，目前 A 股整体估值处于低位，基本面随着三季度多项政策效果的显现，上市公司业绩有望在三季度出现拐点向上，目前市场整体赔率较高，胜率改善，值得多一份耐心等待信心的进一步修复。

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为主、杠杆为辅的策略。

权益市场方面，在政治局会议“活跃资本市场”之后多项政策频出，“政策底”已经明显确立，当前正处于“政策底”→“市场底”的煎熬磨底过程中。无论是当下的经济基本面还是 A 股整体估值水平，我们相信这都将是一个中长期的底部，我们需要保持足够的耐心去找寻具有核心竞争力的优秀公司。随着三季度业绩改善的逐步落地，我们相信市场将会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半导体、通信等板块；二是具备国际比较优势的高端制造业，包括新能源车、光伏、机械制造等业绩维持高增，并且能够分享全球产业趋势的优势板块；三是前期受到多重利空冲击调整充分的医药板块，我们看好四季度板块基本面和估值的双重修复；四是具备长期高分红能力的央企、国企，看好在新一轮央企改革与重估中胜出的公司。

可转债市场方面，短期来看，下跌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，华富弘鑫灵活配置混合 A 份额净值为 1.2862 元，累计份额净值为 1.3312 元。报告期，华富弘鑫灵活配置混合 A 份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准收益率为-1.54%。截止本期末，华富弘鑫灵活配置混合 C 份额净值为 1.2646 元，累计份额净值为 1.3096 元。报告期，华富弘鑫灵活配置混合 C 份额净值增长率为 0.25%，同期业绩比较基准收益率为-1.54%。

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 | 12,574,413.00 | 24.12 |
| | 其中：股票 | 12,574,413.00 | 24.12 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 34,207,400.45 | 65.61 |
| | 其中：债券 | 34,207,400.45 | 65.61 |
| | 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 | 4,001,676.70 | 7.67 |
| | 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 | 1,347,052.91 | 2.58 |
| 8 | 其他资产 | 9,765.44 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 52,140,308.50 | 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 | 2,914,841.00 | 5.61 |
| C | 制造业 | 2,147,670.00 | 4.13 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,385,990.00 | 2.67 |
| F | 批发和零售业 | 511,458.00 | 0.98 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,376,270.00 | 2.65 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,448,143.00 | 2.79 |
| J | 金融业 | 2,531,923.00 | 4.87 |
| 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 | 258,118.00 | 0.50 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 12,574,413.00 | 24.20 |

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 | 601658 | 邮储银行 | 193,900 | 963,683.00 | 1.85 |
| 2 | 600150 | 中国船舶 | 25,700 | 717,030.00 | 1.38 |
| 3 | 601881 | 中国银河 | 56,800 | 624,232.00 | 1.20 |
| 4 | 600941 | 中国移动 | 6,400 | 619,648.00 | 1.19 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 12,400 | 598,920.00 | 1.15 |
| 6 | 601088 | 中国神华 | 18,500 | 577,200.00 | 1.11 |
| 7 | 600028 | 中国石化 | 92,800 | 563,296.00 | 1.08 |
| 8 | 601857 | 中国石油 | 62,200 | 496,356.00 | 0.96 |
| 9 | 001872 | 招商港口 | 30,300 | 483,285.00 | 0.93 |
| 10 | 601298 | 青岛港 | 67,300 | 428,028.00 | 0.82 |

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 | 2,816,668.82 | 5.42 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 15,903,463.15 | 30.61 |

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| 5 | 企业短期融资券 | 3,002,375.41 | 5.78 |
| 6 | 中期票据 | 5,072,478.80 | 9.76 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 7,412,414.27 | 14.27 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 34,207,400.45 | 65.84 |

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 | 188858 | 21 安控 01 | 50,000 | 5,285,440.55 | 10.17 |
| 2 | 148080 | 22 电建 05 | 50,000 | 5,018,578.08 | 9.66 |
| 3 | 113052 | 兴业转债 | 46,190 | 4,766,518.21 | 9.17 |
| 4 | 185598 | 22 鄂投 01 | 30,000 | 3,066,624.66 | 5.90 |
| 5 | 102382045 | 23 西永电子 MTN002 | 30,000 | 3,016,149.84 | 5.81 |

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司、兴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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 9,765.44 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 9,765.44 |

5.11.4 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 | 113052 | 兴业转债 | 4,766,518.21 | 9.17 |
| 2 | 113065 | 齐鲁转债 | 815,633.31 | 1.57 |
| 3 | 113056 | 重银转债 | 622,849.97 | 1.20 |
| 4 | 113042 | 上银转债 | 545,343.15 | 1.05 |
| 5 | 128129 | 青农转债 | 510,186.58 | 0.98 |
| 6 | 123108 | 乐普转 2 | 45,483.72 | 0.09 |
| 7 | 110082 | 宏发转债 | 34,182.12 | 0.07 |
| 8 | 113030 | 东风转债 | 33,452.67 | 0.06 |
| 9 | 113043 | 财通转债 | 18,047.67 | 0.03 |
| 10 | 113634 | 珀莱转债 | 9,610.68 | 0.02 |

| | | | | |
|----|--------|---------|----------|------|
| 11 | 113633 | 科沃转债 | 8,709.94 | 0.02 |
| 12 | 113655 | 欧 22 转债 | 2,396.25 | 0.00 |

5.11.5 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。

5.11.6 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 | 华富弘鑫灵活配置混合 A | 华富弘鑫灵活配置混合 C |
|---------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 39,899,837.65 | 693,247.18 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,242.60 | 373,565.64 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 55,463.92 | 511,707.89 |
| 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 | 39,848,616.33 | 555,104.93 |

§ 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 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |

| | | 金 份 额 比 例 达 到 或 者 超 过 20% 的 时 间 区 间 | | | | |) |
|--------|---|---|---------------|------|------|---------------|---------|
| 机构 | 1 | 2023.7.1-2023.9.30 | 19,414,288.98 | 0.00 | 0.00 | 19,414,288.98 | 48.0500 |
| 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、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富弘鑫灵活配置混合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 10 月 25 日