

# 华富安鑫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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	44,991,761.30 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）
--------	---------------------------------------

1. 本期已实现收益	-530,653.97
2. 本期利润	-1,442,325.58
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0319
4. 期末基金资产净值	42,487,127.09
5. 期末基金份额净值	0.9443

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

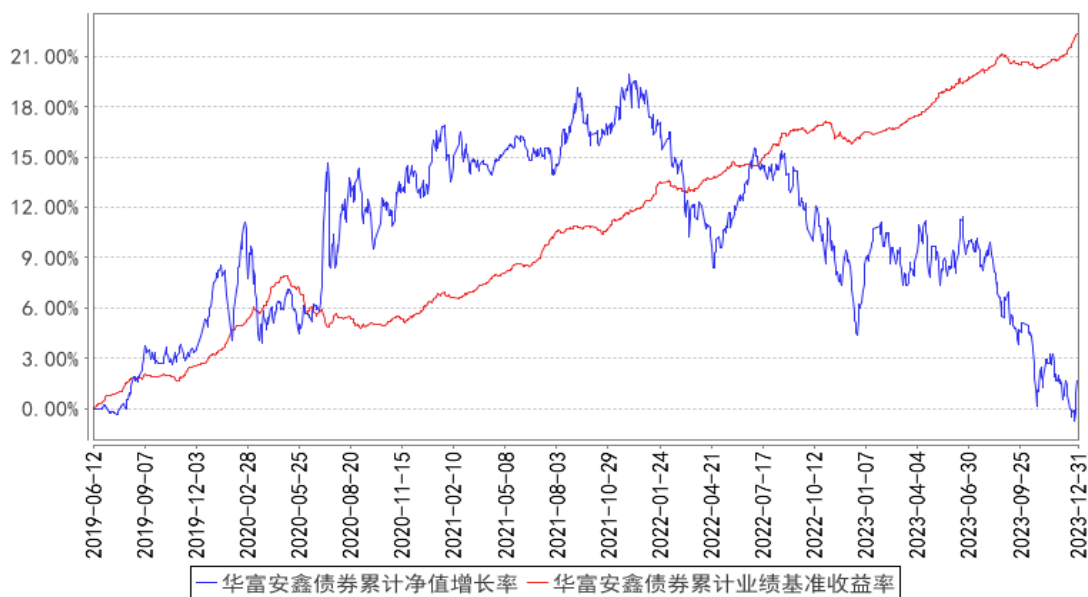
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.25%	0.49%	1.44%	0.05%	-4.69%	0.44%
过去六个月	-7.59%	0.45%	2.19%	0.06%	-9.78%	0.39%
过去一年	-4.37%	0.46%	5.23%	0.05%	-9.60%	0.41%
过去三年	-11.13%	0.42%	15.05%	0.06%	-26.18%	0.36%
自基金合同 生效起至今	1.67%	0.46%	22.38%	0.07%	-20.71%	0.39%

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：1、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。

2、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	本基金基金经理	2022 年 9 月 23 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

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。

回顾 2023 年四季度，本基金年初基于对于大类资产上超配权益资产的判断，维持以权益资产与平衡型可转债资产高仓位、叠加可转债高 YTM 底仓与长端利率债的组合，主要的调整在于降低了整体可转债资产的“股性”，将较多的股性可转债替换成中价位和低价位可转债，同时适度增加了高股息资产的配置，但仍是低估了权益市场信心匮乏的程度，以至于整体投资组合的防守性不足，主要在于可转债资产出现了估值的补跌。由于市场缺乏增量资金、宏观主线较弱，整体权益与可转债的  $\beta$  表现比较差。一方面，国内在宏观经济动能放缓的同时，政策层面也未出现像以往周期中的较强力度的稳增长政策，或者说各部门条线的政策并未形成合力和效果，另一方面，我们也低估了市场资金面的问题，11 月以来，美联储货币政策出现了转向，全球权益资产均演绎了流动性改善的定价，但 A 股市场并未参与有效反弹，背后的原因也是相对复杂，且机构负债端的压力也逐渐显现，短期看市场需要灵活的调整以及严格的止盈纪律。本基金在行业配置

上总体上维持中长期景气方向的布局，整个组合围绕人工智能产业、半导体先进封装、新能源与机器人、医药与消费等中长期景气度与成长性相对明晰的方向进行均衡配置，同时在多元资产配置维度，在配置贵金属板块之外，增加了高速、海运等红利资产和周期资产。可转债品种策略上维持了一定仓位对于低价与波动率配合的量化择券，用该类策略一定程度上替代了传统高等级大盘转债。

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。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 PE 26 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。

在资产配置上，长期“资产荒”预期下，债券类资产的胜率仍不低，但性价比不算有吸引力，且随着疫后复苏存在胜率走低的可能，更多的是把握长期的票息收入。

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。从行业配置上，本基金仍认为本轮 AIGC 的产业升级规格是很高的，在主题投资热情退却后，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和标的仍是值得去积极把握的。除此之外，优势制造业出海、平价消费以及资产荒下的红利资产重估预计是未来的大趋势。本基金将围绕人工智能以及其带动的产业升级（光模块、服务器、先进存储、边缘算力、具身智能、大模型多模态应用等，以及 Chiplet 先进封装）、高端制造（机器人、自动驾驶）、消费（新消费、平价与悦己消费）、医药（创新药出海）以及再次处于左侧的贵金属板块和高股息红利资产几个方向进行配置。

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。风险方面，如果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。

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 0.9443 元，累计基金份额净值为 1.4103 元。报告期，本基金份额净值增长率为-3.25%，同期业绩比较基准收益率为 1.44%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2023 年 02 月 03 日起至本报告期末（2023 年 12 月 31 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 12 月 31 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	8,369,752.17	17.06
	其中：股票	8,369,752.17	17.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,899,161.20	81.33
	其中：债券	39,899,161.20	81.33
	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	669,865.84	1.37
8	其他资产	121,667.99	0.25
9	合计	49,060,447.20	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	669,294.00	1.58
C	制造业	5,621,041.67	13.23
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	311,057.50	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	146,880.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	480,336.00	1.13
J	金融业	364,623.00	0.86
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	492,390.00	1.16
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	284,130.00	0.67
S	综合	-	-
	合计	8,369,752.17	19.70

### 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	22,700	601,096.00	1.41
2	002050	三花智控	15,000	441,000.00	1.04
3	688630	芯碁微装	4,900	418,313.00	0.98
4	002158	汉钟精机	17,000	378,420.00	0.89
5	600547	山东黄金	16,200	370,494.00	0.87
6	600030	中信证券	17,900	364,623.00	0.86
7	603259	药明康德	5,000	363,800.00	0.86
8	300316	晶盛机电	8,200	361,538.00	0.85
9	300308	中际旭创	3,200	361,312.00	0.85
10	300820	英杰电气	6,000	343,680.00	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	8,748,794.58	20.59
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）	31,150,366.62	73.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,899,161.20	93.91

### 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	48,000	5,165,403.62	12.16
2	019709	23 国债 16	23,000	2,312,035.62	5.44
3	127005	长证转债	22,000	2,308,089.31	5.43
4	113044	大秦转债	17,530	2,039,282.67	4.80

5	113053	隆 22 转债	17,000	1,748,900.38	4.12
---	--------	---------	--------	--------------	------

## 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，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	4,408.07
2	应收证券清算款	115,593.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,666.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	121,667.99

#### 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	2,308,089.31	5.43
2	113044	大秦转债	2,039,282.67	4.80
3	113053	隆 22 转债	1,748,900.38	4.12
4	132026	G 三峡 EB2	1,714,603.56	4.04
5	113042	上银转债	1,092,302.07	2.57
6	113037	紫银转债	1,031,233.04	2.43
7	113056	重银转债	1,026,058.83	2.41
8	113052	兴业转债	1,019,109.59	2.40
9	128108	蓝帆转债	992,375.11	2.34
10	127045	牧原转债	737,242.82	1.74
11	113049	长汽转债	592,402.74	1.39
12	113584	家悦转债	534,902.05	1.26
13	128138	侨银转债	533,303.58	1.26
14	118031	天 23 转债	529,056.98	1.25
15	113021	中信转债	516,373.69	1.22
16	123194	百洋转债	500,408.19	1.18
17	113063	赛轮转债	499,262.29	1.18
18	127058	科伦转债	498,034.27	1.17
19	123025	精测转债	496,268.71	1.17
20	123182	广联转债	455,389.59	1.07
21	127006	敖东转债	436,915.07	1.03
22	118034	晶能转债	411,808.88	0.97
23	111000	起帆转债	372,769.73	0.88
24	113602	景 20 转债	369,712.19	0.87
25	118013	道通转债	337,781.92	0.80
26	127024	盈峰转债	321,319.56	0.76
27	113648	巨星转债	271,854.15	0.64
28	128042	凯中转债	271,759.85	0.64
29	118004	博瑞转债	270,765.72	0.64
30	123099	普利转债	264,829.04	0.62
31	127053	豪美转债	253,799.56	0.60

32	113549	白电转债	252,010.85	0.59
33	113065	齐鲁转债	250,847.33	0.59
34	113631	皖天转债	250,282.03	0.59
35	113060	浙 22 转债	250,212.44	0.59
36	113662	豪能转债	249,004.88	0.59
37	123129	锦鸡转债	236,737.11	0.56
38	123076	强力转债	229,482.74	0.54
39	110073	国投转债	220,099.63	0.52
40	118015	芯海转债	215,804.91	0.51
41	113656	嘉诚转债	212,718.53	0.50
42	113618	美诺转债	208,820.71	0.49
43	111012	福新转债	195,626.05	0.46
44	123163	金沃转债	189,601.81	0.45
45	123169	正海转债	174,831.29	0.41
46	127037	银轮转债	162,635.30	0.38
47	123127	耐普转债	155,511.73	0.37
48	118017	深科转债	148,941.00	0.35
49	123142	申昊转债	142,076.05	0.33
50	111008	沿浦转债	137,768.90	0.32
51	113634	珀莱转债	130,612.60	0.31
52	123174	精锻转债	129,600.41	0.31
53	123022	长信转债	128,709.15	0.30
54	113064	东材转债	127,840.41	0.30
55	128122	兴森转债	127,559.34	0.30
56	118003	华兴转债	122,393.10	0.29
57	123078	飞凯转债	120,154.56	0.28
58	113667	春 23 转债	119,367.62	0.28
59	113639	华正转债	111,968.85	0.26
60	123126	瑞丰转债	111,875.81	0.26
61	123153	英力转债	110,597.10	0.26
62	110045	海澜转债	109,456.72	0.26
63	118024	冠宇转债	108,824.05	0.26
64	113666	爱玛转债	106,025.15	0.25
65	110068	龙净转债	102,960.31	0.24
66	110074	精达转债	86,055.99	0.20
67	127027	能化转债	1,168.12	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	45,724,518.34
报告期期间基金总申购份额	455,300.17
减：报告期期间基金总赎回份额	1,188,057.21
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	44,991,761.30

## § 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	3,621,032.12
报告期期间买入/申购总份额	0.00
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	3,621,032.12
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	8.05

### 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	2023.10.1 - 2023.12.31	22,179,158.37	0.00	0.00	22,179,158.37	49.3000
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

2024 年 1 月 22 日