

华富安鑫债券型证券投资基金 2023 年年度报告

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

送出日期：2024 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	51

8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
8.6 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.....	55
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
8.8 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贵金属投资明细.....	55
8.9 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.....	55
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
8.11 投资组合报告附注.....	56
§ 9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	58
§ 10 开放式基金份额变动.....	58
§ 11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4 基金投资策略的改变.....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 其他重大事件.....	61
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
12.1 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.....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§ 13 备查文件目录.....	62
13.1 备查文件目录.....	62
13.2 存放地点.....	63
13.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富安鑫债券型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	44,991,761.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券类固定收益品种，在严格管理投资风险的基础上，追求资产的长期稳定增值。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	林之懿
	联系电话	021-68886996
	电子邮箱	linzy@hffund.com
客户服务电话	400-700-8001	95528
传真	021-68887997	021-63602540
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区栖霞路26弄1号3层、4层	上海市中山东一路12号
办公地址	上海市浦东新区栖霞路18号陆家嘴富汇大厦A座3楼、5楼	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码	200120	200126
法定代表人	赵万利	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-1,949,413.52	-3,167,332.25	2,303,301.45
本期利润	-1,865,713.97	-5,548,869.72	2,063,678.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0409	-0.1253	0.0465
本期加权平均净值利润率	-4.03%	-11.07%	3.97%
本期基金份额净值增长率	-4.37%	-10.66%	4.03%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-2,574,976.53	3,145,906.23	8,685,490.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0572	0.0708	0.1989
期末基金资产净值	42,487,127.09	47,654,695.31	52,428,036.02
期末基金份额净值	0.9443	1.0724	1.2004
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	1.67%	7.24%	20.04%

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) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

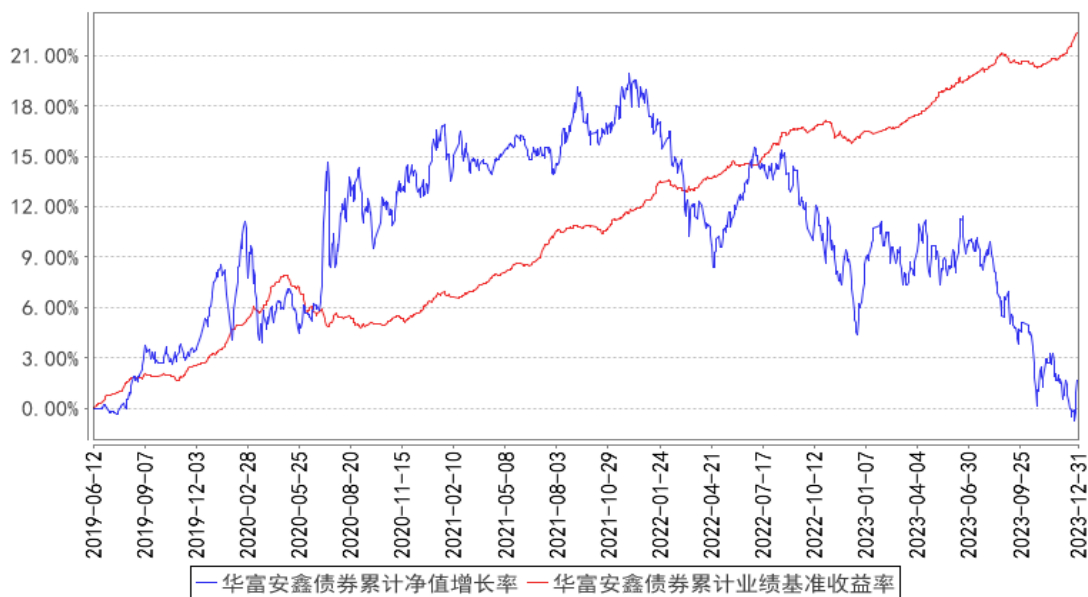
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%	-	0.36%
自基金合同生效起至今	1.67%	0.46%	22.38%	0.07%	-	0.39%
					26.18%	
					20.71%	

注：本基金业绩比较基准=中证全债指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

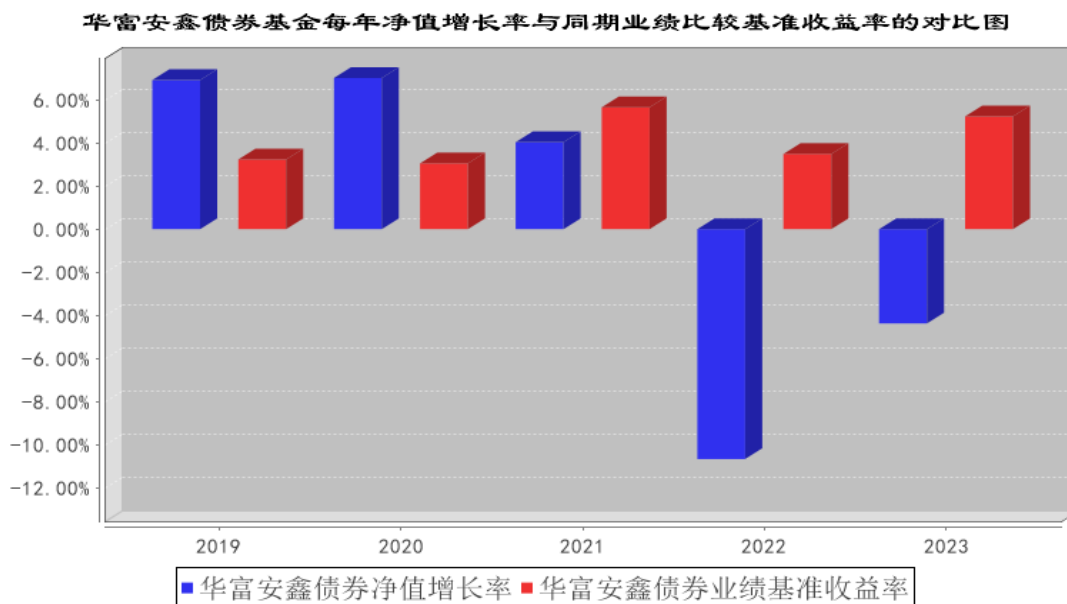


注：1、本基金由华富保本混合型证券投资基金 2019 年 6 月 12 日转型而来。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	0.8800	1,719,684.56	2,266,759.97	3,986,444.53	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	0.8800	1,719,684.56	2,266,759.97	3,986,444.53	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵

活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富国潮优选混合型发起式证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金、华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金共六十一只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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。
张惠	本基金基金经理、固定收益部副总监	2019年6月12日	2023年9月12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、总监助理，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，公司制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公司的公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体控制措施如下：

在研究分析和投资决策环节，公司通过建立规范、完善的研究管理平台，为所有的投资组合经理提供公平的研究服务和支持。公司的各类投资组合，在保证其决策相对独立的同时，在获取投资信息、投资建议及决策实施方面均享有公平的机会。各投资组合经理根据其管理的投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行投资决策，保证各投资组合投资决策的客观性和独立性。

在交易执行环节，公司设立独立的集中交易部门，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。交易执行的公平原则：“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。公司通过完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，确保各投资组合获得公平的交易机会。

在行为监控和分析评估环节，公司将公平交易作为日常交易监控的重要关注内容，加强对投资交易行为的监督力度，公司集中交易部、风险管理部等相关部门严格按照公司关于异常交易的界定规则对违反公平交易原则的异常交易进行识别、监控与分析。每日交易时间结束后，集中交易部对每一笔公平交易的执行结果进行登记，逐笔备注发生公平交易各指令的先后顺序及实际执行结果，由具体执行的交易员签字确认留档，并交风险管理部备案。公司风险管理部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，根据纳入样本内的数据分析结果，未发现明显异常情况。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内方面，2023 全年 GDP 增速达 5.2%，完成了年初“两会”时制定的经济增长目标。从节奏上看，经济增速整体前高后低。从结构来看，地产仍然是宏观经济中最大的影响因素。整体看，受地产低迷导致的资产收缩影响，全年居民消费仍然偏弱，仅实现小幅正增长。为应对国内有效需求不足的情况，2023 年宏观政策转向积极：房地产政策放松加快；货币政策多次降准降息，PSL 也再度启动，持续压降社会融资成本；财政增发国债 1 万亿，基建投资增速维持在较高的水平。通胀方面，由于内生需求整体一般，叠加全球大宗商品价格趋于回落，2023 年 CPI、PPI 同比维持低位，国内通胀压力并不大。

海外方面，2023 年是通胀放缓、实体强劲与金融风险交织的一年，货币政策由紧缩到暂停再到逐渐转向。2023 年一季度美国通胀延续放缓，海外金融体系遭遇黑天鹅事件，银行危机暴露出资产端亏损与流动性不足问题，加剧了市场对提前降息的预期；但美联储迅速释放补充流动性，危机暂时解除。二季度开始，美国经济逐渐展现韧性，服务通胀仍高企，紧缩进程重启。三季度，美国银行风险缓解，经济基本面强劲，但制造业持续走弱。从四季度开始，9 月的 FOMC 决议不加息，美债利率下行，市场开始交易加息停止与降息预期，联储官员内部由分歧加剧到逐渐一致，并在 12 月的会议中首次正式提及降息。

资产表现方面，2023 全年演绎了比较明显的资产荒，债券全年收益率下行，信用利差和期限利差全年呈现“牛平”；权益市场择时一波三折，震荡幅度较大，风格切换和行业轮动都很快，对于机构投资者的操作构成了较大的挑战，全年呈现 AI 主题与小盘股活跃、大盘“中特估”与高分红蓝筹表现稳健，而其他板块表现疲弱的格局；可转债市场中证转债指数全年跌 0.47%，债强股弱的情况下，转债整体具备一定的抗跌性，指数走势平稳。策略方面差异较大，反转因子和红利因子占优，上半年股性策略超额收益远大于防御性策略，7 月份之后债性策略才开始有起色，全年看 2023 年高 YTM 和双低均表现不俗。

回顾 2023 年，本基金年初基于对于大类资产上超配权益资产的判断，保持了整个组合高权益 β 的特征。在一季度整体权益市场疫情开放后的春季躁动、二季度阶段性的 AI 产业主题热情

较高的环境下，本基金一度取得了不错的收益，但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 β 表现比较差，本基金出现了快速的补跌甚至超跌，二季度后市场风险偏好与基本面大幅的转向下，本基金未能执行防守转向，需要深刻反省和反思，在此向投资者表达我最诚挚的歉意。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。

4.4.2 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-4.37%，同期业绩比较基准收益率为 5.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，国内方面，市场可能面临在经济结构转型下的结构冷热不均的宏观环境。传统老经济支柱地产的回落一定程度上制约了经济向上的弹性，其次，降低社会融资成本的长期目标下，货币政策易松难紧，预计 2024 年央行仍然会通过 MLF、LPR 降息等，引导实体经济融资成本下行。当前我国经济面对复杂多变的国际形势，正在探寻转型之路：从外需驱动转向内需扩张，从投资推动转向消费拉动，从高增速转向高质量，从工业化转向服务业。

海外方面，2024 年将是美联储货币宽松转向的正式年，最为重要的问题是美联储降息开启时点和幅度，目前市场的主流预期是 5 月开始降息，全年 140BP。如此强烈的降息预期导致年初以来海外各资产都出现了较大幅度的上涨，但我们研究团队认为海外市场对降息节奏和幅度可能过于乐观，因此还是需要做好资产定价与预期的匹配度。

资产赔率角度，截至 24 年 1 月末，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 1.29%，处历史 90%分位，近 5 年 98%分位，近 3 年 99%分位；股债收益差（美债定价修正后）为-0.84%，处历史 94%分位，近 5 年 100%分位，近 3 年 99%分位；权益资产略便宜一些，全 A 非金融石油石化 PE 25 倍，PB 是 1.95 倍，处在 10-20%的分位，而股息率则在近 1.83%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%，处于近一年 6%分位，但仍处在 20 年以来 60%分位，以及历史的 80%分位，但可转债价格中位数、纯债溢价率均处于 18 年以来的底部位置，显示风险资产的赔率确实已经处于很高的位置。

股票市场估值无疑处于中长期的底部区域，这是基本面、资金面和情绪面多重因素交织的结

果。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海外资金的态度；②国内资金如机构资金负债端的压力、理财平台流动性的压力；③如何继续保持长期经济增长的信心。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。另外 H 股估值横向与纵向均处于低洼处，仍具较好的阶段性配置价值。

可转债方面，整体性价比逐步提高，尤其是在资产荒大背景下，不少数量的可转债已经出现了较高甚至不低于同等级信用债的 YTM，只是因为票息梯度的原因，久期较长的可转债在短期的票息保护不够充分，但从中长期角度看，当前无疑是风险收益比较高的位置了。仍需要注意的风险在于一些尾部个券出现信用风险，可能导致转债急跌，但遇到这种超跌时也是很好的交易机会。

纯债方面，从赔率角度看，当前利率债绝对收益率及期限利差均处于历史低位，历史维度下，利率债赔率偏低，但中长期资产荒背景下债券的胜率仍高，目前以长久期利率债作为阶段性对冲工具。

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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年度，为加强公司内部控制，监察稽核工作从制度建设和内部监察稽核入手为公司持续发展奠定坚实的基础。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，独立、客观、公正地开展基金运作和公司管理的合规性监察，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

1、逐步建立和完善架构清晰、控制有效的内部控制机制。2023 年公司为进一步优化股票池管理流程与规范，明确股票池的评议、决策、维护机制，修订了《华富基金管理有限公司股票池管理办法》；为落实《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其配套规则最新修订的相关要求，公司针对性制定了《华富基金管理有限公司私募资产管理计划关联交易管理办法》；为满足公司业务发展，规范业务流程，公司制定了《华富基金管理有限公司基金中基金投资管理办法》、《华富基金管理有限公司基金中基金登记业务制度》、《华富基金管理有限公司基金中基金估值制度》、《华富基金管理有限公司基金池管理办法》；为落实《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》相关要求，规范公司董事、监事、高级管理人员、基金从业人员及其配偶、利害关系人的证券、基金（货币市场基金除外）和未上市企业股权的投资行

为，以及相应的申报、登记、审查管理流程，制定了《华富基金管理有限公司基金从业人员投资申报管理制度》，同时废止了《华富基金管理有限公司基金从业人员个人证券投资管理制度》以及《华富基金管理有限公司基金从业人员投资证券投资基金管理办法》；为进一步规范公司费用报销流程，修订了《华富基金管理有限公司费用报销管理办法》；为落实“廉洁从业、道德规范、声誉维护、合规管理”的行为规范和岗位要求，制定或修订了公司相关人力资源管理制度；为进一步细化信息披露工作的组织、审核和发布流程，保障信息披露的准确性和及时性和完整性，公司修订了《华富基金管理有限公司公开募集证券投资基金信息披露细则》。

2、多方位开展监察稽核工作，不断提高稽核覆盖面和检查力度。通过定期和不定期监察稽核工作的开展，公司的各个部门、各项业务的规范性和完善性都得到了较大的提高，各部门及时发现和弥补了制度建设中的漏洞和缺陷，实际业务操作流程更加科学有效。

3、加强风险监控，严格控制投资风险，通过对各基金的运行状况、投资比例、相关指标进行监控和跟踪，及时报告异常情况，确保基金投资规范运作。

4、扩大风险控制工作的覆盖面。风险控制工作不再局限于投资管理，从公司运营整体规范要求，风险控制渗透在业务的各个环节和所有部门，由风险控制委员会组织、监察稽核部执行，识别和评估从治理结构到一线业务操作等公司各方面、各业务流程中公司运作和基金管理的风险点和风险程度，明确划分风险责任，并制定相应的风险控制措施。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《证券投资基金运作管理办法》和《华富安鑫债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本报告期内共进行三次利润分配，分配金额合计为 3,986,444.53 元，符合基金合同相关约定。本期利润为-1,865,713.97 元，期末可供分配的利润-2,574,976.53 元，滚存至下一期进行分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2022 年 11 月 08 日起至 2023 年 1 月 13 日，本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于 5000 万元的情形，2023 年 1 月 16 日起至 2023 年 02 月 02 日本基金基金资产净值已满 5000 万。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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对华富安鑫债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对华富安鑫债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审〔2024〕6-32号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华富安鑫债券型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了华富安鑫债券型证券投资基金（以下简称华富安

	<p>鑫债券基金) 财务报表, 包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表, 2023 年度的利润表、净资产变动表, 以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了华富安鑫债券基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况, 以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于华富安鑫债券基金及其管理人华富基金管理有限公司(以下简称基金管理人), 并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>基金管理人管理层(以下简称管理层)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 管理层负责评估华富安鑫债券基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层(以下简称治理层)负责监督华富安鑫债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p>

	<p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对华富安鑫债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华富安鑫债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	樊冬 沈文伟
会计师事务所的地址	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华富安鑫债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	174,125.33	289,685.55
结算备付金		495,740.51	1,347,974.18
存出保证金		4,408.07	6,124.76
交易性金融资产	7.4.7.2	48,268,913.37	58,152,259.00
其中：股票投资		8,369,752.17	9,440,068.64

基金投资		-	-
债券投资		39,899,161.20	48,712,190.36
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		115,593.09	31,615.86
应收股利		-	-
应收申购款		1,666.83	1,301.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		49,060,447.20	59,828,960.53
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,301,761.93	12,008,277.85
应付清算款		153,729.84	-
应付赎回款		50,268.84	262.91
应付管理人报酬		25,052.23	28,655.64
应付托管费		7,157.77	8,187.28
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		966.08	1,023.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	34,383.42	127,858.39
负债合计		6,573,320.11	12,174,265.22
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	45,062,103.62	44,508,789.08
未分配利润	7.4.7.8	-2,574,976.53	3,145,906.23
净资产合计		42,487,127.09	47,654,695.31
负债和净资产总计		49,060,447.20	59,828,960.53

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9443 元，基金份额总额 44,991,761.30 份。

7.2 利润表

会计主体：华富安鑫债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
一、营业总收入		-1,254,060.16	-4,809,065.26
1. 利息收入		11,011.51	10,680.68
其中：存款利息收入	7.4.7.9	11,011.51	10,680.68
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,351,455.65	-2,439,995.19
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-2,125,494.01	-3,501,671.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	671,810.59	922,731.27
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	102,227.77	138,945.09
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	83,699.55	-2,381,537.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,684.43	1,786.72
减：二、营业总支出		611,653.81	739,804.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	324,543.42	351,352.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	92,726.71	100,386.44
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		135,231.06	146,668.96
其中：卖出回购金融资产支出		135,231.06	146,668.96
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		592.62	2,605.72
8. 其他费用	7.4.7.19	58,560.00	138,790.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,865,713.97	-5,548,869.72

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,865,713.97	-5,548,869.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,865,713.97	-5,548,869.72

7.3 净资产变动表

会计主体：华富安鑫债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	44,508,789.08	-	3,145,906.23	47,654,695.31
二、本期期初净资产	44,508,789.08	-	3,145,906.23	47,654,695.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	553,314.54	-	-5,720,882.76	-5,167,568.22
（一）、综合收益总额	-	-	-1,865,713.97	-1,865,713.97
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	553,314.54	-	131,275.74	684,590.28
其中：1. 基金申购款	7,816,561.57	-	397,111.55	8,213,673.12
2. 基金赎回款	-7,263,247.03	-	-265,835.81	-7,529,082.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-3,986,444.53	-3,986,444.53
四、本期期末净资产	45,062,103.62	-	-2,574,976.53	42,487,127.09
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	43,742,545.10	-	8,685,490.92	52,428,036.02
二、本期期初净资产	43,742,545.10	-	8,685,490.92	52,428,036.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	766,243.98	-	-5,539,584.69	-4,773,340.71
（一）、综合收益总额	-	-	-5,548,869.72	-5,548,869.72
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	766,243.98	-	9,285.03	775,529.01
其中：1. 基金申购款	5,985,134.18	-	686,767.69	6,671,901.87
2. 基金赎回款	-5,218,890.20	-	-677,482.66	-5,896,372.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	44,508,789.08	-	3,145,906.23	47,654,695.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华富保本混合型证券投资基金从 2019 年 6 月 12 日转型为华富安鑫债券型证券投资基金。华富保本混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（[2013]69 号）核准。基金合同于 2013 年 4 月 24 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（天健验（2013）6-3 号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金

的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《华富安鑫债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合比例为：本基金对债券、货币市场工具等固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，基金保留不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存储保证金及应收申购款等；权证的投资比例不超过基金资产的净值的 3%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金目前暂无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。在考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息的基础上，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失，应当分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。本基金确定金融工具在估值日只具有较低的信用风险的，可以假设该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加（即处于第一阶段）。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

（1）收取金融资产现金流量的合同权利终止；（2）金融资产已转移，且已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（3）金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对金融资产的控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数

据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设

1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告〔2017〕13号）规定，在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下：

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

② 对不存在活跃市场的投资品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

③ 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），根据中国证券投资基金业协会《关于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的通知》（中基协发〔2017〕6号），估值处理如下：

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值： $FV=S \times (1-LoMD)$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值；S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。LoMD=P/S，P 是估值日看跌期权的价值。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认；
卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后最后一位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式及红利再投资形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

无。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告（2017）13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告（2017）13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的

指导意见》以及《关于固定收益品种的估值处理标准》采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策无重大变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金会计估计无重大变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2012〕85号）、《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2014〕81号）、《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税〔2016〕127号）、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36号）、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税〔2016〕46号）、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2016〕70号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

（二）对基金买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（三）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对

基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(四) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称中国结算)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(五) 主要税种及税率列示如下：

税种	计税依据	税率
增值税	以按税法规定计算的金融服务销售额	3%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	174,125.33	289,685.55
等于：本金	174,114.46	289,670.40
加：应计利息	10.87	15.15
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	174,125.33	289,685.55

注：“其他存款”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的

银行存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	9,133,653.44	-	8,369,752.17	-763,901.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	198,758.40	39,899,161.20	-497,825.14
	银行间市场	-	-	-
	合计	198,758.40	39,899,161.20	-497,825.14
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,331,881.38	198,758.40	48,268,913.37	-1,261,726.41
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	9,725,544.75	-	9,440,068.64	-285,476.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	416,153.98	48,712,190.36	-1,059,949.85
	银行间市场	-	-	-
	合计	416,153.98	48,712,190.36	-1,059,949.85
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	59,081,530.98	416,153.98	58,152,259.00	-1,345,425.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	12.97	0.25
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	5,070.45	18,558.14
其中：交易所市场	5,070.45	18,558.14
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	20,000.00	20,000.00
中债账户维护费	4,500.00	4,500.00
应付信息披露费	-	80,000.00
上清账户维护费	4,800.00	4,800.00
合计	34,383.42	127,858.39

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,439,195.03	44,508,789.08
本期申购	7,804,447.30	7,816,561.57
本期赎回（以“-”号填列）	-7,251,881.03	-7,263,247.03
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	44,991,761.30	45,062,103.62

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,364,568.13	-3,218,661.90	3,145,906.23
本期期初	6,364,568.13	-3,218,661.90	3,145,906.23
本期利润	-1,949,413.52	83,699.55	-1,865,713.97
本期基金份额交易产生的变动数	137,129.70	-5,853.96	131,275.74
其中：基金申购款	733,583.92	-336,472.37	397,111.55
金赎回款	-596,454.22	330,618.41	-265,835.81
本期已分配利润	-3,986,444.53	-	-3,986,444.53
本期末	565,839.78	-3,140,816.31	-2,574,976.53

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	1,285.82	1,854.24
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	9,606.46	8,703.71
其他	119.23	122.73
合计	11,011.51	10,680.68

注：“其他存款利息收入”所列金额为基金投资于有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利

息损失的银行存款利息收入。“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,125,494.01	-3,501,671.55
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-2,125,494.01	-3,501,671.55

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	23,259,334.00	34,533,002.86
减：卖出股票成本总额	25,317,283.44	37,930,278.77
减：交易费用	67,544.57	104,395.64
买卖股票差价收入	-2,125,494.01	-3,501,671.55

7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	499,745.88	1,352,887.10

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	172,064.71	-430,155.83
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	671,810.59	922,731.27

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	110,220,532.83	89,453,125.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	109,340,813.11	88,626,881.49
减：应计利息总额	701,070.13	1,253,322.99
减：交易费用	6,584.88	3,076.65
买卖债券差价收入	172,064.71	-430,155.83

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	102,227.77	138,945.09
其中：证券出借权益 补偿收入	-	-
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	102,227.77	138,945.09

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	83,699.55	-2,381,537.47
股票投资	-478,425.16	-135,079.03
债券投资	562,124.71	-2,246,458.44
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-

其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	83,699.55	-2,381,537.47

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	2,683.49	1,786.72
基金转换费收入	0.94	-
合计	2,684.43	1,786.72

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	-	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,360.00	1,290.75
账户维护费	37,200.00	37,200.00
其他	-	300.00
合计	58,560.00	138,790.75

7.4.7.20 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

华富基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
合肥兴泰金融控股（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海华富利得资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
华安证券	36,182,202.13	78.12	7,486,807.83	10.79

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
华安证券	154,022,705.49	77.56	12,274,629.88	8.00

注：本表中“当期债券成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券交易成交总额。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
华安证券	1,124,550,000.00	97.94	29,100,000.00	2.38

注：本表中“当期债券回购成交总额”为当期通过交易单元进行的交易所债券回购成交总额。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华安证券	33,708.07	78.31	5,070.45	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华安证券	6,838.90	10.66	764.45	4.12

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	324,543.42	351,352.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	63,212.04	76,338.57
应支付基金管理人的净管理费	261,331.38	275,014.02

注：基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	92,726.71	100,386.44

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内和上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本报告期内及上年度可比期间没有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本报告期内及上年度可比期间没有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金合同生效日（2019年6月12日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	3,333,828.13	0.00
报告期间申购/买入总份额	287,203.99	3,333,828.13
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	3,621,032.12	3,333,828.13
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.05%	7.50%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
上海华富利得资产管理有限公司	22,179,158.37	49.30	20,420,007.28	45.95

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	174,125.33	1,285.82	289,685.55	1,854.24

注：本表仅列示活期存款余额及产生的利息收入。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合 计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 1 月 19 日	-	2023 年 1 月 19 日	0.3550	720,476.43	886,709.27	1,607,185.70	-
2	2023 年 4 月 20 日	-	2023 年 4 月 20 日	0.3050	590,130.74	788,999.22	1,379,129.96	-
3	2023 年 7 月 12 日	-	2023 年 7 月 12 日	0.2200	409,077.39	591,051.48	1,000,128.87	-
合计	-	-	-	0.8800	1,719,684.56	2,266,759.97	3,986,444.53	-

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 6,301,761.93 元，于 2024 年 01 月 04 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的风险管理部、监察稽核部，对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	12,778,282.24	20,292,545.72
AAA 以下	18,372,084.38	18,739,215.71
未评级	-	-
合计	31,150,366.62	39,031,761.43

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	174,125.33	-	-	-	-	-	174,125.33
结算备付金	495,740.51	-	-	-	-	-	495,740.51
存出保证金	4,408.07	-	-	-	-	-	4,408.07
交易性金融资产	4,031,124.34	7,759,016.47	19,957,657.87	1,714,603.56	6,436,758.96	8,369,752.17	48,268,913.37
衍生	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,666.83	1,666.83
应收清算款	-	-	-	-	-	115,593.09	115,593.09
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,705,398.25	7,759,016.47	19,957,657.87	1,714,603.56	6,436,758.96	8,487,012.09	49,060,447.20
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	50,268.84	50,268.84

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,052.23	25,052.23
应付托管费	-	-	-	-	-	7,157.77	7,157.77
应付清算款	-	-	-	-	-	153,729.84	153,729.84
卖出回购金融资产款	6,301,761.93	-	-	-	-	-	6,301,761.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应	-	-	-	-	-	966.08	966.08

交税费							
其他负债	-	-	-	-	-	34,383.42	34,383.42
负债总计	6,301,761.93	-	-	-	-	271,558.18	6,573,320.11
利率敏感度缺口	1,596,363.68	7,759,016.47	19,957,657.87	1,714,603.56	6,436,758.96	8,215,453.91	42,487,127.09
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	289,685.55	-	-	-	-	-	289,685.55
结算备付金	1,347,974.18	-	-	-	-	-	1,347,974.18
存出保证金	6,124.76	-	-	-	-	-	6,124.76

交易性金融资产	1,041,579.34	12,054,777.81	28,193,080.28	1,582,003.56	5,840,749.37	9,440,068.64	58,152,259.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,301.18	1,301.18
应收清算款	-	-	-	-	-	31,615.86	31,615.86
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产	2,685,363.83	12,054,777.81	28,193,080.28	1,582,003.56	5,840,749.37	9,472,985.68	59,828,960.53

总计							
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	262.91	262.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,655.64	28,655.64
应付托管费	-	-	-	-	-	8,187.28	8,187.28
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	12,008,277.85	-	-	-	-	-	12,008,277.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投	-	-	-	-	-	-	-

资 顾 问 费							
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
应 交 税 费	-	-	-	-	-	1,023.15	1,023.15
其 他 负 债	-	-	-	-	-	127,858.39	127,858.39
负 债 总 计	12,008,277.85	-	-	-	-	165,987.37	12,174,265.22
利 率 敏 感 度 缺 口	9,322,914.02	12,054,777.81	28,193,080.28	1,582,003.56	5,840,749.37	9,306,998.31	47,654,695.31

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 除利率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率下降 25 基点	536,614.79	458,293.42
市场利率上升 25 基点	-519,749.10	-442,882.10	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	8,369,752.17	19.70	9,440,068.64	19.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	39,899,161.20	93.91	48,712,190.36	102.22
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	48,268,913.37	113.61	58,152,259.00	122.03

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	沪深 300 指数上升百分之五	448,543.55	93,561.44
沪深 300 指数下降	-448,543.55	-93,561.44	

	百分之五		
--	------	--	--

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	37,805,515.23	36,207,146.32
第二层次	10,463,398.14	21,945,112.68
第三层次	-	-
合计	48,268,913.37	58,152,259.00

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	121,667.99	0.25
9	合计	49,060,447.20	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
11	000408	藏格矿业	13,100	331,954.00	0.78
12	003020	立方制药	11,050	311,057.50	0.73
13	600489	中金黄金	30,000	298,800.00	0.70
14	688351	微电生理	11,600	297,540.00	0.70
15	000568	泸州老窖	1,600	287,072.00	0.68
16	002409	雅克科技	5,100	284,223.00	0.67
17	601595	上海电影	11,000	284,130.00	0.67
18	002230	科大讯飞	5,600	259,728.00	0.61
19	600132	重庆啤酒	3,900	259,155.00	0.61
20	688180	君实生物	6,000	250,980.00	0.59
21	603444	吉比特	900	220,608.00	0.52
22	002597	金禾实业	9,737	213,337.67	0.50
23	688147	微导纳米	5,000	194,950.00	0.46
24	000625	长安汽车	9,000	151,470.00	0.36
25	600026	中远海能	12,000	146,880.00	0.35
26	300416	苏试试验	7,000	128,590.00	0.30
27	002567	唐人神	17,000	127,500.00	0.30
28	688766	普冉股份	1,200	117,576.00	0.28
29	000596	古井贡酒	500	116,400.00	0.27

30	002465	海格通信	6,500	83,525.00	0.20
----	--------	------	-------	-----------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	880,075.00	1.85
2	600350	山东高速	791,514.00	1.66
3	688521	芯原股份	742,429.62	1.56
4	600547	山东黄金	720,080.00	1.51
5	603708	家家悦	619,342.00	1.30
6	300820	英杰电气	517,007.00	1.08
7	000858	五粮液	515,282.00	1.08
8	300274	阳光电源	468,096.00	0.98
9	603259	药明康德	461,337.00	0.97
10	000999	华润三九	442,593.00	0.93
11	002158	汉钟精机	437,385.00	0.92
12	600009	上海机场	429,399.00	0.90
13	600030	中信证券	425,662.00	0.89
14	003020	立方制药	415,557.00	0.87
15	688630	芯碁微装	408,662.46	0.86
16	603528	多伦科技	406,073.50	0.85
17	600012	皖通高速	403,408.00	0.85
18	601117	中国化学	399,857.40	0.84
19	002050	三花智控	391,525.00	0.82
20	600489	中金黄金	386,750.00	0.81

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600350	山东高速	786,600.00	1.65
2	603708	家家悦	551,801.00	1.16
3	601601	中国太保	547,765.00	1.15
4	688521	芯原股份	543,127.64	1.14
5	300308	中际旭创	485,848.00	1.02
6	603733	仙鹤股份	482,349.00	1.01
7	600009	上海机场	481,530.00	1.01
8	600547	山东黄金	470,883.00	0.99
9	000999	华润三九	434,493.00	0.91

10	601117	中国化学	429,274.72	0.90
11	000733	振华科技	426,299.00	0.89
12	688599	天合光能	417,079.11	0.88
13	000858	五粮液	408,460.00	0.86
14	000568	泸州老窖	408,000.00	0.86
15	300274	阳光电源	401,691.00	0.84
16	300737	科顺股份	382,811.00	0.80
17	603233	大参林	380,367.00	0.80
18	600012	皖通高速	373,564.00	0.78
19	603528	多伦科技	372,287.11	0.78
20	300171	东富龙	367,716.00	0.77

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	24,725,392.13
卖出股票收入（成交）总额	23,259,334.00

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	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

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货

8.10.2 本期国债期货投资评价

无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,408.07
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,667.99

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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

8.11.5 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情况。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,121	21,212.52	25,810,116.76	57.37	19,181,644.54	42.63

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	27,778.82	0.0617

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 6 月 12 日) 基金份额总额	107,228,241.96
本报告期期初基金份额总额	44,439,195.03
本报告期基金总申购份额	7,804,447.30
减：本报告期基金总赎回份额	7,251,881.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	44,991,761.30

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人重大人事变动情况如下：

2023 年 11 月 8 日，经向监管机构备案并收到监管无异议函，聘任林之懿女士担任公司督察长，满志弘女士不再担任公司督察长。

2023 年 12 月 19 日，经公司董事会审议批准，聘任陈启明先生、尹培俊先生担任公司副总经理。

本基金本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。本基金本年度需支付给审计机构天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 2 万元人民币。天健会计师事务所（特殊普通合伙）从 2012 年起为本公司提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及其高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-08-31
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	信息披露内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	公司已按要求完成整改并提交整改报告。
其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员不存在受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华安证券	2	36,182,202.13	78.12	33,708.07	78.31	-
浙商证券	1	10,135,523.29	21.88	9,337.77	21.69	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号），我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2)此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3)本报告期本基金新增国信证券 1 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华安证券	154,022,705.49	77.56	1,124,550,000.00	97.94	-	-
浙商证券	34,991,562.05	17.62	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	23,600,000.00	2.06	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	9,558,449.00	4.81	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-

券						
---	--	--	--	--	--	--

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华富基金管理有限公司关于旗下基金2022年度最后一日基金份额净值及基金份额累计净值的公告	中国证监会指定披露媒介	2023年1月1日
2	华富安鑫债券型证券投资基金2023年第一次分红公告	中国证监会指定披露媒介	2023年1月18日
3	华富安鑫债券型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023年1月20日
4	华富安鑫债券型证券投资基金2022年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023年3月31日
5	华富安鑫债券型证券投资基金2023年第二次分红公告	中国证监会指定披露媒介	2023年4月19日
6	华富安鑫债券型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023年4月21日
7	华富安鑫债券型证券投资基金2023年第三次分红公告	中国证监会指定披露媒介	2023年7月11日
8	华富安鑫债券型证券投资基金2023年第2季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023年7月21日
9	华富安鑫债券型证券投资基金2023年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2023年8月30日
10	华富基金管理有限公司澄清公告	中国证监会指定披露媒介	2023年9月7日
11	华富安鑫债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2023年9月14日
12	华富安鑫债券型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023年9月14日
13	华富安鑫债券型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2023年9月14日
14	华富安鑫债券型证券投资基金2023年第3季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023年10月25日
15	华富基金有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023年11月9日
16	华富基金有限公司基金澄清公告	中国证监会指定披露媒介	2023年11月10日
17	华富安鑫债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2023年11月28日
18	华富安鑫债券型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会指定披露媒介	2023年11月28日
19	华富基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023年12月21日
20	华富基金管理有限公司关于副总经理	中国证监会指定披露媒介	2023年12月21日

变更的公告	介
-------	---

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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. 1. 1-2023. 12. 31	20,420,007.28	1,759,151.09	0.00	22,179,158.37	49.30
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 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 3 月 30 日