

# 华富恒利债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 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 4 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 04 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 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 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	1,588,498.48 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	628,593.61 份	959,904.87 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 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)	
	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C
1. 本期已实现收益	-4,719.74	-12,097.09
2. 本期利润	1,190.62	5,882.36
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0028	0.0018
4. 期末基金资产净值	65,198.82	65,198.82
5. 期末基金份额	1,030	1,030

金份	7	2
额净		
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	-0.29%	0.16%	0.98%	0.04%	-1.27%	0.12%
过去六个月	-5.56%	0.44%	0.84%	0.07%	-6.40%	0.37%
过去一年	-11.06%	0.42%	3.69%	0.06%	-14.75%	0.36%
过去三年	-1.95%	0.39%	10.54%	0.07%	-12.49%	0.32%
过去五年	0.99%	0.40%	27.24%	0.07%	-26.25%	0.33%
自基金合同 生效起至今	7.76%	0.34%	36.63%	0.07%	-28.87%	0.27%

华富恒利债券 C

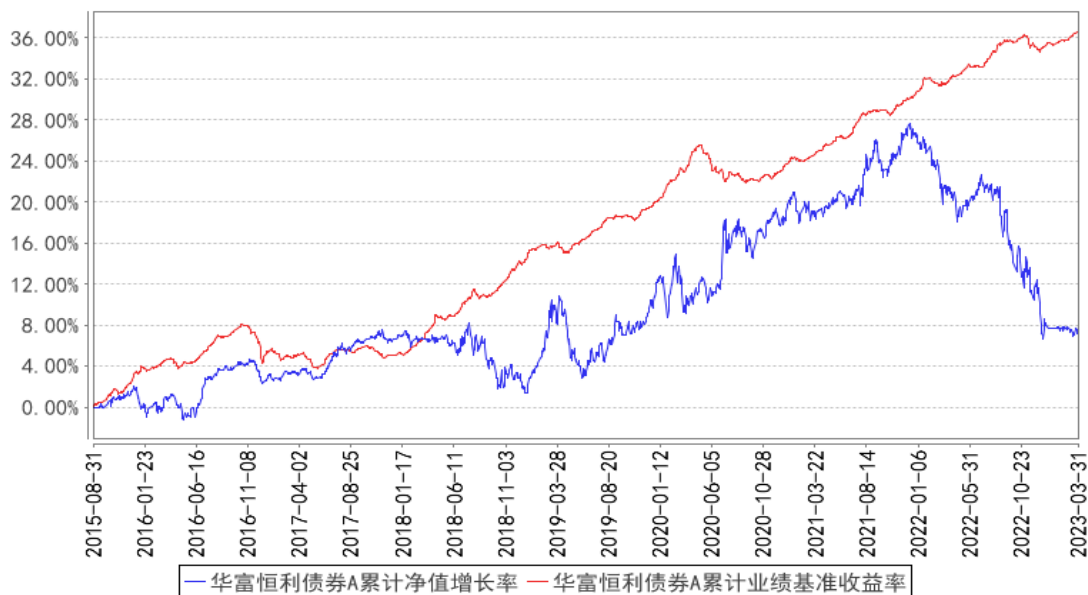
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.40%	0.16%	0.98%	0.04%	-1.38%	0.12%
过去六个月	-5.74%	0.43%	0.84%	0.07%	-6.58%	0.36%
过去一年	-11.48%	0.42%	3.69%	0.06%	-15.17%	0.36%
过去三年	-3.21%	0.39%	10.54%	0.07%	-13.75%	0.32%
过去五年	-3.12%	0.40%	27.24%	0.07%	-30.36%	0.33%

自基金合同 生效起至今	2.11%	0.34%	36.63%	0.07%	-34.52%	0.27%
----------------	-------	-------	--------	-------	---------	-------

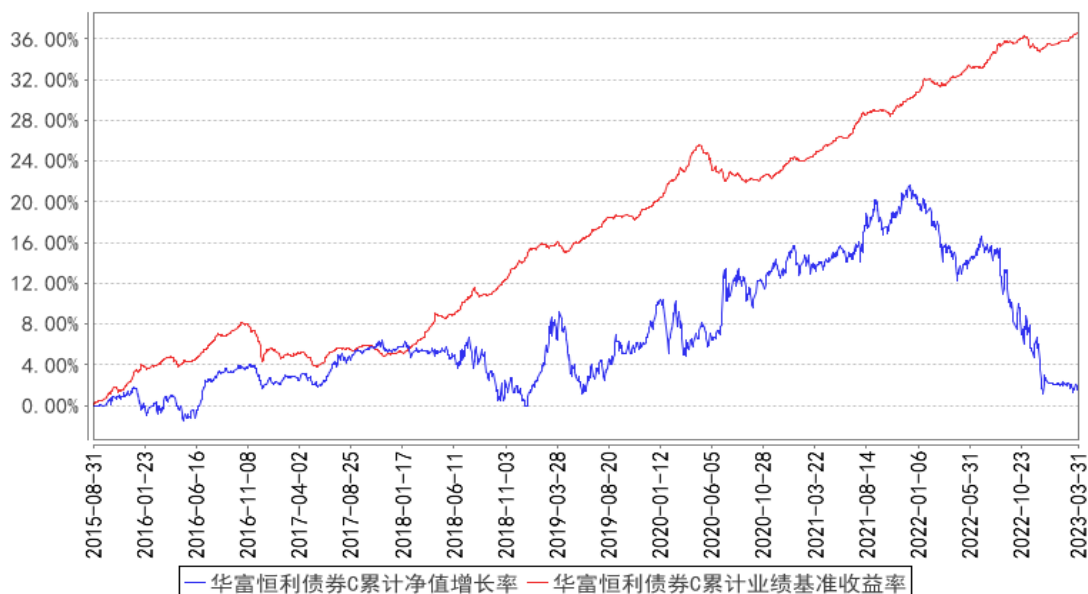
注：本基金业绩比较基准收益率 = 中证全债指数收益率。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华富恒利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华富恒利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富恒利债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；投资于现金或者到期日在

一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金建仓期为 2015 年 8 月 31 日到 2016 年 2 月 29 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富恒利债券型证券投资基金基金合同》的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张惠	本基金基金经理、固定收益部副总监	2015 年 8 月 31 日	-	十六年	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

一季度，国内经济整体步入疫后修复阶段。1-3 月随着内需逐步升温，制造业 PMI 明显高于荣枯线，经济出现明显改善。一季度非制造业的表现比制造业更好，与疫后线下消费场景恢复有较大的关系，1-2 月社零同比增速攀升至 3.5%，较去年 12 月明显改善。受积压需求释放及居民购房信心回暖影响，核心城市一手房、二手房成交面积逐月回升，地产景气度边际修复。与经济数据相匹配的是，一季度融资数据表现较好，受企业中长贷拉动，2 月人民币贷款增速较去年末抬升 0.5% 至 11.6%。与国内形成反差的是，出口端整体弱势，海外边际降温、国内边际回暖的格局还在延续。3 月份两会政府工作报告将 GDP 预期目标定为“5.0% 左右”，既考虑了“稳中求进”的工作总基调，又反映了新政府对经济质的诉求高于量。货币政策方面，央行于四季度货币政策执行报告重提引导市场利率围绕政策利率波动，或有意将去年偏宽松的流动性适度回收。同时央行于三月中旬超预期降准，致力于缓解银行负债端压力，推动金融系统更好的支持实体经济增长。整体来说，一季度银行间流动性保持在合理适度的状态。

海外方面，一方面美国通胀的紧张状态正在边际放缓，CPI 与 PCE 通胀在逐月下行，美联储紧缩周期逐渐接近尾声。此外，美国劳动力市场的强劲以及劳动供给的改善支撑了经济的软着陆可能性。往后看，美国通胀下行趋势基本确立，而新增就业与失业率将会市场关注的焦点。另一

方面，硅谷银行破产、瑞信被瑞银收购等黑天鹅事件显示出欧美金融体系的问题，体现为银行的资产端亏损与负债端流动性不足。尤其是在紧缩周期下，相对脆弱的中小型银行以及长期亏损的大型银行在受到挤兑后爆发危机极为迅速；对此，各国央行也相继及时出手，暂时避免了风险的大面积传播。在通胀降温与金融风险频发的背景下，市场降息预期大幅升温，黄金、美债受到利好涨幅明显，非银行板块海外的风险资产也在流动性预期改善下有所反弹。

2023 年一季度，债券市场整体温和平稳，股票市场整体反弹，结构性上涨明显，可转债市场跟随权益有所上行。国内债券市场方面，一季度在资金中枢抬升、经济温和复苏的影响下，利率债收益率曲线小幅熊平。股票市场方面，一季度在国内大兴数字经济叠加 ChatGPT 引爆全球 AI 产业热情的背景下，TMT 板块表现异常优秀，计算机、传媒、通信、电子板块分别上涨 38.7%、34.3%、28.9%和 16.9%，此外，在“中特估”的推动下，建筑、石油石化行业也涨幅超 10%，相反，由于市场缺乏增量资金，在存量博弈下，房地产、消费者服务、银行和电力设备新能源等板块一季度跌幅明显。可转债市场方面，由于权益市场的上行，带动可转债整体上行，并小幅消化了一定转股溢价率，可转债对应正股指数上涨 9.12%的情况下，中证转债指数一季度收涨 3.53%，等权可转债指数收涨 6.38%。

回顾一季度，本基金基于年初对于大类资产上超配权益资产的判断，将大类资产配置逐渐从无风险资产向风险资产移动，进一步提高了组合的风险资产仓位。在行业配置上，一方面站在全年维度我们选择了业绩有望困境反转的计算机和医药板块，同时基于 ChatGPT 的问世所带来的新产业趋势，我们增加了以半导体为代表的电子行业个股配置；一方面，我们选择了在去年的业绩低点之后今年受益于疫后复苏的大消费和地产链个股进行配置。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。

展望二季度，国内经济延续复苏的进程，市场对于经济复苏的方向普遍认可而对复苏的高度也普遍谨慎。4 月开始进入一季报披露期，预计一季度为全年低点，二三四季度逐级回升，业绩小幅增长为权益市场的提供了小幅上行的基础。海外方面，预计随着通胀约束的缓解美联储二季度将结束加息，叠加近期中国在外交与人民币结算方面动作相对积极，预计二季度仍然会呈现人民币资产较强、美元走弱的格局。然而市场当前对于美联储三季度转向降息的预期相对较满，需要警惕的是年内降息阶段性后移或落空对资产的扰动。

在资产配置上，债券的胜率仍不低，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，更多的是围绕票息收入与把握阶段性长端利率的机会，而股票与可转债市场基本处于中长期底部区间，预计在上市公司一季报后投资主线会更加清晰。



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，建议保持中性久期、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，在国内持续复苏海外衰退担忧的背景下，叠加政策呵护流动性宽裕，我们认为市场的风险偏好和估值依然有修复空间。由于前期缺乏增量资金叠加年底业绩真空期，市场以存量博弈为主，在一季报落地后，预计二季度开始盈利回升、宏观经济“去疫情化”回归周期，国内被动去库存周期，权益市场仍会有“复苏交易”的机会。在行业配置上，我们重点关注三个方向，一是本轮 AIGC 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计算机、电子和高端制造业板块；二是在消费场景完全恢复后，受益于扩大内需政策，基本面有望持续改善的大消费板块，特别是一季报之后未来有望逐季业绩改善的可选消费品；三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 1.037 元，累计份额净值为 1.081 元。报告期，华富恒利债券 A 份额净值增长率为-0.29%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%。截止本期末，华富恒利债券 C 份额净值为 1.002 元，累计份额净值为 1.023 元。报告期，华富恒利债券 C 份额净值增长率为-0.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

#### 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 03 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 03 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	287,116.68	14.24
	其中：股票	287,116.68	14.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,397,004.75	69.29
	其中：债券	1,397,004.75	69.29
	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	35,888.02	1.78
8	其他资产	296,240.93	14.69
9	合计	2,016,250.38	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	178,389.68	11.05
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	29,886.00	1.85
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	62,941.00	3.90
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	15,900.00	0.99
N	水利、环境和公共设施管理	-	-

	业		
0	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	287,116.68	17.79

## 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	603198	迎驾贡酒	300	19,983.00	1.24
2	002493	荣盛石化	1,300	19,669.00	1.22
3	002415	海康威视	400	17,064.00	1.06
4	603259	药明康德	200	15,900.00	0.99
5	002401	中远海科	700	15,512.00	0.96
6	600859	王府井	600	14,994.00	0.93
7	603233	大参林	400	14,892.00	0.92
8	688596	正帆科技	414	14,539.68	0.90
9	002508	老板电器	500	14,180.00	0.88
10	002439	启明星辰	400	13,300.00	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	301,418.71	18.67
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）	1,095,586.04	67.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,397,004.75	86.55

## 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	3,000	301,418.71	18.67
2	113021	中信转债	290	32,072.95	1.99
3	113050	南银转债	280	31,935.19	1.98
4	110079	杭银转债	280	31,907.47	1.98
5	127032	苏行转债	270	31,625.20	1.96

## 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：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 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、杭州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	13,946.76
2	应收证券清算款	282,284.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	296,240.93

### 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	113021	中信转债	32,072.95	1.99
2	113050	南银转债	31,935.19	1.98
3	110079	杭银转债	31,907.47	1.98
4	127032	苏行转债	31,625.20	1.96
5	127038	国微转债	29,975.73	1.86
6	113604	多伦转债	24,112.75	1.49
7	123044	红相转债	23,389.78	1.45
8	123122	富瀚转债	17,225.72	1.07
9	128142	新乳转债	17,001.31	1.05
10	127066	科利转债	16,939.38	1.05
11	113655	欧 22 转债	16,757.93	1.04
12	123154	火星转债	16,748.83	1.04
13	110063	鹰 19 转债	16,729.77	1.04
14	110047	山鹰转债	16,717.99	1.04
15	123108	乐普转 2	16,663.41	1.03
16	128135	洽洽转债	16,568.62	1.03
17	127052	西子转债	16,564.44	1.03
18	118015	芯海转债	16,542.85	1.02
19	113633	科沃转债	16,530.55	1.02
20	113643	风语转债	16,500.92	1.02
21	127053	豪美转债	16,477.74	1.02
22	123109	昌红转债	16,408.00	1.02
23	123133	佩蒂转债	16,372.40	1.01
24	128132	交建转债	16,348.36	1.01
25	110089	兴发转债	16,338.52	1.01
26	113644	艾迪转债	16,252.71	1.01

27	123090	三诺转债	16,135.78	1.00
28	127046	百润转债	16,120.21	1.00
29	113619	世运转债	16,119.43	1.00
30	123101	拓斯转债	16,101.15	1.00
31	127044	蒙娜转债	16,099.98	1.00
32	113639	华正转债	16,097.74	1.00
33	128072	翔鹭转债	16,096.70	1.00
34	113602	景 20 转债	16,086.48	1.00
35	113046	金田转债	15,988.13	0.99
36	113623	凤 21 转债	15,971.53	0.99
37	113658	密卫转债	15,962.64	0.99
38	128131	崇达转 2	15,925.21	0.99
39	113045	环旭转债	15,923.29	0.99
40	127041	弘亚转债	15,897.33	0.98
41	118003	华兴转债	15,819.63	0.98
42	110087	天业转债	15,742.11	0.98
43	113629	泉峰转债	15,699.02	0.97
44	113625	江山转债	15,654.16	0.97
45	110062	烽火转债	15,600.59	0.97
46	110045	海澜转债	15,599.55	0.97
47	113636	甬金转债	15,596.03	0.97
48	127007	湖广转债	15,576.31	0.97
49	123131	奥飞转债	15,537.78	0.96
50	123025	精测转债	15,476.32	0.96
51	128140	润建转债	14,980.14	0.93
52	110052	贵广转债	14,647.35	0.91
53	128044	岭南转债	14,195.21	0.88
54	118007	山石转债	8,555.72	0.53
55	113048	晶科转债	7,343.75	0.45
56	118016	京源转债	7,074.12	0.44

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C
----	----------	----------

报告期期初基金份额总额	693,789.12	77,680.61
报告期期间基金总申购份额	40,638.61	935,349.28
减:报告期期间基金总赎回份额	105,834.12	53,125.02
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	628,593.61	959,904.87

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)

		区 间					
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	202 3.1 .4- 202 3.3 .31	0.00	771,72 0.93	0.00	771,720. 93	48.5 800
-	-	-	-	-	-	-	-
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 4 月 21 日