

# 华富安鑫债券型证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 20 日

## § 1 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 04 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 03 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	44,823,809.64 份
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。
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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-863,224.16
2. 本期利润	-160,849.37

3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0036
4. 期末基金资产净值	42,179,787.45
5. 期末基金份额净值	0.9410

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

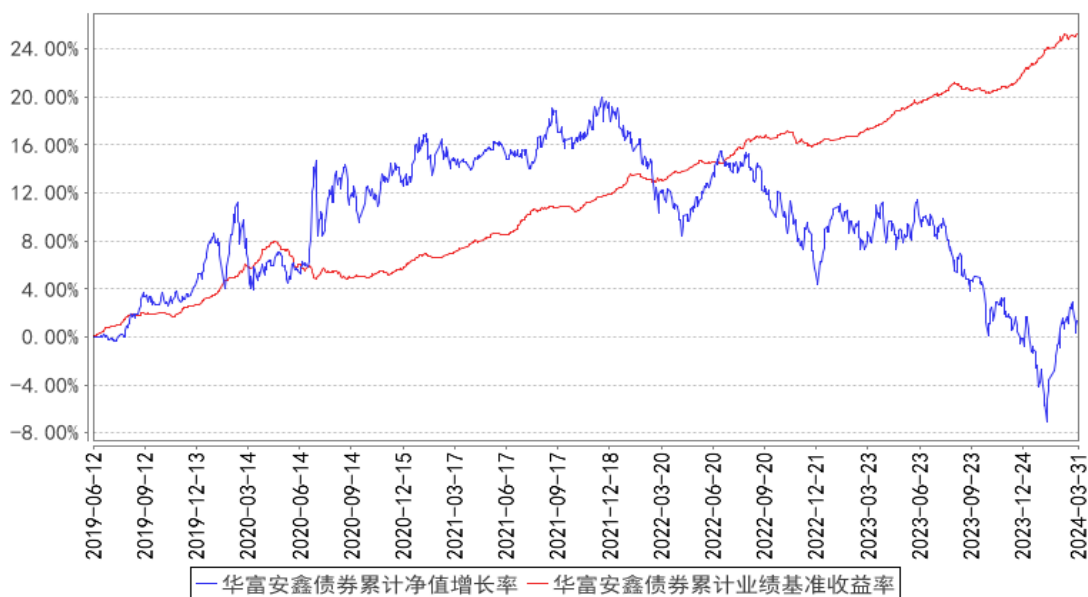
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.35%	0.73%	2.34%	0.09%	-2.69%	0.64%
过去六个月	-3.59%	0.62%	3.81%	0.07%	-7.40%	0.55%
过去一年	-6.84%	0.54%	6.65%	0.06%	-13.49%	0.48%
过去三年	-11.67%	0.45%	16.59%	0.06%	-28.26%	0.39%
自基金合同 生效起至今	1.32%	0.47%	25.24%	0.07%	-23.92%	0.40%

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	-	七年	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，2024 年一季度宏观经济出现边际企稳迹象，在 1 万亿增发国债、PSL 投放 5000 亿、全球景气度边际企稳下的外需拉动等因素下，3 月官方制造业 PMI 为 50.8%，再度回归至荣枯线以上，但考虑到季调因素的影响，剔除后对于经济动能回升的持续性仍待观察。政策方面持续释放支撑经济的信号，“两会”将全年 GDP 增速目标设置在 5%，同时增发 1 万亿超长期特别国债，政策端表态偏积极，央行于一季度降准 50BP、下调 LPR 利率，也体现出货币政策对稳增长的支撑。

海外方面，美联储货币政策仍处于加息结束到降息开始之前的过渡阶段，一月和三月的 FOMC 会议决议均维持政策利率不变，海外通胀回落速度的放缓，导致市场对降息预期有所回落，同时预期降息周期的开启时间显著延后。

资产表现方面，一季度债券表现持续强势，收益率下行且信用利差继续收窄，股票与可转债则是先跌后涨，大盘价值资产总体表现较强。具体来看，股票市场资金面与情绪面在一季度呈现问题极致暴露后逐渐修复，整体一季度呈现先跌后涨，上证指数一季度收涨 2.23%，重上 3000 点；沪深 300 上涨 3.10%；但中小盘尚未能完全收回季初跌幅。可转债方面，一季度转债市场同样先

抑后扬，估值回归理性常态水平，中证转债指数季度跌幅 0.81%，高于同期可转债正股、中证 2000 等权益类资产，但弱于沪深 300 等大盘指数，可转债估值层面，可转债整体的纯债溢价率压缩至近 5 年的极低分位，转债定价水平正向理性的机构投资者倾斜，溢价率中枢也已于 2 月初的最高值迅速修正至中位数水平。利率债方面，一季度债券市场表现较好，收益率趋势向下，10 年国债收益率一度下探至 2.26% 的历史低位。受制于高息资产的缺失，当前债券市场资产荒的问题仍然严重，叠加市场对货币政策进一步宽松的预期较强，多重因素下收益率快速下行。信用债方面，一季度表现略有分化，高等级主要跟随利率收益率波动，低等级则延续强势，高等级信用利差变动不大，但低等级信用利差继续大幅收窄，信用债曲线继续平坦化。

回顾 2024 年一季度，本基金年初基于对于大类资产上超配权益资产的判断，继续保持了整个组合高权益  $\beta$  的特征。在 1 月 1 日至 2 月 5 日期间，权益市场与可转债市场整体出现超预期调整，本基金由于含权资产占比高，风格偏向均衡成长，因此净值出现较明显的下跌，此后随着各类救市举措出台，市场出现显著回升，本基金净值也跟随出现明显回升，但由于科创、创业类资产和可转债资产的占比明显更高，上市资产尚未完全回补年初的跌幅，本基金在一季度末尚未获得正收益，主要回升来自 AI 算力、机器人和智能驾驶、黄金和船舶等资产，但整体资产组合偏向均衡成长而没有足够权重的红利和价值资产，这也是需要反思的地方。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，继续维持了贵金属、船舶等中长期成长空间较大的板块配置。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。纯债方面，维持了超长久期利率债的配置，同时在调整过程中增加了部分中短久期、偏高票息的信用债配置。

展望二季度，国内经济增长引擎换挡的中长期问题仍存在，但随着前期政策逐步见效，预计短期内宏观数据有望继续企稳。结构上，前期增发国债项目继续施工，二季度地方专项债加速发行进一步促开工，政府支出可能仍然是二季度宏观经济最重要的拉动因素。此外，3 月国常会提到“要进一步优化房地产政策，有效激发潜在需求”，预计地产边际松绑的政策可能将相继出台，二季度地产相关数据二阶导也可能企稳。另外，工业品价格初期回升后，有望引导部分企业利润走出阴霾。

海外方面，海外通胀压力可能在未来几个月持续增加，尤其是在第三季度左右可能出现二次通胀压力，美国核心 CPI 通胀在 Q3 之前预计会继续下行，但是可能速度会趋缓，最低水平会较年初预期的 2.4% 上修至 2.9%。

资产赔率角度，截至 2024 年 3 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 1.30%，处历史 90%分位，近 5 年 98%分位，近 3 年 97%分位；股债收益差(美债定价修正后)为-0.73%，处历史 96%分位，近 5 年 99%分位，近 3 年 98%分位；权益资产仍是更便宜的资产，全 A 非金融石油石化 PE 为 26 倍，PB 是 2.02 倍，处在 10-30%的分位，而股息率则在近 1.74%的水平，处于历史极高分位。恒生指数 PE 为 8.5 倍，处于近三年 11%分位与历史的 5%分位。可转债方面，转债市场的纯债溢价率已处于近 5 年的极低分位，债底保护下资产的防守性极佳，转债定价水平正向理性的机构投资者倾斜，溢价率中枢也已于 2 月初的最高值迅速修正至中位数水平，截止 3 月末，可转债市场的中位数价格仍仅为 111 左右，64%的可转债有正 YTM，因此可转债进攻退守的期权属性日渐凸显。债券方面，绝对收益率水平和期限利差均在历史低位，信用债整体利差水平较低，期限利差、等级利差、银行二永和非金融永续债等品种利差均已压缩到历史较低的水平。

股票方面，权益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。我们应充分认识到当前是中长期的底部，但短期的风险因素我们还是要时刻保持警惕，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，尤其是年报期退市股增加的情况下可能会构成小盘尾盘股的资金生态继续面临挑战；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。行业配置上，本基金维持均衡成长与景气投资的配置，看好具备制造能力出海的优质企业，以及 AI 算力、机器人、智能汽车、先进封装、低空经济、创新药等长期成长空间较大的方向。

可转债方面，转债有估值小幅抬升的机会。短期资金层面，部分高评级、信用资质好、基本面稳健的个券的筹码层面正在好转；从股债配置和权益角度看，转债资产当下的相对低估值，既能提供一定的弹性，也有对权益的“容错能力”；而落脚到基本面来看，3 月的 PMI 数据短期有所回暖，海外坚挺的需求支撑出口，一些迹象表明至少有部分行业能保持不错的盈利。当前时点，市场比较担心的风险点在于业绩披露期，绩差股和退市潮可能会带来转债整体的  $\beta$  受到波及，应提前规避盈利差的个券，同时在调整中可能也会迎来布局的机会。

信用债与利率债方面，从中长期看，利率继续下行的趋势不变。短期来看，财政政策更加积极的背景下，预计二季度政府债供给将加速，货币政策也将更加灵活，为缓解银行息差压力及降准配合政府债发行，存在降存款利率的可能。中期角度看，只要货币政策处于偏宽松的状态，潜在政府债供给压力是脉冲式的，不会对利率趋势产生影响，但预期利率债的波动会增加。信用债供给方面，受 35 号文和特殊再融资债置换影响，年内城投债净供给预计收缩，金融债供给放量速度目前偏慢，而整体银行间负债端稳定，二季度城农商和理财都有一定配置需求，供需结构预

计仍旧友好。目前赔率下，信用债各维度利差继续单边压缩空间不大，后续预计跟随利率债收益率波动，因此在票息策略的基础上，更多的是把握估值调整带来的机会。

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 0.9410 元，累计基金份额净值为 1.4070 元。报告期，本基金份额净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准收益率为 2.34%。

#### 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（2024 年 3 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（2024 年 3 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	8,163,703.25	15.24
	其中：股票	8,163,703.25	15.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,282,405.95	82.64
	其中：债券	44,282,405.95	82.64
	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	1,084,940.33	2.02
8	其他资产	52,375.37	0.10
9	合计	53,583,424.90	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	396,300.00	0.94
C	制造业	6,809,066.25	16.14
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	235,144.00	0.56
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	171,693.00	0.41
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	101,500.00	0.24
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	450,000.00	1.07
S	综合	-	-
	合计	8,163,703.25	19.35

### 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	300354	东华测试	13,000	599,170.00	1.42
2	002422	科伦药业	19,575	598,016.25	1.42
3	603019	中科曙光	12,000	573,000.00	1.36
4	300308	中际旭创	3,200	500,992.00	1.19
5	000625	长安汽车	27,000	453,600.00	1.08
6	601595	上海电影	15,000	450,000.00	1.07
7	600150	中国船舶	12,000	444,000.00	1.05
8	600489	中金黄金	30,000	396,300.00	0.94
9	300751	迈为股份	3,500	370,300.00	0.88
10	601058	赛轮轮胎	24,000	352,320.00	0.84

### 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	9,674,775.25	22.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,114,721.75	5.01
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,105,834.25	7.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	29,387,074.70	69.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,282,405.95	104.98

### 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	54,000	6,021,023.67	14.27
2	175944	21 交房 01	30,000	3,105,834.25	7.36
3	019709	23 国债 16	23,000	2,325,763.15	5.51
4	232380021	23 浙商银行二级资本债 01	20,000	2,114,721.75	5.01
5	132026	G 三峡 EB2	15,000	1,804,449.45	4.28

### 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、兴业银行股份有限公司、浙商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	3,292.22
2	应收证券清算款	36,491.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,591.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	52,375.37

### 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	132026	G 三峡 EB2	1,804,449.45	4.28
2	113053	隆 22 转债	1,718,373.51	4.07
3	113052	兴业转债	1,177,213.88	2.79
4	113037	紫银转债	1,176,273.14	2.79
5	113042	上银转债	1,100,277.21	2.61
6	113056	重银转债	1,049,536.45	2.49
7	128108	蓝帆转债	972,062.25	2.30
8	118027	宏图转债	880,497.62	2.09
9	123182	广联转债	826,006.71	1.96
10	128138	侨银转债	767,808.79	1.82
11	127045	牧原转债	744,443.58	1.76

12	118042	奥维转债	685,155.45	1.62
13	118031	天 23 转债	657,809.79	1.56
14	113044	大秦转债	599,030.41	1.42
15	113049	长汽转债	574,133.70	1.36
16	110094	众和转债	571,511.96	1.35
17	118034	晶能转债	556,826.86	1.32
18	113021	中信转债	531,141.21	1.26
19	113584	家悦转债	529,481.51	1.26
20	123194	百洋转债	476,969.23	1.13
21	118013	道通转债	436,414.67	1.03
22	123025	精测转债	372,759.45	0.88
23	123219	宇瞳转债	354,009.62	0.84
24	127079	华亚转债	333,958.19	0.79
25	113666	爱玛转债	331,321.64	0.79
26	127024	盈峰转债	320,524.59	0.76
27	113674	华设转债	311,292.53	0.74
28	123109	昌红转债	308,336.00	0.73
29	127076	中宠转 2	307,661.01	0.73
30	123035	利德转债	293,511.10	0.70
31	113066	平煤转债	288,308.05	0.68
32	118035	国力转债	265,131.64	0.63
33	113648	巨星转债	264,633.19	0.63
34	113065	齐鲁转债	264,119.59	0.63
35	118023	广大转债	261,468.90	0.62
36	128122	兴森转债	251,216.99	0.60
37	113631	皖天转债	246,098.74	0.58
38	128042	凯中转债	242,348.34	0.57
39	123099	普利转债	239,655.34	0.57
40	113563	柳药转债	238,531.78	0.57
41	113549	白电转债	229,940.99	0.55
42	127053	豪美转债	227,514.33	0.54
43	113662	豪能转债	226,802.68	0.54
44	113064	东材转债	224,258.08	0.53
45	113639	华正转债	220,936.22	0.52
46	118024	冠宇转债	211,088.49	0.50
47	118015	芯海转债	198,449.46	0.47
48	113656	嘉诚转债	193,078.55	0.46
49	113618	美诺转债	190,823.67	0.45
50	111012	福新转债	180,111.62	0.43
51	123076	强力转债	177,643.62	0.42
52	127027	能化转债	172,303.41	0.41
53	123169	正海转债	163,804.64	0.39

54	110095	双良转债	154,730.18	0.37
55	113059	福莱转债	134,023.56	0.32
56	127018	本钢转债	131,355.73	0.31
57	110085	通 22 转债	129,668.81	0.31
58	110047	山鹰转债	129,493.64	0.31
59	113623	凤 21 转债	128,155.12	0.30
60	127073	天赐转债	123,968.04	0.29
61	123142	申昊转债	123,732.82	0.29
62	128130	景兴转债	123,134.30	0.29
63	128118	瀛通转债	120,996.75	0.29
64	123128	首华转债	119,913.25	0.28
65	113643	风语转债	118,575.34	0.28
66	118020	芳源转债	118,390.82	0.28
67	111011	冠盛转债	116,853.44	0.28
68	113675	新 23 转债	115,803.21	0.27
69	128119	龙大转债	115,776.51	0.27
70	128081	海亮转债	113,706.82	0.27
71	123126	瑞丰转债	111,110.88	0.26
72	128066	亚泰转债	110,599.86	0.26
73	113667	春 23 转债	107,825.79	0.26
74	118003	华兴转债	107,747.63	0.26
75	110068	龙净转债	100,321.17	0.24
76	118043	福立转债	98,002.11	0.23
77	113569	科达转债	58,095.41	0.14

### 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	44,991,761.30
报告期期间基金总申购份额	474,880.24
减：报告期期间基金总赎回份额	642,831.90
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	44,823,809.64

## §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 (%)	8.08

### 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	20240101-20240331	22,179,158.37	0.00	0.00	22,179,158.37	49.48
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 4 月 20 日