

# 华富安业一年持有期债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 18 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 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华富安业一年持有期债券	
基金主代码	014385	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 6 日	
报告期末基金份额总额	73,340,881.64 份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。	
投资策略	根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合流动性、估值水平、风险偏好等因素，综合评价各类资产的风险收益水平。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	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 本基金如果投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富安业一年持有期债券 A	华富安业一年持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	014385	014386

报告期末下属分级基金的份额总额	54,277,879.95 份	19,063,001.69 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	华富安业一年持有期债券 A	华富安业一年持有期债券 C
1. 本期已实现收益	584,617.46	150,556.49
2. 本期利润	988,869.97	255,781.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0140	0.0121
4. 期末基金资产净值	54,517,591.35	18,988,817.11
5. 期末基金份额净值	1.0044	0.9961

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

华富安业一年持有期债券 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	1.20%	0.12%	1.26%	0.09%	-0.06%	0.03%
过去六个月	2.87%	0.15%	2.54%	0.10%	0.33%	0.05%
过去一年	1.93%	0.16%	2.18%	0.10%	-0.25%	0.06%
自基金合同 生效起至今	0.44%	0.17%	2.99%	0.11%	-2.55%	0.06%

华富安业一年持有期债券 C

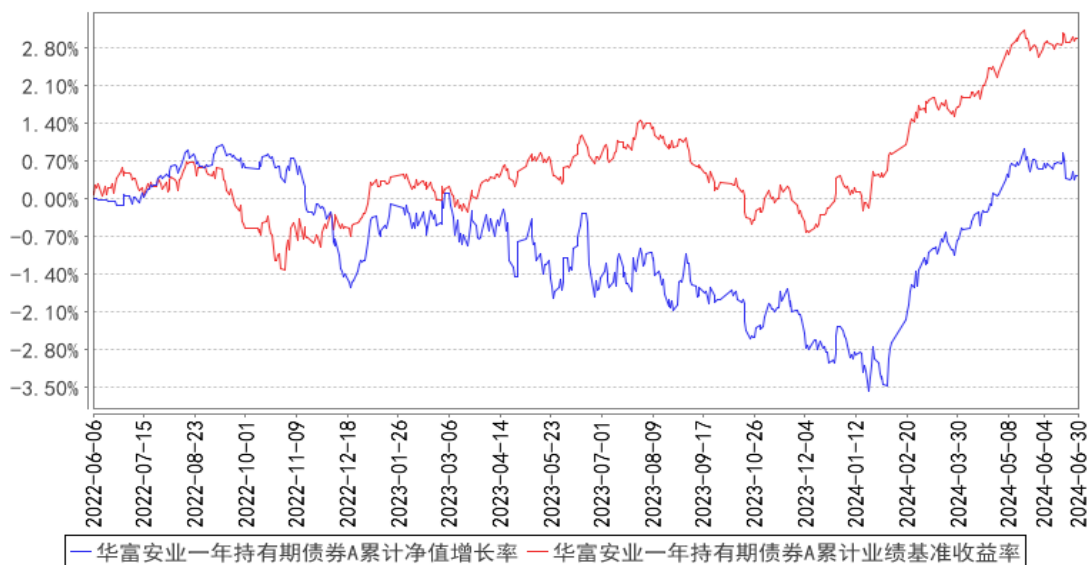
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
----	--------	---------------	----------------	-----------------------	-----	-----

过去三个月	1.10%	0.12%	1.26%	0.09%	-0.16%	0.03%
过去六个月	2.66%	0.15%	2.54%	0.10%	0.12%	0.05%
过去一年	1.53%	0.16%	2.18%	0.10%	-0.65%	0.06%
自基金合同生效起至今	-0.39%	0.17%	2.99%	0.11%	-3.38%	0.06%

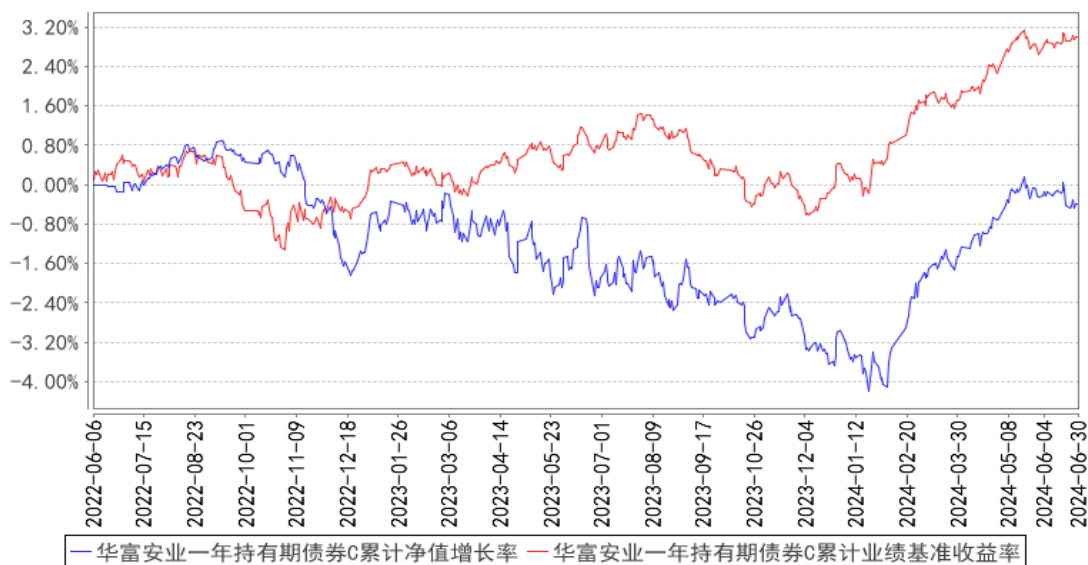
注：业绩比较基准收益率=中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%

### 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

华富安业一年持有期债券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



华富安业一年持有期债券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图



注：本基金建仓期为 2022 年 6 月 6 日至 2022 年 12 月 5 日，建仓期结束各项资产配置比例符合合同的约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富安业一年持有期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		
尹培俊	本基金基金经理、公司副总经理、固定收益部总监、公司公募投资决策委员会联席主席	2022 年 6 月 6 日	-	十九年	兰州大学工商管理硕士，硕士研究生学历。历任上海君创财经顾问有限公司顾问部项目经理、上海远东资信评估有限公司集团部高级分析师、新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理。2012 年 7 月加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用研究员、总监助理、副总监、公司总经理助理，自 2014 年 3 月 6 日起任华富强化回报债券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 日起任华富收益增强债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 28 日起任华富安华债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 26 日起任华富安盈一年持有期债券型证券

					投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 8 日起任华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，自 2022 年 6 月 6 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，自 2023 年 7 月 28 日起任华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。
戴弘毅	本基金基金经理	2023 年 9 月 12 日	-	七年	中国社会科学院研究生院金融硕士、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

国内方面，今年以来，宏观数据显示出中国经济企稳迹象明显，但市场对经济至今为止是否能算全面复苏，依然分歧很大，分歧的主要原因，一是在于国内独立于海外的低迷通胀环境，使得实际 GDP 在 2024 年一季度同比录得 5.3% 好于市场预期，但名义 GDP 增长相对不高，同比增速仅为 3.97%；二是企业效益分层显著，今年二季度以来，大型企业制造业 PMI 维持在 50% 荣枯线以上，而中型企业 5、6 月的 PMI 分别为 49.4%、49.8%，小型企业则为 46.7%、47.4%，均为荣枯线下方；三是宏观经济仍处在结构转型的阵痛中，主要增长引擎尚不明确，作为传统增长主要拉动力的房地产业及建筑业仍显疲软，尤其是房地产行业在各地政策放松的背景下尚未呈现明显的复苏，消费中的住宿与餐饮业增长也呈现增长不足态势，新的增长动力可能来源于工业和信息技术行业，但对于支撑起整体宏观经济增长动能尚需一定时间。

海外方面，2024 年二季度整体总结是“经济的微妙平衡、通胀的再度回落”。海外二季度的整体通胀没有延续一季度的反弹，在商品和住房通胀的带动下重回下降趋势。在此宏观背景下，降息预期多次起伏，10 年美债收益率在 4.2%-4.7% 的区间内震荡，COMEX 黄金价格也在 2300-2450 的区间内震荡；由于欧洲方面的降息已开启，日本央行的加息一直不及预期，叠加地缘政治局势的变化，美元指数整体波动上行在二季度末站稳 105，人民币汇率波动相对较大。

资产表现方面，权益方面，2024 年 4 月至 5 月中上旬市场延续了反弹行情，5 月下旬以来 A 股出现了不小的回撤，整体市场结构与宏观经济环境的分化存在一致性，大企业表现好于小企业，中证 100、沪深 300、中证 500、中证 1000、中证 2000 指数二季度分别录得 -1.89%、-2.14%、-6.5%、-10.02%、-13.75%。可转债方面，二季度转债整体表现还是好于正股，一方面得益于转债的抗跌，且下修等条款对转债的平价有一定的抬升，另一方面，转债相较于股债更易受资金流动影响，5 月份资金的净流入驱动了转债行情。但转债市场表现分化显著，低价券在 6 月经历了更大的波动，核心原因是权益市场调整和转债市场的信用风险担忧和流动性问题。2024 年二季度债券市场表现较好，利率债方面，虽然 4、5 月因市场担心禁止手工补息的影响而出现震荡，但 6 月收益率趋势向下，10 年国债从季初的 2.30% 一度降至 2.22% 的前低位置，30 年国债收益率再度下破 2.5% 的市场心理点位，一度低至 2.41%（距离上一轮前低的 2.39% 仅一步之遥）。信用债方面，二季度整体

表现强势，除四月末跟随利率有所调整外，收益率整体下行，且信用利差、期限利差和等级利差均继续收窄。

本基金在 2023 年下半年之后开始转型为低波固收+策略，主要目标是追求高 Calmar 比、持有期内高正收益概率和净值中枢逐渐抬升，为达到尽量在多数情况下季度实现正回报，依照 CPPI 策略方式构建组合。首先，构建纯债底仓，底仓票息静态收益作为安全垫；其次，设置止损容忍度，即 3 个月内含权资产最大的回撤止损线，本基金设为含权资产 10%左右的止损；最后每 3 个月调整，通过底仓静态收益倒算含权资产仓位，本基金在 2024 年一季度保持了目标仓位。在 2024 年二季度权益市场先涨后跌的行情下，最终录得正收益，达成季度正收益目标，并于季度末，结合基金组合的静态收益率情况，继续控制权益资产在 11%左右的仓位，以应对新一季度的挑战。

展望 2024 年三季度，随着前期政策逐步落地，预计宏观数据或继续结构性修复。结构上，前期增发国债项目继续施工，三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三季度宏观经济最重要的拉动因素。此外，地产“517”新政后，多地城市跟进，政策出台的节奏均快于市场预期。目前二手房销售已经出现企稳迹象，未来房地产市场有望按照“二手房销售→房价→新开工→新房销售→投资”的顺序逐步阶段性修复。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。

海外宏观经济方面，预计通胀降温有一定进展，美债市场目前演绎 9 月降息预期明显升温，但叠加近期美国大选变数较多，市场对于资产定价的逻辑变化较大，“降息交易”、“美国贸易条件收紧推升通胀”、“地缘降温”、“美元长期走弱”、“中美贸易摩擦加剧”等多重逻辑交错，未来一段时间内全球风险资产预计呈现波动率放大的特征。

资产赔率角度，截至 2024 年 6 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）1.54%，处历史 93%分位，近 5 年 100%分位，近 3 年 99%分位。股债收益差（美债定价修正后）-0.36%，处历史 98%分位，近 5 年 100%分位，近 3 年 100%分位。PE25.06x，处历史 25%分位，近 5 年 2%分位，近 3 年 3%分位。PB1.91x，处历史 7%分位，近 5 年 1%分位，近 3 年 2%分位。股息率 2.08%，处历史 96%分位，近 5 年 100%分位，近 3 年 100%分位。恒生指数 PE 为 9.2 倍，处于近三年 28%分位与历史的 19%分位。可转债方面，在 6 月 24 日，转债跌破面值占比高达 19.9%，处于历史第三高点，而转债跌破债底的占比则高达 28.9%，处于历史最高的位置，显示出市场对于可转债信用风险的担忧，之后有所修复，但截止 6 月底，价格低于债底的可转债占比仍有 20%，处历史 99%分位。信用债方面，绝对收益来看 1-5 年各期限隐含 AAA-AA(2) 各级别的曲线收益率均在 2.55%以下，利差来看，1 年中高等级信用利差略高，3 年和 5 年各期限和等级的信用利差主要在历史 5%分位以下，等级利差和期限利差也已压缩至历史低位，目前仅部分 5 年中等偏弱信用债



和 5 年城农商永续债能带来一定骑乘收益和品种溢价。

股票方面，权益市场估值大概率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。我们应充分认识到虽然当前是中长期的底部，但对于短期的风险因素我们还是要时刻保持警惕，当前市场面临的问题仍在：①海外资金的长期持有耐心，②国内审慎的金融防风险环境，③长期经济增长的信心与经济结构、企业景气的分化。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，却忽视了部分企业的长期竞争力。另外港股估值横向与纵向均处于低洼处，纵使港股市场面临众多中长期的压力，但仅从赔率角度看仍具较好的阶段性配置价值。此前监管层暂缓 IPO 和大股东减持，严格退市制度等，都有助于股票市场长期供需格局的稳定，另外，新“国九条”站在投资者立场，重点提出“加大退市监管、强化分红、改善盈利质量”等要求，这都是中长期利好 A 股的制度建设。配置上，红利、出海链和海外定价周期品，叠加科技景气品种（如 AI、机器人、智能汽车、低空经济）等的“哑铃”组合配置仍是本基金看好的方向，选股上，更偏好于竞争格局相对较好、增长确定性、盈利质量和分红回报综合维度评分较高的白马公司。

可转债方面，转债的信用违约率定价处于高位区间，低价券修复策略仍有可为；截止六月末跌破债底的转债占比超 20%，远高于信用债市场违约率，违约定价水平已达到历史的极值水平，低价券定价水平较不合理；随着资金逐渐平稳，评级披露风险释放较为充分，市场筹码在恢复和重构中，理性定价会逐步回归，此外，条款博弈的机会也陆续出现。高盈亏比转债有极大的挖掘空间，绩优、大盘、红利风格吸引力仍较强：近 73%的转债价格落在 120 元以内，其中不乏高质成长、行业龙头、稳健低波或小盘价值类个券。总的来看，转债绝对价格水平处于历史较便宜位置，在高安全性资产配置压力增加的环境下仍是难得的品种，拉长时间看该点位的胜率很大，风险是机构行为出清可能需要过程，这存在一定不确定性，但估值波动尾部风险定能抗得过去。

信用债与利率债方面，展望 2024 年三季度，当前收益率再度逼近前期低点的背景下，利率债难免出现波动，但也正因如此，更为考验专业投资机构的能力，波段操作的必要性有所提升。信用债方面，供给侧看，化债政策持续，年内城投债净供给收缩局面难改变，产业债虽然净融资同比增加，但长期化、头部化可能继续演绎，难以满足市场对主流票息资产的需求，全年二级市场永续债净融资规模或将显著高于 2023 年，对供给能形成一定补充。需求侧看，存款脱媒的影响在三季度可能边际减弱，往后看供需结构上虽然不及二季度，但整体信用品种仍偏友善。基于这个角度，信用债可调整空间或将很小，即使随着后续地方债供给增加和上层关注长债收益率等因素，信用跟随利率或有所波动，判断三季度内利差仍将持续维持在低位水平。

在整体资产配置上，本基金后续计划保持低波固收+定位，保持 CPPI 策略的框架，根据底仓

票息的安全垫动态控制含权资产的仓位，基于目前静态收益安全垫，继续控制权益仓位在 10%左右的水平，同时在仓位管理的同时，继续坚持宏观对冲思路下的风险平价配置策略，争取 2024 年三季度继续获得稳健回报。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，华富安业一年持有期债券 A 份额净值为 1.0044 元，累计份额净值为 1.0044 元。报告期，华富安业一年持有期债券 A 份额净值增长率为 1.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.26%。截止本期末，华富安业一年持有期债券 C 份额净值为 0.9961 元，累计份额净值为 0.9961 元。报告期，华富安业一年持有期债券 C 份额净值增长率为 1.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.26%。

#### 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	8,441,208.29	8.24
	其中：股票	8,441,208.29	8.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	89,466,668.60	87.31
	其中：债券	82,375,335.73	80.39
	资产支持证券	7,091,332.87	6.92
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	3,774,136.44	3.68
8	其他资产	788,098.09	0.77
9	合计	102,470,111.42	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 3,403,416.10 元，占期末净值比例为 4.63%。

### 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	135,160.00	0.18
B	采矿业	1,467,346.00	2.00
C	制造业	2,681,110.19	3.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	115,128.00	0.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	439,824.00	0.60
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	112,192.00	0.15
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	87,032.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	5,037,792.19	6.85

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
非日常生活消费品	905,346.61	1.23
日常消费品	-	-
能源	735,985.15	1.00
金融	3,647.43	0.00
医疗保健	301,184.40	0.41
工业	-	-
信息技术	-	-
通信服务	1,234,218.99	1.68
公用事业	223,033.52	0.30
房地产	-	-
合计	3,403,416.10	4.63

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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	00883	中国海洋石油	36,000	735,985.15	1.00
2	00700	腾讯控股	2,100	713,752.27	0.97
3	600489	中金黄金	44,200	654,160.00	0.89
4	601088	中国神华	13,900	616,743.00	0.84
5	00941	中国移动	7,406	520,466.72	0.71
6	02020	安踏体育	4,800	328,564.80	0.45
7	601166	兴业银行	17,200	303,064.00	0.41
8	00013	和黄医药	12,000	301,184.40	0.41
9	600519	贵州茅台	200	293,478.00	0.40
10	002422	科伦药业	8,203	248,796.99	0.34

### 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	6,430,319.94	8.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,436,856.81	15.56
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	33,713,666.30	45.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	24,839,615.67	33.79
7	可转债（可交换债）	5,954,877.01	8.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	82,375,335.73	112.07

### 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	242480003	24广州农商行永续债 01	60,000	6,109,630.03	8.31
2	2028051	20浦发银行永续债	50,000	5,327,226.78	7.25
3	102381876	23 九联投资 MTN002	50,000	5,317,693.44	7.23
4	102382296	23 胶州湾 MTN001	50,000	5,239,744.26	7.13
5	185968	22 首城 02	50,000	5,213,417.81	7.09

### 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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	189045	普陀 04	50,000	5,083,376.71	6.92
2	144180	融惠 16 优	20,000	2,007,956.16	2.73

### 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，上海浦东发展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	11,489.67
2	应收证券清算款	751,247.31
3	应收股利	25,331.13

4	应收利息	-
5	应收申购款	29.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	788,098.09

#### 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	128129	青农转债	1,064,253.42	1.45
2	118034	晶能转债	439,304.05	0.60
3	110085	通 22 转债	423,068.05	0.58
4	113053	隆 22 转债	396,826.39	0.54
5	113516	苏农转债	384,929.04	0.52
6	110047	山鹰转债	331,729.04	0.45
7	113641	华友转债	304,401.04	0.41
8	127022	恒逸转债	286,184.01	0.39
9	113049	长汽转债	279,517.05	0.38
10	113046	金田转债	270,743.34	0.37
11	123108	乐普转 2	265,614.38	0.36
12	113054	绿动转债	264,089.25	0.36
13	110089	兴发转债	224,758.08	0.31
14	113532	海环转债	222,769.04	0.30
15	110093	神马转债	221,007.62	0.30
16	113024	核建转债	220,716.44	0.30
17	127089	晶澳转债	194,605.10	0.26
18	113639	华正转债	160,361.67	0.22

#### 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	华富安业一年持有期债券 A	华富安业一年持有期债券 C
报告期期初基金份额总额	81,777,997.41	23,563,358.56
报告期期间基金总申购份额	88,130.84	8,743.89
减：报告期期间基金总赎回份额	27,588,248.30	4,509,100.76
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	54,277,879.95	19,063,001.69

## §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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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、华富安业一年持有期债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富安业一年持有期债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富安业一年持有期债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富安业一年持有期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 7 月 19 日