

华富安鑫债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 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：2023 年 1 月 20 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 2023 年 1 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 2022 年 10 月 01 日起至 2022 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	44,439,195.03 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（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）
--------	---------------------------------------

1. 本期已实现收益	-1,223,118.23
2. 本期利润	-2,000,641.14
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0447
4. 期末基金资产净值	47,654,695.31
5. 期末基金份额净值	1.0724

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

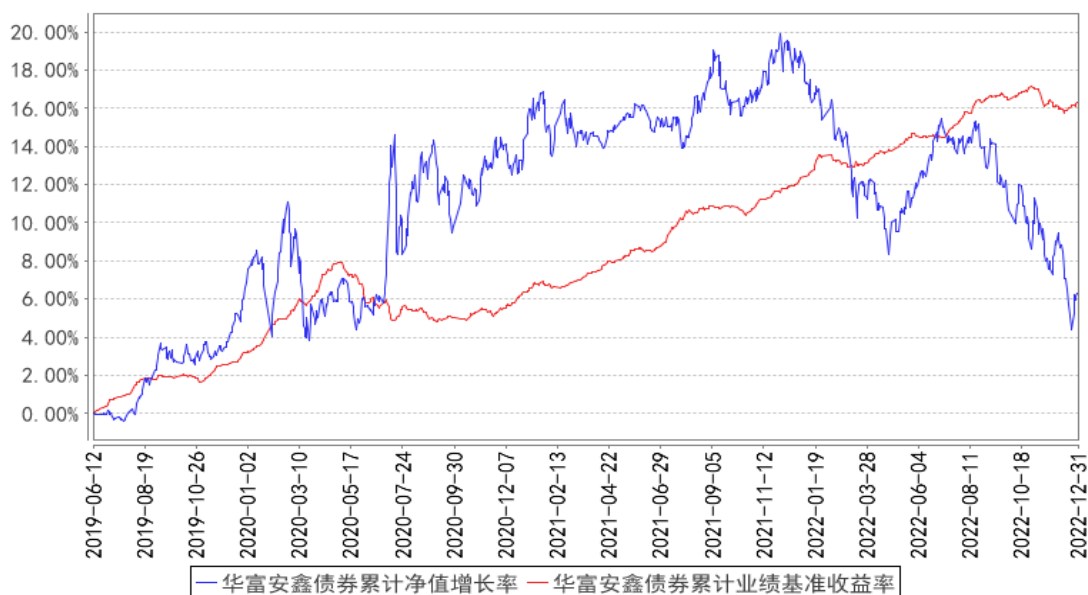
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.98%	0.50%	-0.14%	0.08%	-3.84%	0.42%
过去六个月	-7.66%	0.42%	1.56%	0.07%	-9.22%	0.35%
过去一年	-10.66%	0.43%	3.49%	0.07%	-14.15%	0.36%
过去三年	-0.55%	0.49%	12.66%	0.08%	-13.21%	0.41%
自基金合同 生效起至今	7.24%	0.45%	16.30%	0.07%	-9.06%	0.38%

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：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。根据《华富安鑫债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：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%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金合同生效未满一年。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		
张惠	本基金基金经理、固定收益部副总监	2019 年 6 月 12 日	-	十五年	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 2020 年 11 月 9 日起任华富永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，具有基金从业资格。
戴弘毅	本基金的基金经理	2022 年 9 月 23 日	-	五年	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，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

四季度国内持续处于衰退后期，经济整体偏低迷，疫情对于经济活动影响比较明显。具体来说，10 月份，国内疫情形势恶化，不少地区采取严格的风控措施以遏制疫情扩散，经济活动被迫中断，11 至 12 月份，国内疫情管控政策逐步放松，国内新冠感染人数迅速走高，受此影响，经济活动仍维持低迷。结构来看，四季度消费增速、地产投资增速进一步下探，受疫情形势、地产低迷影响较大。出口方面，四季度外需回落的压力逐渐显现，集装箱运价指数明显回落，国内出口增速加速下滑。基建方面，受益于政策性金融工具投放及信贷政策宽松，四季度基建投资增速仍维持在双位数以上。整体看，经济内部结构与三季度差异不大。国内通胀方面，四季度整体通胀压力可控，整体国内通胀中枢向下。四季度猪肉价格较三季度有所回升，但由于翘尾因素 CPI 同比增速反而出现回落，由于四季度国内经济偏弱、内生动力不足，核心 CPI 同比增速仍维持低位。PPI 方面，四季度全球衰退预期强化、海外油价震荡下行，叠加高基数，PPI 同比呈现快速回落的态势。

海外方面，由于 10 月开始美国制造业与服务业 PMI 相继走弱、核心 CPI 与核心 PCE 以及非农就业数据相继低于市场预期，叠加美联储主席鲍威尔开始释放鸽派言论，海外市场逐渐开始交易流动性边际宽松，美元指数与长端美债收益率均出现见顶回落，尽管欧央行和日本央行仍维持收紧动作，但从资产表现来看，市场已经开始预期 23 年的流动性拐点。

从国内资本市场的表现来看，四季度利率债偏弱，股票市场年内二次探底之后出现结构性修复，而可转债资产受债市与股票风格拖累整体持续下行。10 月，国庆假期后人民日报连续三天发文强调坚持疫情防控和动态清零政策，债券市场对经济预期转向悲观，结合资金面稳定、权益市场调整，债市小幅走强。进入 11 月，防疫优化措施 20 条、金融支持地产 16 条相继出台，债券市场重燃复苏预期，收益率快速上行。受市场调整影响，理财产品爆发赎回潮，债市抛压急剧上升。虽然期间央行超预期降准，但对短期市场提振有限。进入 12 月，理财产品负反馈仍在持续，但受益于央行表态积极且于公开市场大量投放跨年资金，利率债市场有所修复，收益率小幅下行。国内 A 股市场四季度各大指数总体震荡分化，上证指数、沪深 300、创业板指分别上涨

2.14%、1.75%、2.53%。从结构上看，10 月，中小市值股票维持修复而大市值板块持续回调，中证 1000 涨逾 2.7%而上证 50 跌逾 12%，11-12 月权益市场出现风格切换，中小市值出现补跌而权重市值板块上涨明显，上证 50 涨逾 14%而中证 1000 小幅收跌。行业表现方面，疫情复苏主线表现相对较好，TMT 板块也出现明显低位反弹，能源主线回调明显，中信一级行业指数涨跌幅居前 5 位的依次为零售、消费者服务、传媒、计算机、医药，涨跌幅分别为 18.43%、16.38%、14.67%、11.49%、10.49%；下跌方面，有色金属、电力设备及新能源、基础化工、石油石化、煤炭跌幅居前，涨跌幅分别为-1.47%、-1.92%、-2.6%、-4.32%、-15.78%。可转债方面，由于股票市场中小成长风格处于相对劣势、债券市场受到理财赎回冲击明显，可转债成为四季度表现最差的资产，中证转债、可转债等权指数四季度分别下跌 2.48%和 1.06%，其中 12 月中上旬分别连续下跌 5 和 6%，出现了比较明显的估值消化。

回顾四季度，组合于四季度净值出现了比较明显的下跌，反省主要原因在于仓位管理上尤其是可转债的仓位上，考虑到临近年底，国内疫情、房地产、海外流动性等全年压制国内风险资产的因素均出现曙光或是接近尾声，股票与可转债为主的权益类资产处于中长期看的低点，因此维持了权益仓位、且在市场下跌时增加了可转债的仓位，将大类资产配置逐渐从无风险资产向风险资产移动，考虑通过哑铃型可转债组合增厚整个投资组合的含权量。但是从过程来看，由于市场自 11 月开始的反弹主要是价值蓝筹主导，这部分可转债性价比合适目标的相对较少，同时市场缺乏增量资金的情况下，新能源在市场蓝筹反弹过程中被一定程度充当“提款机”；另一方面，由于理财赎回冲击从纯债市场影响到可转债市场，流动性较好、机构持仓相对重的可转债在此过程中受到了明显的冲击。结构上，由于海外流动性预期拐点初显、国内疫情防控趋势性放松，本基金在行业上增加了大消费（餐饮链为主、地产链为辅）和医药的配置，使得整个组合围绕中长期业绩与估值相匹配的新能源为主的专精特新、医药和大消费为主的相对平衡的配置。

展望一季度基本面，国内经济预计逐渐由衰退后期向弱复苏过渡、海外逐渐由滞胀后期向衰退期过渡。展望一季度，预计经济整体将处于疫情闯关后期及疫后恢复初期。具体来说，一季度前期国内疫情或仍将严峻，不少经济活动的开展仍然受到人员和环境的制约，预计整体经济数据或仍将承压。但进入一季度后期，随着人员康复率逐步提升，预计经济活动将重启，各项经济数据或将由底部逐步恢复。受疫后需求恢复拉动，非必需品及服务消费的价格或将呈现逐步回升的趋势。但考虑到变种毒株的影响，预计疫后恢复初期消费需求仍有制约，通胀上行的幅度将相对可控。食品通胀中，由于今年春耕可能受疫情冲击，粮食蔬菜的涨价可能会延续到春节后，但猪价的低迷决定了食品通胀相对可控。能源方面，在海外衰退预期逐渐升温的环境下，一季度能源价格预计整体承压。

海外方面，地缘政治格局依然存在不确定性，大国博弈持续存在，但全球货币流动性将逐渐趋于明朗，海外主要经济体将在 23 年上半年逐渐进入衰退期、并结束货币紧缩。中期看，全球通胀中枢预计仍不低，需要警惕通胀的尾部风险。

在资产配置上，债券的胜率仍不低，但性价比不算有吸引力，且展望 23 年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 23 年出现胜率改善，现阶段仍维持对风险资产的高度重视。

债券市场方面，预一季度初期，预计国内仍将处于疫情闯关期，经济数据或整体承压，货币政策大概率维持偏暖、流动性维持合理充裕。上述背景下，预计债券市场仍然有支撑，特别是偏短端的品种。但进入一季度中后期，各项经济数据大概率将呈现边际恢复的特征，届时债券市场对经济复苏、通胀上行、流动性收敛的担忧可能逐步加强，债市面临的调整压力也或将边际提升。

权益市场方面，四季度大盘估值触底后出现结构性修复，但整体赔率仍偏高，截止 2022 年末，全 A 非金融石油石化的股权风险溢价在 0.88% 左右，处于历史 91% 分位水平，近 5 年的 86% 分位，近 3 年的 94 分位。A 股剔除金融、石油石化后 TTM 的 PE 估值为 26.88 倍，处于历史 30% 分位；PB 为 2.27 倍，处于历史 27 分位。根据历史回归，沪深 300 隐含未来一年仍有近 33% 的回报率。随着美国加息斜率的拐点隐现、防疫放松、地产政策放松进一步信号，23 年权益市场较迎来分子端 EPS 的企稳和风险偏好修复下的估值修复，中长期看，22 年三季度盈利底奠定估值底、宏观经济“去疫情化”回归正常周期，23 年国内进入被动去库存周期，年中前后市场将迎来“复苏交易”，因此对于权益资产可以保持谨慎乐观。结构上，当前阶段会从中长期角度关注中国优势资产（风光储为代表的具备优势的高端制造、成本压力与疫情影响减弱后的必需消费品，老龄化趋势加强的医药）。结构上，围绕三个方面，一是具备中长期景气度优势的新能源相关的优势制造板块，包括光伏、风电、储能、电动车智能化，也包括军工、机器人等，需要关注需求仍旺盛，且产业链供给短板不明显的领域，结合半年报考察估值与业绩的匹配度，二是疫后消费复苏板块，重点是餐饮复苏链和医疗服务，也需要业绩基本相对有优势或反转确定性高的标的，三是全球商品大通胀的环境有所缓解后，受益于原材料见顶回落后甄选供给缺口缓解、毛利率回升的产业链中下游。

可转债方面，可转债上周出现赎回流动性冲击、成长风格承压二方面因素导致尾部风险，可转债估值出现了一定程度的消化，截止 2022 年末，可转债全市场转股溢价率中位数为 35.8%，近三年 81% 分位，纯债溢价率中位数为 26.5%，历史 64% 分位，近三年 42% 分位，根据我们研究团队拟合的 100 平价溢价率从三季度最高的 38% 压缩至年底的 26% 左右（从近五年的最高位消化至 67% 分位）。中长期来看，资产荒时代下固收+资金对于可转债的配置需求仍较高，可转债性价比

从中长期看应该持续处于紧平衡的状态。短期来看，今年多数时候可转债面临的潜在风险点都是“信用下沉何时到尽头”、潜在的赎回潮和中小盘成长风格合适走弱，这三个因素在接近年期都有一定的出清。积极的当面在于，一方面权益市场政策底、盈利最低点已过，另一方面部分可转债票息甚至高于同期限的信用债，性价比凸显。2023 年将在控制整体组合溢价率的情况下把握结构性机会，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：一是高票息的底仓类转债，可以选股息收益高、溢价率相对低的品种，但需要对评级相对谨慎；二是半年内不赎回、溢价率较低的“专精特新”风格进攻品种（多集中在新能源、医药和周期涨价品），需要根据一季度的业绩的相对确定性去筛选与聚焦。

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 1.0724 元，累计份额净值为 1.4504 元。报告期，本基金份额净值增长率为-3.98%，同期业绩比较基准收益率为 -0.14%。

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 11 月 8 日起至本报告期末（2022 年 12 月 31 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，至本报告期期末（2022 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	9,440,068.64	15.78
	其中：股票	9,440,068.64	15.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,712,190.36	81.42
	其中：债券	48,712,190.36	81.42
	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	1,637,659.73	2.74
8	其他资产	39,041.80	0.07
9	合计	59,828,960.53	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	155,664.00	0.33
C	制造业	6,346,234.20	13.32
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	565,260.00	1.19
G	交通运输、仓储和邮政业	201,985.00	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	363,538.00	0.76
J	金融业	492,852.00	1.03
K	房地产业	376,694.00	0.79
L	租赁和商务服务业	367,251.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	570,590.44	1.20
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,440,068.64	19.81

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	601601	中国太保	20,100	492,852.00	1.03
2	300316	晶盛机电	7,000	444,920.00	0.93

3	688599	天合光能	6,500	414,440.00	0.87
4	603517	绝味食品	6,600	403,194.00	0.85
5	000733	振华科技	3,400	388,382.00	0.81
6	603233	大参林	9,500	376,200.00	0.79
7	601615	明阳智能	14,800	373,848.00	0.78
8	300171	东富龙	15,500	367,815.00	0.77
9	601888	中国中免	1,700	367,251.00	0.77
10	000568	泸州老窖	1,600	358,848.00	0.75

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	9,680,428.93	20.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	9,773,625.75	20.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	29,258,135.68	61.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,712,190.36	102.22

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	58,000	5,840,749.37	12.26
2	019674	22 国债 09	37,910	3,839,679.56	8.06
3	149386	21 北港 01	35,000	3,656,736.71	7.67
4	188179	21 华创 01	30,000	3,092,671.23	6.49
5	112752	18 智光 01	30,000	3,024,217.81	6.35

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

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

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，财通证券股份有限公司、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	6,124.76
2	应收证券清算款	31,615.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,301.18
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	39,041.80

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	113044	大秦转债	1,485,721.89	3.12
2	113043	财通转债	1,127,576.16	2.37
3	127012	招路转债	1,048,989.43	2.20
4	113042	上银转债	1,041,579.34	2.19
5	113052	兴业转债	1,018,143.84	2.14
6	113037	紫银转债	983,964.96	2.06
7	113056	重银转债	974,258.97	2.04
8	128108	蓝帆转债	970,075.74	2.04
9	110053	苏银转债	964,992.92	2.02
10	120002	18 中原 EB	888,043.66	1.86

11	113057	中银转债	857,049.60	1.80
12	127006	敖东转债	820,687.10	1.72
13	113055	成银转债	741,681.95	1.56
14	127005	长证转债	736,805.07	1.55
15	127058	科伦转债	651,886.41	1.37
16	110079	杭银转债	615,879.75	1.29
17	127036	三花转债	534,960.65	1.12
18	128138	侨银转债	521,926.94	1.10
19	113021	中信转债	505,114.28	1.06
20	123049	维尔转债	499,808.22	1.05
21	111000	起帆转债	496,726.81	1.04
22	123121	帝尔转债	456,987.77	0.96
23	113626	伯特转债	454,647.67	0.95
24	128078	太极转债	444,560.81	0.93
25	118009	华锐转债	417,826.77	0.88
26	110061	川投转债	393,051.10	0.82
27	127044	蒙娜转债	377,778.19	0.79
28	113625	江山转债	342,414.82	0.72
29	128133	奇正转债	341,014.97	0.72
30	113025	明泰转债	317,504.88	0.67
31	128017	金禾转债	305,119.18	0.64
32	127037	银轮转债	268,542.08	0.56
33	113537	文灿转债	260,534.90	0.55
34	123085	万顺转 2	252,190.85	0.53
35	113584	家悦转债	250,606.88	0.53
36	110068	龙净转债	248,506.47	0.52
37	113598	法兰转债	247,243.56	0.52
38	123025	精测转债	232,189.15	0.49
39	113048	晶科转债	219,289.07	0.46
40	127062	垒知转债	205,044.41	0.43
41	128106	华统转债	124,156.00	0.26
42	127061	美锦转债	117,137.16	0.25
43	128141	旺能转债	31,987.25	0.07
44	132022	20 广版 EB	21,010.78	0.04
45	113047	旗滨转债	19,584.65	0.04
46	113050	南银转债	18,794.45	0.04
47	127027	靖远转债	1,160.88	0.00
48	110073	国投转债	1,050.42	0.00
49	127024	盈峰转债	1,014.52	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	45,181,064.74
报告期期间基金总申购份额	226,925.87
减：报告期期间基金总赎回份额	968,795.58
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	44,439,195.03

§ 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	3,333,828.13
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	3,333,828.13
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	7.50

注：

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	1	2022.10.1-2022.12.31	20,420,007.28	0.00	0.00	20,420,007.28	45.9500

构							
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

2023 年 1 月 20 日