

华富恒利债券型证券投资基金

2023 年第 4 季度报告

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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 22 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 2024 年 01 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 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 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	11,473,059.97 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	10,365,606.95 份	1,107,453.02 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 10 月 1 日-2023 年 12 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	18,877.08	1,150.40
2. 本期利润	9,031.19	-74.01
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0009	-0.0001
4. 期末基金资产净值	10,604,013.72	1,091,257.19
5. 期末基金份额净值	1.023	0.985

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	0.10%	0.17%	1.44%	0.05%	-1.34%	0.12%
过去六个月	-0.58%	0.24%	2.19%	0.06%	-2.77%	0.18%
过去一年	-1.63%	0.34%	5.23%	0.05%	-6.86%	0.29%
过去三年	-10.81%	0.38%	15.05%	0.06%	-25.86%	0.32%
过去五年	4.83%	0.40%	24.43%	0.07%	-19.60%	0.33%
自基金合同 生效起至今	6.30%	0.34%	42.38%	0.07%	-36.08%	0.27%

华富恒利债券 C

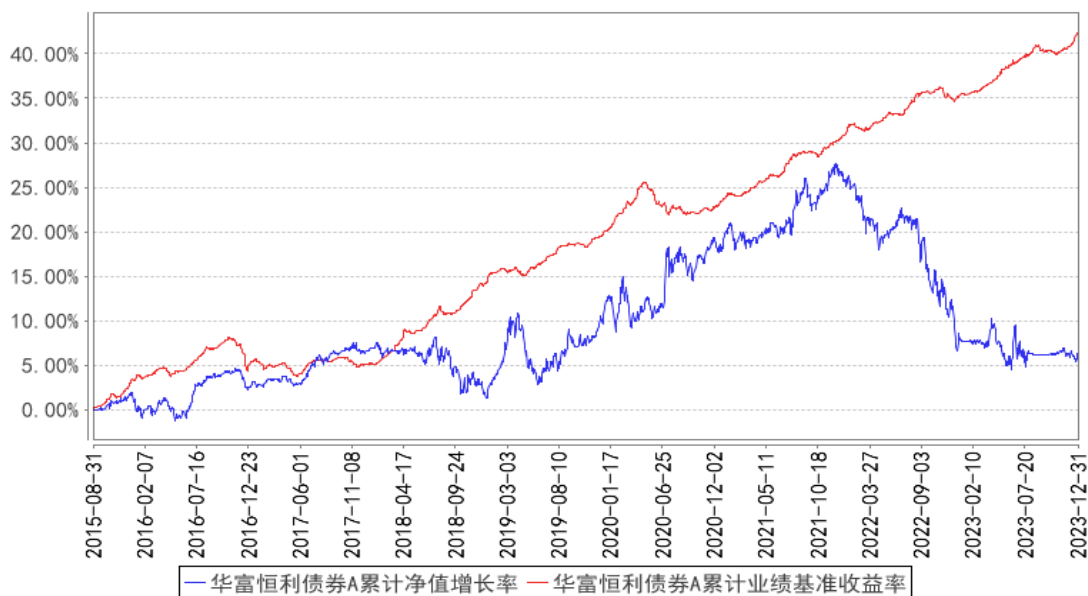
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.00%	0.16%	1.44%	0.05%	-1.44%	0.11%
过去六个月	-0.91%	0.25%	2.19%	0.06%	-3.10%	0.19%

过去一年	-2.09%	0.35%	5.23%	0.05%	-7.32%	0.30%
过去三年	-11.97%	0.38%	15.05%	0.06%	-27.02%	0.32%
过去五年	0.38%	0.41%	24.43%	0.07%	-24.05%	0.34%
自基金合同生效起至今	0.38%	0.35%	42.38%	0.07%	-42.00%	0.28%

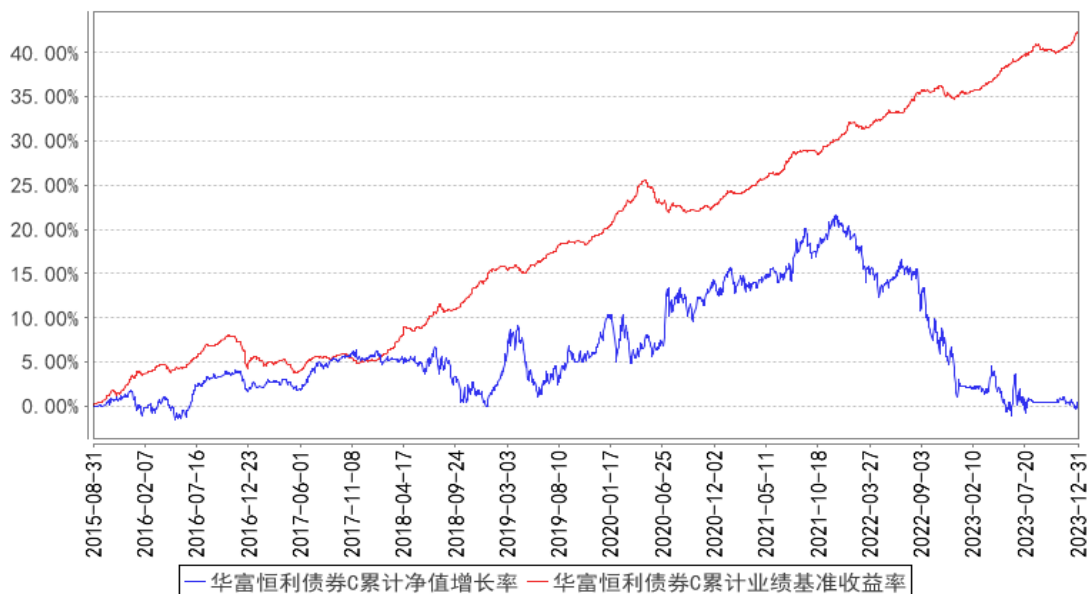
注：本基金业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率。

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：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 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

四季度，国内宏观环境有所企稳，但仍面临一些阶段性的压力。从数据来说，10、11、12 月官方制造业 PMI 分别为 49.5、49.4、49，尚处于荣枯线以下。其中，既有外部环境复杂性、严峻性、不确定性上升的拖累，也有国内有效需求不足的影响。为了缓解压力，政策端也加大了扶持力度。12 月政治局会议重提“先立后破”，或意在短期纠偏。具体政策上，财政端于四季度增发国债 1 万亿，用于 2023 年及 2024 年，货币端新增 PSL 投放 3500 亿以支持项目建设，产业端地产政策适度松绑，宏观政策一致性明显增强，持续释放偏积极的信号。四季度整体流动性总量充裕，但结构上和节奏上略为偏紧，主要系政府债发行较多，特殊再融资债、增发国债等导致四季度整体政府债券净融资创近年来同期新高。但在跨税、跨年等季节性时点，央行呵护银行间市场态度依旧明显，公开市场操作量加大，始终保持流动性合理充裕，跨年整体资金较为平稳。

海外方面，自 9 月美联储议息会议暂停加息以来，四季度美国经济活动在韧性中边际放缓。失业率、通胀回落的趋势延续。在能源和房租分项回落的带动下，CPI 自 9 月 3.7% 的同比显著下行至 11 月的 3.1%。10 月在美债供给冲击较大、而需求较弱的情况下，金融条件紧缩，但随着 11 月 FOMC 会议开始释放鸽派信号、12 月联储主席提及降息展望，市场迅速大幅打入降息预期，10 年美债利率自 5% 左右持续下行至 3.7%。四季度，债券市场波动较大，收益率先上后下，整体小幅下行。特别是进入 12 月，多家国有大行开启新一轮存款利率下调，市场对后续央行公开市场降息的预期显著升温，推动收益率快速下行。尤其部分配置型机构出于考核等因素，对超长久

期增配，导致超长端利率迅速下行。四季度信用债市场呈现期限利差和等级利差同时收窄，延续“资产荒”格局，收益率整体下行，但结构上仍有分化。权益市场在宏观环境、海外流动性改善、内部存量资金博弈加剧等多重因素影响下，震荡幅度较大，大盘指数一波三折，风格切换和行业轮动都很快，对于投资操作有较大挑战，结构上整体利好低估值、高分红和小微盘股。最终上证指数四季度下跌 4.4%，沪深 300 下跌 7%，但小盘股代表国证 2000 仅下跌 1.1%，微盘股代表北交所更是大涨了 33%。在股债波动加剧放大的四季度，前期相对强势的可转债出现补跌，四季度中证转债指数跌 3.22%，为近 7 个季度最大调整，转债估值连续回落。

回顾四季度，本基金继续以追求绝对收益为目标，在大类资产配置上继续配置了高等级信用债，以票息为主、杠杆为辅的债券策略给组合贡献了正向的票息和杠杆收益。同时随着债券市场的超涨和权益市场的超跌，股债性价比开始出现明显左侧的偏移，组合用超跌的可转债资产部分代替原先的纯债票息策略，特别是高 YTM 的转债配置价值凸显后我们加大了对这类资产的增配。同时基于可转债资产估值和价格的下跌，我们立足于转债资产特性，以双低策略增强的思路，严格控制组合回撤，并在关键指数点位把握超跌机会，挖掘非对称性收益。在风险资产上，在较弱的基本面定价环境下，我们降低了风险资产仓位，同时以防御性思路主要配置了能源、贵金属等板块个股，在政治局会议“活跃资本市场”提议之后随着多项呵护市场信心的政策频出，我们小幅增加了前期超跌但行业基本面依然较好的医药和科技个股，虽然短期依然对组合净值带来了拖累，但是我们相信随着市场信心的进一步修复，这些优质公司有望为组合带来正向贡献。由于权益市场的整体下行，本季度组合净值小幅下跌。

展望 2024 年一季度，预计在宏观政策持续发力的支持下，宏观数据或边际企稳回升。首先，结构上，保障性住房建设、“平急两用”公共基础设施建设、城中村改造等“三大工程”的快速推进或将成为经济企稳回升的重要动力。其次，财政或继续加力，地方政府专项债再度提前发放，去年 1 万亿增发国债大部分也将在今年投入使用，PSL 大概率还将继续投放。再次，人民币汇率已经稳定，通胀较低，都有利于央行继续放松货币政策。另外，2023 年一季度由于春节靠前，导致第二产业基数较低，加之今年一季度企业可能开启补库存，都有利于制造业复苏。最后，在“房住不炒”大基调下，地产政策近期再次适度松绑，也有利于地产相关数据短期企稳。12 月存款利率下调以及 PSL3500 亿投放，短期来看一季度降息概率较大，降准概率仍有但必要性下降。整体一季度流动性较四季度有所改善，中枢有望小幅缓慢下行。

在资产配置上，对于债券来说，虽然赔率很低但是基于经济发展阶段和持续偏宽松的货币环境胜率依然在，我们尽量在波动中择机进行配置；对于权益来说，虽然各项估值和比价指标均不是很理想，但是胜率的改善需要持续观察并积极应对，当下的市场值得我们多一份耐心等待信心

的进一步修复；对于可转债来说，债券的胜率提供了安全边际，权益的胜率改善有望带来资产弹性，是 24 年值得重视和挖掘的资产。

债券市场方面，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。但考虑到当前经济企稳回升的动力还不突出，货币政策仍需要为经济企稳回升提供协助，预计一段时间内低利率的环境还会持续。但市场结构性的扰动仍然值得关注，例如一季度经济潜在的环比改善、政府债务的集中发行，均可能对收益率构成阶段性的扰动。如后续收益率有所调整，将持续关注潜在的投资机会。当前我国经济正在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。而这样的经济结构调整，将非常有利于我国实际利率的趋势性下行。

权益市场方面，12 月中央经济工作会议定调积极，或再度成为今年春季躁动行情的发令枪。回顾 2011 年以来的行情，在上一年年底的会议定调积极之后，次年年初上涨的行情有 9 次。而本次会议“先立后破”、“财政政策要适度加力”、“经济大省要真正挑起大梁”等措辞或意味着今年中央扶持政策力度将继续加大，地方响应积极性也会提升。而后续市场能否继续企稳回升，要关注 2 个方面：一是本轮企业补库存力度，二房地产政策放松效果。我们预计随着一线城市地产政策的持续放松叠加房地产行业保障租赁体制的不断健全，地产行业下行压力将有所缓解；同时企业的补库存周期有望从一季度陆续开启，历史来看，在主动补库阶段权益市场将迎来上涨。但是我们也客观看到目前市场处于存量博弈阶段，资金不再一味追逐高 ROE（尤其以高杠杆维持的高 ROE），转而追求稳定回报，即自由现金流为正且长期稳定或改善，负债率低或有息负债下降或增速低的行业，我们也将重点在这些行业中找到确定性收益回报的个股。

可转债市场方面，首先，转债当前的估值具有较为不错的性价比，中位数 118 元的水平给反弹留有空间。其次，海外确认美联储宽松周期，国内流动性整体处于相对宽松的水平，负债端较为友好，为转债市场提供更为稳定的投资环境。再次，权益市场在一季度是业绩空窗期，配合一些逻辑演绎，加上整体估值处于低位，容易产生行情，波动中给转债带来机会。但影响经济基本面的核心因素还未出现明显向好信号，形成趋势性上涨合力还比较难，倾向于市场围绕估值中枢区间震荡，所以需要把握交易节奏。具体行业可能依旧是结构性的，可以关注在宏观经济周期中具备相对韧性的行业，比如有出口海外的能力的、需求不全在国内的行业，可能出现的制造业补库存。此外，也可参与一些有催化的主题性投资。

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 1.023 元，累计份额净值为 1.067 元。报告期，华富恒利债券 A 份额净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.44%。截止本期末，华富恒利债券 C 份额净值为 0.985 元，累计份额净值为 1.006 元。报告期，华富恒利债券 C 份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.44%。

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 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 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	893,803.60	7.03
	其中：股票	893,803.60	7.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,504,840.53	74.75
	其中：债券	9,504,840.53	74.75
	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	1,000,000.00	7.86
	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	1,315,968.30	10.35
8	其他资产	1,517.24	0.01
9	合计	12,716,129.67	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	255,265.00	2.18
C	制造业	182,320.00	1.56

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	69,285.00	0.59
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	79,550.00	0.68
J	金融业	109,317.60	0.93
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	80,036.00	0.68
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	118,030.00	1.01
S	综合	-	-
	合计	893,803.60	7.64

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	601881	中国银河	9,072	109,317.60	0.93
2	600188	兖矿能源	4,400	87,164.00	0.75
3	603259	药明康德	1,100	80,036.00	0.68
4	603993	洛阳钼业	12,600	65,520.00	0.56
5	002252	上海莱士	7,700	61,600.00	0.53
6	601098	中南传媒	5,200	52,884.00	0.45
7	603000	人民网	1,600	44,768.00	0.38
8	300413	芒果超媒	1,700	42,840.00	0.37
9	000933	神火股份	2,200	36,960.00	0.32
10	600729	重庆百货	1,300	36,660.00	0.31

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	7,358,861.06	62.92

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）	2,145,979.47	18.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,504,840.53	81.27

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	019709	23 国债 16	56,000	5,629,304.11	48.13
2	019702	23 国债 09	10,000	1,071,816.99	9.16
3	019547	16 国债 19	6,010	646,751.58	5.53
4	113648	巨星转债	820	123,844.67	1.06
5	113616	韦尔转债	990	111,823.62	0.96

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，中国银河证券股份有限公司、兖矿能源集团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	1,517.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,517.24

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	113648	巨星转债	123,844.67	1.06
2	113616	韦尔转债	111,823.62	0.96
3	118015	芯海转债	80,327.38	0.69
4	113577	春秋转债	56,956.78	0.49
5	123112	万讯转债	56,591.88	0.48
6	123076	强力转债	56,223.27	0.48
7	123153	英力转债	55,298.55	0.47
8	123176	精测转 2	54,741.26	0.47
9	123174	精锻转债	54,432.17	0.47
10	118035	国力转债	54,341.53	0.46
11	113629	泉峰转债	53,658.67	0.46
12	118027	宏图转债	53,582.21	0.46
13	113618	美诺转债	53,365.29	0.46
14	111010	立昂转债	52,225.48	0.45
15	118009	华锐转债	51,815.11	0.44

16	128037	岩土转债	35,785.60	0.31
17	123109	昌红转债	34,638.82	0.30
18	128035	大族转债	34,525.32	0.30
19	127006	敖东转债	31,676.34	0.27
20	123127	耐普转债	29,688.60	0.25
21	113670	金 23 转债	28,657.28	0.25
22	123049	维尔转债	28,341.25	0.24
23	113637	华翔转债	27,915.54	0.24
24	123011	德尔转债	27,326.77	0.23
25	113609	永安转债	27,244.63	0.23
26	128039	三力转债	27,239.38	0.23
27	113666	爱玛转债	26,506.29	0.23
28	128134	鸿路转债	26,492.68	0.23
29	127086	恒邦转债	26,470.18	0.23
30	123117	健帆转债	23,520.17	0.20
31	127040	国泰转债	22,882.82	0.20
32	123163	金沃转债	22,752.22	0.19
33	113649	丰山转债	22,607.57	0.19
34	113033	利群转债	22,538.06	0.19
35	128132	交建转债	22,227.16	0.19
36	123087	明电转债	22,220.26	0.19
37	123064	万孚转债	22,184.22	0.19
38	123172	漱玉转债	22,067.75	0.19
39	127035	濮耐转债	21,955.12	0.19
40	128120	联诚转债	21,908.38	0.19
41	113565	宏辉转债	21,797.26	0.19
42	123119	康泰转 2	21,105.47	0.18

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	10,361,939.41	927,447.70
报告期期间基金总申购	3,784.14	209,441.31

份额		
减:报告期期间基金总赎回份额	116.60	29,435.99
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	10,365,606.95	1,107,453.02

§ 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

项目	华富恒利债券 A	华富恒利债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	9,764,648.44	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,764,648.44	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	85.11	0.00

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

		到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	2023.1.01 - 2023.12.31	9,764,648.44	0.00	0.00	9,764,648.44	85.1100
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

2024 年 1 月 22 日