

华富强化回报债券型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 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 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华富强化回报债券 |
| 场内简称 | 华富强债 |
| 基金主代码 | 164105 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010 年 9 月 8 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 343,032,189.65 份 |
| 投资目标 | 在控制风险的基础上，力争为持有人创造稳定的当期收益和长期回报。 |
| 投资策略 | 本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、法规政策、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险等因素，研判各类固定收益类资产以及参与新股申购、股票增发、可转换债券转股、要约收购类股票等非固定收益类资产投资的预期收益和预期风险，以确定各类金融资产的配置比例。 |
| 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低风险品种，预期风险和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 | 中国建设银行股份有限公司 |

§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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -10,627,410.51 |
| 2. 本期利润 | 6,597,643.12 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0178 |
| 4. 期末基金资产净值 | 588,153,430.63 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.715 |

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

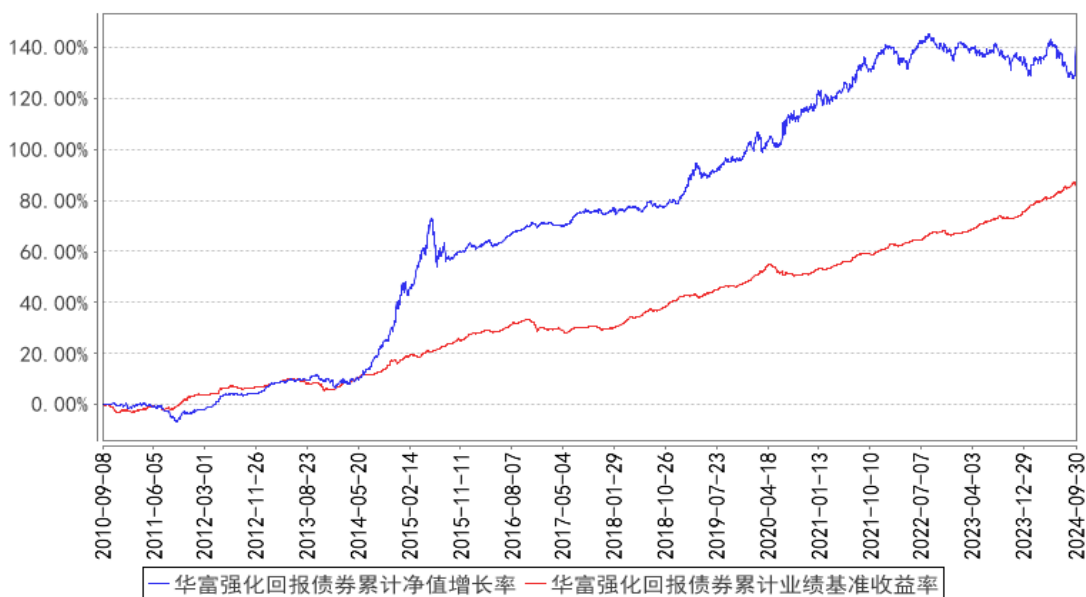
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 1.48% | 0.46% | 1.24% | 0.12% | 0.24% | 0.34% |
| 过去六个月 | 2.51% | 0.39% | 3.19% | 0.11% | -0.68% | 0.28% |
| 过去一年 | 1.96% | 0.34% | 7.13% | 0.09% | -5.17% | 0.25% |
| 过去三年 | 4.07% | 0.27% | 16.57% | 0.07% | -12.50% | 0.20% |
| 过去五年 | 23.56% | 0.30% | 26.83% | 0.07% | -3.27% | 0.23% |
| 自基金合同 生效起至今 | 141.05% | 0.29% | 85.57% | 0.09% | 55.48% | 0.20% |

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

华富强化回报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：本基金建仓期为 2010 年 9 月 8 日到 2011 年 3 月 8 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《华富强化回报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 | | |
| 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 | 2014 年 3 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 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。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

2024 年三季度宏观经济基本延续了上个季度的稳健趋势。7-9 月，国内制造业 PMI 分别为 49.4%、49.1%和 49.8%，整体保持在荣枯线附近；7-8 月国内规模以上工业增加值同比分别增长 5.1%和 4.5%。需求方面，同期社会消费零售总额分别增长 2.7%和 2.1%；出口金额分别增长 7.0%

和 8.7%，继续保持相对强劲的复苏态势；国内固定资产投资完成额分别增长 3.6% 和 3.4%。总体来看，三季度国内制造业投资和出口维持了年初以来的复苏态势，消费、基建出现回落，房地产行业下滑幅度依然较大。由于需求偏弱叠加居民存款流动持续，三季度信贷和存款数据均有所降温，银行理财规模持续增长。9 月底召开的中央政治局会议和金融支持经济会议进一步加大了逆周期调节的货币政策以及新型政策性工具来支持资本市场发展，对于市场信心有较大提振，扭转了市场对经济压力的预期。

海外方面，回顾 2024 年三季度，美国通胀稳步下行、失业率持续上行，就业市场边际走弱；美联储在 9 月初以 50BP 的前置降息开启宽松周期，市场也因此对全球流动性预期大幅提升。汇率方面，美元在三季度自 106 大幅下行至 100 处的支撑位，美元的走弱与央行稳汇率的操作、以及利好经济政策的出台使得人民币汇率自 7.3 大幅升值至 6.97 附近。

2024 年三季度，在宏观经济放缓同时资金偏宽松的背景下，7-9 月利率债收益率波动下行，但是在季末政治局会议和金融支持经济会议推出了一系列逆周期调节政策后，债券收益率出现回调，10 年期国债收益率一度从季初的 2.23% 下探至 2.00%，但最后几个交易日回调后最终回到季初水平。30 年期国债收益率从季初的 2.42% 一度下探至 2.10%，最终回到 2.44%。信用债方面，三季度整体表现偏弱，信用利差和等级利差均持续走阔。三季度内，中高等级信用利差走阔主要在 20-30BP 区间，回到了历史中位数水平。可转债方面，7-9 月转债市场相较于正股还是表现出了转债资产的抗跌特性，但受制于股票走弱和债券信用风险的增加，收益一般。但是随着 9 月底相关会议和一系列逆周期调节政策的推出，权益市场风险偏好大幅提升后，可转债也出现了跟随式上涨，转债估值持续修复，但是仍在低位区域徘徊，积聚了未来上涨的潜力。权益市场方面，以 9 月底政治局会议和金融支持经济相关会议为节点，市场整体风险偏好出现逆转，交易量持续上升，主要宽基指数在三季度末的最后几个交易日均大幅上涨创下了年内新高，市场整体处于较热的看涨情绪中。

本基金在三季度保持中短久期信用债和三年左右二永债配置，增配长久期利率债；股票部分适当减仓但保持较高仓位，转债适度提升仓位。

展望 2024 年四季度，随着 9 月底相关重要会议的召开，宏观经济整体企稳回升的预期大幅改善，各项逆周期调节政策陆续落地，以降息降准的货币宽松政策先行，后续积极的财政政策有望陆续推出，在大力化解地方债务压力、积极有效拉动投资、促进消费需求、改善民生预期等方向都值得期待。整体来看，资本市场的信心得到大幅提升。随着政策调整力度加大，市场悲观预期已经开始修正，风险偏好有望逐步提升，带动风险资产估值回升。海外方面，美国短期的经济韧性、长期的 L 型复苏、通胀的回落作为基准假设，而流动性预期会因为短期的数据波动而摇摆。

另外，近期中东地缘政治因素导致油价企稳回升，四季度也需观察中东局势是否会引发海外滞涨。

在资产配置上，随着政策加码，市场对经济增长的预期有所修复，但货币政策继续宽松，债券市场的胜率仍在，且经过 9 月份市场调整，收益率水平和信用利差均有所回升，赔率得到改善，考虑流动性和利差水平，可考虑增配利率或中短久期高等级信用品种。而股票市场在流动性宽松与信用改善的大背景下，风险资产胜率持续提升，市场有望重新从存量博弈演变为增量市场。从市场涨势来看，需要震荡整理，但中期维度市场风险偏好提升，企业盈利预期有望修复改善，股票市场有望迎来较大的机会。行业配置层面，目前相对看好低估值蓝筹、资源、非银、消费等行业竞争格局稳定、盈利回升的价值类品种，主题机会适当关注 AI 应用方向。可转债方面，经济基本面的修复和股票市场的上涨也将大幅缓释可转债市场的信用风险担忧，转债的期权价值也得以修复，同时转债市场相对股票市场滞涨，目前整体性价比较高，配置价值较为显著，将以较为积极的双低增强和纯债替代的思路，挖掘非对称性收益机会。

本基金股票和转债仓位保持较高仓位，整体风格偏均衡；纯债部分将继续提升票息策略强度，考虑适度拉长久期。中期而言，本基金将根据性价比进一步平衡股债配置，股票仓位仍会坚持以基本面和业绩驱动为主的投资理念，寻找具有估值优势或拥有优势赛道具备长期成长性的企业。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，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 1.715 元，累计基金份额净值为 2.166 元。报告期，本基金份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.24%。

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 | 103,395,623.30 | 14.54 |
| | 其中：股票 | 103,395,623.30 | 14.54 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 593,346,720.02 | 83.46 |
| | 其中：债券 | 589,273,802.76 | 82.89 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 资产支持证券 | 4,072,917.26 | 0.57 |
| 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 | 9,911,665.70 | 1.39 |
| 8 | 其他资产 | 4,264,595.74 | 0.60 |
| 9 | 合计 | 710,918,604.76 | 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 | 58,416,960.70 | 9.93 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,821,162.60 | 6.09 |
| 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 | 9,157,500.00 | 1.56 |
| 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 | - | - |
| 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 | 103,395,623.30 | 17.58 |

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 | 600900 | 长江电力 | 1,192,052 | 35,821,162.60 | 6.09 |
| 2 | 601677 | 明泰铝业 | 840,000 | 12,616,800.00 | 2.15 |
| 3 | 002706 | 良信股份 | 1,500,000 | 11,310,000.00 | 1.92 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 750,000 | 9,157,500.00 | 1.56 |
| 5 | 600690 | 海尔智家 | 250,000 | 8,037,500.00 | 1.37 |
| 6 | 603596 | 伯特利 | 140,000 | 6,848,800.00 | 1.16 |
| 7 | 603225 | 新凤鸣 | 447,284 | 5,662,615.44 | 0.96 |
| 8 | 002891 | 中宠股份 | 225,000 | 5,508,000.00 | 0.94 |
| 9 | 002050 | 三花智控 | 200,000 | 4,766,000.00 | 0.81 |
| 10 | 601966 | 玲珑轮胎 | 179,109 | 3,607,255.26 | 0.61 |

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 | 31,514,096.88 | 5.36 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 89,885,156.51 | 15.28 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,618,304.11 | 5.21 |
| 4 | 企业债券 | 119,713,693.64 | 20.35 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 122,982,650.35 | 20.91 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 225,178,205.38 | 38.29 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 589,273,802.76 | 100.19 |

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 | 123107 | 温氏转债 | 200,000 | 24,618,301.37 | 4.19 |
| 2 | 240310 | 24 进出 10 | 200,000 | 20,551,961.64 | 3.49 |
| 3 | 102101539 | 21 京城投 MTN002 | 200,000 | 20,544,400.00 | 3.49 |
| 4 | 188729 | 21 国宏 02 | 200,000 | 20,224,449.32 | 3.44 |
| 5 | 019740 | 24 国债 09 | 196,000 | 19,753,395.51 | 3.36 |

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 | 143955 | 融惠 15 优 | 40,000 | 4,072,917.26 | 0.69 |

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，中国进出口银行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 | 19,273.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,550,806.49 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 694,515.53 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,264,595.74 |

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 | 123107 | 温氏转债 | 24,618,301.37 | 4.19 |
| 2 | 113044 | 大秦转债 | 19,595,079.04 | 3.33 |
| 3 | 113623 | 凤 21 转债 | 11,690,864.43 | 1.99 |
| 4 | 123076 | 强力转债 | 11,062,978.62 | 1.88 |
| 5 | 110085 | 通 22 转债 | 10,297,800.00 | 1.75 |
| 6 | 113050 | 南银转债 | 10,056,324.38 | 1.71 |
| 7 | 127076 | 中宠转 2 | 9,965,663.97 | 1.69 |
| 8 | 127045 | 牧原转债 | 9,253,678.90 | 1.57 |
| 9 | 110073 | 国投转债 | 9,217,347.95 | 1.57 |
| 10 | 113060 | 浙 22 转债 | 8,855,600.55 | 1.51 |
| 11 | 113641 | 华友转债 | 8,330,240.00 | 1.42 |
| 12 | 127031 | 洋丰转债 | 6,554,270.14 | 1.11 |
| 13 | 123119 | 康泰转 2 | 6,363,304.11 | 1.08 |
| 14 | 113061 | 拓普转债 | 6,101,694.52 | 1.04 |
| 15 | 113633 | 科沃转债 | 5,815,617.12 | 0.99 |
| 16 | 113052 | 兴业转债 | 5,472,965.75 | 0.93 |
| 17 | 123109 | 昌红转债 | 4,994,222.30 | 0.85 |
| 18 | 123144 | 裕兴转债 | 4,926,107.22 | 0.84 |
| 19 | 123179 | 立高转债 | 3,570,082.47 | 0.61 |
| 20 | 127016 | 鲁泰转债 | 3,344,097.06 | 0.57 |
| 21 | 127041 | 弘亚转债 | 3,252,613.66 | 0.55 |
| 22 | 111014 | 李子转债 | 3,107,186.30 | 0.53 |
| 23 | 123159 | 崧盛转债 | 3,005,991.65 | 0.51 |
| 24 | 113059 | 福莱转债 | 2,978,697.26 | 0.51 |
| 25 | 113579 | 健友转债 | 2,608,518.52 | 0.44 |
| 26 | 110082 | 宏发转债 | 2,591,985.91 | 0.44 |
| 27 | 110086 | 精工转债 | 2,532,741.92 | 0.43 |
| 28 | 123147 | 中辰转债 | 2,439,059.10 | 0.41 |
| 29 | 113542 | 好客转债 | 2,359,662.74 | 0.40 |
| 30 | 118038 | 金宏转债 | 2,305,865.75 | 0.39 |
| 31 | 118028 | 会通转债 | 2,248,953.42 | 0.38 |
| 32 | 113030 | 东风转债 | 2,215,764.14 | 0.38 |
| 33 | 128144 | 利民转债 | 2,213,159.48 | 0.38 |
| 34 | 113639 | 华正转债 | 2,127,975.34 | 0.36 |
| 35 | 113048 | 晶科转债 | 1,928,186.30 | 0.33 |
| 36 | 118031 | 天 23 转债 | 1,859,493.83 | 0.32 |
| 37 | 118039 | 煜邦转债 | 1,538,488.00 | 0.26 |
| 38 | 111008 | 沿浦转债 | 1,433,243.97 | 0.24 |
| 39 | 113640 | 苏利转债 | 1,393,471.88 | 0.24 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 40 | 123133 | 佩蒂转债 | 950,906.31 | 0.16 |
|----|--------|------|------------|------|

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 | 384,012,479.06 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,416,440.53 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 44,396,729.94 |
| 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 | 343,032,189.65 |

§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 | 1 | 20240701-20240930 | 90,145,366.64 | 0.00 | 0.00 | 90,145,366.64 | 26.28 |
| 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、华富强化回报债券型证券投资基金基金合同
- 2、华富强化回报债券型证券投资基金托管协议
- 3、华富强化回报债券型证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富强化回报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 10 月 25 日