

华富安鑫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：上海浦东发展银行股份有限公司

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 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	40,544,195.49 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 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-194,602.74
2. 本期利润	-435,678.51

3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0103
4. 期末基金资产净值	37,644,895.70
5. 期末基金份额净值	0.9285

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

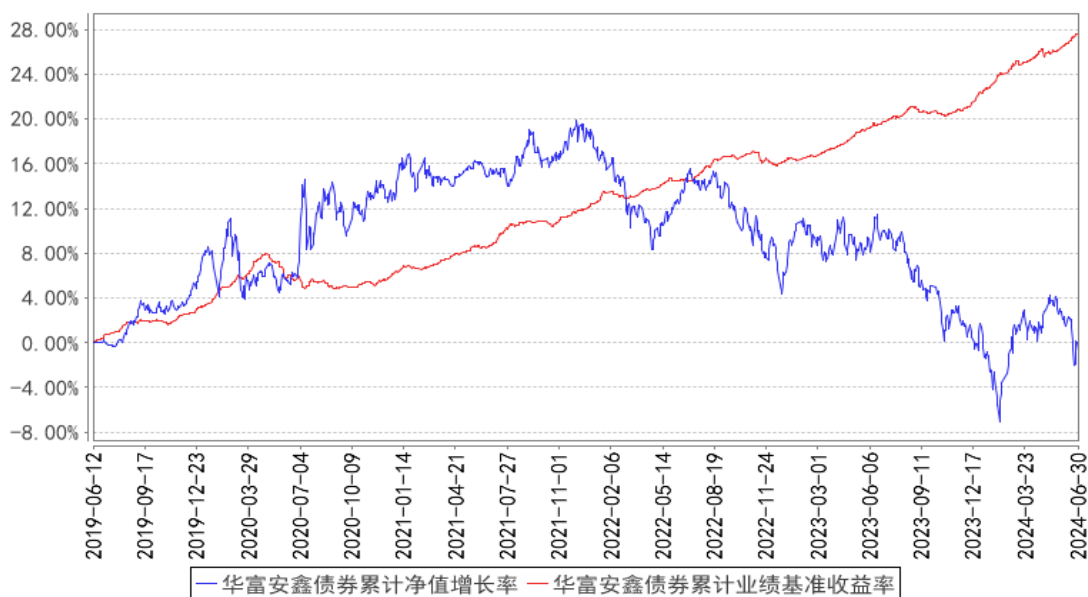
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.33%	0.60%	1.92%	0.08%	-3.25%	0.52%
过去六个月	-1.67%	0.66%	4.31%	0.08%	-5.98%	0.58%
过去一年	-9.14%	0.56%	6.59%	0.07%	-15.73%	0.49%
过去三年	-13.28%	0.48%	17.29%	0.06%	-30.57%	0.42%
过去五年	-0.03%	0.48%	27.16%	0.07%	-27.19%	0.41%
自基金合同 生效起至今	-0.03%	0.48%	27.65%	0.07%	-27.68%	0.41%

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，2024 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中，主要增长引擎尚不明确，传统增长主要拉动力度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，但支撑起整体宏观经济的成长动能尚需要一定时间。

海外方面，2024 年第二季度整体总结是“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，10Y 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

美元/盎司的区间内震荡；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 股出现了一定的回撤，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，2024 年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，10Y 国债从季初的 2.30% 一度降至 2.22% 的前低位置，30Y 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 4 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。

回顾 2024 年二季度，本基金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 β 的特征。本基金在二季度增加了白电、铜、化工品和船舶等资产，取得一定正向贡献，整体资产在偏向成长风格的基础上向“确定性”品种上做了一定迁移，但 6 月可转债资产下跌对于净值的影响较明显，本基金在下跌过程中积极向更高性价比的转债上做了增配，增加估值修复的弹性。本基金在行业配置上总体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、工业金属、涨价化工品、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等久期、偏高票息的信用债配置。

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之一。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%，处于历史 99%分位。信用债方面，绝对收益来看 1-5Y 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，1Y 中高等级信用利差略高，3Y 和 5Y 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 5Y 中等偏弱信用债和 5Y 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，但对估值波动尾部风险有信心应对。

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，全年二永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，我们预计三季度内利差仍或持续维持在低位水平。

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 0.9285 元，累计基金份额净值为 1.3945 元。报告期，本基金份额净值增长率为-1.33%，同期业绩比较基准收益率为 1.92%。

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 06 月 30 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（2024 年 06 月 30 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	7,353,834.40	15.26

	其中：股票	7,353,834.40	15.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,717,684.42	82.40
	其中：债券	39,717,684.42	82.40
	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	1,125,611.96	2.34
8	其他资产	5,309.59	0.01
9	合计	48,202,440.37	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	444,000.00	1.18
C	制造业	6,371,786.40	16.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	202,540.00	0.54
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	-	-
K	房地产业	38,808.00	0.10
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	296,700.00	0.79
S	综合	-	-
	合计	7,353,834.40	19.53

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	300308	中际旭创	4,480	617,702.40	1.64
2	000333	美的集团	7,800	503,100.00	1.34
3	603019	中科曙光	12,000	498,000.00	1.32
4	002422	科伦药业	16,000	485,280.00	1.29
5	600489	中金黄金	30,000	444,000.00	1.18
6	300751	迈为股份	3,500	418,180.00	1.11
7	300354	东华测试	13,000	403,910.00	1.07
8	002001	新和成	20,000	384,000.00	1.02
9	600584	长电科技	11,800	374,178.00	0.99
10	000625	长安汽车	27,000	362,610.00	0.96

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	8,133,195.42	21.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,036,543.34	5.41
	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）	29,547,945.66	78.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,717,684.42	105.51

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	41,000	4,731,223.64	12.57
2	242480003	24 广州农商行永 续债 01	20,000	2,036,543.34	5.41
3	019709	23 国债 16	20,000	2,031,230.14	5.40
4	113053	隆 22 转债	17,000	1,729,756.05	4.59
5	019630	20 国债 04	11,570	1,370,741.64	3.64

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，兴业银行股份有限公司、重庆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	3,481.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,828.00
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	5,309.59

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	113053	隆 22 转债	1,729,756.05	4.59
2	113052	兴业转债	1,222,859.68	3.25
3	113037	紫银转债	1,203,443.13	3.20
4	113042	上银转债	1,127,641.19	3.00
5	113056	重银转债	1,087,845.56	2.89
6	118031	天 23 转债	1,067,789.18	2.84
7	118008	海优转债	979,368.33	2.60
8	128108	蓝帆转债	883,613.13	2.35
9	110047	山鹰转债	871,973.48	2.32
10	123182	广联转债	814,734.79	2.16
11	127045	牧原转债	769,270.73	2.04
12	128138	侨银转债	746,366.83	1.98
13	118027	宏图转债	694,374.66	1.84
14	113049	长汽转债	614,937.52	1.63
15	127079	华亚转债	559,745.34	1.49
16	110094	众和转债	554,681.47	1.47
17	123219	宇瞳转债	542,759.08	1.44
18	113584	家悦转债	531,012.88	1.41
19	132026	G 三峡 EB2	517,826.30	1.38
20	118034	晶能转债	517,402.55	1.37
21	118013	道通转债	468,229.55	1.24
22	113674	华设转债	450,018.97	1.20
23	123194	百洋转债	426,871.73	1.13
24	113677	华懋转债	378,702.40	1.01
25	113678	中贝转债	361,955.34	0.96
26	127050	麒麟转债	349,228.08	0.93
27	113615	金诚转债	348,971.73	0.93
28	113666	爱玛转债	342,390.82	0.91
29	128119	龙大转债	334,225.97	0.89
30	123025	精测转债	327,132.16	0.87
31	127024	盈峰转债	321,063.92	0.85
32	123109	昌红转债	313,233.70	0.83
33	123217	富仕转债	307,593.04	0.82
34	127076	中宠转 2	305,905.41	0.81
35	113066	平煤转债	300,167.62	0.80
36	123035	利德转债	287,508.63	0.76
37	113065	齐鲁转债	284,994.04	0.76

38	123113	仙乐转债	275,000.00	0.73
39	128130	景兴转债	269,598.63	0.72
40	118035	国力转债	264,577.05	0.70
41	113631	皖天转债	253,178.08	0.67
42	128122	兴森转债	249,495.34	0.66
43	113549	白电转债	239,199.01	0.64
44	113648	巨星转债	234,354.33	0.62
45	113563	柳药转债	229,709.81	0.61
46	113064	东材转债	224,897.53	0.60
47	123126	瑞丰转债	220,399.78	0.59
48	118024	冠宇转债	219,307.95	0.58
49	110048	福能转债	214,203.01	0.57
50	113639	华正转债	213,815.56	0.57
51	127053	豪美转债	213,707.34	0.57
52	118023	广大转债	212,718.08	0.57
53	127075	百川转 2	203,998.90	0.54
54	113656	嘉诚转债	200,872.16	0.53
55	127027	能化转债	194,046.17	0.52
56	118015	芯海转债	193,012.77	0.51
57	113618	美诺转债	189,760.19	0.50
58	123099	普利转债	181,513.70	0.48
59	127074	麦米转 2	179,859.04	0.48
60	123169	正海转债	162,154.32	0.43
61	113623	凤 21 转债	136,230.78	0.36
62	123228	震裕转债	133,618.48	0.35
63	113059	福莱转债	128,174.47	0.34
64	110085	通 22 转债	126,920.42	0.34
65	113662	豪能转债	125,351.12	0.33
66	113675	新 23 转债	115,933.04	0.31
67	118003	华兴转债	109,745.14	0.29
68	128066	亚泰转债	109,413.15	0.29
69	123142	申昊转债	108,804.16	0.29
70	128081	海亮转债	108,505.84	0.29
71	113643	风语转债	107,254.79	0.28
72	118043	福立转债	99,144.96	0.26
73	123128	首华转债	91,988.53	0.24
74	111012	福新转债	61,887.04	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	44,823,809.64
报告期期间基金总申购份额	264,499.06
减：报告期期间基金总赎回份额	4,544,113.21
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	40,544,195.49

§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	3,621,032.12
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	2024-05-16	3,621,032.12	-3,476,117.14	0.00
合计			3,621,032.12	-3,476,117.14	

注：其中一笔赎回 76,775.94 份（2023 年 7 月 13 日红利再投份额）适用费率 0.10%，其余适用费率为 0.00%

§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	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%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

类别		的时间区间					
机构	1	20240401-20240630	22,179,158.37	0.00	0.00	22,179,158.37	54.70
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 7 月 19 日