

**华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金**  
**2020 年中期报告**  
**2020 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2020 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 22 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>7 投资组合报告</b>	30
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	31
7.6 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	32
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	32
7.8 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贵金属投资明细	32
7.9 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	32
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	33
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	33
7.12 投资组合报告附注	33
<b>8 基金份额持有人信息</b>	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	34
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	34
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	34
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>35</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>35</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	35
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	35
10.4 基金投资策略的改变 .....	35
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	35
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	35
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	36
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	36
10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 .....	37
10.9 其他重大事件 .....	37
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>38</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>38</b>
12.1 备查文件目录 .....	38
12.2 存放地点 .....	39
12.3 查阅方式 .....	39

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	华安安腾一年定开债
基金主代码	008904
交易代码	008904
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 22 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	509,999,000.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金通过对经济形势（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况等）、大类资产配置价值等的研判，分析研究各大类资产的风险收益特征，在此基础上严控风险，制定不同资产的配置比例，力争实现基金资产的稳健增值。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	薛珍	张燕
	联系电话	021-38969999	0755-83199084

负责人	电子邮箱	service@huaan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		朱学华	李建红

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日）
本期已实现收益	-834,466.63
本期利润	-5,871,333.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0115
本期加权平均净值利润率	-1.16%
本期基金份额净值增长率	-1.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-5,871,333.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0115
期末基金资产净值	504,127,666.55
期末基金份额净值	0.9885

<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2020年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-1.15%

### 3.2 基金净值表现

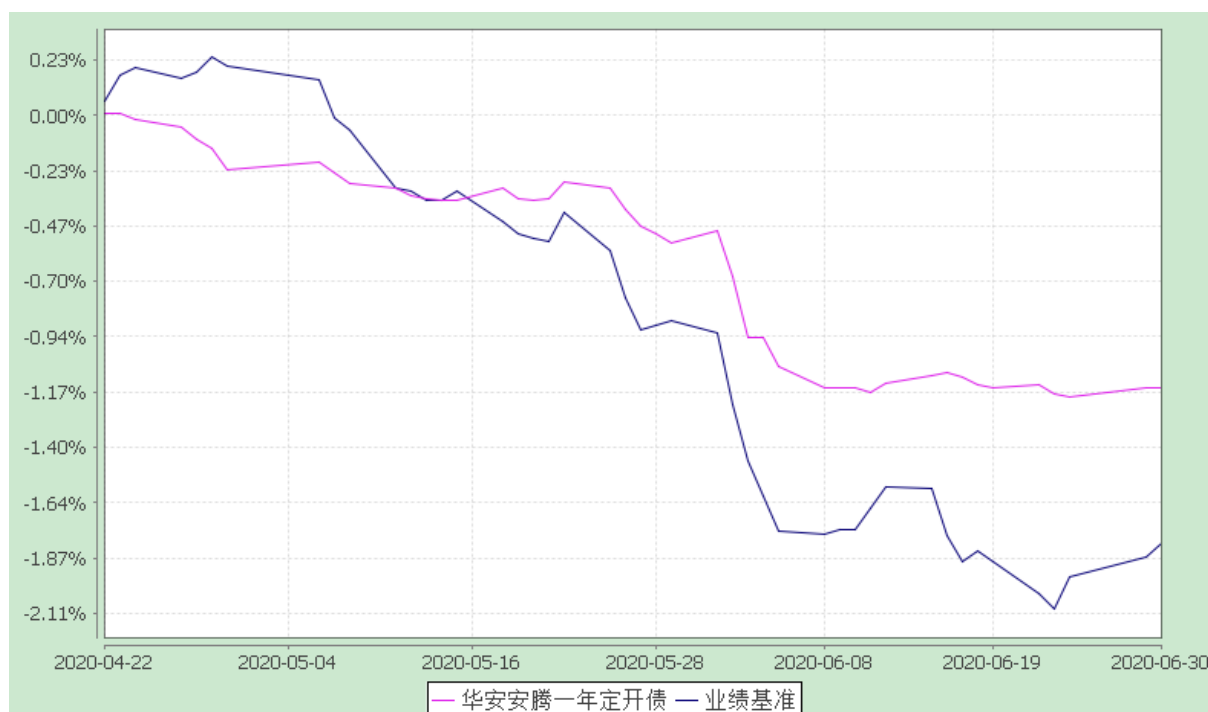
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.61%	0.08%	-0.94%	0.12%	0.33%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.15%	0.06%	-1.81%	0.11%	0.66%	-0.05%

注：本基金于 2020 年 4 月 22 日成立。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额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

华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2020年4月22日至2020年6月30日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 138 只开放式基金，管理资产规模达到 4,157.70 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马晓璇	本基金的基金经理	2020-04-22	-	6 年	6 年基金行业从业经验。历任德勤华永会计师事务所高级审计员、德勤咨询（上海）有限公司财务咨询经理。2013 年 11 月加入华安基金，历任固定收益部研究员、专户固收部投资经理。2018 年 9 月起担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月至 2019 年 12 月，同时担任华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月至 2019 年 2 月，同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月起，同时担任华安添鑫中短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月起，同时担任华安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金的基金经



					理。2019 年 12 月起，同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月起，同时担任华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

#### 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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一

级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，国内经济经历了前所未有的冲击。COVID-19 的爆发首先使国内经济，尤其是内需按下暂停键；随后疫情在海外疫情蔓延，美联储直接降息 150bp 至零利率区间，并且立即开始 QE，加上石油危机，海外市场剧烈动荡，出现了美元荒的情况。二季度以来，我国主要宏观经济指标呈现良好的回升迹象。固定资产投资负增长幅度持续收窄，其中房地产投资表现出韧性，基建投资在地方专项债等财政刺激工具的带动下表现出更强的复苏节奏。相比之下，制造业投资受到中小企业盈利恢复的影响，处于较慢的复苏进程中。

国内货币政策方面，央行春节后立即将 MLF 利率下调 10bp。二季度初，央行又调降法定存款

准备金率 1 个百分点，同时在 4 月初将超额存款准备金利率从 0.72% 下调至 0.35%。4 月 MLF 和 LPR 各期限利率分别下调了 20bp。此后，央行更多采用结构性货币政策，旨在使宽松政策能直达中小微企业，避免资金在银行间市场淤积造成政策套利的行为。在降准、降息以及再贷款等宽松政策的作用下，M1、M2 和社融的增速都有明显的提升。企业短期和中长期贷款都出现了持续的增长，成为贷款和货币增速的主要拉动力量。在 6 月的陆家嘴金融论坛上，央行行长提到了“要关注政策的“后遗症”，总量要适度，并提前考虑政策工具的适时退出”，由此，可以认为官方宣告了总量货币政策边际收敛。

物价方面，CPI 和 PPI 同比数据仍旧处于下行轨道上，但是 PPI 环比数据有比较明显的改善；同时，南华工业品指数在二季度出现了 13.75% 的环比涨幅。未来 PPI 同比可能将进入上升区间。

年初至二季度初，债券收益率曲线整体快速下移，并且呈现出愈发陡峭的曲线形态；银行间隔夜拆借利率一度下行至 1% 以下。此后，由于央行对短端资金利率的指导和总量宽松政策的缺位，债券市场出现了急剧调整，中债总财富指数二季度下跌 0.82%，其中 4 月上涨 1.54%，5 月和 6 月分别下跌 1.51% 和 0.84%，出现了 2015 年 3 月以来的该指数的最大单月跌幅。

报告期内，本基金成立于 4 月中下旬，主要投资于中短久期中高等级信用债。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，华安安腾一年定期开放债份额净值为 0.9885 元，；华安安腾一年定期开放债净值增长率为-1.15%，同期业绩比较基准增长率-1.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内货币政策自 2018 年一季度开始进入宽松周期，2020 年由于疫情的影响，逆周期政策力度加大。目前信用宽松的局面已经形成，经济正在复苏。在这轮全球危机中，我国的政策较为收敛，仍旧保持着正常化的货币政策，目前已经开始关注政策后遗症和政策工具适时退出等问题。从易纲行长在陆家嘴论坛上的表态“展望下半年，货币政策还将保持流动性合理充裕，预计带动全年人民币贷款新增近 20 万亿元，社会融资规模增量将超过 30 万亿元。”来看，全年贷款和社融增速将低于目前的水平，不出意外的话，下半年总量政策将会有一定的收敛。债券市场利率可能出现震荡上行的趋势。

本基金将继续投资于中短久期中高等级信用债。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式证券投资基金，报告期内不存在基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
<b>资 产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	647,378.96
结算备付金		3,534,709.19
存出保证金		28,097.08
交易性金融资产	6.4.7.2	665,648,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		665,648,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	10,878,578.79
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>680,736,764.02</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		176,000,000.00
应付证券清算款		300,047.55
应付赎回款		-
应付管理人报酬		124,074.66
应付托管费		41,358.22
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	14,991.95
应交税费		72,201.45
应付利息		17,841.04
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	38,582.60
<b>负债合计</b>		<b>176,609,097.47</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>
实收基金	6.4.7.9	509,999,000.00
未分配利润	6.4.7.10	-5,871,333.45
<b>所有者权益合计</b>		<b>504,127,666.55</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>680,736,764.02</b>

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9885 元，基金份额总额 509,999,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-4,930,070.27</b>
1.利息收入		3,979,678.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	123,442.69
债券利息收入		3,705,058.27
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		151,177.91
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,872,882.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,872,882.32
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-

衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-5,036,866.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-
<b>减：二、费用</b>		<b>941,263.18</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	286,677.28
2. 托管费	6.4.10.2	95,559.08
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.15	12,064.73
5. 利息支出		491,131.98
其中：卖出回购金融资产支出		491,131.98
6.税金及附加		13,019.07
7. 其他费用	6.4.7.16	42,811.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-5,871,333.45</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-5,871,333.45</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	509,999,000.00	-	509,999,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,871,333.45	-5,871,333.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	509,999,000.00	-5,871,333.45	504,127,666.55

金净值)			
------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 2956 号《关于准予华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 509,999,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0199 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 509,999,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的封闭期为自基金合同生效日起(含)或自每一个开放期结束之日次日起(含)至 12 个月后的月度对日止的期间。本基金在封闭期内不办理申购、赎回等业务，也不上市交易。每个封闭期结束日的下一工作日(含)起，本基金进入开放期，开放期不少于 1 个工作日且不超过 20 个工作日，具体时间由基金管理人在当期封闭期结束前公告。投资者可在开放期内办理本基金的申购、赎回或其他业务。每个开放期结束之日的次日起(含)进入下一封闭期，以此类推。本基金封闭期和开放期的具体时间安排以基金管理人届时公告为准。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、央行票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、货币市场工具以及法律法规或中国



证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不参与股票等权益类资产投资,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;但在每个开放期开始前 1 个月、开放期及开放期结束后 1 个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占资产净值的比例不受限制,但在开放期本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2020 年 8 月 25 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适

用比例计算缴纳。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	活期存款	647,378.96
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	647,378.96	

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	297,935,500.00	-3,858,322.99
	银行间市场	367,712,500.00	-1,178,543.83
	合计	665,648,000.00	-5,036,866.82
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	670,684,866.82	665,648,000.00	-5,036,866.82

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	1,402.32
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,590.60
应收债券利息	10,875,573.17
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.70
合计	10,878,578.79

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	14,991.95
合计	14,991.95

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	22,047.20
预提审计费	16,535.40
合计	38,582.60

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	509,999,000.00	509,999,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	509,999,000.00	509,999,000.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-834,466.63	-5,036,866.82	-5,871,333.45
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-834,466.63	-5,036,866.82	-5,871,333.45

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
活期存款利息收入	44,056.36
定期存款利息收入	67,777.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,546.24
其他	62.31
合计	123,442.69

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	682,670,565.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	680,384,963.55

减：应收利息总额	6,158,484.74
买卖债券差价收入	-3,872,882.32

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-5,036,866.82
——股票投资	-
——债券投资	-5,036,866.82
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-5,036,866.82

#### 6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,702.23
银行间市场交易费用	10,362.50
合计	12,064.73

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	16,535.40
信息披露费	22,047.20
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,828.44

其他费用	400.00
合计	42,811.04

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	286,677.28
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	95,559.08

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易

## 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份



项目	本期
	2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
基金合同生效日（2020年4月22日）持有的基金份额	10,000,000.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.96%

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2020年4月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	647,378.96	44,056.36

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末无受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币 176,000,000.00 元，为 GC004。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为定期开放式的债券型基金，其预期的风险水平和收益水平为证券投资基金中的低风险品种，其长期预期的风险水平低于股票基金、混合基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。本基金在合理控制风险的前提下，通过主动管理充分捕捉债券市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日
A-1	20,132,000.00
A-1 以下	-
未评级	225,416,500.00
合计	245,548,500.00

注：未评级债券为国债、超短期融资券、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日
AAA	359,221,500.00
AAA 以下	60,878,000.00
未评级	-
合计	420,099,500.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内,本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内,本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人在运作期内对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	647,378.96	-	-	-	647,378.96
结算备付金	3,534,709.19	-	-	-	3,534,709.19
存出保证金	28,097.08	-	-	-	28,097.08
交易性金融资产	442,048,000.00	223,600,000.00	-	-	665,648,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,878,578.79	10,878,578.79
资产总计	446,258,185.23	223,600,000.00	-	10,878,578.79	680,736,764.02
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	176,000,000.00	-	-	-	176,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	300,047.55	300,047.55
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	124,074.66	124,074.66
应付托管费	-	-	-	41,358.22	41,358.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	14,991.95	14,991.95
应交税费	-	-	-	72,201.45	72,201.45
应付利息	-	-	-	17,841.04	17,841.04
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	38,582.60	38,582.60
负债总计	176,000,000.00	-	-	609,097.47	176,609,097.47
利率敏感度缺口	270,258,185.23	223,600,000.00	-	10,269,481.32	504,127,666.55

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2020年6月30日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 105
	市场利率上行 25 个基点	减少约 104

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	665,648,000.00	97.78
	其中：债券	665,648,000.00	97.78
	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	4,182,088.15	0.61
8	其他各项资产	10,906,675.87	1.60
9	合计	680,736,764.02	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	----------

			例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	297,935,500.00	59.10
5	企业短期融资券	245,548,500.00	48.71
6	中期票据	122,164,000.00	24.23
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	665,648,000.00	132.04

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112672	18 深建 01	400,000	40,768,000.00	8.09
2	011902431	19 国网租赁 SCP003	400,000	40,220,000.00	7.98
3	143272	17 建发 01	400,000	40,048,000.00	7.94
4	143029	18 沪资 02	300,000	30,462,000.00	6.04
5	136611	16 电投 04	300,000	30,240,000.00	6.00

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证投资。



**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	28,097.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,878,578.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,906,675.87

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2	254,999,500.00	509,999,000.00	100.00%	0.00	0.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.96%	10,000,000.00	1.96%	三年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.0 0	1.96%	10,000,000.0 0	1.96%	-

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年4月22日）基金份额总额	509,999,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	509,999,000.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	638,708,410.12	82.75%	1,944,800,000.00	83.30%	-	-
中信证券	133,110,015.61	17.25%	390,000,000.00	16.70%	-	-

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-13
2	华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-13
3	华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-13
4	华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-13
5	华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-13
6	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
7	关于华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金延长募集期的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-12
8	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-14

	告	和公司网站	
9	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
10	华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
11	华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-17
12	华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-23
13	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
14	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20200422-20200630	0.00	499,999,000.00	0.00	499,999,000.00	98.04%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

- 2、《华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金联接基金招募说明书》
- 3、《华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金联接基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

## 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十八日