## 汇安稳裕债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020年9月30日

基金管理人: 汇安基金管理有限责任公司基金托管人: 中国建设银行股份有限公司报告送出日期: 2020年10月28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 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 日起至 2020 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇安稳裕债券
基金主代码	005212
交易代码	005212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年3月27日
报告期末基金份额总额	428, 708, 230. 98 份
	在严格控制风险并保证充分流动性的前提下,通过积
投资目标	极主动的资产管理,力争为投资者提供稳健持续增长
	的投资收益。
	本基金投资策略主要包括债券投资策略、资产配置策
投资策略	略、股票投资策略、国债期货投资策略、权证投资策
	略等。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率 10%
	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风
风险收益特征	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	汇安基金管理有限责任公司
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(2020年7月1日 - 2020年9月30日)
1. 本期已实现收益	14, 698, 967. 30
2. 本期利润	12, 763, 478. 08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0298
4. 期末基金资产净值	446, 479, 277. 38
5. 期末基金份额净值	1. 0415

- 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。

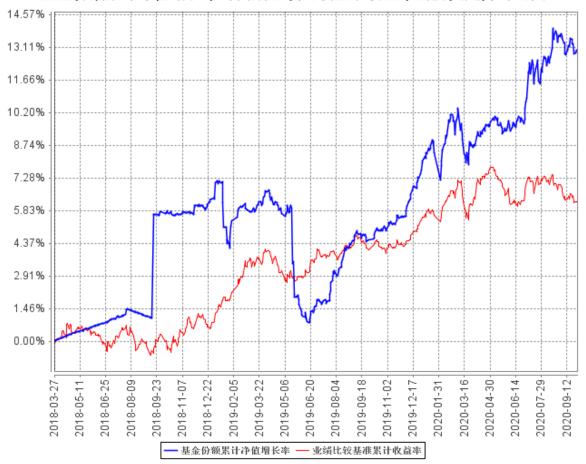
### 3.2 基金净值表现

### 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	2.77%	0.28%	-0. 29%	0. 14%	3.06%	0.14%
过去六个月	3.87%	0.22%	0.01%	0. 14%	3.86%	0.08%
过去一年	8.06%	0.23%	2.01%	0. 13%	6.05%	0.10%
自基金合同 生效起至今	12. 94%	0. 27%	6. 17%	0. 13%	6. 77%	0. 14%

## 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





注:本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

## § 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
<b>姓石</b>	<b>- 昭労</b>	任职日期	离任日期	证分 <u>从</u> 业平成	近·奶
仇秉则	固定收益 投资部副 总经理、 本基金的 基金经理	2019年10月 14日	_	14 年	仇秉则, CFA, CPA, 中山大学经济学学士, 14 年证券、基金 行业从业经历,曾任 普华永道中天会计师 事务所审计经理,嘉 实基金管理有限公司 固定收益部高级信用

分析师。2016年6月 加入汇安基金担任经 担用。 证收证明,工作。 证明,工作,工作。 证明,工作,工作,工作,工作,工作,工作,工作,工作,工作,工作,工作,工作,工作,	 		
限责任公司,担任图定收益投资部信用信 定收益投资部信用经 投资部第工作。2016 年12月9日至2018 年2月9日配置基金公 理:2017年1月9日至 2018年2月9日 至2018年2月9日至 混合型证券投资基金 是:2017年1月1日日至 2018年5月14日,任汇安丰泽 灵活配量基金经理;2017年1 月14日,但是全型证理 灵活配量基金超过; 2017年3月1日,但 企型证券投资基位。 2018年5月1日,1日 1日日至2019年1月 10日至2019年1月 10日至2019年1月 10日至2019年1月 1日代安嘉还统债基金 经理:2016年12月5 日至2019年10月11日,任汇安基征债债券型证券投资基金 经理:2016年12月5 日至2019年10月11日,任汇安基础债债券型证券投资基金是2016年12月5日,1日,任汇安基础债债券型证券投资基金基金经理。2016年12月5日至2019年11月11日,任汇安基础经理。2016年12月2日至2019年11月11日,1日1日至1日至2019年10月11日日至2019年10月11日日至2019年10月11日日日1日日1日日1日日1日1日日1日日1日1日1日1日日1日1日1日1			分析师。2016年6月
定收益投资部局总经理、职,从中至 2018年2月19日至 2018年2月11日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日			加入汇安基金管理有
理一职,从事信用债 投资研究工作。2016 年12月19日至2018 年2月9日,任汇交 丰利灵活配置选基基企经 理;2017年月25日 至2018年2月9日配置 混合型证券投资基金基金经理。2017年1 月13日至2018年5 月14日配置基金经经理。2017年3月13日至 2018年5月14日配置混合型经理。2017年3月13日至 2018年5月14配置基金经理。2017年3月10日,任汇安非证券投资基金基金经理。2017年1月10日至2019年1月10日,任汇安基设委基金经理。2016年12月10日,任汇安嘉校债债券型证券投资基金基金经理。2016年12月1日,任汇安嘉校资基金基金经理。2016年12月1日,任汇安嘉校资基金基金经理。2016年12月1日,日1日,日1日,日1日,日1日,日1日,日1日,日1日,日1日,日1日,			限责任公司,担任固
投资研究工作。2016年12月19日至2018年2月19日至2018年2月19日配置金金经理。2017年1月25日至2018年2月9日至2018年2月9日至2018年2月9日至2018年5月14日日混合金经理。2017年1月13日在12日至2018年5月14日配置金经金经理。2017年3月14日日汇安丰准券投资基金。1月14日日至2018年5月14日配置金经理。2017年3月16日至2019年1月10日至2019年1月10日至2019年1月10日至2019年10月11日,在汇安薪役资基金经理。2016年12月21019年10月11日,在汇安嘉将基金经理。2016年12月21日至2019年10月11日,在汇安嘉将线资基金经理。2016年12月22日至2019年10月11日,在汇安丰融灵活配置金经理。2016年11月19日日日,1月19日日日1日年11月22日至2019年10月11日日1日年11日月11日日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1			定收益投资部副总经
年 12 月 19 日至 2018 年 2 月 9 日,任汇安 丰利灵活配置混合型 证券投资基金经理。2017 年 1 月 25 日 至 2018 年 2 月 9 日, 任汇安丰泰灵活配置 混合整组票。2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽 投资基金金建理。2018 年 5 月 14 日,任汇安丰理 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰理 2018 年 5 月 14 日,任 汇安业证券投资基金生 金经理。2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华契 活配置混合型证券投资基金生工。2019 年 1 月 10 日,任汇安丰业经 资基企经理。2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉沿统债债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安丰龄 表述是理。2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安丰龄 表述是理。2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰龄 灵活配量证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰龄 灵活配量证券投资基金基金经理。2016 年 12			理一职,从事信用债
年 2 月 9 日,任江安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金处理,2017年 1 月 25 日至 2018年 2 月 9 日,任江安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年 1 月 13 日至 2018年 5 月 14 日,任江安丰泰灵资基金基金经理;2017年 3 月 13 日至 2018年 5 月 14 日,任江安丰泽灵活配置混合型延进,2017年 3 月 13 日至 2018年 5 月 14 日,任江安丰恒灵活配置混合型理,2017年 1 月 10 日至 2019年 1 月 10 日年 12 月 2019年 10 月 11 日代江安李设委基金全经理;2016年 12 月 5 日至 2019年 10 月 11 日,任江安泰设资基金基金经理,2016年 12 月 11 日,任江安泰设济基金基金经理,2016年 12 月 22 日至 2019年 11 月 19 日,任江安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年 12 月 22 日至 2019年 11 月 19 日,任江安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理;2016年 12 月 22 日至 2019年 10 月 11 日任江安嘉源纯债债券型			投资研究工作。2016
丰利交资基金基金经理: 2017 年 1 月 25 日至 2018 年 2 月 9 日 日 在汇安丰泰灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理: 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配量混合型处理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配量混合型处理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰地投资基金基金经理: 2017 年 1 月 10 日,任汇安丰地投资基金基金经理: 2017 年 1 月 10 日,任汇安丰地投资基金基金经理: 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汇晚债债券型证券投资基金基金经理: 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕基金经理: 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安丰融灵活配金基金经理: 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配金基金经理: 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉城债债券型 投资基金基金经理: 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉城债债券型			年 12 月 19 日至 2018
丰利交资基金基金经理: 2017 年 1 月 25 日至 2018 年 2 月 9 日 日 在汇安丰泰灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理: 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配量混合型处理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配量混合型处理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰地投资基金基金经理: 2017 年 1 月 10 日,任汇安丰地投资基金基金经理: 2017 年 1 月 10 日,任汇安丰地投资基金基金经理: 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汇晚债债券型证券投资基金基金经理: 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕基金经理: 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安丰融灵活配金基金经理: 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配金基金经理: 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉城债债券型 投资基金基金经理: 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉城债债券型			年2月9日,任汇安
理; 2017 年 1 月 25 日 至 2018 年 2 月 9 日,任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金处理; 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配置混合全型证券投资基金基金经理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉设基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕吨债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安寿报领债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 2日至 2019 年 10 月 11 日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,			
理; 2017 年 1 月 25 日 至 2018 年 2 月 9 日,任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金处理; 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配置混合全型证券投资基金基金经理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉设基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕吨债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安寿报领债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 2日至 2019 年 10 月 11 日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,日,			证券投资基金基金经
至 2018 年 2 月 9 日,任汇安丰泰灵活配置 混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日 任汇安丰泽灵活配置混合全型证券投资基金基金经理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰恒灵资基金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵活配置混查金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉次基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇实券投资基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇实券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日日,任汇安嘉源纯债债券型,2016年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			理; 2017年1月25日
任汇安丰泰灵活配置 混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽 灵活配置混基金处理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任 汇安丰恒灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日年 (12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日, 任汇安嘉礼姓债债券 型证券投资基金 经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混各型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			
混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任 汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日 任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汽纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			任汇安丰泰灵活配置
基金经理: 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理: 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任 汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理: 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理: 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉江纯债债券型证券投资基金基金经理: 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理: 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理: 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			混合型证券投资基金
月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017 年 3 月 13 日至2018 年 5 月 14 日,任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理;2016 年 12 月 2 日至2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉资基金经理;2016 年 12 月 22 日至2019 年 10 月 11 日,任汇安寿资基金基金经理;2016 年 12 月 22 日至2019 年 10 月 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016 年 12 月 22 日至2019 年 10 月 11 日日,任汇安嘉源纯债债券型			
灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任 汇安丰恒灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵 活配置混合型证券投 资基金基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日, 任汇安嘉咨班债债券 型证券投资基金基 经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 12 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			月 13 日至 2018 年 5
灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任 汇安丰恒灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵 活配置混合型证券投 资基金基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日, 任汇安嘉咨班债债券 型证券投资基金基 经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 12 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			月 14 日,任汇安丰泽
2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日,任 汇安丰恒灵活配置混 合型证券投资基金基金经理: 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理: 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉征纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			灵活配置混合型证券
2018 年 5 月 14 日,任 汇安丰恒灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵 活配置混合型证券投 资基金基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日, 任汇安嘉征纯债债券 型证券投资基金基金 经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			投资基金基金经理;
汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			2017年3月13日至
合型证券投资基金基金经理; 2017年1月10日至2019年1月10日至2019年1月10日,任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016年12月2日至2019年10月11日,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016年12月5日至2019年10月11日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016年12月22日至2019年11月19日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016年12月22日至2019年10月11日任汇安嘉源纯债债券型			2018年5月14日,任
金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			汇安丰恒灵活配置混
10 日至 2019 年 1 月 10 日,任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			合型证券投资基金基
10 日,任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016 年 12 月 2 日至2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理;2016 年 12 月 5 日至2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理;2016 年 12 月 22 日至2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016 年 12 月 22 日至2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			金经理; 2017年1月
活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016年12月2日至2019年10月11日,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016年12月5日至2019年10月11日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016年12月22日至2019年11月19日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016年12月22日至2019年10月11日任汇安嘉源纯债债券型			10 日至 2019 年 1 月
资基金基金经理; 2016年12月2日至 2019年10月11日, 任汇安嘉汇纯债债券 型证券投资基金基金 经理;2016年12月5 日至2019年10月11日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理;2016年12 月22日至2019年11月19日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016年12月22日至 2019年10月11日任 汇安嘉源纯债债券型			10 日,任汇安丰华灵
2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			活配置混合型证券投
2019 年 10 月 11 日, 任汇安嘉汇纯债债券 型证券投资基金基金 经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			资基金基金经理;
任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型			2016年12月2日至
型证券投资基金基金经理; 2016年12月5日至2019年10月11日,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理; 2016年12月22日至2019年11月19日,任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016年12月22日至2019年10月11日任汇安嘉源纯债债券型			2019年10月11日,
经理: 2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			任汇安嘉汇纯债债券
日至 2019 年 10 月 11 日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			型证券投资基金基金
日,任汇安嘉裕纯债 债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			经理; 2016年12月5
债券型证券投资基金 基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			日至 2019 年 10 月 11
基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			日, 任汇安嘉裕纯债
月 22 日至 2019 年 11 月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			债券型证券投资基金
月 19 日,任汇安丰融 灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			基金经理; 2016年12
灵活配置混合型证券 投资基金基金经理; 2016年12月22日至 2019年10月11日任 汇安嘉源纯债债券型			月 22 日至 2019 年 11
投资基金基金经理; 2016年12月22日至 2019年10月11日任 汇安嘉源纯债债券型			月 19 日,任汇安丰融
2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			灵活配置混合型证券
2019 年 10 月 11 日任 汇安嘉源纯债债券型			投资基金基金经理;
汇安嘉源纯债债券型			2016年12月22日至
			2019年10月11日任
证券投资基金基金经			汇安嘉源纯债债券型
			证券投资基金基金经

	理; 2017年7月27日
	至2019年10月11日,
	任汇安丰裕灵活配置
	混合型证券投资基金
	基金经理; 2017 年 8
	月 10 日至 2019 年 10
	月 11 日,任汇安丰益
	灵活配置混合型证券
	投资基金基金经理;
	2019 年 5 月 10 日至
	2020年5月11日,任
	汇安丰利灵活配置混
	合型证券投资基金基
	金经理; 2019年8月
	9 日至今任汇安嘉诚
	一年封闭运作债券型
	证券投资基金基金经
	理; 2019年10月14
	日至今任汇安稳裕债
	券型证券投资基金基
	金经理; 2020年3月
	5 日至今任汇安信利
	债券型证券投资基金
	基金经理;2020年4月
	21 日至今任汇安嘉利
	一年封闭运作混合型
	证券投资基金基金经
	理。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.1.1 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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,完善相应制度及流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合,报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金未发现可能的异常交易情况,不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年进入第三季度,国内国际经济呈现分化走势。除中国外全球主要经济体均受到新冠疫情的持续影响,部分地区发生了疫情二次乃至多次反弹,从而对经济的复工复产形成了抑制。国外主要经济体央行均大概率长期保持了超常规货币宽松政策。中国经济需求端持续修复,生产端维持稳定。社会消费零售总额 8 月首次转正,家电、汽车等可选消费品稳步恢复,商品房销售额累计值也实现转正,房地产投资、基建投资保持较高增速,制造业投资增速相对较低,但仍呈修复态势;工业增加值维持在 5%附近波动,PMI 连续 7 个月维持扩张区间。

政策方面,报告期内社会融资规模与 M2 维持了明显高于名义国内生产总值的水平,有力地支持了实体经济的修复,中国央行通过公开市场操作维持流动性合理充裕,但在稳增长和防风险之间保持平衡。资金利率、同业存单利率围绕 OMO、MLF 等政策利率附近波动,收益率曲线呈现期限利差相对较窄的较平坦的形态。

本基金在投资操作上,债券方面,合理控制久期,继续严控信用风险,在收益率相对高点积极配置优质信用债;转债方面,合理控制仓位,优选行业景气度高、具有一定安全边际的品种;权益方面,控制总体仓位水平,采取价值与成长的相对平衡配置,获取较好的风险调整后收益。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0415 元;本报告期基金份额净值增长率为 2.77%,业绩比较基准收益率为-0.29%。

## 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,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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	53, 536, 494. 65	11.40
	其中: 股票	53, 536, 494. 65	11.40
2	基金投资		_
3	固定收益投资	384, 615, 879. 00	81.91
	其中:债券	374, 682, 879. 00	79. 79
	资产支持证券	9, 933, 000. 00	2. 12
4	贵金属投资	1	-
5	金融衍生品投资	ı	-
6	买入返售金融资产	20, 000, 130. 00	4. 26
	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	2, 473, 754. 84	0.53
8	其他资产	8, 951, 312. 71	1.91
9	合计	469, 577, 571. 20	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	_	-
В	采矿业		-
С	制造业	27, 962, 668. 35	6.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	_	-
Е	建筑业	-	-
F	批发和零售业	_	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2, 809, 500. 00	0.63
Н	住宿和餐饮业	3, 775, 425. 00	0.85

Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	4, 760, 301. 30	1.07
J	金融业	_	-
K	房地产业	11, 807, 600. 00	2. 64
L	租赁和商务服务业	2, 421, 000. 00	0. 54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	=
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业	-	_
S	综合	_	_
	合计	53, 536, 494. 65	11.99

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 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	000002	万科 A	280,000	7, 845, 600. 00	1.76
2	600258	首旅酒店	212, 700	3, 775, 425. 00	0.85
3	000651	格力电器	65,000	3, 464, 500. 00	0.78
4	601137	博威合金	237, 085	3, 203, 018. 35	0.72
5	002120	韵达股份	150,000	2,809,500.00	0.63
6	002624	完美世界	79, 961	2,662,701.30	0.60
7	002027	分众传媒	300,000	2, 421, 000. 00	0.54
8	000069	华侨城 A	350,000	2, 373, 000. 00	0.53
9	002508	老板电器	70,000	2, 288, 300.00	0.51
10	601058	赛轮轮胎	500,000	2, 235, 000. 00	0.50

## 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	13, 986, 000. 00	3. 13
2	央行票据	_	-
3	金融债券	103, 803, 028. 00	23. 25
	其中: 政策性金融债	21, 689, 028. 00	4.86
4	企业债券	109, 354, 979. 40	24. 49
5	企业短期融资券	10, 013, 000. 00	2.24
6	中期票据	136, 689, 000. 00	30.61

7	可转债 (可交换债)	836, 871. 60	0. 19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	374, 682, 879. 00	83. 92

## 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	1823001	18 农银人寿	400,000	41, 696, 000. 00	9.34
2	101752010	17 新城控股 MTN002	400,000	40, 368, 000. 00	9.04
3	102000728	20 大连万达 MTN001	400,000	39, 688, 000. 00	8.89
4	101801534	18 德泰 MTN001	300,000	31, 959, 000. 00	7. 16
5	136164	16 中油 01	310,000	30, 993, 800. 00	6.94

# 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	168034	君美2优	100,000	9, 933, 000. 00	2. 22	

## **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** 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** 本基金本报告期末未持有权证投资。

## 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

本基金本报告期未投资国债期货。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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未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。
- 5.10.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68, 699. 66
2	应收证券清算款	1, 293, 120. 54
3	应收股利	-
4	应收利息	7, 589, 492. 51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8, 951, 312. 71

### 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	113542	好客转债	836, 871. 60	0. 19

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,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	428, 674, 026. 21
报告期期间基金总申购份额	46, 369. 33
减:报告期期间基金总赎回份额	12, 164. 56
报告期期末基金份额总额	428, 708, 230. 98

## §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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资产投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资产投资本基金。

## §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	20200701-20200930	152, 517, 009. 83	0.00	0.00	152, 517, 009. 83	35. 5759%
	2	20200701-20200930	123, 713, 361. 25	0.00	0.00	123, 713, 361. 25	28. 8572%
	3	20200701-20200930	152, 432, 032. 40	0.00	0.00	152, 432, 032. 40	35. 5561%
个人	-	-	_	_	_	_	_

#### 产品特有风险

本基金本报告期内存在单一基金份额持有人持有基金份额比例超过 20%的情况,投资人在投资本基金时,可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险,具体包括:巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理,保护中小投资者利益。

## §9备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇安稳裕债券型证券投资基金募集的文件
- 2、汇安稳裕债券型证券投资基金基金合同
- 3、汇安稳裕债券型证券投资基金托管协议
- 4、汇安稳裕债券型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街 5号中青旅大厦 13层 上海市虹口区东大名路 501 白玉兰大厦 36层 02-03室

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站: http://www.huianfund.cn/

汇安基金管理有限责任公司 2020年10月28日