

# 华安稳定收益债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

## 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 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>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43
<b>8 基金份额持有人信息</b>	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	45
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.9 其他重大事件 .....	49
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安稳定收益债券型证券投资基金	
基金简称	华安稳定收益债券	
基金主代码	040009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 4 月 30 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	138,861,805.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B
下属分级基金的交易代码	040009	040010
报告期末下属分级基金的份额总额	109,268,651.95 份	29,593,153.81 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益及市场价格变动收益，以追求资产持续稳健的增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的各种数量模型工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产的分配比例。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中较高流动性、低风险的品种，其预期的风险水平和预期收益率低于股票基金、混合基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25号

	-32层	
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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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 层、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 层、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（2021年1月1日至2021年6月30日）	
	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B
本期已实现收益	-6,258,373.88	-866,816.22
本期利润	-2,647,168.75	407,684.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0086	0.0059
本期加权平均净值利润率	-0.78%	0.53%
本期基金份额净值增长率	2.09%	1.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B
期末可供分配利润	5,888,228.28	1,439,283.13
期末可供分配基金份额利润	0.0539	0.0486
期末基金资产净值	123,566,330.14	33,333,751.06
期末基金份额净值	1.1308	1.1264
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B

基金份额累计净值增长率	126.53%	114.90%
-------------	---------	---------

注：1、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（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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

华安稳定收益债券 A

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	1.34%	0.25%	0.08%	0.07%	1.26%	0.18%
过去三个月	4.27%	0.28%	1.39%	0.06%	2.88%	0.22%
过去六个月	2.09%	0.29%	2.09%	0.07%	0.00%	0.22%
过去一年	7.27%	0.27%	2.49%	0.10%	4.78%	0.17%
过去三年	22.74%	0.26%	14.71%	0.11%	8.03%	0.15%
自基金合同生效起至今	126.53%	0.25%	72.02%	0.12%	54.51%	0.13%

华安稳定收益债券 B

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	1.30%	0.26%	0.08%	0.07%	1.22%	0.19%
过去三个月	4.16%	0.27%	1.39%	0.06%	2.77%	0.21%
过去六个月	1.89%	0.29%	2.09%	0.07%	-0.20%	0.22%
过去一年	6.84%	0.27%	2.49%	0.10%	4.35%	0.17%
过去三年	21.29%	0.26%	14.71%	0.11%	6.58%	0.15%
自基金合同生效起至今	114.90%	0.25%	72.02%	0.12%	42.88%	0.13%

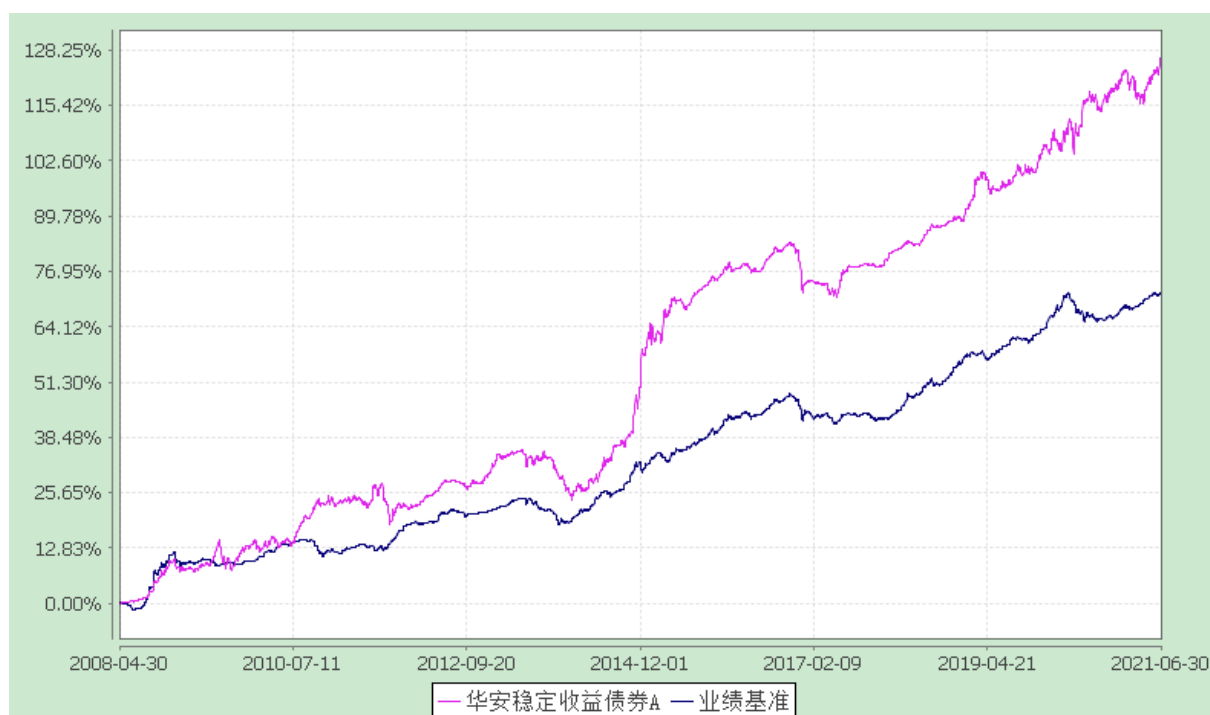
#### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安稳定收益债券型证券投资基金

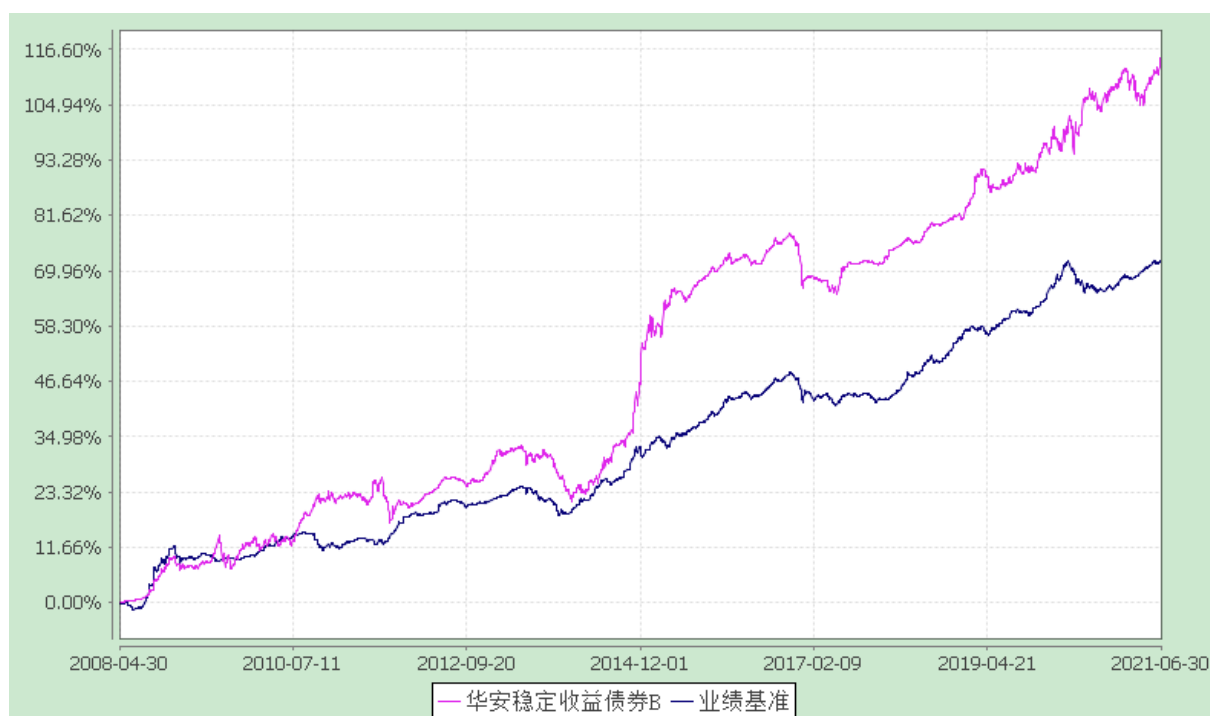
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2008 年 4 月 30 日至 2021 年 6 月 30 日）

华安稳定收益债券 A



华安稳定收益债券 B





## 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。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2021 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 163 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,256.69 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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部高级总监	2008-04-30	-	23 年	金融学硕士（金融工程方向），23 年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008 年 4 月起担任华安稳定收益债券基金的基金经理。2011 年 6 月至 2021 年 3 月，同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月至 2017 年 6 月担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 10 月至 2017 年 7 月同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安现金富利投资基金的基金经理。2014 年 7 月至 2017 年 7 月同时担任华安汇财通货币

				<p>市场基金的基金经理。2015 年 2 月至 2017 年 6 月担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2017 年 7 月，担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月至 2018 年 9 月，担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月至 2019 年 12 月，同时担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月，同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2018 年 8 月，同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 1 月，同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月起，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月，同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 2 月至 2018 年 6 月，同时担任华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月至 2020 年 2 月，同时担任华安安盛 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月起，同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安锦源 0-7 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基</p>
--	--	--	--	---

					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。

#### 4.2 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

上半年市场关心的是“价”，即“通胀预期”。其中，一季度，随着疫苗接种加速、美国财政刺激计划落地，海外经济复苏步伐加快、商品价格大涨、美国 10 年国债收益率迅速上扬，市场预期美联储加速缩表。二季度，欧美国国家逐步解封，经济尤其线下服务业快速恢复，油价逐步抬升。但大宗工业品和农产品价格冲高回落，10 年期美债收益率不升反降，反映市场开始对乐观的经济预期进行修正，通胀交易消退。

上半年国内经济整体延续复苏态势。出口保持强劲，地产投资体现较强的韧性，制造业投资逐步改善，消费的恢复低于预期。在海外涨价和国内“碳中和”限产预期的扰动下，国内大宗商品价格上涨幅度较大。在政策干预和引导下，二季度大宗商品价格开始回落。PPI 一路走高、CPI 整体保持低位。社融增速快速下行，地方专项债发行减速。货币政策除春节前收紧导致利率大幅波动外，上半年整体维持宽松，债券市场利率震荡下行。信用市场融资量一度下降，在各地政府“化债”努力下，部分地区的信用债融资功能逐步恢复。股票市场，上半年主要指数均呈现震荡上行的走势，其中上证指数上涨 3.40%，深圳成指上涨 4.78%，沪深 300 上涨 0.24%，创业板指上涨 17.22%。从行业表

现来看，约 2/3 的行业实现了正收益，其中基础化工、钢铁和新能源板块均获得了超过 20% 的指数涨幅，非银、家电、军工板块的指数跌幅则超过了 10%，整体分化还是比较大。从风格来看，周期和成长风格涨幅领先，消费风格表现稳定，金融风格相对落后。可转债市场在整体估值修复的背景下，亦呈现结构化特征，与锂电、光伏和强周期等相关的个券纷纷触发强制转股条款。

本基金上半年维持组合高等级信用策略，逐步拉长组合久期，优化可转债持仓，择机实施可转债和正股间的套利策略。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，华安稳定收益债券 A 份额净值为 1.1308 元，B 份额净值为 1.1264 元；华安稳定收益债券 A 份额净值增长率为 2.09%，B 份额净值增长率为 1.89%，同期业绩比较基准增长率为 2.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年市场关注的焦点将重回“量”，即“经济增长”。首先海外经济复苏不均衡，美国经济依然偏强，日欧偏弱，发展中国家抗疫水平参差不齐、经济复苏之路也更加周折。其次欧美财政货币等刺激政策将逐步退出，劳动者将重返劳动市场，疫情冲击后的就业市场仍需谨慎观察。最后，近期德尔塔等变异病毒的传播也增添了经济复苏的变数。国内经济增速将呈现回落的态势。其中出口将受到海外供需缺口缩小、替代效应下降的影响增速回落。地产投资受制于“三条红线”等政策影响增速放缓。地方专项债发行将提速，以保障经济平稳运行。PPI 将在二三季度见顶，CPI 年内依然处于较低水平。近期的“降准”更加体现政策“跨周期”的考量，未来若经济下行压力加大，货币政策仍有放松空间。目前整体利率处于偏低水平，信用利差相对较小。预计利率维持区间震荡走势，信用债风险防范的工作依然重要。股票市场，企业整体盈利依然在改善，降准后流动性充裕，社融将逐步企稳，预计股市整体震荡，机会依然在行业景气度向好、盈利增长方向明确的行业和个股，我们关注“碳中和”、硬科技和新消费等高景气方向。相应地可转债市场的个券挖掘工作重要程度上升。本基金将维持中高信用等级策略，动态调整组合久期和转债仓位，精选个券优化结构。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人利益。

#### 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**

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## **5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### **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**

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### **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**

本托管人复核审查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。

## 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：华安稳定收益债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	4,344,501.93	34,097,293.63
结算备付金		481,274.85	1,445,911.06
存出保证金		45,608.16	57,408.73
交易性金融资产	6.4.7.2	148,869,517.70	692,433,074.00
其中：股票投资		8,415,350.00	3,100,000.00
基金投资		-	-
债券投资		140,454,167.70	689,333,074.00
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		2,445,047.51	-
应收利息	6.4.7.5	1,433,418.18	8,159,431.27
应收股利		-	-
应收申购款		101,694.54	82,659.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		157,721,062.87	736,275,778.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 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		-	10,000,000.00
应付证券清算款		-	1,242,201.22
应付赎回款		530,628.43	27,070.84
应付管理人报酬		89,605.24	339,727.18
应付托管费		29,868.40	113,242.39
应付销售服务费		10,928.22	62,079.16

应付交易费用	6.4.7.7	67,924.70	109,926.26
应交税费		1,979.65	73,231.31
应付利息		-	1,062.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,047.03	188,215.27
负债合计		820,981.67	12,156,755.90
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	138,861,805.76	654,097,945.57
未分配利润	6.4.7.10	18,038,275.44	70,021,076.98
所有者权益合计		156,900,081.20	724,119,022.55
负债和所有者权益总计		157,721,062.87	736,275,778.45

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 138,861,805.76 份，其中 A 类基金份额净值 1.1308 元，基金份额总额 109,268,651.95 份；B 类基金份额净值 1.1264 元，基金份额总额 29,593,153.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安稳定收益债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>506,828.10</b>	<b>27,475,146.45</b>
1.利息收入		6,253,783.61	11,931,106.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	52,131.55	126,643.77
债券利息收入		6,114,895.65	11,803,271.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		86,756.41	1,191.23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,740,616.65	34,133,571.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,188,987.98	3,392,535.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-9,667,211.47	30,741,035.49
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	115,582.80	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.16	4,885,705.41	-18,665,643.11



填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	107,955.73	76,111.82
<b>减：二、费用</b>		<b>2,746,312.79</b>	<b>4,689,417.32</b>
1. 管理人报酬		1,251,451.50	2,278,144.33
2. 托管费		417,150.46	759,381.40
3. 销售服务费		151,872.06	117,661.28
4. 交易费用	6.4.7.18	201,021.11	283,796.97
5. 利息支出		598,219.69	1,091,293.45
其中：卖出回购金融资产支出		598,219.69	1,091,293.45
6.税金及附加		14,186.01	36,661.80
7. 其他费用	6.4.7.19	112,411.96	122,478.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,239,484.69</b>	<b>22,785,729.13</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,239,484.69</b>	<b>22,785,729.13</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安稳定收益债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	654,097,945.57	70,021,076.98	724,119,022.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,239,484.69	-2,239,484.69
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）	-515,236,139.81	-49,743,316.85	-564,979,456.66
其中：1.基金申购款	80,772,525.04	8,970,147.72	89,742,672.76
2.基金赎回款	-596,008,664.85	-58,713,464.57	-654,722,129.42
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（基金净值）	138,861,805.76	18,038,275.44	156,900,081.20
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 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）	728,975,379.10	88,355,241.67	817,330,620.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,785,729.13	22,785,729.13
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）	-102,637,716.33	-11,986,058.28	-114,623,774.61
其中：1.基金申购款	385,718,687.32	53,854,427.00	439,573,114.32
2.基金赎回款	-488,356,403.65	-65,840,485.28	-554,196,888.93
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）	-	-35,569,042.87	-35,569,042.87
五、期末所有者权益（基金净值）	626,337,662.77	63,585,869.65	689,923,532.42

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：朱学华，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安稳定收益债券型证券投资基金(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[2008]294 号《关于核准华安稳定收益债券型证券投资基金募集申请的批复》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《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 3,130,395,744.96 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 4 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,130,761,926.67 份基金份额，其中认购资金利息折合 366,181.71 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》和《华安稳定收益债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者

认/申购时收取认/申购费用的，称为 A 类；在投资者认/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 B 类。本基金 A 和 B 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据本基金的基金管理人于 2012 年度以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，参加大会表决的基金份额持有人份额占权益登记日本基金总份额的 58%。大会审议并通过了《关于修改华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并经中国证监会证监基金字[2012]1161 号《关于核准华安稳定收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》同意，修改了《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》第十二章“基金的投资”中“(二)投资范围”和“(六)投资限制”中的部分内容”生效。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和修改后的《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、可转换债券、可分离债券、债券回购、央行票据、信用等级为投资级的企业(公司)债，以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的 80%；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%上，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股票等权益类品种的投资比例为基金资产的 0-20%。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数。

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 2021 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<年度报告和中期报告>》、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》、《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,344,501.93
定期存款	-
其他存款	-
合计	4,344,501.93

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,286,332.04	8,415,350.00	1,129,017.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	71,265,251.15	71,152,167.70	-113,083.45
	银行间市场	69,121,938.03	69,302,000.00	180,061.97
	合计	140,387,189.18	140,454,167.70	66,978.52
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		147,673,521.22	148,869,517.70	1,195,996.48

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	691.49
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	194.94
应收债券利息	1,432,513.21
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	18.54
合计	1,433,418.18

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	65,676.24
银行间市场应付交易费用	2,248.46
合计	67,924.70

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	786.88
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	29,752.78
合计	90,047.03

### 6.4.7.9 实收基金

华安稳定收益债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	487,066,955.44	487,066,955.44
本期申购	72,746,951.95	72,746,951.95
本期赎回（以“-”号填列）	-450,545,255.44	-450,545,255.44
本期末	109,268,651.95	109,268,651.95

华安稳定收益债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	167,030,990.13	167,030,990.13

本期申购	8,025,573.09	8,025,573.09
本期赎回（以“-”号填列）	-145,463,409.41	-145,463,409.41
本期末	29,593,153.81	29,593,153.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

华安稳定收益债券 A

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
上年度末	27,694,898.00	24,710,317.22	52,405,215.22
本期利润	-6,258,373.88	3,611,205.13	-2,647,168.75
本期基金份额交易产生的变动数	-15,548,295.84	-19,912,072.44	-35,460,368.28
其中：基金申购款	4,200,462.74	3,920,211.77	8,120,674.51
基金赎回款	-19,748,758.58	-23,832,284.21	-43,581,042.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,888,228.28	8,409,449.91	14,297,678.19

华安稳定收益债券 B

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
上年度末	8,990,598.98	8,625,262.78	17,615,861.76
本期利润	-866,816.22	1,274,500.28	407,684.06
本期基金份额交易产生的变动数	-6,684,499.63	-7,598,448.94	-14,282,948.57
其中：基金申购款	371,363.68	478,109.53	849,473.21
基金赎回款	-7,055,863.31	-8,076,558.47	-15,132,421.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,439,283.13	2,301,314.12	3,740,597.25

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	41,093.91
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,664.78
其他	372.86
合计	52,131.55



**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	93,544,935.41
减：卖出股票成本总额	94,733,923.39
买卖股票差价收入	-1,188,987.98

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,112,952,338.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,106,667,958.37
减：应收利息总额	15,951,591.35
买卖债券差价收入	-9,667,211.47

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	115,582.80
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	115,582.80

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	4,885,705.41
——股票投资	548,017.96
——债券投资	4,337,687.45
——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	4,885,705.41

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	64,667.11
转换费收入	43,288.62
合计	107,955.73

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	196,121.11
银行间市场交易费用	4,900.00
合计	201,021.11

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,101.81
账户维护费	16,450.00
其他费用	600.00
合计	112,411.96

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2021】669 号文核准，基金管理人股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

##### 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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间

	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	28,537,910.00	30.51%	18,113,702.21	14.88%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	91,252,331.57	12.85%	319,166,426.92	21.59%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	26,006.91	30.13%	5,373.86	8.18%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	16,506.99	14.71%	16,506.99	14.71%

## 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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,251,451.50	2,278,144.33
其中：支付销售机构的客户维护费	66,184.60	42,773.17

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.6% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	417,150.46	759,381.40

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	1.20	1.20
华安基金管理有限公司	-	49,434.51	49,434.51
中国建设银行股份有限公司	-	8,703.65	8,703.65
合计	-	58,139.36	58,139.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	华安稳定收益债券A	华安稳定收益债券B	合计
国泰君安证券股份有 限公司	-	29.41	29.41
华安基金管理有限公 司	-	78,710.11	78,710.11
中国建设银行股份有 限公司	-	10,515.66	10,515.66
合计	-	89,255.18	89,255.18

注：支付基金销售机构的 B 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金管理有限公司，再由华安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	4,344,501.93	41,093.91	3,931,704.48	105,725.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

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

无。

##### **6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

##### **6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### **6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购**

截至报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### **6.4.12 金融工具风险及管理**

本基金是一只债券型证券投资基金，属于较高流动性、低风险品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

##### **6.4.12.1 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管理委员会，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；在管理层层面设立风险控制委员会，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。

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。而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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，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。

#### 6.4.12.2 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本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.12.2.1 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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	30,069,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	17,011,900.00	49,915,000.00
合计	17,011,900.00	79,984,000.00

注：未评级债券为超短期融资券。

##### 6.4.12.2.2 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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	58,216,857.70	545,969,151.60
AAA 以下	8,116,410.00	63,379,922.40
未评级	57,109,000.00	-
合计	123,442,267.70	609,349,074.00



注：未评级债券为国债及政策性金融债。

### 6.4.12.3 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可随时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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.12.3.1 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》及《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期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%。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。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%。

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。

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 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定期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。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	4,344,501.93	-	-	-	4,344,501.93
结算备付金	481,274.85	-	-	-	481,274.85
存出保证金	45,608.16	-	-	-	45,608.16
交易性金融资产	60,835,167.70	79,619,000.00	-	8,415,350.00	148,869,517.70
应收证券清算款	-	-	-	2,445,047.51	2,445,047.51
应收利息	-	-	-	1,433,418.18	1,433,418.18
应收申购款	-	-	-	101,694.54	101,694.54

资产总计	65,706,552.64	79,619,000.00		12,395,510.23	157,721,062.87
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	530,628.43	530,628.43
应付管理人报酬	-	-	-	89,605.24	89,605.24
应付托管费	-	-	-	29,868.40	29,868.40
应付销售服务费	-	-	-	10,928.22	10,928.22
应付交易费用	-	-	-	67,924.70	67,924.70
应交税费	-	-	-	1,979.65	1,979.65
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,047.03	90,047.03
负债总计	-	-	-	820,981.67	820,981.67
利率敏感度缺口	65,706,552.64	79,619,000.00		11,574,528.56	156,900,081.20
<b>上年度末</b>					
<b>2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	34,097,293.63	-	-	-	34,097,293.63
结算备付金	1,445,911.06	-	-	-	1,445,911.06
存出保证金	57,408.73	-	-	-	57,408.73
交易性金融资产	457,929,074.00	231,404,000.00	-	3,100,000.00	692,433,074.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	8,159,431.27	8,159,431.27
应收申购款	-	-	-	82,659.76	82,659.76
资产总计	493,529,687.42	231,404,000.00	-	11,342,091.03	736,275,778.45
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	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,242,201.22	1,242,201.22
应付赎回款	-	-	-	27,070.84	27,070.84
应付管理人报酬	-	-	-	339,727.18	339,727.18
应付托管费	-	-	-	113,242.39	113,242.39
应付销售服务费	-	-	-	62,079.16	62,079.16
应付交易费用	-	-	-	109,926.26	109,926.26
应交税费	-	-	-	73,231.31	73,231.31
应付利息	-	-	-	1,062.27	1,062.27
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	188,215.27	188,215.27
负债总计	10,000,000.00	-	-	2,156,755.90	12,156,755.90
利率敏感度缺口	483,529,687.42	231,404,000.00	-	9,185,335.13	724,119,022.55

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.12.4.1.2 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	增加约73	增加约299
	2.市场利率上升25个基点	减少约72	减少约295

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的各种数量模型工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产的分配比例，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的 80%；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%；股票等权益类品种的投资比例为基金资产的 0-20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	8,415,350.00	5.36	3,100,000.00	0.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>8,415,350.00</b>	<b>5.36</b>	<b>3,100,000.00</b>	<b>0.43</b>

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 06 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资比例较低，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

**6.4.13 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	8,415,350.00	5.34
	其中：股票	8,415,350.00	5.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	140,454,167.70	89.05
	其中：债券	140,454,167.70	89.05
	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	4,825,776.78	3.06
8	其他各项资产	4,025,768.39	2.55
9	合计	157,721,062.87	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**

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	1,191,900.00	0.76
C	制造业	5,549,250.00	3.54

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	629,400.00	0.40
E	建筑业	389,000.00	0.25
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	655,800.00	0.42
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	8,415,350.00	5.36

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601012	隆基股份	14,000	1,243,760.00	0.79
2	601677	明泰铝业	50,000	977,500.00	0.62
3	603806	福斯特	8,000	841,040.00	0.54
4	002812	恩捷股份	3,000	702,300.00	0.45
5	300059	东方财富	20,000	655,800.00	0.42
6	300207	欣旺达	20,000	651,200.00	0.42
7	600483	福能股份	60,000	629,400.00	0.40
8	600985	淮北矿业	50,000	610,500.00	0.39
9	002460	赣锋锂业	5,000	605,450.00	0.39
10	601899	紫金矿业	60,000	581,400.00	0.37
11	000932	华菱钢铁	80,000	528,000.00	0.34

12	603098	森特股份	10,000	389,000.00	0.25
----	--------	------	--------	------------	------

#### 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002241	歌尔股份	13,548,342.92	1.87
2	601677	明泰铝业	9,848,211.96	1.36
3	600483	福能股份	9,208,117.74	1.27
4	601615	明阳智能	6,401,473.87	0.88
5	002460	赣锋锂业	6,375,878.96	0.88
6	601899	紫金矿业	6,057,701.58	0.84
7	000932	华菱钢铁	5,913,314.55	0.82
8	600711	盛屯矿业	5,777,453.52	0.80
9	300138	晨光生物	4,848,970.50	0.67
10	603098	森特股份	4,572,188.71	0.63
11	002812	恩捷股份	4,070,075.58	0.56
12	600985	淮北矿业	4,017,663.49	0.55
13	601012	隆基股份	3,810,149.64	0.53
14	002497	雅化集团	3,365,836.56	0.46
15	603187	海容冷链	2,809,143.00	0.39
16	002756	永兴材料	2,396,172.00	0.33
17	600323	瀚蓝环境	1,981,176.76	0.27
18	603806	福斯特	1,642,596.25	0.23
19	603039	泛微网络	1,450,099.76	0.20
20	300207	欣旺达	1,406,688.08	0.19

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002241	歌尔股份	11,278,865.58	1.56
2	601677	明泰铝业	9,057,011.78	1.25
3	600483	福能股份	8,148,214.71	1.13
4	603098	森特股份	6,959,667.87	0.96
5	002460	赣锋锂业	5,965,141.20	0.82
6	600711	盛屯矿业	5,603,772.80	0.77



7	601615	明阳智能	5,193,022.68	0.72
8	601899	紫金矿业	5,119,702.62	0.71
9	002812	恩捷股份	4,749,533.08	0.66
10	000932	华菱钢铁	4,711,984.40	0.65
11	300138	晨光生物	4,454,962.82	0.62
12	600985	淮北矿业	3,369,363.47	0.47
13	300059	东方财富	3,100,296.40	0.43
14	601012	隆基股份	3,063,512.30	0.42
15	002497	雅化集团	2,984,501.50	0.41
16	603187	海容冷链	2,416,698.00	0.33
17	002756	永兴材料	2,363,397.00	0.33
18	600323	瀚蓝环境	1,806,481.30	0.25
19	603039	泛微网络	1,464,229.30	0.20
20	603806	福斯特	887,396.00	0.12

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	99,501,255.43
卖出股票的收入（成交）总额	93,544,935.41

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	54,046,900.00	34.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,283,000.00	25.67
	其中：政策性金融债	20,074,000.00	12.79
4	企业债券	32,371,000.00	20.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	13,753,267.70	8.77

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	140,454,167.70	89.52

#### 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	200005	20 付息国债 05	300,000	29,019,000.00	18.50
2	210303	21 进出 03	200,000	20,074,000.00	12.79
3	019649	21 国债 01	170,000	17,011,900.00	10.84
4	143686	18 中证 G2	100,000	10,317,000.00	6.58
5	1922046	19 兴业消费金融债 02	100,000	10,129,000.00	6.46

#### 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。

#### 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

本基金本报告期没有投资股指期货。

##### 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

无。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 8 月 25 日，光大银行因违规办理内保外贷业务等违法违规事项，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚〔2020〕18 号）给予警告，没收违法所得 585,571.35 元人民币，并处 543 万元人民币罚款的行政处罚。2020 年 10 月 20 日，光大银行因违反银行交易记录管理规定，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚〔2020〕29 号）给予罚款 60 万元人民币的行政处罚，并要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020 年 10 月 20 日，光大银行因违规开展外汇交易，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚〔2020〕30 号）给予罚款 60 万元人民币的行政处罚，并要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

本基金投资 21 光大银行小微债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他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	45,608.16
2	应收证券清算款	2,445,047.51
3	应收股利	-
4	应收利息	1,433,418.18
5	应收申购款	101,694.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,025,768.39

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110075	南航转债	2,457,800.00	1.57
2	110053	苏银转债	2,427,200.00	1.55
3	132018	G 三峡 EB1	2,402,400.00	1.53
4	128137	洁美转债	1,277,900.00	0.81
5	113508	新风转债	649,050.00	0.41
6	128141	旺能转债	550,200.00	0.35
7	110051	中天转债	459,320.00	0.29
8	113568	新春转债	341,640.00	0.22

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 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

份额级别	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
华安稳定收益债券 A	4,420	24,721.41	59,933,983.02	54.85%	49,334,668.93	45.15%
华安稳定收益债券 B	2,339	12,652.05	5,036,257.08	17.02%	24,556,896.73	82.98%
合计	6,759	20,544.73	64,970,240.10	46.79%	73,891,565.66	53.21%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	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	华安稳定收益债券 A	16.16	0.00%
	华安稳定收益债券 B	5.67	0.00%
	合计	21.83	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。

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B
基金合同生效日（2008 年 4 月 30 日）基金份额总额	2,398,033,991.27	732,727,935.40
本报告期期初基金份额总额	487,066,955.44	167,030,990.13
本报告期基金总申购份额	72,746,951.95	8,025,573.09
减：本报告期基金总赎回份额	450,545,255.44	145,463,409.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	109,268,651.95	29,593,153.81

**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：

2021 年 2 月 6 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，杨牧云先生新任本基金管理人的督察长。

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**

报告期内无涉及本基金财产、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	
财信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	28,537,910.00	30.51%	26,006.91	30.13%	-
银河证券	3	22,934,150.25	24.52%	21,358.08	24.75%	-
国盛证券	3	14,810,083.24	15.83%	13,793.05	15.98%	-
申万宏源	3	7,800,869.40	8.34%	7,108.87	8.24%	-
华泰证券	3	7,147,738.56	7.64%	6,656.61	7.71%	-
长江证券	4	5,269,522.48	5.63%	4,907.58	5.69%	-
天风证券	3	2,845,327.20	3.04%	2,592.93	3.00%	-

粤开证券	3	1,464,229.30	1.57%	1,363.48	1.58%	-
万联证券	3	1,463,349.00	1.56%	1,362.79	1.58%	-
方正证券	3	1,271,755.98	1.36%	1,158.99	1.34%	-

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，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(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：

2021 年 3 月完成租用托管在建设银行的 中信建投证券 上交所 49968 交易单元。

2021 年 6 月完成托管在建设银行的 申万宏源深交所 278300 交易单元退租。

#### 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
财信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	127,011,595.67	17.89%	60,000,000.00	6.95%	-	-
兴业证券	79,687,000.56	11.22%	-	-	-	-
上海证券	21,609,756.62	3.04%	45,000,000.00	5.21%	-	-
广发证券	14,992,000.00	2.11%	-	-	-	-
招商证券	10,389,561.00	1.46%	15,000,000.00	1.74%	-	-
新时代证券	6,604,326.26	0.93%	-	-	-	-
光大证券	3,573,759.53	0.50%	-	-	-	-
国泰君安证券	91,252,331.57	12.85%	-	-	-	-
银河证券	48,072,121.25	6.77%	37,000,000.00	4.28%	-	-
国盛证券	122,342,889.30	17.23%	608,500,000.00	70.47%	-	-
申万宏源	28,649,528.62	4.03%	-	-	-	-
华泰证券	66,115,731.5	9.31%	50,000,000	5.79%	-	-



	7		0.00			
长江证券	6,920,150.80	0.97%	8,000,000.00	0.93%	-	-
天风证券	13,071,881.95	1.84%	-	-	-	-
粤开证券	2,952,262.20	0.42%	23,000,000.00	2.66%	-	-
万联证券	27,859,158.83	3.92%	17,000,000.00	1.97%	-	-
方正证券	39,035,524.56	5.50%	-	-	-	-

### 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	华安稳定收益债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-21
2	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
3	华安稳定收益债券型证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-05
4	华安稳定收益债券型证券投资基金（华安稳定收益债券 A）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-05
5	华安稳定收益债券型证券投资基金（华安稳定收益债券 B）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-05
6	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
7	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-24
8	华安稳定收益债券型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-30
9	华安稳定收益债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2021-04-21

		定媒介	
10	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-07

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	20210101-20210406	175,023,190.69	0.00	175,023,190.69	0.00	0.00%
	2	20210312-20210630	79,933,983.02	0.00	20,000,000.00	59,933,983.02	43.16%
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、《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安稳定收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安稳定收益债券型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安稳定收益债券型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

二〇二一年八月三十日