

**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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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

| | |
|---|----|
| 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 2 基金简介 | 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 |
| 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 4 管理人报告 | 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 | 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 |
| 5 托管人报告 | 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 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 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 | 17 |
| 7 投资组合报告 | 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 | 39 |
| 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 | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 39 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 41 |
| 8 基金份额持有人信息 | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 42 |

| | |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 42 |
| 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 | 42 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 42 |
| 9 开放式基金份额变动 | 43 |
| 10 重大事件揭示 | 43 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 43 |
| 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 | 43 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 43 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 43 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 43 |
| 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 | 44 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 44 |
| 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 | 45 |
| 10.9 其他重大事件 | 45 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 46 |
| 12 备查文件目录 | 46 |
| 12.1 备查文件目录 | 46 |
| 12.2 存放地点 | 47 |
| 12.3 查阅方式 | 47 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------------------|
| 基金名称 | 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金 |
| 基金简称 | 华安锦源 0-7 年金融债定开债 |
| 基金主代码 | 009786 |
| 交易代码 | 009786 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 11 日 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 9,158,976,166.22 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。本基金以剩余期限在 0-7 年（包含 7 年）的金融债为主要投资标的。</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-金融债券总全价（总值）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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨牧云 | 林兴盛 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 021-52629999-213707 |
| | 电子邮箱 | service@huaan.com.cn | linxingsheng@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 95561 |

| | | |
|-------|---|----------------------|
| 传真 | 021-68863414 | 021-62159217 |
| 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 | 福州市湖东路154号 |
| 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 | 上海市银城路167号兴业大厦4 楼 |
| 邮政编码 | 200120 | 200120 |
| 法定代表人 | 朱学华 | 吕家进 |

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） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 176,620,745.86 |
| 本期利润 | 202,428,928.47 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0222 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.20% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.21% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 188,723,285.72 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0206 |
| 期末基金资产净值 | 9,389,288,329.56 |
| 期末基金份额净值 | 1.0251 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 2.51% |

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：封闭式基金交易佣

金、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）。

4、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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

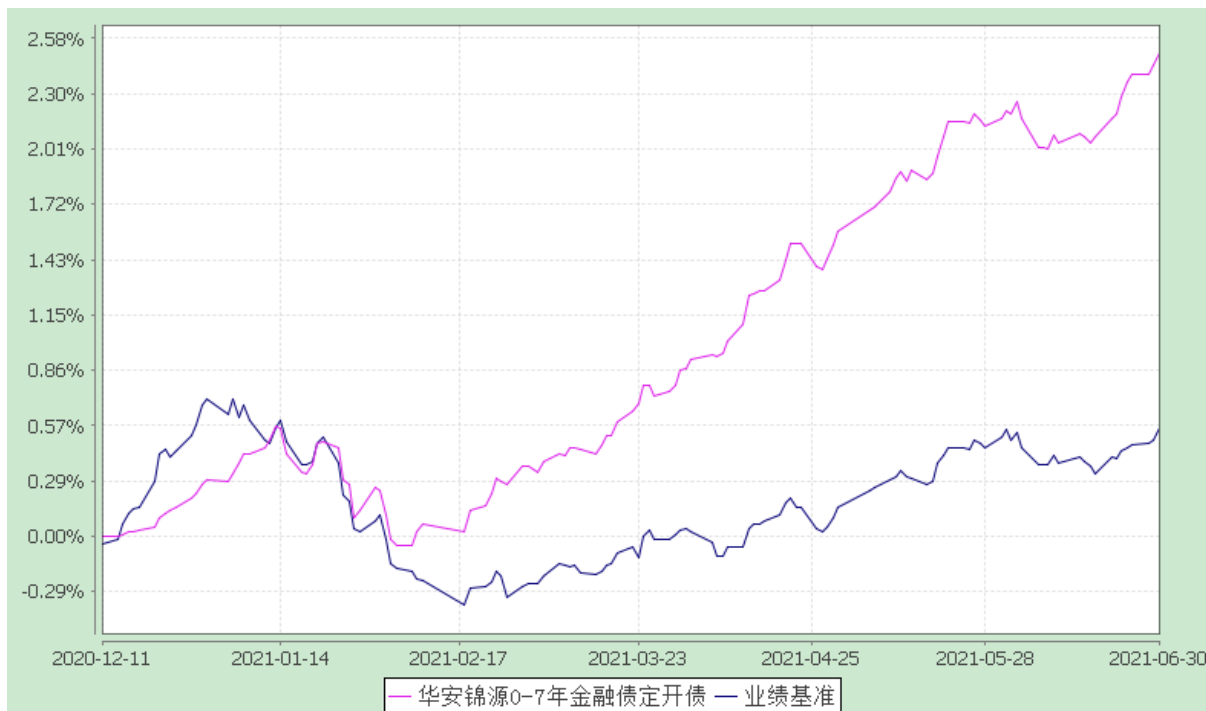
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 0.33% | 0.06% | 0.05% | 0.04% | 0.28% | 0.02% |
| 过去三个月 | 1.64% | 0.06% | 0.53% | 0.04% | 1.11% | 0.02% |
| 过去六个月 | 2.21% | 0.06% | -0.15% | 0.06% | 2.36% | 0.00% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 2.51% | 0.06% | 0.56% | 0.06% | 1.95% | 0.00% |

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 12 月 11 日至 2021 年 6 月 30 日）



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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 | | |
| | | | | | |

| | | | | |
|-----------|---|------------------------|----------|--|
| <p>贺涛</p> | <p>本基金的基金 经理 固定收益部高 级总监</p> | <p>2021-01-1 8</p> | <p>-</p> | <p>23 年</p> <p>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，</p> |
|-----------|---|------------------------|----------|--|

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|-----|---|
| | | | | | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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金的基金经理。</p> |
| 林唐宇 | 本基金的基金经理 | 2020-12-11 | - | 5 年 | <p>理学硕士，FRM（金融风险管理师），6 年相关金融行业从业经验。曾任中国人保资管管理公司债券交易员。2016 年 3 月加入华安基金，历任集中交易部债券交易员，固定收益部基金经理助理。2020 年 1 月起，同时担任华安现金宝货币市场基金、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。2020 年 9 月起，同时担任华安中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2020 年 12 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金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安锦源 0-5 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p> |
| 周舒展 | 本基金的基金经理 | 2021-01-25 | - | 9 年 | <p>硕士研究生，9 年金融、基金行业从业经验。曾任中国银行上海人民币交易业务总部代客交易员、代客</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | 组合管理台投资经理、衍生与策略交易台负责人，2020 年 12 月加入华安基金。2021 年 1 月起，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金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安鼎瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、华安中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金、华安锦源 0-5 年金融债 3 个月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。

4.2 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

上半年，疫苗接种在欧美提速，海外经济出现边际改善迹象，欧元区、美国制造业 PMI 均录得近二十年来新高。国内政策方面，货币政策稳字当头，公开市场基本维持等额到期续作；财政政策留有余力，发债后倾。利率方面，资金利率保持平稳，波动率降低，市场预期转好，无风险利率下行，信用利差收窄。

报告期内，本基金以利率债配置为主，基于对宏观经济趋势的研判，灵活运用久期策略、骑乘策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0251 元，本报告期净值增长率为 2.21%，同期业绩比较基准增长率-0.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济的高点及财政收缩的低点均已过去。往后看，经济动能缓步减弱，政府债券发行进度回归正常化。国内政策着眼长远，缓解生育压力、严控房地产增速、推动绿色能源发展和控制政府平台无序扩张将持续推进。长期的行稳致远、可持续发展或许会引起短期增长与物价上的压力。我们认为，货币政策将保持中性，无风险利率在低位震荡；同时，我们对信用风险高度关注。

本基金将以研究为基石，不断优化组合的持仓结构。我们将继续勤勉尽责，为持有人带来较好的收益。

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

本报告期内未进行利润分配。

本基金的基金管理人于 2021 年 7 月 12 日发布了 2021 年度第一次分红公告：0.2000 元/10 份。权益登记日及除息日：2021 年 7 月 14 日；现金红利发放日：2021 年 7 月 15 日。

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遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 |
|----|-----|------------------------|--------------------------|
|----|-----|------------------------|--------------------------|

| | | | |
|-------------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 10,920,190.49 | 1,815,388,246.77 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 15,845,747,000.00 | 6,679,227,000.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 15,845,747,000.00 | 6,679,227,000.00 |
| 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 | 409,922,814.88 | 590,188,365.29 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 269,131,490.47 | 53,841,744.82 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 16,535,721,495.84 | 9,138,645,356.88 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | - | - |
| 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 | | 7,135,298,992.59 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | 6.4.10.2 | 2,295,591.75 | 1,494,734.18 |
| 应付托管费 | 6.4.10.2 | 382,598.63 | 249,122.35 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 161,419.66 | 25,565.59 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 8,155,713.12 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 138,850.53 | 10,000.00 |
| 负债合计 | | 7,146,433,166.28 | 1,779,422.12 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 9,158,976,166.22 | 9,110,154,536.14 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 230,312,163.34 | 26,711,398.62 |
| 所有者权益合计 | | 9,389,288,329.56 | 9,136,865,934.76 |
| 负债和所有者权益总计 | | 16,535,721,495.84 | 9,138,645,356.88 |

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0251 元，基金份额总额 9,158,976,166.22 份。

6.2 利润表

会计主体：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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|---------------------------------------|
| 一、收入 | | 268,081,850.19 |
| 1.利息收入 | | 222,785,971.15 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 3,126,276.39 |
| 债券利息收入 | | 218,621,173.97 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,038,520.79 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 19,487,696.43 |
| 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 | 19,487,696.43 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 25,808,182.61 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | - |
| 减：二、费用 | | 65,652,921.72 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 13,696,878.49 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 2,282,813.10 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 157,350.00 |
| 5. 利息支出 | | 49,352,499.13 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 49,352,499.13 |
| 6.税金及附加 | | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 163,381.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 202,428,928.47 |
| 减：所得税费用 | | - |

| | | |
|-------------------|--|----------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 202,428,928.47 |
|-------------------|--|----------------|

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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） | 9,110,154,536.14 | 26,711,398.62 | 9,136,865,934.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 202,428,928.47 | 202,428,928.47 |
| 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） | 48,821,630.08 | 1,171,836.25 | 49,993,466.33 |
| 其中：1.基金申购款 | 48,827,636.72 | 1,171,863.28 | 49,999,500.00 |
| 2.基金赎回款 | -6,006.64 | -27.03 | -6,033.67 |
| 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） | 9,158,976,166.22 | 230,312,163.34 | 9,389,288,329.56 |

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[2020]第 1139 号《关于准予华安锦源 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 9,110,027,173.75 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 1083 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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金基金合同》于 2020 年 12 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,110,154,536.14 份基金份额,其中认购资金利息折合 127,362.39 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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 3 个公历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 10,001,850.14 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金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券))、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券、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%,其中,投资于剩余期限在 0-7 年(包含 7 年)的金融债的比例不低于非现金基金资产的 80%;但在每个开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内,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-金融债券总全价(总值)指数收益率。

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》、《华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应

收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充

足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券

在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现

现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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 | 10,920,190.49 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 10,920,190.49 |

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 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | 15,804,333,906.01 | 15,845,747,000.00 |
| | 合计 | 15,804,333,906.01 | 15,845,747,000.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 15,804,333,906.01 | 15,845,747,000.00 | 41,413,093.99 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 409,922,814.88 | - |
| 合计 | 409,922,814.88 | - |

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 | 2,503.76 |
| 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 | - |
| 应收债券利息 | 269,030,389.03 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | 98,597.68 |
| 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 | - |
| 合计 | 269,131,490.47 |

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 2021 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 | 161,419.66 |
| 合计 | 161,419.66 |

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 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |
| 预提审计费 | 79,343.16 |
| 合计 | 138,850.53 |

6.4.7.9 实收基金

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（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 9,110,154,536.14 | 9,110,154,536.14 |
| 本期申购 | 48,827,636.72 | 48,827,636.72 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,006.64 | -6,006.64 |
| 本期末 | 9,158,976,166.22 | 9,158,976,166.22 |

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

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 | 11,106,487.24 | 15,604,911.38 | 26,711,398.62 |
| 本期利润 | 176,620,745.86 | 25,808,182.61 | 202,428,928.47 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 996,052.62 | 175,783.63 | 1,171,836.25 |
| 其中：基金申购款 | 996,106.86 | 175,756.42 | 1,171,863.28 |
| 基金赎回款 | -54.24 | 27.21 | -27.03 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 188,723,285.72 | 41,588,877.62 | 230,312,163.34 |

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 | 30,338.14 |
| 定期存款利息收入 | 3,021,666.45 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 74,271.80 |
| 其他 | - |
| 合计 | 3,126,276.39 |

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 |
|------------------------|----------------------|
| | 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 | 11,168,078,967.23 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 11,050,593,083.57 |
| 减：应收利息总额 | 97,998,187.23 |
| 买卖债券差价收入 | 19,487,696.43 |

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

无。

6.4.7.18 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 | 25,808,182.61 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 25,808,182.61 |
| ——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 | 25,808,182.61 |

6.4.7.19 其他收入

无。

6.4.7.20 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 | - |
| 银行间市场交易费用 | 157,350.00 |
| 合计 | 157,350.00 |

6.4.7.21 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 | 79,343.16 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 15,230.47 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 其他费用 | 300.00 |
| 合计 | 163,381.00 |

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

本基金的基金管理人于 2021 年 7 月 12 日发布了 2021 年度第一次分红公告：0.2000 元/10 份。
权益登记日及除息日：2021 年 7 月 14 日；现金红利发放日：2021 年 7 月 15 日。

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(“华安基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司(“兴业银行”) | 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

无。

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 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,696,878.49 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 90,208.61 |

注：1、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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后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。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目；

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 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托管费 | 2,282,813.10 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后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

单位：人民币元

| 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | | | | |
|----------------------------|------------------|----------------|-------|------|----------------|------------|
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行 | 1,155,291,214.80 | 100,722,854.79 | - | - | 801,510,000.00 | 344,494.36 |

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 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------------------|----------------------------|
| 期初持有的基金份额 | 10,001,850.14 |
| 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 | 10,001,850.14 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 0.11% |

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|----------------|---------------------|------------------------------|-----------------------|--------------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份 额占基金总份 额的比例 |
| 兴业银行股份有 限公司 | 3,999,999,500.00 | 43.67% | - | - |

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 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行 | 10,920,190.49 | 30,338.14 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2021 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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 2021 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 7,135,298,992.59 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值 单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|--------|----------|------------|------------|---------------|----------------|
| 200303 | 20 进出 03 | 2021-07-02 | 98.90 | 10,000,000.00 | 989,000,000.00 |
| 190208 | 19 国开 08 | 2021-07-01 | 101.13 | 8,000,000.00 | 809,040,000.00 |
| 200313 | 20 进出 13 | 2021-07-01 | 100.91 | 6,350,000.00 | 640,778,500.00 |

| | | | | | |
|--------|----------|------------|--------|---------------|------------------|
| 150405 | 15 农发 05 | 2021-07-07 | 102.55 | 5,270,000.00 | 540,438,500.00 |
| 150205 | 15 国开 05 | 2021-07-05 | 102.19 | 5,270,000.00 | 538,541,300.00 |
| 160404 | 16 农发 04 | 2021-07-02 | 100.79 | 5,270,000.00 | 531,163,300.00 |
| 150210 | 15 国开 10 | 2021-07-05 | 103.50 | 4,700,000.00 | 486,450,000.00 |
| 200313 | 20 进出 13 | 2021-07-05 | 100.91 | 4,000,000.00 | 403,640,000.00 |
| 190203 | 19 国开 03 | 2021-07-01 | 100.78 | 3,960,000.00 | 399,088,800.00 |
| 190305 | 19 进出 05 | 2021-07-02 | 100.68 | 3,270,000.00 | 329,223,600.00 |
| 190404 | 19 农发 04 | 2021-07-01 | 101.32 | 3,110,000.00 | 315,105,200.00 |
| 200207 | 20 国开 07 | 2021-07-06 | 100.28 | 2,500,000.00 | 250,700,000.00 |
| 200208 | 20 国开 08 | 2021-07-06 | 98.82 | 2,400,000.00 | 237,168,000.00 |
| 200313 | 20 进出 13 | 2021-07-02 | 100.91 | 2,110,000.00 | 212,920,100.00 |
| 190409 | 19 农发 09 | 2021-07-06 | 100.49 | 2,100,000.00 | 211,029,000.00 |
| 150218 | 15 国开 18 | 2021-07-07 | 101.96 | 2,008,000.00 | 204,735,680.00 |
| 200313 | 20 进出 13 | 2021-07-02 | 100.91 | 1,860,000.00 | 187,692,600.00 |
| 200208 | 20 国开 08 | 2021-07-06 | 98.82 | 1,854,000.00 | 183,212,280.00 |
| 140205 | 14 国开 05 | 2021-07-07 | 107.05 | 1,400,000.00 | 149,870,000.00 |
| 180211 | 18 国开 11 | 2021-07-05 | 101.76 | 1,270,000.00 | 129,235,200.00 |
| 150210 | 15 国开 10 | 2021-07-07 | 103.50 | 1,000,000.00 | 103,500,000.00 |
| 160404 | 16 农发 04 | 2021-07-07 | 100.79 | 860,000.00 | 86,679,400.00 |
| 190203 | 19 国开 03 | 2021-07-06 | 100.78 | 710,000.00 | 71,553,800.00 |
| 150218 | 15 国开 18 | 2021-07-05 | 101.96 | 570,000.00 | 58,117,200.00 |
| 合计 | | | | 79,842,000.00 | 8,068,882,460.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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。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流动性风险及市场风险。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。

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。

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。

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公司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。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。

6.4.13.4.1.1 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 | 10,920,190.49 | - | - | - | 10,920,190.49 |
| 交易性金融资产 | 570,982,000.00 | 15,274,765,000.00 | - | - | 15,845,747,000.00 |
| 买入返售金融资产 | 409,922,814.88 | - | - | - | 409,922,814.88 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 269,131,490.47 | 269,131,490.47 |
| 资产总计 | 991,825,005.37 | 15,274,765,000.00 | - | 269,131,490.47 | 16,535,721,495.84 |
| 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 | 7,135,298,992.59 | - | - | - | 7,135,298,992.59 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,295,591.75 | 2,295,591.75 |
| 应付托管费 | - | - | - | 382,598.63 | 382,598.63 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 161,419.66 | 161,419.66 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | 8,155,713.12 | 8,155,713.12 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 138,850.53 | 138,850.53 |
| 负债总计 | 7,135,298,992.59 | - | - | 11,134,173.69 | 7,146,433,166.28 |
| 利率敏感度缺口 | -6,143,473,987.22 | 15,274,765,000.00 | - | 257,997,316.78 | 9,389,288,329.56 |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,815,388,246.77 | - | - | - | 1,815,388,246.77 |
| 交易性金融资产 | 5,353,013,000.00 | 1,175,694,000.00 | 150,520,000.00 | - | 6,679,227,000.00 |

| | | | | | |
|-----------|------------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 买入返售金融资产 | 590,188,365.29 | - | - | - | 590,188,365.29 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 53,841,744.82 | 53,841,744.82 |
| 资产总计 | 7,758,589,612.06 | 1,175,694,000.00 | 150,520,000.00 | 53,841,744.82 | 9,138,645,356.88 |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,494,734.18 | 1,494,734.18 |
| 应付托管费 | - | - | - | 249,122.35 | 249,122.35 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 25,565.59 | 25,565.59 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 10,000.00 | 10,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,779,422.12 | 1,779,422.12 |
| 利率敏感度缺口 | 7,758,589,612.06 | 1,175,694,000.00 | 150,520,000.00 | 52,062,322.70 | 9,136,865,934.76 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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 | 上年度末 |
| | | 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 9,224 | - |
| | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 9,140 | - |

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

6.4.13.4.3.1 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，本基金未持有交易性权益类资产，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。

6.4.14 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 | 15,845,747,000.00 | 95.83 |
| | 其中：债券 | 15,845,747,000.00 | 95.83 |
| | 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 | 409,922,814.88 | 2.48 |
| | 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 | 10,920,190.49 | 0.07 |
| 8 | 其他各项资产 | 269,131,490.47 | 1.63 |
| 9 | 合计 | 16,535,721,495.84 | 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。

7.2.2 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

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初基金资产净值 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入或卖出股票。

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 | 15,845,747,000.00 | 168.76 |

| | | | |
|----|-----------|-------------------|--------|
| | 其中：政策性金融债 | 15,845,747,000.00 | 168.76 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 15,845,747,000.00 | 168.76 |

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 | 200313 | 20 进出 13 | 21,600,000 | 2,179,656,000.00 | 23.21 |
| 2 | 190203 | 19 国开 03 | 14,100,000 | 1,420,998,000.00 | 15.13 |
| 3 | 160404 | 16 农发 04 | 13,400,000 | 1,350,586,000.00 | 14.38 |
| 4 | 200303 | 20 进出 03 | 12,800,000 | 1,265,920,000.00 | 13.48 |
| 5 | 190208 | 19 国开 08 | 9,000,000 | 910,170,000.00 | 9.69 |

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

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 269,131,490.47 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 269,131,490.47 |

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

无。

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 |
| 66 | 138,772,366.15 | 9,158,950,986.86 | 100.00% | 25,179.36 | 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 | 141.01 | 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、基金投资和研究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 | 10,001,850.14 | 0.11% | 10,001,850.14 | 0.11% | 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 | 10,001,850.14 | 0.11% | 10,001,850.14 | 0.11% | - |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2020 年 12 月 11 日）基金份额总额 | 9,110,154,536.14 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 9,110,154,536.14 |
| 本报告期基金总申购份额 | 48,827,636.72 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 6,006.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 9,158,976,166.22 |

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 | |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 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，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，最大限度地调动物体资源，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 |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | 370,000,000.00 | 100.00% | - | - |

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金基金经理变更公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2021-01-16 |
| 2 | 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金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 | 2021-01-20 |
| 3 | 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 | 2021-01-20 |
| 4 | 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金基金经理变更公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2021-01-23 |
| 5 | 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金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 | 2021-01-27 |
| 6 | 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金更新的招募说明书(2021 年第 2 号) | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2021-01-27 |
| 7 | 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 | 2021-02-06 |

| | | | |
|----|---|-------------------------|------------|
| | 告 | 露网站和公司网站等指定媒介 | |
| 8 | 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 |
| 9 | 关于华安锦源 0-7 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2021-03-10 |
| 10 | 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定媒介 | 2021-04-21 |
| 11 | 关于华安锦源 0-7 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2021-06-10 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

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 | 20210101-20210630 | 1,999,999.50 | 0.00 | 0.00 | 1,999,999.50 | 21.84% |
| | 2 | 20210101-20210630 | 3,999,999.50 | 0.00 | 0.00 | 3,999,999.50 | 43.67% |
| 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金基金合同》
- 2、《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金招募说明书》

- 3、《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金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安锦源 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