

# 汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起 式证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 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 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇安恒鑫 12 个月定开纯债债券
基金主代码	008818
交易代码	008818
基金运作方式	本基金以定期开放的方式运作，即本基金以封闭期和开放期相结合的方式运作。本基金以 12 个月为一个封闭期。在封闭期内本基金不接受基金份额的申购和赎回（红利再投资除外）。每个封闭期为自基金合同生效日（含该日）起或每个开放期结束日次日（含该日）起至 12 个月后的月度对日（如该日为非工作日或日历月度不存在该对应日期的，则顺延至下一工作日）的前一日止。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束日的下一个工作日起（含该日）进入开放期，投资人在开放期可办理本基金份额的申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期不少于 5 个工作日且不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期前 2 日进行公告。
基金合同生效日	2020 年 9 月 18 日
报告期末基金份额总额	510,021,950.04 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括大类资产配置策略、债券组合管理策略，其中债券组合管理策略包括利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择

	策略、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

### § 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（2021 年 7 月 1 日 — 2021 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	5,048,390.17
2. 本期利润	5,506,541.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0108
4. 期末基金资产净值	513,359,439.01
5. 期末基金份额净值	1.0065

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

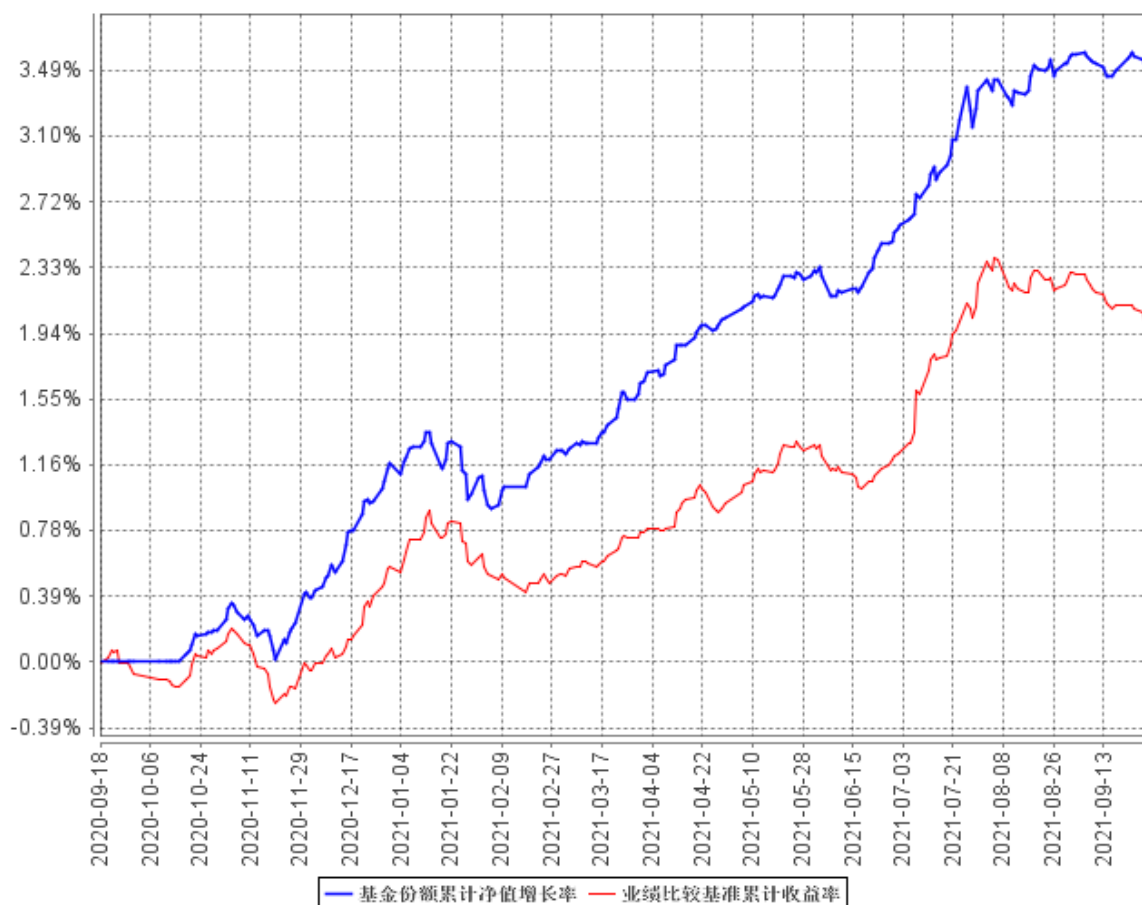
#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	1.07%	0.06%	0.83%	0.06%	0.24%	0.00%
过去六个月	1.95%	0.05%	1.28%	0.05%	0.67%	0.00%
过去一年	3.63%	0.05%	2.13%	0.04%	1.50%	0.01%
自基金合同 生效起至今	3.63%	0.05%	2.06%	0.04%	1.57%	0.01%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①基金合同生效日为 2020 年 9 月 18 日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

②根据《汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每个开放期开始前 1 个月、开放期及开放期结束后 1 个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当

保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期为 2020 年 9 月 18 日至 2021 年 3 月 17 日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张昆	固定收益投资部高级经理、本基金的基金经理	2020 年 9 月 23 日	-	5 年	张昆先生，清华大学金融学硕士研究生，5 年证券、基金行业从业经历。曾任雅利(上海)资产管理有限公司固定收益投资部投资经理；凯石基金管理有限公司投资四部总监。2020 年 2 月加入汇安基金管理有限责任公司，担任固定收益投资部高级经理一职。2020 年 9 月 23 日至今，任汇安裕鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2020 年 9 月 23 日至今，任汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2020 年 12 月 23 日至今，任汇安恒利 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 2 日至今，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基

					金基金经理；2021 年 1 月 12 日至今，任汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2021 年 4 月 21 日至今，任汇安稳裕债券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合规守信情况的说明

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

报告期内，国内经济基本面呈现类滞胀特征，一方面，内需相对疲软，受疫情、自然灾害及可支配收入增幅较低的影响，社会零售消费品总额两年平均增幅低于往年同期水平，同时，地产投资及销售出现下滑拐点，基建投资呈现托而不举的特征，外向型制造业相对较强，但整体制造业投资增速维持低位；另一方面，全球疫情和碳减排背景下形成了明显的供给瓶颈，部分大宗商品和海运价格不断冲击高位，挤压国内中下游企业的盈利，但整体物价水平的传导或仍缓慢。

政策面上，货币政策维持灵活精准、合理适度，尽管美联储引导 taper 预期的脚步渐近，但中国央行仍旧保持政策定力，以我为主，保持流动性合理充裕，资金价格维持相对低位，随着增强信贷总量增长的稳定性的政策实施，社融增速及 M2 的下行速率将减缓并触底回升。当前政策端将强调跨周期设计，以国内经济状况和物价走势为重心，货币政策将在维持宏观杠杆率基本稳定的同时给予实体经济以充裕的货币支持，财政政策在继续提质增效的同时将更为积极，产业政策加强供给端结构性调节，纾解当前经济运行中遭遇的供应瓶颈，经济的类滞胀特征将有所缓和。

报告期内，债券市场收益率呈现先下后上的 V 型走势，本基金积极利用处于低位的资金利率，采用套息策略，同时，依据货币政策拐点和基本面变化，把握收益率下行波段，力争提升组合收益。

#### 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 1.0065 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.07%，业绩比较基准收益率为 0.83%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，截至报告期末成立不满三年，本项不适用。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	692,532,984.20	98.20

	其中：债券	692,532,984.20	98.20
	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	4,063,603.05	0.58
8	其他资产	8,619,765.62	1.22
9	合计	705,216,352.87	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

## 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	120,564,984.20	23.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	571,968,000.00	111.42
	其中：政策性金融债	571,968,000.00	111.42
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	692,532,984.20	134.90

### 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	210312	21 进出 12	1,200,000	120,720,000.00	23.52
2	200208	20 国开 08	1,200,000	119,820,000.00	23.34
3	210203	21 国开 03	1,000,000	101,340,000.00	19.74
4	019641	20 国债 11	1,000,000	100,250,000.00	19.53
5	200405	20 农发 05	700,000	68,411,000.00	13.33

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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。

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 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	5,171.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,614,593.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,619,765.62

### 5.10.4 报告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。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	510,021,950.04
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	510,021,950.04

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,450.04
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,450.04
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	1.96

注：基金管理人汇安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.04	1.96	10,000,450.04	1.96	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.04	1.96	10,000,450.04	1.96	-

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20210701-20210930	500,021,500.00	0.00	0.00	500,021,500.00	98.04%
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。							

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议
- 4、汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 10.2 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

### 10.3 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

2021 年 10 月 27 日