
华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:华安证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期: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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021年10月25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07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华安证券合赢三个月定开
基金主代码	970034
基金运作方式	契约型，定期开放
基金合同生效日	2021年06月11日
报告期末基金份额总额	209,552,637.51份
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，追求资产的长期稳定增值，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划以封闭期为周期进行投资运作，在合理的资产配置基础上，通过固定收益类资产配置构建债券组合为产品提供稳健收益，通过对不同资产间的动态调整和优化策略争取增强回报。本集合计划在封闭期与开放期采取不同的投资策略。
业绩比较基准	基准指数=沪深300指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率× 90%
风险收益特征	。本集合计划为债券型集合资产管理计划，属于中低风险/收益的投资品种，其预期风险和预期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	华安证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 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07月01日 - 2021年09月30日）
1. 本期已实现收益	3,397,432.31
2. 本期利润	2,302,263.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0127
4. 期末基金资产净值	212,558,718.52
5. 期末基金份额净值	1.0143

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	1.32%	0.03%	0.08%	0.13%	1.24%	-0.10%
自基金合同生效起至今	1.43%	0.03%	0.05%	0.13%	1.38%	-0.10%

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

华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年06月11日-2021年09月30日)



§ 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		
张欣	基金经理	2016-09-05	-	10年	-
张钰	基金经理	2020-06-02	-	7年	-

注：本产品由大集合公募改造而来，有关基金经理任职日期从担任原大集合产品投资经理时间起算。

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，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华安证券股份有限公司公募资产管理业务公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

前三季度，股票市场走势一波三折，债券市场走势相对平稳，延续了去年四季度以来的震荡上行态势，大部分时间债券收益率平稳下行，可转债市场上半年估值上行，九月中旬开始，高企的估值叠加资金利率和短债利率有所上升，转债市场波动剧烈。在投资运作上，管理人坚持中高等级信用债为主的配置策略，注意提高产品流动性，在一季度可转债市场出现大面积下跌、投资价值提升的位置显著增配基本面稳定、中高评级的可转债资产，增厚了产品收益。展望四季度，经济增长的压力加大，货币政策整体或维持稳健格局，信用债投资以中高评级、短久期为主，少量参与转债的结构性行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华安证券合赢三个月定开基金份额净值为1.0143元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.32%，同期业绩比较基准收益率为0.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	111,221,303.31	51.74
	其中：债券	111,221,303.31	51.74
	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	96,461,345.00	44.87
	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	3,897,467.49	1.81
8	其他资产	3,381,778.08	1.57
9	合计	214,961,893.88	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股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	90,058,364.70	42.37
5	企业短期融资券	19,999,000.00	9.41
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	1,163,938.61	0.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	111,221,303.31	52.32

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	143171	17杭旅02	100,000	10,134,000.00	4.77
2	012102212	21佛山公用SCP003	100,000	10,003,000.00	4.71
3	163309	20中林01	100,000	10,002,000.00	4.71
4	139427	G19商都1	100,000	9,997,000.00	4.70
5	042100194	21皖北煤电CP002	100,000	9,996,000.00	4.70

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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,977.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,377,800.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,381,778.08

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128044	岭南转债	928,126.61	0.44
2	113565	宏辉转债	235,812.00	0.11

5.11.5 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。

5.11.6 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	169,879,236.91
报告期期间基金总申购份额	70,842,698.04
减：报告期期间基金总赎回份额	31,169,297.44
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	209,552,637.51

截至本报告期末，本公司从业人员及其配偶购买持有华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划份额合计7920949.48份。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划合同；
- 3、华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划产品资料概要更新；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号。

9.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95318

公司网址：<http://www.hazq.com/>

华安证券股份有限公司

2021年10月27日