

**华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金**  
**2021 年第 3 季度报告**  
**2021 年 9 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华安添利 6 个月债券
基金主代码	010619
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 5 日
报告期末基金份额总额	6,353,572,680.88 份
投资目标	本基金在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，给出股票、债券和货币市场工具等大类资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。

业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+中证 800 指数收益率×10%	
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。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安添利 6 个月债券 A	华安添利 6 个月债券 C
下属分级基金的交易代码	010619	010620
报告期末下属分级基金的份额总额	5,094,527,705.94 份	1,259,044,974.94 份

### §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)	
	华安添利 6 个月债券 A	华安添利 6 个月债券 C
1.本期已实现收益	26,099,122.08	5,220,422.09
2.本期利润	17,038,786.21	1,584,915.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0023	0.0008
4.期末基金资产净值	5,134,947,903.12	1,265,724,325.01
5.期末基金份额净值	1.0079	1.0053

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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

##### 1、华安添利 6 个月债券 A:

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	0.35%	0.12%	0.32%	0.12%	0.03%	0.00%
过去六个月	0.53%	0.09%	1.17%	0.11%	-0.64%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	0.79%	0.09%	0.76%	0.12%	0.03%	-0.03%

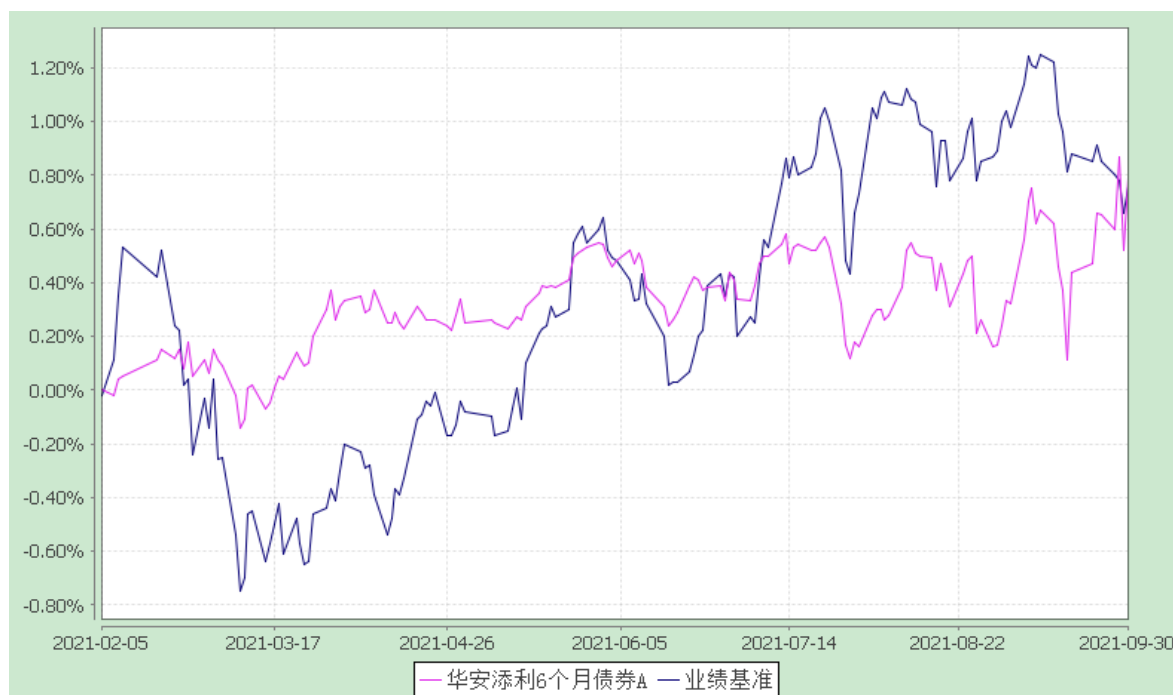
##### 2、华安添利 6 个月债券 C:

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	0.25%	0.12%	0.32%	0.12%	-0.07%	0.00%
过去六个月	0.33%	0.09%	1.17%	0.11%	-0.84%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	0.53%	0.09%	0.76%	0.12%	-0.23%	-0.03%

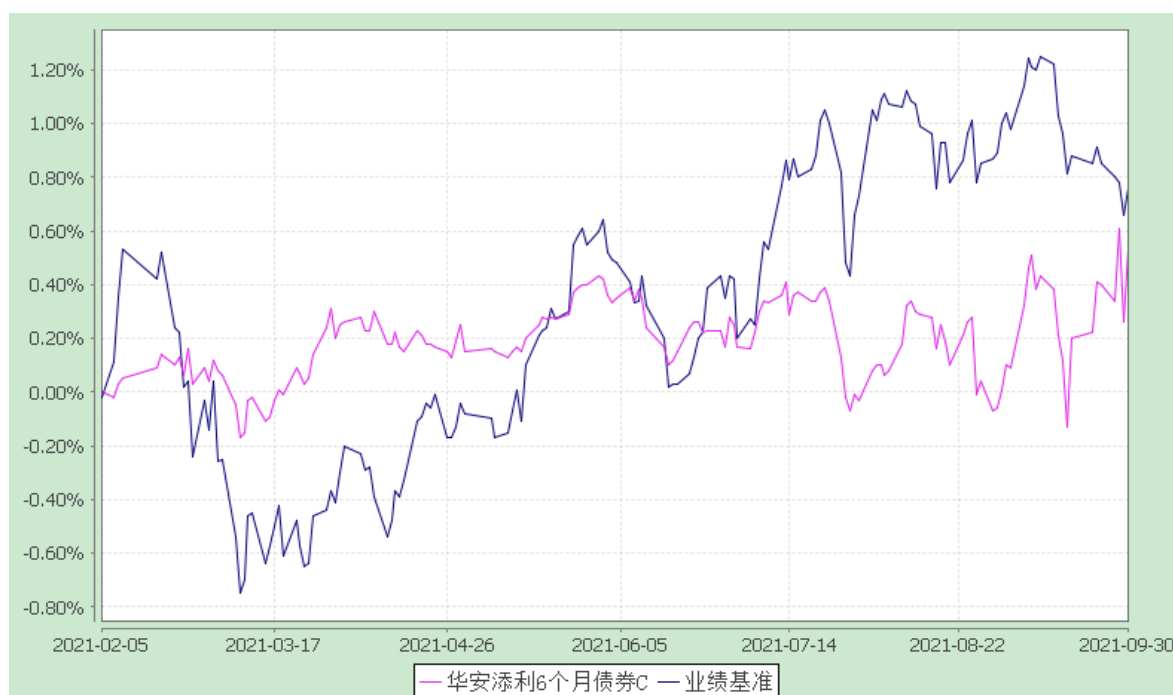
#### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2021 年 2 月 5 日至 2021 年 9 月 30 日)

##### 1. 华安添利 6 个月债券 A:



## 2. 华安添利 6 个月债券 C:



注：1. 本基金于 2021 年 2 月 5 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2. 根据本基金基金合同，本基金建仓期为 6 个月。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## §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		
周益鸣	本基金的基金经理	2021-02-05	-	13 年	硕士，13 年金融、基金行业从业经验。曾任太平资产管理有限公司交易员。2010 年 6 月加入华安基金，历任集中交易部交易员、固定收益部基金经理助理。2018 年 6 月起，担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2020 年 10 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 7 月至 2021 年 3 月，同时担任华安安业债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月，同时担任华安安和债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 5 月，同时担任华安安敦债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起，同时担任华安添瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安添福 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起，同时担任华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，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。2021 年 7 月起，同时担任华安添和一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。
陆奔	本基金的基金经理	2021-02-05	-	10 年	硕士研究生，10 年基金行业从业经历。2011 年加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部

				<p>基金经理助理。2018 年 9 月起，担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 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 月至 2020 年 2 月，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。2020 年 1 月起，同时担任华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起，同时担任华安添瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安添福 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起，同时担任华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安兴安优选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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 公平交易专项说明

##### 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。

#### 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度，宏观经济在边际上略有转弱。受到疫情反复的影响，国内消费增速有所回落。房地产行业由于房企资金链较为紧张，开发贷和按揭贷款额度受限，使得投资和销售增速均有明显回落，部分房企爆发信用风险事件。出口表现相对靓丽，海外复工复产进度较慢，美国劳动参与率依然较低，对华商品需求强劲。但出口企业对于新接订单比较谨慎，由于大宗商品在今年出现大幅度、大面积的上涨，出口制造企业价格传导能力有限，导致利润被挤压，同时海运价格较高，货运周期较长，现金流紧张。社会融资方面，由于涉房贷款受控，新增贷款需求减少叠加高基数，导致社会融资增速进一步下行。在经济走弱，融资恶化的情况下，债券利率在三季度有所下行。A 股市场整体呈现震荡走势，但结构性机会凸显，尤其体现在部分传统价值板块和中小盘成长个股方向，这大体与我们前期判断相符。

报告期内，本基金继续按照“固收+”策略布局投资，保持灵活适度仓位，积极参与市场结构性机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0079 元，本报告期份额净值增长率为 0.35%；本基金 C 类份额净值为 1.0053 元，本报告期份额净值增长率为 0.25%。同期业绩比较基准增长率为 0.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，近期海外央行紧缩预期加强，全球通胀预期持续发酵，大宗商品居高不下，导致海外债券利率持续走高。国内社会融资需求可能会逐步转暖，涉房贷款有松动的诉求，地方政府债券供给量也会有所增加。债券市场利率或将面临上行压力。可转债目前整体转股溢价率偏高，并且股票估值并不是非常便宜，在滞涨的环境下可能会出现溢价率和转股价双杀的可能，耐心等待更加的配置时机。经济增长动能边际转弱和全球通胀超预期是当前市场两大主要矛盾。动态演绎看潜在稳增长的角度，预期政策发力点还是在消费和新基建。国际视角看，美国面临财政上限和美联储宽松退出两大约束，四季度中美关系大概率是边际趋缓的节奏。综上分析，四季度宏观环境相对复杂，折射到市场不同板块（比如周期消费/成长价值）都是利空利多交织的状态，呈现

上有顶下有底的特征。全球横向比较看，A 股还是更有性价比，至少存在可把握的结构性的机会。本基金权益投资下一阶段会维持均衡化配置，选股更注重安全边际，保持灵活适度仓位，控制净值波动，并从更中期的视角择机配置优质公司。

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的利益。

#### 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 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	1,073,830,306.17	16.29
	其中：股票	1,073,830,306.17	16.29
2	固定收益投资	5,281,585,100.00	80.13
	其中：债券	5,281,585,100.00	80.13
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	79,948,239.92	1.21
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	108,977,003.60	1.65
7	其他各项资产	46,589,306.27	0.71
8	合计	6,590,929,955.96	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	568,227,892.13	8.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,925,700.55	0.78
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,587,442.00	0.17
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	185,849,159.04	2.90
K	房地产业	100,049,154.00	1.56
L	租赁和商务服务业	14,586,000.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,021,723.45	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	117,583,235.00	1.84
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,073,830,306.17	16.78

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300143	盈康生命	7,359,500	105,020,065.00	1.64
2	002487	大金重工	3,093,900	74,377,356.00	1.16
3	601567	三星医疗	3,702,900	60,838,647.00	0.95
4	600011	华能国际	6,036,965	49,925,700.55	0.78
5	600887	伊利股份	1,278,900	48,214,530.00	0.75
6	000977	浪潮信息	1,414,900	40,352,948.00	0.63
7	002236	大华股份	1,687,321	40,023,254.12	0.63

8	600036	招商银行	787,600	39,734,420.00	0.62
9	600315	上海家化	864,600	37,912,710.00	0.59
10	603986	兆易创新	242,800	35,203,572.00	0.55

#### 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	725,032,000.00	11.33
	其中：政策性金融债	675,132,000.00	10.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,396,270,100.00	68.68
6	中期票据	100,600,000.00	1.57
7	可转债（可交换债）	10,383,000.00	0.16
8	同业存单	49,300,000.00	0.77
9	其他	-	-
10	合计	5,281,585,100.00	82.52

#### 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	210210	21 国开 10	3,000,000	304,770,000.00	4.76
2	012102435	21 中石化 SCP008	3,000,000	300,300,000.00	4.69
3	012101789	21 船重 SCP001	2,500,000	250,625,000.00	3.92
4	210201	21 国开 01	2,200,000	220,132,000.00	3.44
5	012101641	21 沪港务 SCP001	2,000,000	200,480,000.00	3.13

#### 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投资。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 5.10.2 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。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2020 年 11 月 27 日，招商银行因金融机构违反规定办理结汇、售汇的行为，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检（2020）92 号）责令改正、并处罚款人民币 55 万元、没收违法所得 128.82 万元人民币的行政处罚。2021 年 5 月 17 日，招商银行因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2021）16 号）给予罚款 7170 万元的行政处罚。

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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	951,073.31
2	应收证券清算款	2,617,217.87
3	应收股利	-

4	应收利息	42,961,993.80
5	应收申购款	59,021.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,589,306.27

#### 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	113042	上银转债	10,383,000.00	0.16

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安添利6个月债券A	华安添利6个月债券C
本报告期期初基金份额总额	8,818,604,930.95	2,735,120,913.76
报告期期间基金总申购份额	5,027,237.40	1,068,022.14
减：报告期期间基金总赎回份额	3,729,104,462.41	1,477,143,960.96
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,094,527,705.94	1,259,044,974.94

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §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

本季度，中信银行股份有限公司已完成法定代表人变更的工商登记手续，自 2021 年 9 月 2 日起，法定代表人由李庆萍女士变更为朱鹤新先生。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《关于华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《关于华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《关于华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》

### 9.2 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>。

### 9.3 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  
二〇二一年十月二十七日