

---

# 华安合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划

## 2021年第4季度报告

### 2021年12月31日

基金管理人:华安证券股份有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2022年01月24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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年01月20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10月01日起至2021年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华安证券合赢六个月持有债券
基金主代码	970063
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年08月16日
报告期末基金份额总额	523, 727, 358. 23份
投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略 2、固定收益类资产投资策略： 1) 持有到期策略；2) 利率预期策略；3) 收益率曲线策略；4) 类属替换策略；5) 个券优先策略；6) 信用债券投资策略；7) 可转债及可交换债投资策略 3、资产支持证券投资策略 4、股票投资策略 5、现金头寸管理
业绩比较基准	基准指数 = 中债综合全价（总值）指数收益率 × 80% + 沪深300指数收益率 × 10% + 金融机构人

	人民币活期存款基准利率（税后）×10%
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、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。
基金管理人	华安证券股份有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

### § 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10月01日 - 2021年12月31日）
1. 本期已实现收益	4,977,060.81
2. 本期利润	6,317,319.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0129
4. 期末基金资产净值	534,359,433.10
5. 期末基金份额净值	1.0203

#### 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	1.28%	0.02%	0.66%	0.08%	0.62%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.03%	0.03%	0.41%	0.09%	1.62%	-0.06%

##### 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



## § 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		
樊艳	基金经理	2017-12-14	-	17年	-
张钰	基金经理	2020-06-02	-	5年	-

### 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、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，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。在本报告期内，基金运作合法合规，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

2021年国内经济方面，出口表现亮眼，国内疫情零星爆发，居民收入增速平稳，消费对经济增速贡献相对有限，房地产投资增速回落，房地产对经济贡献有所下降；全年货币政策整体保持宽松，债券市场小幅走牛，收益率震荡下行。2022年，疫情对全球经济仍将产生影响，但随着疫苗接种率提升各国对疫情的应对能力将增强，新兴经济体生产能力可能逐步恢复，出口数据或弱于21年，市场对美联储2022年下半年加息预期有所加强，但国内货币和财政政策仍有放松空间，预计债券收益率仍有一定下行空间。报告期内，本基金根据市场情况调整资产结构和组合久期，适当运用杠杆，提高组合收益。

### 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六个月持有债券基金份额净值为1.0203元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.28%，同期业绩比较基准收益率为0.66%。

### 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	839,057.77	0.15
	其中：股票	839,057.77	0.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	473,024,840.70	83.70

	其中：债券	473,024,840.70	83.70
	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	74,042,403.50	13.10
	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	7,387,680.55	1.31
8	其他资产	9,852,990.69	1.74
9	合计	565,146,973.21	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	283,544.72	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,450.00	0.00
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	553,063.05	0.10
J	金融业	-	-
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	839,057.77	0.16

### 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	600845	宝信软件	8,000	486,640.00	0.09
2	002245	蔚蓝锂芯	5,000	137,550.00	0.03
3	603866	桃李面包	3,000	85,200.00	0.02
4	300031	宝通科技	2,411	66,423.05	0.01
5	002991	甘源食品	500	38,150.00	0.01
6	300505	川金诺	523	16,024.72	0.00
7	301090	华润材料	500	6,620.00	0.00
8	603176	N汇通	1,000	2,450.00	0.00

### 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	69,238,490.00	12.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	213,949,790.00	40.04
5	企业短期融资券	140,091,000.00	26.22
6	中期票据	40,536,000.00	7.59
7	可转债（可交换债）	9,209,560.70	1.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	473,024,840.70	88.52

### 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	136042	15渝信02	339,000	33,225,390.00	6.22
2	012103480	21鲁钢铁SCP026	300,000	30,021,000.00	5.62
3	102100455	21淮北建投MTN002	200,000	20,522,000.00	3.84
4	143171	17杭旅02	200,000	20,188,000.00	3.78
5	019654	21国债06	200,000	20,006,000.00	3.74
6	012180050	21深圳特发SCP003	200,000	20,006,000.00	3.74

**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**

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 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。

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	9,847.44
2	应收证券清算款	-



3	应收股利	-
4	应收利息	8,787,453.25
5	应收申购款	1,055,690.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,852,990.69

#### 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	132009	17中油EB	1,044,800.00	0.20
2	132018	G三峡EB1	559,600.00	0.10
3	128138	侨银转债	518,938.64	0.10
4	113017	吉视转债	464,320.00	0.09
5	113037	紫银转债	434,120.00	0.08
6	113042	上银转债	422,120.00	0.08
7	127003	海印转债	357,765.00	0.07
8	123076	强力转债	330,675.00	0.06
9	127034	绿茵转债	320,100.00	0.06
10	128083	新北转债	235,002.00	0.04
11	128127	文科转债	225,010.00	0.04
12	123056	雪榕转债	217,834.00	0.04
13	128132	交建转债	217,644.00	0.04
14	127028	英特转债	188,059.50	0.04
15	113589	天创转债	183,321.60	0.03
16	128026	众兴转债	182,902.62	0.03
17	113608	XD威派转	159,445.00	0.03
18	113601	塞力转债	156,912.00	0.03
19	123100	朗科转债	136,643.00	0.03
20	123107	温氏转债	134,948.00	0.03
21	128135	洽洽转债	131,478.00	0.02
22	113588	润达转债	125,920.00	0.02
23	128087	孚日转债	118,959.00	0.02

24	128139	祥鑫转债	116,949.00	0.02
25	123049	维尔转债	116,204.00	0.02
26	123117	健帆转债	116,202.00	0.02
27	113563	柳药转债	115,950.00	0.02
28	123010	博世转债	111,831.00	0.02
29	127016	鲁泰转债	111,561.00	0.02
30	113044	大秦转债	109,440.00	0.02
31	123004	铁汉转债	109,417.00	0.02
32	128124	科华转债	109,292.00	0.02
33	113021	中信转债	108,370.00	0.02
34	110072	广汇转债	102,150.00	0.02
35	113596	城地转债	98,350.00	0.02
36	123109	昌红转债	95,075.40	0.02
37	128037	岩土转债	91,360.00	0.02
38	123099	普利转债	72,321.50	0.01
39	113036	宁建转债	71,675.10	0.01
40	128145	日丰转债	71,433.00	0.01
41	128107	交科转债	66,921.64	0.01
42	113542	好客转债	64,284.60	0.01
43	128130	景兴转债	64,271.50	0.01
44	127017	万青转债	63,322.50	0.01
45	128042	凯中转债	58,606.50	0.01
46	113519	长久转债	55,710.00	0.01
47	113532	海环转债	55,560.00	0.01
48	113578	全筑转债	53,375.00	0.01
49	113033	利群转债	44,220.00	0.01
50	113600	新星转债	41,004.00	0.01
51	113599	嘉友转债	25,080.00	0.00
52	123064	万孚转债	23,106.60	0.00

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	436,043,166.22
报告期期间基金总申购份额	122,720,287.55
减：报告期期间基金总赎回份额	35,036,095.54
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	523,727,358.23

截至报告期末，本公司从业人员及配偶持有华安证券合赢六个月持有14,254,413.30份。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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、华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- 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

2022年01月24日