

# 华安合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划

## 2021 年年度报告

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

送出日期:2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

华安证券股份有限公司的董事会、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。本年度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。

集合资产管理计划托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2022年3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。

华安证券股份有限公司承诺以诚实信用、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。

集合资产管理计划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集合计划的招募说明书及其更新。

本报告期自2021年08月16日起至2021年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	3
1.1 重要提示	3
1.2 目录	4
§2 基金简介	7
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19

7.3 所有者权益 ( 基金净值 ) 变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
8.6 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	50
8.7 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	51
8.8 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	51
8.9 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	51
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
8.12 投资组合报告附注	51
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
9.3 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情况	55
§10 开放式基金份额变动	55
§11 重大事件揭示	55
11.1 基金份额持有人大会决议	55
11.2 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	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4 基金投资策略的改变	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	56
§12 影响投资者决策的其他重要信息	57
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	57
§13 备查文件目录	57
13.1 备查文件目录	57
13.2 存放地点	58
13.3 查阅方式	58



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划
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
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
报告期末基金份额总额	523, 727, 358. 23份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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	本集合计划在严格控制投资风险和保持资产合理流动性的前提下，通过审慎的投资管理提高固定收益类资产收益，积极运用新股申购等方式增厚产品收益。
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。

### 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	华安证券股份有限公司	中国光大银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	徐玉红	石立平
	联系电话	0551-65161962	010-63639180
	电子邮箱	402072670@qq.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95318	95595
传真		0551-65161859	010-63639132
注册地址		安徽省合肥市政务区天鹅湖 路198号	北京市西城区太平桥大街25 号、甲25号中国光大中心
办公地址		安徽省合肥市政务区天鹅湖 路198号	北京市西城区太平桥大街25 号中国光大中心
邮政编码		230081	100033
法定代表人		章宏韬	李晓鹏

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hazq.com">http://www.hazq.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦13楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元



<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	本期2021年08月16日（基金合同生效日）- 2021年12月31日
本期已实现收益	8,210,544.14
本期利润	8,747,781.01
加权平均基金份额本期利润	0.0197
本期加权平均净值利润率	1.94%
本期基金份额净值增长率	2.03%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末
期末可供分配利润	9,775,615.99
期末可供分配基金份额利润	0.0187
期末基金资产净值	534,359,433.10
期末基金份额净值	1.0203
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末
基金份额累计净值增长率	2.03%

### 3.2 基金净值表现

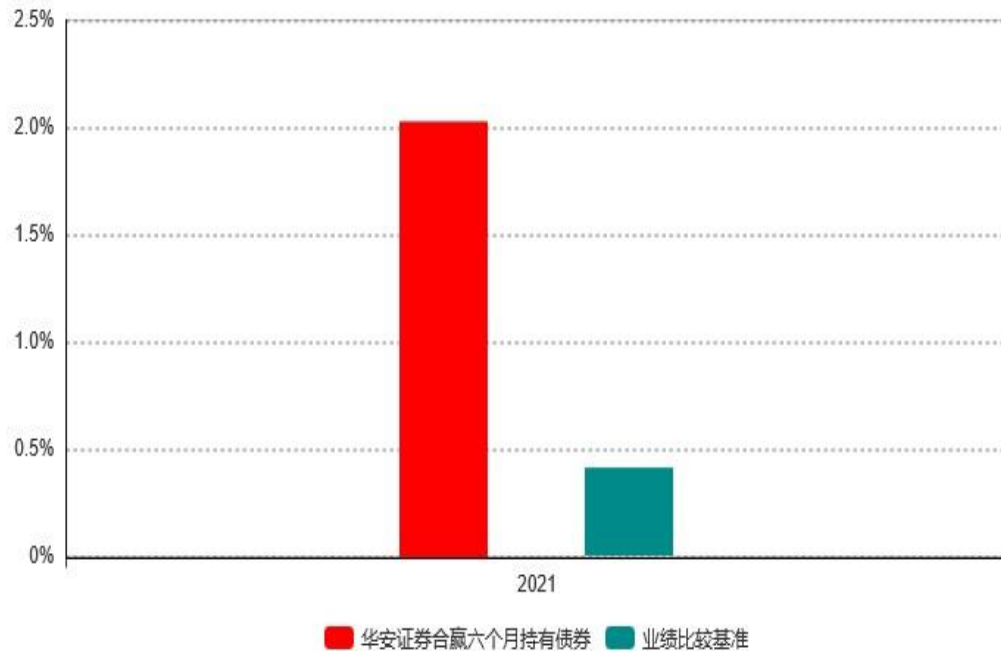
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

## § 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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理人员视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 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

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。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。

#### 4.4.2 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2.03%，同期业绩比较基准收益率为0.41%。

#### 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；国内经济稳字当头，政策更趋温和；市场对美联储2022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，预计全年债券收益率波动幅度加大。本基金将依据经济和市场的变化调整组合杠杆水平和久期，信用债维持中高信用等级策略，动态调整可转债仓位、精选个券。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。

合规管理方面，面对新形势新挑战，公司紧跟最新法律法规要求，贯彻落实最新监管精神，通过合规审查、合规检查、合规咨询等多项措施，压实合规职责，提升内控质量，严格防范公募资管业务可能出现的各类合规风险；以风险为导向实施差异化管理，对资管业务核心环节重点关注，加强合规检查，强化问题整改落实。同时，为提升员工合规意识，持续开展线上线下全方位、多角度的合规培训，如新员工合规培训、专项合规培训、法制专题宣传等，严把新员工入职的合规意识，并持续在员工执业过程中加强传导各项法律法规和监管政策精神，将合规文化贯穿于公司和每位员工的业务开展环节。

风险管理方面，公司风险管理部立足二道防线职责定位，对公募资管业务进行开展风险审核、风险查询、风险检查等工作，对公募资管业务各个相关环节进行覆盖，确保公募资管业务符合公司风险偏好。

稽核方面，公司稽核部对资产管理业务不定期开展常规稽核工作，通过实施询问、观察、检查、核对、分析性复核等必要的稽核程序，以监督、评价公司资产管理业务的经营业绩、内控制度的建立与执行、合规风控管理等情况。此外，稽核部每年度定期开展公司层面内部控制评价工作和合规管理有效性评估工作，检查范围包括资产管理业务内部控制情况、产品设计、投资者保护、推广募集、投资运作、投资顾问、估值核算、信息披露和公平交易等内容，不断提高资管业务内部控制和合规管理水平，加强稽核监督力量。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建

立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

否

#### 4.10 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

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 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

#### 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。

该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划2021年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天职业字[2022]9791号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划(以下简称“华安证券合赢六个月持有债券”)财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表、2021年8月16日(集合计划合同生效日)至2021年12月31日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表,以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照附注1.4.2的规定编制,公允反映了华安证券合赢六个月持有债券2021年12月31日的财务状况以及2021年8月16日(集合计划合同生效日)至2021年12月31日止的经营成果和基金净值变动情况</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行

	<p>了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安证券合赢六个月持有债券，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>华安证券合赢六个月持有债券管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华安证券合赢六个月持有债券管理人华安证券股份有限公司（以下简称“管理人”）负责按照附注1.4.2的规定编制财务报表，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理人管理层负责评估华安证券合赢六个月持有债券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理人管理层计划清算华安证券合赢六个月持有债券、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平</p>



的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

1. 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。
2. 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。
3. 评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。
4. 对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对华安证券合赢六个月持有债券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致华安证券合赢六个月持有债券不能持续经营。
5. 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）		
注册会计师的姓名	丁启新	户永红	周任阳
会计师事务所的地址	上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦13楼		
审计报告日期	2022-03-20		

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	6,423,589.12
结算备付金		964,091.43
存出保证金		9,847.44
交易性金融资产	7.4.7.2	473,863,898.47
其中：股票投资		839,057.77
基金投资		-
债券投资		473,024,840.70
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	74,042,403.50
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	8,787,453.25
应收股利		-
应收申购款		1,055,690.00
递延所得税资产		-

其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		565,146,973.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		27,997,360.00
应付证券清算款		1,012,273.98
应付赎回款		770,470.01
应付管理人报酬		687,793.04
应付托管费		44,360.89
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	42,216.67
应交税费		45,948.62
应付利息		-8,974.92
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	196,091.82
负债合计		30,787,540.11
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	523,727,358.23
未分配利润	7.4.7.10	10,632,074.87
所有者权益合计		534,359,433.10
负债和所有者权益总计		565,146,973.21

## 7.2 利润表

会计主体：华安合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年08月16日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
<b>一、收入</b>		11,113,422.45
1. 利息收入		8,195,158.29
其中：存款利息收入	7.4.7.11	48,770.82
债券利息收入		6,197,400.20
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,948,987.27
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,381,027.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	154,371.82
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	2,226,655.47
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	537,236.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	-
<b>减：二、费用</b>		2,365,641.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,704,750.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	170,475.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.20	56,340.79
5. 利息支出		215,117.38
其中：卖出回购金融资产支出		215,117.38

6. 税金及附加		19,156.86
7. 其他费用	7.4.7.21	199,800.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,747,781.01
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,747,781.01

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31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）	290,153,354.30	86,693.32	290,240,047.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,747,781.01	8,747,781.01
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）	233,574,003.93	1,797,600.54	235,371,604.47
其中：1. 基金申购款	310,825,932.50	2,356,350.42	313,182,282.92
2. 基金赎回款	-77,251,928.57	-558,749.88	-77,810,678.45
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）	523,727,358.23	10,632,074.87	534,359,433.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

章宏韬

龚胜昔

许琼

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由华安理财合赢12号债券型集合资产管理计划变更而来。华安理财合赢12号债券型集合资产管理计划由华安理财合赢12号债券分级集合资产管理计划变更而来（以下简称“原集合计划”）。

原集合计划管理人为华安证券股份有限公司，托管人为中国光大银行股份有限公司，原集合计划为限定性集合资产管理计划。原集合计划2013年5月15日开始募集，2013年5月24日结束募集，2013年5月29日成立，并于2013年6月5日取得中国证券业协会出具的《关于华安证券股份有限公司发起设立华安理财合赢12号债券分级集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]595号）。

根据中国证监会发布的《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》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更，本集合计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将本集合计划名称变更为“华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自本集合计划管理人公告的生效之日起生效。

本集合计划自本资产管理合同生效日起，存续期不得超过3年，本集合计划自本资产管理合同生效日起3年后，按照中国证监会有关规定

本集合计划为公募债券型集合资产管理计划。

变更后本集合计划为契约型开放式，本集合计划每个开放日开放申购，但本集合计划对集合计划份额持有人持有的集合计划份额均设置6个月的最短持有期限。在最短持有期限内，集合计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），集合计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。

**投资范围：**

包括债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%，投资于可交换债券、可转换债券的比例不超过集合计划资产的20%，投资于股票等资产的比例合计不超过集合计划资产的20%，本集合计划每个交易日日终，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在1年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%。

业绩比较基准： $\text{基准指数} = \text{中债综合全价（总值）指数收益率} \times 80\% + \text{沪深300指数收益率} \times 10\% + \text{金融机构人民币活期存款基准利率（税后）} \times 10\%$

**7.4.2 会计报表的编制基础**

本集合计划财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本集合计划财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

**7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本集合计划编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本集合计划2021年12月31日的财务状况以及2021年8月16日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。

**7.4.4 重要会计政策和会计估计**

**7.4.4.1 会计年度**

本集合计划的会计年度为公历1月1日至12月31日止。本集合计划本期的会计年度为2021年8月16日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日。

**7.4.4.2 记账本位币**

本集合计划核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

#### 7.4.4.3 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集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划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。

本集合计划目前以交易目的持有的债券投资、股票投资等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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划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。本集合计划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。本集合计划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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本集合计划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和金融负债，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已宣告但尚未发放的现金股利、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和金融负债，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，且本集合计划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；（3）该金融资产已转移，虽然本集合计划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。

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。



#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划计价持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具（主要为权证投资）等按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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，计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人可根据具体情况与计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

同时满足下列条件的，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额在扣除损益平准金分摊部分后所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于本集合计划申购确认日及本集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括本集合计划转换所引起的转入本集合计划的实收基金增加和转出本集合计划的实收基金减少。

每份集合计划份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的集合计划份额总额。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在集合计划份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

收入是本集合计划在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集合计划、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

基金红利收入按基金公司宣告的分红比例计算的金额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算本集合计划持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按本集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本集合计划投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为本集合计划费用计入当年损益。

本集合计划的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认。

本集合计划的其他费用如不影响估值日本集合计划份额净值小数点后第四位，发生时直接计入本集合计划损益；如果影响本集合计划份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入本集合计划损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一计划份额享有同等的分配权；当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；分配收益后每份额净值不能低于发行面值；分红后集合计划总份额不得超过最高规模限制；在符合上述分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为12次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的10%，若本集合计划合同生效不满3个月可不进行收益分配。

？

分配方案由管理人拟定，包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由托管人核实后确定，通过管理人网站和推广网点通告委托人。

本集合计划的收益分配包括现金分红和红利再投资两种方式。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红。若投资者选择现金红利转换为集合计划份额进行再投资的，再投资份额以红利再投日为登记日，且需满足持有期的规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

本报告期间本集合计划无需说明的外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

无。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期间本集合计划无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期间本集合计划无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间本集合计划无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

##### 增值税及附加税金

根据财政部和国家税务总局《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号），自2018年1月1日起，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。此外，应按照增值税的7%计算城市建设维护税，按增值税的3%计算教育费附加，地方教育附加应按照本集合计划管理人所在地税务机关规定的比例计算。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

?

##### 所得税

本集合计划非所得税纳税主体。资产管理计划份额持有人从资产管理计划中获得的各项收益，由资产管理计划份额持有人根据国家的法律法规，自行申报并履行纳税义务。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
活期存款	6,423,589.12
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	6,423,589.12

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		400,788.75	839,057.77	438,269.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	274,682,252.71	277,078,840.70	2,396,587.99
	银行间市场	195,617,870.00	195,946,000.00	328,130.00
	合计	470,300,122.71	473,024,840.70	2,724,717.99
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		470,700,911.46	473,863,898.47	3,162,987.01

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本集合计划未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	74,042,403.50	-
银行间市场	-	-
合计	74,042,403.50	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本集合计划未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	3,487.70
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	477.18
应收债券利息	8,686,414.05
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	97,069.48
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	4.84
合计	8,787,453.25

7.4.7.6 其他资产

本报告期末，本集合计划未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	40,679.17
银行间市场应付交易费用	1,537.50
合计	42,216.67

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	-
预提费用	174,900.00
其他应付	21,191.82
合计	196,091.82

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	290,153,354.30	290,153,354.30
本期申购	310,825,932.50	310,825,932.50
本期赎回（以“-”号填列）	-77,251,928.57	-77,251,928.57
本期末	523,727,358.23	523,727,358.23

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-439.44	87,132.76	86,693.32
本期利润	8,210,544.14	537,236.87	8,747,781.01
本期基金份额交易产生的变动数	1,565,511.29	232,089.25	1,797,600.54
其中：基金申购款	2,095,879.84	260,470.58	2,356,350.42
基金赎回款	-530,368.55	-28,381.33	-558,749.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,775,615.99	856,458.88	10,632,074.87

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	44,234.31
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,536.51
其他	-
合计	48,770.82

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	237,210.00
减：卖出股票成本总额	82,838.18
买卖股票差价收入	154,371.82

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期间本集合计划无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本报告期间本集合计划无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日



债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	2, 226, 655. 47
债券投资收益——赎回差价 收入	-
债券投资收益——申购差价 收入	-
合计	2, 226, 655. 47

**7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转 股及债券到期兑 付）成交总额	95, 498, 430. 90
减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	91, 079, 223. 99
减：应收利息总额	2, 192, 551. 44
买卖债券差价收入	2, 226, 655. 47

**7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本报告期间本集合计划无债券投资收益--赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

本报告期间本集合计划无债券投资收益--申购差价收入。

**7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

本报告期间本集合计划无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

本报告期间本集合计划无贵金属投资收益。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

本报告期间本集合计划无衍生工具收益。

**7.4.7.17 股利收益**

本报告期间本集合计划无股利收益。

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	537,236.87
——股票投资	-188,395.80
——债券投资	725,632.67
——资产支持证券投资	-
——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	537,236.87

**7.4.7.19 其他收入**

本报告期间本集合计划无其他收入。

**7.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31

	日
交易所市场交易费用	54,153.29
银行间市场交易费用	2,187.50
合计	56,340.79

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	31,200.00
信息披露费	150,000.00
证券出借违约金	-
帐户维护费	18,300.00
其他	300.00
合计	199,800.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本报告期末本集合计划不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本集合计划报告报出日，本集合计划不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安证券股份有限公司	本集合计划的设立人和管理人
中国光大银行股份有限公司	本集合计划的托管人

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华安证券股份有限公司	237,210.00	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华安证券股份有限公司	132,907,613.00	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华安证券股份有限公司	1,555,575,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比例		额的比例
华安证券股份有限公司	175,398.58	100.00%	40,679.17	100.00%

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,704,750.72
其中：支付销售机构的客户维护费	-

①本集合计划各类份额的管理费皆按前一日该类集合计划资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div 365$$

H为各类份额每日应计提的集合计划管理费；E为该类份额前一日的集合计划资产净值。

②计提方式与支付方式：管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。由托管人根据管理人的指令于次月5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。

当集合计划份额的累计净值低于份额面值时，基于对投资者权益的保护，管理人将不计提管理费。当集合计划份额累计净值超过份额面值当日开始，管理人恢复计提管理费。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	170,475.69

①本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div 365$$

H为每日集合计划应计提的托管费；E为前一日集合计划资产净值。

②计提方式与支付方式：托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。由托管人根据管理人的指令于次月5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本报告期间本集合计划无销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期间本集合计划未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期间本集合计划未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期间本集合计划未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期间本集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

##### 7.4.10.5.2 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

本报告期末，除管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

#### 7.4.10.6 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08月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大 银行股份	6,423,589.12	44,234.31

有限公司		
------	--	--

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期本集合计划未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本报告期本集合计划无其他关联交易事项的说明。

**7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金**

根据本集合计划合同的相关规定，结合本集合计划实际运作情况，本报告期末本集合计划未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末本集合计划未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本报告期末本集合计划未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本报告期末本集合计划未持有银行间市场债券正回购。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

**7.4.13 金融工具风险及管理**

本集合计划为公募混合型集合资产管理计划。可能投资股票资产，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险，在市场大幅上涨时也不能保证集合计划净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。本集合计划投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资。

本集合计划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信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划的基金管理人从事风险管理的主要目的是在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本集合计划的基金管理人对于金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险发生的可能损失。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。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，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。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划的管理人建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的集合计划财产和集合计划管理人的财产相互独立，对所管理的不同集合计划分别管理，分别记账，进行证券投资。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指本集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者本集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致本集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。集合计划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；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。

本集合计划应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

于本报告期末，本集合计划未持有资产支持证券。

本集合计划债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日
A-1	10,023,000.00
A-1以下	-
未评级	162,056,000.00
合计	172,079,000.00



短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中未评级债券主要为国债、政策性金融债、超短期融资券及同业存单等。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本集合计划均未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本集合计划均未持有短期信用评级的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日
AAA	131,759,868.00
AAA以下	121,779,482.70
未评级	47,406,490.00
合计	300,945,840.70

长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中未评级债券主要包含国债和政策性金融债等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本集合计划未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本集合计划未持有长期信用评级的同业存单。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括集合计划出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

在本集合计划出现巨额赎回情形下，集合计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本集合计划

单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，集合计划管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的股票、债券和货币市场工具等，同时本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2021年12月 31日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	6,423,589.12	-	-	-	-	6,423,589.12
结算备付金	964,091.43	-	-	-	-	964,091.43
存出保证金	9,847.44	-	-	-	-	9,847.44
交易性金融资产	20,190,059.50	38,504,505.50	223,811,155.00	142,813,933.30	47,705,187.40	473,024,840.70
买入返售金融资产	74,042,403.50	-	-	-	-	74,042,403.50
资产总计	101,629,990.99	38,504,505.50	223,811,155.00	142,813,933.30	47,705,187.40	554,464,772.19
负债	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	28,000,000.00	-	-	-	-	28,000,000.00
负债总计	28,000,000.00	-	-	-	-	28,000,000.00
流动性净额	73,629,990.99	38,504,505.50	223,811,155.00	142,813,933.30	47,705,187.40	526,464,772.19

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划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集合计划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时间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。

本集合计划的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本集合计划对债券的投资比例不低于集合计划资产的80%，投资于可交换债券、可转换债券的比例不超过集合计划资产的20%，投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的20%；

(2) 本集合计划每个交易日日终，保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本集合计划持有一家发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

(4) 本集合计划管理人管理的全部公募型集合计划持有一家发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

(5) 本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的10%；

(7) 本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的20%；

(8) 本集合计划持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

(9) 本集合计划管理人管理的全部集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(10) 本集合计划应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(11) 本集合计划资产总值不得超过集合计划净资产的140%；

(12) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等集合计划管理

人之外的因素致使集合计划不符合前款所规定比例限制的，集合计划管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(13) 本集合计划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的，可接受质押品的资质要求应当与集合计划合同约定的投资范围保持一致；

(14) 本管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合计划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30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本集合计划投资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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,423,589.12	-	-	-	-	-	6,423,589.12
结算备付金	964,091.43	-	-	-	-	-	964,091.43
存出保证金	9,847.44	-	-	-	-	-	9,847.44
交易性金融资产	20,306,009.50	38,298,124.50	223,811,155.00	142,697,983.30	47,911,568.40	839,057.77	473,863,898.47
买入返售金融	74,042,403.50	-	-	-	-	-	74,042,403.50

华安合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划 2021 年年度报告

资产							
应收利息	-	-	-	-	-	8,787,453.25	8,787,453.25
应收申购款	-	-	-	-	-	1,055,690.00	1,055,690.00
资产总计	101,745,940.99	38,298,124.50	223,811,155.00	142,697,983.30	47,911,568.40	10,682,201.02	565,146,973.21
负债							
卖出回购金融资产款	27,997,360.00	-	-	-	-	-	27,997,360.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,012,273.98	1,012,273.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	770,470.01	770,470.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	687,793.04	687,793.04
应付托管费	-	-	-	-	-	44,360.89	44,360.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	42,216.67	42,216.67
应交税费	-	-	-	-	-	45,948.62	45,948.62
应付利息	-	-	-	-	-	-8,974.92	-8,974.92
其他负债	-	-	-	-	-	196,091.82	196,091.82
负债总计	27,997,360.00	-	-	-	-	2,790,180.11	30,787,540.11
利率敏感度缺口	73,748,580.99	38,298,124.50	223,811,155.00	142,697,983.30	47,911,568.40	7,892,020.91	534,359,433.10

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响，对其他会计科目的影响可忽略。	
假设	2. 基金组合对利率的风险暴露，根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到，债券凸性对组合净值的影响可忽略。	
假设	3. 市场即期利率曲线平行变动。	
假设	4. 基金组合构成和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：人民币元）
		本期末

	2021年12月31日	
市场利率下降25个基点		1,736,378.83
市场利率上升25个基点		-1,736,378.83

#### 7.4.13.4.2 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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	839,057.77	0.16
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	473,024,840.70	88.52
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	473,863,898.47	88.68

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本集合计划无其他价格风险的敏感性分析。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为277,917,898.47元，属于第二层次的余额为195,946,000.00元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	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	其他各项资产	9,852,990.69	1.74
9	合计	565,146,973.21	100.00

## 8.2 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

### 8.3 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

金额单位：人民币元

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	汇通集团	1,000	2,450.00	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300031	宝通科技	70,811.07	0.01
2	300505	川金诺	23,095.68	0.00
3	301090	华润材料	5,225.00	0.00
4	603176	汇通集团	1,700.00	0.00

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600845	宝信软件	127,000.00	0.02
2	002245	蔚蓝锂芯	110,210.00	0.02

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,925.00
卖出股票收入（成交）总额	237,210.00

#### 8.5 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	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

#### 8.6 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	136042	15渝信02	339,000	33,225,390.00	6.22

2	012103480	21鲁钢铁SCP0 26	300,000	30,021,000.0 0	5.62
3	102100455	21淮北建投MT N002	200,000	20,522,000.0 0	3.84
4	143171	17杭旅02	200,000	20,188,000.0 0	3.78
5	019654	21国债06	200,000	20,006,000.0 0	3.74
6	012180050	21深圳特发SC P003	200,000	20,006,000.0 0	3.74

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 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。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，** 深圳市特区建设发展集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会、中国证券监督管理委员会深圳监管局、深圳市交通运输局、深圳市龙岗区水务局的处罚；东北证券在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会山东监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,852,990.69

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002991	甘源食品	38,150.00	0.01	新股未上市
2	301090	华润材料	6,620.00	0.00	新股未上市

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
3,755	139,474.66	2,640,122.10	0.50%	521,087,236.13	99.50%

#### 9.2 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	14, 191, 435. 50	2. 71%
------------------	------------------	--------

### 9.3 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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年08月16日)基金份额总额	271, 402, 808. 32
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	310, 825, 932. 50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	58, 501, 382. 59
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	523, 727, 358. 23

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开份额持有人大会。

### 11.2 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

本报告期内，华安证券股份有限公司根据工作需要，于2021年12月13日，任命陈飞宇先生担任本基金管理人的资产管理总部总经理，主持资产管理总部相关工作。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为31,200元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
华安证券	3	237,210.00	100.00%	175,398.58	100.00%	-

#### 11.7.2 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华安证券	132,907,613.00	100.00%	1,555,575,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 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	华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-08-10
2	华安证券合赢六个月持有期	规定媒介	2021-08-10



	债券型集合资产管理计划托管协议		
3	华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划基金合同	规定媒介	2021-08-10
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	规定媒介	2021-08-10
5	华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划合同生效公告	规定媒介	2021-08-16
6	关于增加上海陆金所基金销售有限公司为华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划代销机构的公告	规定媒介	2021-08-16
7	华安证券合赢六个月持有债券基金净值日报2021-11-12更正公告	规定媒介	2021-11-12
8	华安证券股份有限公司华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	规定媒介	2021-12-30

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号。

### 13.3 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  
二〇二二年三月三十一日