

# 华安年年红定期开放债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| <b>1 重要提示及目录</b>                        | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b>                           | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b>                          | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 10 |
| 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             | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13 |
| 4.8 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 |
| <b>5 托管人报告</b>                          | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | 15 |
| 6.1 资产负债表                               | 15 |
| 6.2 利润表                                 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 17 |
| 6.4 报表附注                                | 19 |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 44 |
| 7.3 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       | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 45 |
| 7.6 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      | 45 |
| 7.7 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   | 46 |
| 7.8 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   | 46 |
| 7.9 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      | 46 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 46 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 46 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 48 |

|           |                                     |           |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 8.2       | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 48        |
| 8.3       | 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的情况 ..... | 48        |
| <b>9</b>  | <b>开放式基金份额变动 .....</b>              | <b>49</b> |
| <b>10</b> | <b>重大事件揭示 .....</b>                 | <b>49</b> |
| 10.1      | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 49        |
| 10.2      | 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 .....   | 49        |
| 10.3      | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 49        |
| 10.4      | 基金投资策略的改变 .....                     | 49        |
| 10.5      | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 49        |
| 10.6      | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 49        |
| 10.7      | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 50        |
| 10.8      | 其他重大事件 .....                        | 53        |
| <b>11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>54</b> |
| <b>12</b> | <b>备查文件目录 .....</b>                 | <b>54</b> |
| 12.1      | 备查文件目录 .....                        | 54        |
| 12.2      | 存放地点 .....                          | 55        |
| 12.3      | 查阅方式 .....                          | 55        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称            | 华安年年红定期开放债券型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 华安年年红债券            |                 |
| 基金主代码           | 000227             |                 |
| 交易代码            | 000227             |                 |
| 基金运作方式          | 契约性开放式             |                 |
| 基金合同生效日         | 2013 年 11 月 14 日   |                 |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司         |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 171,848,322.13 份   |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安年年红债券 A          | 华安年年红债券 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 000227             | 001994          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 139,654,011.19 份   | 32,194,310.94 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金主要投资于固定收益品种，在合理控制信用风险的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响债券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的各种数量模型工具，分析和比较不同债券品种和具体债券工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的价值增长和套利的机会，以确定基金资产在利率类固定收益品种（国债、央行票据等）和信用类固定收益品种之间的配置比例。同时结合基金的封闭运作期限和现金流预测调整债券组合的平均久期,决定投资品种。 |
| 业绩比较基准 | 同期一年期定期存款收益率（税后）+1.2%  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。  |

### 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          |      | 华安基金管理有限公司           | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨牧云                  | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38969999         | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | service@huaan.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008850099           | 95588               |

|       |                                 |                 |
|-------|---------------------------------|-----------------|
| 传真    | 021-68863414                    | 010-66105798    |
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 邮政编码  | 200120                          | 100140          |
| 法定代表人 | 朱学华                             | 陈四清             |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                         |
|---------------------|-------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                    |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn        |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                    |
|--------|------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 华安基金管理有限公司 | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2022年1月1日至2022年6月30日） |               |
|---------------|---------------------------|---------------|
|               | 华安年年红债券 A                 | 华安年年红债券 C     |
| 本期已实现收益       | 3,042,529.60              | 327,133.17    |
| 本期利润          | 2,741,672.25              | 285,486.29    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0097                    | 0.0072        |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.93%                     | 0.69%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.87%                     | 0.67%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日)          |               |
|               | 华安年年红债券 A                 | 华安年年红债券 C     |
| 期末可供分配利润      | 1,640,890.55              | 222,992.92    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0117                    | 0.0069        |
| 期末基金资产净值      | 146,133,194.29            | 33,530,053.33 |

|              |                       |           |
|--------------|-----------------------|-----------|
| 期末基金份额净值     | 1.046                 | 1.041     |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |           |
|              | 华安年年红债券 A             | 华安年年红债券 C |
| 基金份额累计净值增长率  | 69.47%                | 30.72%    |

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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4)自 2015 年 12 月 15 日起，本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。详情请参阅相关公告。

### 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

华安年年红债券 A

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.38%    | 0.10%       | 0.22%      | 0.01%         | 0.16%  | 0.09% |
| 过去三个月      | 0.58%    | 0.08%       | 0.67%      | 0.01%         | -0.09% | 0.07% |
| 过去六个月      | 0.87%    | 0.07%       | 1.34%      | 0.01%         | -0.47% | 0.06% |
| 过去一年       | 2.42%    | 0.06%       | 2.70%      | 0.01%         | -0.28% | 0.05% |
| 过去三年       | 16.19%   | 0.15%       | 8.10%      | 0.01%         | 8.09%  | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 69.47%   | 0.17%       | 26.26%     | 0.01%         | 43.21% | 0.16% |

华安年年红债券 C

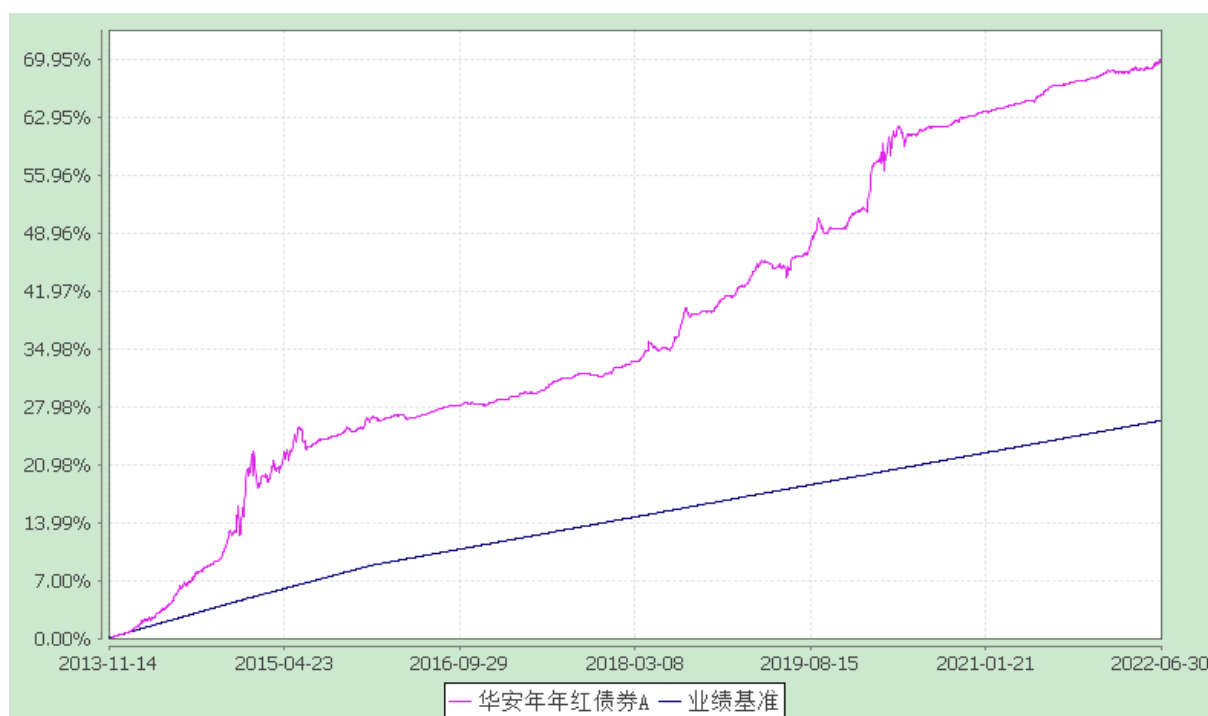
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.29%    | 0.10%       | 0.22%      | 0.01%         | 0.07%  | 0.09% |
| 过去三个月      | 0.48%    | 0.08%       | 0.67%      | 0.01%         | -0.19% | 0.07% |
| 过去六个月      | 0.67%    | 0.07%       | 1.34%      | 0.01%         | -0.67% | 0.06% |
| 过去一年       | 1.94%    | 0.06%       | 2.70%      | 0.01%         | -0.76% | 0.05% |
| 过去三年       | 14.47%   | 0.15%       | 8.10%      | 0.01%         | 6.37%  | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 30.72%   | 0.12%       | 17.76%     | 0.01%         | 12.96% | 0.11% |

注：自 2015 年 12 月 15 日起，本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。详情请参阅相关公告。

### 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

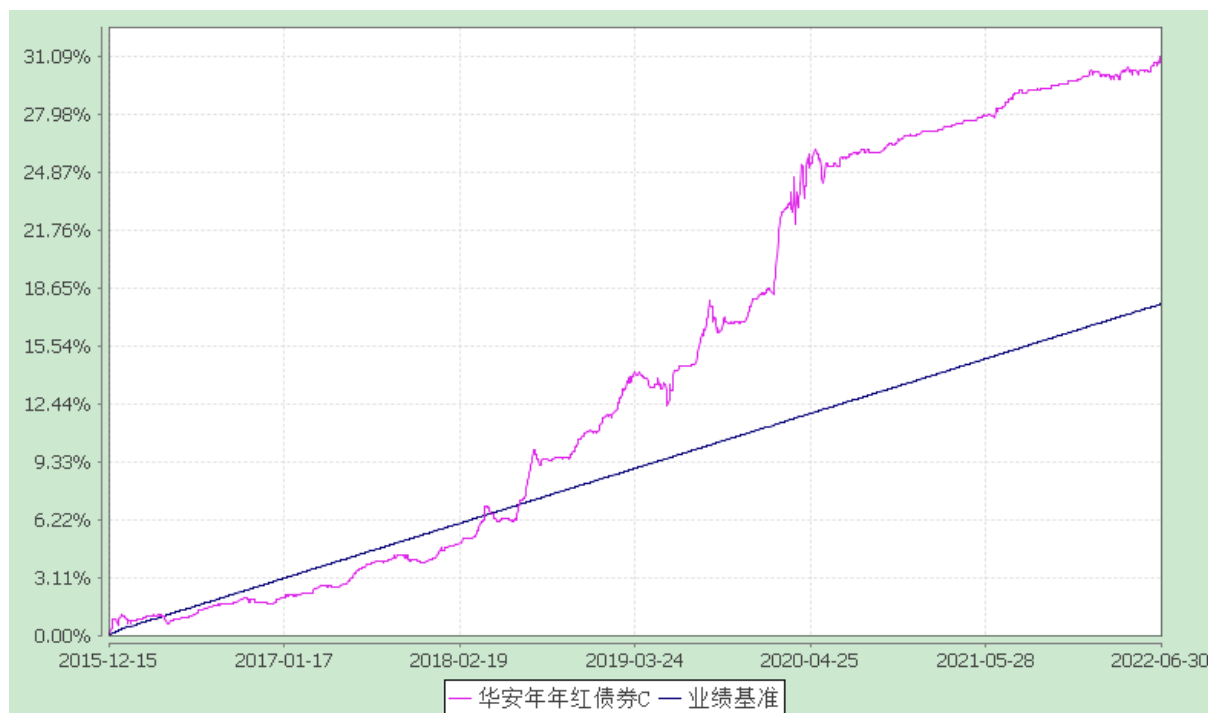
华安年年红定期开放债券型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2013 年 11 月 14 日至 2022 年 6 月 30 日）

华安年年红债券 A



华安年年红债券 C





注：自 2015 年 12 月 15 日起，本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。详情请参阅相关公告。

## 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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2022 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 206 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,985.16 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

|     |          | 理) 期限      |      | 年限   |   |
|-----|----------|------------|------|------|---|
|     |          | 任职日期       | 离任日期 |      |   |
| 周益鸣 | 本基金的基金经理 | 2018-06-08 | -    | 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。 |

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 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 12 次，未出现异常交易。

## 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

上半年，我国宏观经济受到新冠疫情影响，出现了一定程度的下滑。得益于海外市场较为强劲，出口增速仍然保持在较高水平。内需方面，消费场景缺失和居民收入下降导致社会零售增速偏弱，但也看到政策层面已经做了部分对冲，例如汽车购置税减半等。投资方面，分化较大，上半年基建投资增速较去年明显提高，制造业投资增速也受益于经济转型、技术升级和新能源产业链扩张而表现强劲，但房地产投资增速持续下行，对经济形成一定的拖累。

应对突如其来的经济下行，央行提供了较为宽松的金融环境，降低了 LPR 利率，债券市场利率也随之下行，收益率曲线呈现陡峭化下行的态势。可转债市场受到股票市场下跌的影响，整体表现不佳，但是溢价率水平仍然维持在较高的水平，在低利率环境下固收加产品依然谋求权益方面的增厚。

本基金在今年上半年适度控制仓位，保持均衡风格，稳健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 2022 年 6 月 30 日，华安年年红债券 A 份额净值为 1.046 元，C 份额净值为 1.041 元；华安年年红债券 A 份额净值增长率为 0.87%，C 份额净值增长率为 0.67%，同期业绩比较基准增长率为 1.34%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，海外宏观经济可能会出现下行风险。美联储在巨大的通胀压力下，被迫在短期内大幅提高联邦利率，按揭利率随之出现了明显的上升，并影响到了房地产市场的销售，耐用品消费

也出现了较为明显的下滑，加息带来的经济压力已经开始显现。劳动力市场的需求可能会在下半年逐步转弱，部分企业已经开始停止扩招甚至有裁员计划。

国内通胀压力较小，稳增长诉求强于海外，因此货币和财政政策都明显偏宽，5-6 月份的宏观经济在环比上已经出现了较为明显的改善，下半年更需要关注的是改善的幅度和持续性，以及我们如何应对外需的收缩。在国内外宏观经济周期错位的背景下，债券组合会维持哑铃型配置，保持组合久期的弹性，信用债方面以高等级为主，避免过度资质下沉。

可转债市场虽然溢价率整体偏高，但是不同板块之间溢价率差异较大，仍然有一些品种具备较高的风险收益比，值得积极参与。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，每季度末基金份额可供分配利润超过 0.01 元时，本基金至少进行收益分配 1 次，本基金每年收益分配次数最多为 12 次；每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 50%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

本报告期内应分配的金额为 2,406,672.77 元（华安年年红债券 A）、256,509.45 元（华安年年红债券 C）。

本报告期无应分配但尚未实施的利润。

本报告期内实施了 2022 年度的第一次分红，并于期后公告了 2022 年度第二次分红方案。

2022 年度第一次分红，分红方案为：0.060 元/10 份（华安年年红债券 A）、0.060 元/10 份（华安年年红债券 C）。权益登记日及除息日：2022 年 4 月 15 日；现金红利发放日：2022 年 4 月 18 日。

本基金的基金管理人于 2022 年 7 月 11 日发布了 2022 年度第二次分红公告：0.070/10 份（华安年年红债券 A）、0.040 元/10 份（华安年年红债券 C）。权益登记日及除息日：2022 年 7 月 13 日；现金红利发放日：2022 年 7 月 14 日。

#### 4.8 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

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 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，本基金托管人在对华安年年红定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，华安年年红定期开放债券型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安年年红定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安年年红定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 2,016,038.60 元。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安年年红定期开放债券型基金管理有限公司编制和披露的华安年年红定期开放债券型证券投资基金 2022 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安年年红定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            | -                              | -                                |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 2,071,338.52                   | 2,809,099.41                     |
| 结算备付金         |            | 68,448.77                      | 20,465.15                        |
| 存出保证金         |            | 2,871.33                       | 4,532.89                         |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 178,803,181.02                 | 383,534,030.00                   |
| 其中：股票投资       |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 178,803,181.02                 | 383,534,030.00                   |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | 4,603,483.23                     |
| <b>资产总计</b>   |            | <b>180,945,839.64</b>          | <b>390,971,610.68</b>            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                              | 39,974,620.04                    |
| 应付清算款         |            | 853,259.09                     | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 146,006.34                     | 166,367.78                       |
| 应付托管费         |            | 45,212.42                      | 59,417.08                        |
| 应付销售服务费       |            | 15,762.43                      | 17,853.05                        |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 7,230.51                       | 25,764.43                        |

|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 应付利润        |         | -              | -              |
| 递延所得税负债     |         | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 215,121.23     | 515,424.38     |
| 负债合计        |         | 1,282,592.02   | 40,759,446.76  |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 171,848,322.13 | 336,005,941.94 |
| 其他综合收益      |         | -              | -              |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 7,814,925.49   | 14,206,221.98  |
| 净资产合计       |         | 179,663,247.62 | 350,212,163.92 |
| 负债和净资产总计    |         | 180,945,839.64 | 390,971,610.68 |

注：（1）报告截至日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 171,848,322.13 份，其中 A 类基金份额净值 1.046 元，基金份额总额 139,654,011.19 份；C 类基金份额净值 1.041 元，基金份额总额 32,194,310.94 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：华安年年红定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | <b>4,327,354.32</b>                      | <b>37,624,079.72</b>                          |
| 1.利息收入           |          | 155,914.47                               | 40,534,003.35                                 |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 23,921.86                                | 141,144.50                                    |
| 债券利息收入           |          | -  | 36,947,046.66                                 |
| 资产支持证券利息收入       |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入       |          | 131,992.61                               | 3,445,812.19                                  |
| 证券出借利息收入         |          | -  | -   |
| 其他利息收入           |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 4,513,929.10                             | 2,068,929.41                                  |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | -  | -   |
| 基金投资收益           |          | -  | -   |
| 债券投资收益           | 6.4.7.11 | 4,513,929.10                             | 2,068,929.41                                  |



|                            |          |                     |                      |
|----------------------------|----------|---------------------|----------------------|
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.12 | -                   | -                    |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.13 | -                   | -                    |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -                   | -                    |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | -                   | -                    |
| 其他投资收益                     |          | -                   | -                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -342,504.23         | -4,979,152.29        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                   | -                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 14.98               | 299.25               |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | <b>1,300,195.78</b> | <b>7,539,447.94</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2 | 680,328.69          | 4,471,326.60         |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2 | 335,428.42          | 2,478,902.15         |
| 3. 销售服务费                   |          | 102,873.94          | 253,563.96           |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                   | -                    |
| 5. 利息支出                    |          | 57,209.74           | 41,198.12            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 57,209.74           | 41,198.12            |
| 6. 信用减值损失                  |          | -                   | -                    |
| 7.税金及附加                    |          | 14,925.13           | 131,332.46           |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.18 | 109,429.86          | 163,124.65           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>3,027,158.54</b> | <b>30,084,631.78</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>3,027,158.54</b> | <b>30,084,631.78</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                   | -                    |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>3,027,158.54</b> | <b>30,084,631.78</b> |

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期/年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期/年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安年年红定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                              |      |       |       |
|----|---------------------------------|------|-------|-------|
|    | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |      |       |       |
|    | 实收基金                            | 其他综合 | 未分配利润 | 净资产合计 |
|    |                                 |      |       |       |

|  |                 | 收益（若有） |               |                 |
|--|-----------------|--------|---------------|-----------------|
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 336,005,941.94  | -      | 14,206,221.98 | 350,212,163.92  |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 336,005,941.94  | -      | 14,206,221.98 | 350,212,163.92  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -164,157,619.81 | -      | -6,391,296.49 | -170,548,916.30 |
| （一）、综合收益总额                               | -               | -      | 3,027,158.54  | 3,027,158.54    |
| （二）、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）      | -164,157,619.81 | -      | -7,402,416.43 | -171,560,036.24 |
| 其中：1.基金申购款                               | 939,140.36      | -      | 41,190.97     | 980,331.33      |
| 2.基金赎回款                                  | -165,096,760.17 | -      | -7,443,607.40 | -172,540,367.57 |
| （三）、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） | -               | -      | -2,016,038.60 | -2,016,038.60   |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 171,848,322.13  | -      | 7,814,925.49  | 179,663,247.62  |

| 项目                   | 上年度可比期间                         |            |                 |                   |
|----------------------|---------------------------------|------------|-----------------|-------------------|
|                      | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |            |                 |                   |
|                      | 实收基金                            | 其他综合收益（若有） | 未分配利润           | 实收基金              |
| 一、上期期末净资产（基金净值）      | 2,859,075,055.21                | -          | 129,983,238.99  | 2,989,058,294.20  |
| 二、本期期初净资产（基金净值）      | 2,859,075,055.21                | -          | 129,983,238.99  | 2,989,058,294.20  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -2,523,888,738.50               | -          | -114,434,396.96 | -2,638,323,135.46 |
| （一）、综合收益总额           | -                               | -          | 30,084,631.78   | 30,084,631.78     |
| （二）、本期基金             | -2,523,888,738.50               | -          | -110,425,758.87 | -2,634,314,49     |

|  |                   |   |                 |                   |
|--|-------------------|---|-----------------|-------------------|
| 份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）              |                   |   |                 | 7.37              |
| 其中：1.基金申购款                               | 5,894,938.39      | - | 248,600.01      | 6,143,538.40      |
| 2.基金赎回款                                  | -2,529,783,676.89 | - | -110,674,358.88 | -2,640,458,035.77 |
| （三）、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） | -                 | - | -34,093,269.87  | -34,093,269.87    |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 335,186,316.71    | - | 15,548,842.03   | 350,735,158.74    |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安年年红定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]755 号文《关于核准华安年年红定期开放债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2013 年 11 月 14 日生效，首次设立募集规模为 297,880,059.75 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金根据申购费及销售服务费收取方式的不同将基金份额分为 A 类基金份额及 C 类基金份额。对于 A 类基金份额，投资者申购时需缴纳申购费；对于 C 类基金份额，投资者申购时无需缴纳申购费，而从 C 类基金资产中收取销售服务费。

本基金的封闭期由封闭运作期和封闭清算期构成。自基金合同生效日（含）起或自每一个开放期结束之日次日（含）起至一个公历年后对应日（如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日）止的期间为本基金的一个封闭运作期；封闭运作期的最后一日称为支点浮动费率计算基准日。支点浮动费率计算基准日后的不超过五个工作日期间称为封闭清算期。本基金封闭期内不办理申购、赎回等业务。申购与赎回业务的开放期由基金管理人在封闭期结束前公告说明，开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人

可办理基金份额申购、赎回或其他业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及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相关规定。

本基金不从二级市场买入股票，不参与一级市场股票首次公开发行或增发，但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票，本基金应在其可交易之日起的 6 个月内卖出。因上述原因持有的权证，本基金应在其可交易之日起的 1 个月内卖出。

除每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月以外的期间，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，在非开放期，本基金不受该比例的限制，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金的业绩比较基准为：同期一年期定期存款收益率（税后）+1.2%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等

有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金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主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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。终

止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为



以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：以摊余成本计量的金融资产：银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,809,099.41 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 237.37 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,809,336.78 元。结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,465.15 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9.20 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,474.35 元。存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,532.89 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,534.89 元。应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,603,483.23 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 237.37 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 9.20 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 2.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 4,603,234.66 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 383,534,030.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4,603,234.66 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 388,137,264.66 元。以摊余成本计量的金融负债：卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 39,974,620.04 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 19,316.38 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 39,993,936.42 元。应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 19,316.38 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 19,316.38 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期末初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应

纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 2,071,338.52           |
| 等于：本金  | 2,067,736.76           |
| 加：应计利息 | 3,601.76               |
| 定期存款   | -                      |
| 等于：本金  | -                      |
| 加：应计利息 | -                      |
| 其他存款   | -                      |
| 等于：本金  | -                      |
| 加：应计利息 | -                      |
| 合计     | 2,071,338.52           |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |                |               |                |
|-------------------|------------------------|----------------|---------------|----------------|
|                   | 成本                     | 应计利息           | 公允价值          | 公允价值变动         |
| 股票                | -                      | -              | -             | -              |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -              | -             | -              |
| 债券                | 交易所市<br>场              | 70,653.93      | 42,534,124.03 | -45,210.31     |
|                   | 银行间市<br>场              | 42,508,680.41  | 1,092,056.99  | 136,269,056.99 |
|                   |                        | 135,033,626.76 |               | 143,373.24     |

|        |    |                |              |                |           |
|--------|----|----------------|--------------|----------------|-----------|
|        | 合计 | 177,542,307.17 | 1,162,710.92 | 178,803,181.02 | 98,162.93 |
| 资产支持证券 |    | -              | -            | -              | -         |
| 基金     |    | -              | -            | -              | -         |
| 其他     |    | -              | -            | -              | -         |
|        | 合计 | 177,542,307.17 | 1,162,710.92 | 178,803,181.02 | 98,162.93 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

### 6.4.7.5 其他资产

无。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年6月30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   | -                 |
| 应付交易费用      | 6,641.40          |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | 6,641.40          |
| 应付利息        | -                 |
| 预提信息披露费     | 179,507.37        |
| 预提审计费       | 24,795.19         |
| 其他          | 4,177.27          |
| 合计          | 215,121.23        |

注：其他负债-其他科目的余额为尚未支付的补差保证金。

### 6.4.7.7 实收基金

华安年年红债券 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
|               | 基金份额                       | 账面金额            |
| 上年度末          | 295,549,334.97             | 295,549,334.97  |
| 本期申购          | 799,916.03                 | 799,916.03      |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -156,695,239.81            | -156,695,239.81 |
| 本期末           | 139,654,011.19             | 139,654,011.19  |

华安年年红债券 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |               |
|---------------|----------------------------|---------------|
|               | 基金份额                       | 账面金额          |
| 上年度末          | 40,456,606.97              | 40,456,606.97 |
| 本期申购          | 139,224.33                 | 139,224.33    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,401,520.36              | -8,401,520.36 |
| 本期末           | 32,194,310.94              | 32,194,310.94 |

注：申购含红利再投、转化入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

华安年年红债券 A

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       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 2,046,556.54  | 10,533,090.48 | 12,579,647.02 |
| 本期利润           | 3,042,529.60  | -300,857.35   | 2,741,672.25  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,674,897.99 | -5,393,940.58 | -7,068,838.57 |
| 其中：基金申购款       | 7,454.16      | 28,176.93     | 35,631.09     |
| 基金赎回款          | -1,682,352.15 | -5,422,117.51 | -7,104,469.66 |
| 本期已分配利润        | -1,773,297.60 | -             | -1,773,297.60 |
| 本期末            | 1,640,890.55  | 4,838,292.55  | 6,479,183.10  |

华安年年红债券 C

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      |
|----------------|-------------|--------------|--------------|
| 上年度末           | 188,281.64  | 1,438,293.32 | 1,626,574.96 |
| 本期利润           | 327,133.17  | -41,646.88   | 285,486.29   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -49,680.89  | -283,896.97  | -333,577.86  |
| 其中：基金申购款       | 691.94      | 4,867.94     | 5,559.88     |
| 基金赎回款          | -50,372.83  | -288,764.91  | -339,137.74  |
| 本期已分配利润        | -242,741.00 | -            | -242,741.00  |
| 本期末            | 222,992.92  | 1,112,749.47 | 1,335,742.39 |

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 23,263.88                       |
| 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 | 641.51                          |
| 其他        | 16.47                           |
| 合计        | 23,921.86                       |

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                   |
|------------------------------|----------------------|
|                              | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 4,787,332.36         |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -273,403.26          |
| 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             | 4,513,929.10 |

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 626,301,503.01       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 618,325,456.54       |
| 减：应计利息总额               | 8,240,748.34         |
| 减：交易费用                 | 8,701.39             |
| 买卖债券差价收入               | -273,403.26          |

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -342,504.23                |
| ——股票投资                     | -                          |
| ——债券投资                     | -342,504.23                |
| ——资产支持证券投资                 | -                          |
| ——基金投资                     | -                          |
| ——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<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | -342,504.23                |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 14.98                      |
| 合计      | 14.98                      |

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 24,795.19                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 账户维护费   | 17,130.00                  |
| 银行汇划费   | 7,397.30                   |
| 其他费用    | 600.00                     |
| 合计      | 109,429.86                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明



#### 6.4.8.1或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金管理人于 2022 年 7 月 11 日发布的分红公告，本基金向 2022 年 7 月 13 日在本基金注册登记机构在册的 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.070 元，C 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.040 元。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据本基金管理人于 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经基金管理人股东会第七十三次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2022】469 号文核准，基金管理人股东上海上国投资产管理有限公司将其持有的本公司 15% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“工商银行”) | 基金托管人、基金代销机构        |
| 国泰君安证券股份有限公司         | 基金管理人的股东、基金代销机构     |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |              |
|--------------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|              | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -                          | -            | 34,807,839.46                   | 10.54%       |

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 680,328.69                     | 4,471,326.60                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 394,213.21                     | 4,034,285.47                        |

注：1、支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.7% / 当年天数。

2、管理费包括按合同计提的补差保证金。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 335,428.42                     | 2,478,902.15                        |

注：支付基金托管人 中国工商银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日      |           |           |
|----------------|---------------------------------|-----------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |           |           |
|                | 华安年年红债券 A                       | 华安年年红债券 C | 合计        |
| 国泰君安证券股份有限公司   | -                               | 27.16     | 27.16     |
| 华安基金管理有限公司     | -                               | 5,105.20  | 5,105.20  |
| 中国工商银行股份有限公司   | -                               | 4,292.06  | 4,292.06  |
| 合计             | -                               | 9,424.42  | 9,424.42  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |           |           |
|                | 华安年年红债券A                        | 华安年年红债券C  | 合计        |
| 国泰君安证券股份有限公司   | -                               | 41.16     | 41.16     |
| 华安基金管理有限公司     | -                               | 9,142.01  | 9,142.01  |
| 中国工商银行股份有限公司   | -                               | 7,661.83  | 7,661.83  |
| 合计             | -                               | 16,845.00 | 16,845.00 |

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日      |               |      |       |      |       |      |
|---------------------------------|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称          | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                 | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| -                               | -             | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称          | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                 | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 工商银行                            | 20,133,312.60 | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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

无。

##### 6.4.10.5 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入       | 期末余额                            | 当期利息收入       |
|       | 中国工商银行                     | 2,071,338.52 | 23,263.88                       | 3,881,719.73 |

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

###### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 6.4.11 利润分配情况

华安年年红债券 A

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日 |            | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额     | 再投资形式发放总额  | 利润分配合计       | 备注 |
|----|------------|-----|------------|---------------|--------------|------------|--------------|----|
|    |            | 场内  | 场外         |               |              |            |              |    |
| 1  | 2022-04-15 | -   | 2022-04-15 | 0.060         | 1,535,899.90 | 237,397.70 | 1,773,297.60 | -  |
| 合计 |            |     |            | 0.060         | 1,535,899.90 | 237,397.70 | 1,773,297.60 | -  |

华安年年红债券 C

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日 |            | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额   | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计     | 备注 |
|----|------------|-----|------------|---------------|------------|-----------|------------|----|
|    |            | 场内  | 场外         |               |            |           |            |    |
| 1  | 2022-04-15 | -   | 2022-04-15 | 0.060         | 197,779.65 | 44,961.35 | 242,741.00 | -  |
| 合计 |            |     |            | 0.060         | 197,779.65 | 44,961.35 | 242,741.00 | -  |

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金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。本基金在合理控制信用风险的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。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。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，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。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不

重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金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基金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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同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%，本基金与由本基金的基金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的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在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时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4.2 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。

本基金的基金管理人在运作期内对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.2.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年6月30日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计             |
|-------------------|----------------|------|------|-----|----------------|
| 资产                |                |      |      |     |                |
| 银行存款              | 2,071,338.52   | -    | -    | -   | 2,071,338.52   |
| 结算备付金             | 68,448.77      | -    | -    | -   | 68,448.77      |
| 存出保证金             | 2,871.33       | -    | -    | -   | 2,871.33       |
| 交易性金融资产           | 178,803,181.02 | -    | -    | -   | 178,803,181.02 |
| 应收清算款             | -              | -    | -    | -   | -              |
| 资产总计              | 180,945,839.64 | -    | -    | -   | 180,945,839.64 |



|                         |                |               |               |               |                |
|-------------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
|                         |                |               |               |               | 4              |
| 负债                      |                |               |               |               |                |
| 短期借款                    | -              | -             | -             | -             | -              |
| 交易性金融负债                 | -              | -             | -             | -             | -              |
| 衍生金融负债                  | -              | -             | -             | -             | -              |
| 卖出回购金融资产款               | -              | -             | -             | -             | -              |
| 应付清算款                   | -              | -             | -             | 853,259.09    | 853,259.09     |
| 应付赎回款                   | -              | -             | -             | -             | -              |
| 应付管理人报酬                 | -              | -             | -             | 146,006.34    | 146,006.34     |
| 应付托管费                   | -              | -             | -             | 45,212.42     | 45,212.42      |
| 应付销售服务费                 | -              | -             | -             | 15,762.43     | 15,762.43      |
| 应交税费                    | -              | -             | -             | 7,230.51      | 7,230.51       |
| 应付利润                    | -              | -             | -             | -             | -              |
| 递延所得税负债                 | -              | -             | -             | -             | -              |
| 其他负债                    | -              | -             | -             | 215,121.23    | 215,121.23     |
| 负债总计                    | -              | -             | -             | 1,282,592.02  | 1,282,592.02   |
| 利率敏感度缺口                 | 180,945,839.64 | -             | -             | -1,282,592.02 | 179,663,247.64 |
|                         |                |               |               |               | 2              |
| <b>上年度末</b>             |                |               |               |               |                |
| <b>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>   | <b>1-5 年</b>  | <b>5 年以上</b>  | <b>不计息</b>    | <b>合计</b>      |
| 资产                      |                |               |               |               |                |
| 银行存款                    | 2,809,099.41   | -             | -             | -             | 2,809,099.41   |
| 结算备付金                   | 20,465.15      | -             | -             | -             | 20,465.15      |
| 存出保证金                   | 4,532.89       | -             | -             | -             | 4,532.89       |
| 交易性金融资产                 | 317,960,030.00 | 10,398,000.00 | 55,176,000.00 | -             | 383,534,030.00 |
| 应收清算款                   | -              | -             | -             | -             | -              |
| 其他资产                    | -              | -             | -             | 4,603,483.23  | 4,603,483.23   |
| 资产总计                    | 320,794,127.45 | 10,398,000.00 | 55,176,000.00 | 4,603,483.23  | 390,971,610.68 |
| 负债                      |                |               |               |               |                |
| 短期借款                    | -              | -             | -             | -             | -              |
| 交易性金融负债                 | -              | -             | -             | -             | -              |
| 衍生金融负债                  | -              | -             | -             | -             | -              |

|           |                |               |               |              |                |
|-----------|----------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款 | 39,974,620.04  | -             | -             | -            | 39,974,620.04  |
| 应付清算款     | -              | -             | -             | -            | -              |
| 应付赎回款     | -              | -             | -             | -            | -              |
| 应付管理人报酬   | -              | -             | -             | 166,367.78   | 166,367.78     |
| 应付托管费     | -              | -             | -             | 59,417.08    | 59,417.08      |
| 应付销售服务费   | -              | -             | -             | 17,853.05    | 17,853.05      |
| 应交税费      | -              | -             | -             | 25,764.43    | 25,764.43      |
| 应付利润      | -              | -             | -             | -            | -              |
| 递延所得税负债   | -              | -             | -             | -            | -              |
| 其他负债      | -              | -             | -             | 515,424.38   | 515,424.38     |
| 负债总计      | 39,974,620.04  | -             | -             | 784,826.72   | 40,759,446.76  |
| 利率敏感度缺口   | 280,819,507.41 | 10,398,000.00 | 55,176,000.00 | 3,818,656.51 | 350,212,163.92 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了归类。

#### 6.4.13.4.2.2 利率风险的敏感性分析

| 假设            | 除市场利率以外的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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|               | 市场利率下降 25 个基点      | 132,776.99        | 1,368,091.13        |
| 市场利率上升 25 个基点 | -132,521.97        | -1,339,436.58     |                     |

#### 6.4.13.4.3 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.4 其他价格风险

其他价格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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上期末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|--------------------|
| 第一层次          | 42,534,124.03     | 7,284,030.00       |
| 第二层次          | 136,269,056.99    | 376,250,000.00     |
| 第三层次          | -                 | -                  |
| 合计            | 178,803,181.02    | 383,534,030.00     |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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              | -              | -             |
|    | 其中：股票             | -              | -             |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 178,803,181.02 | 98.82         |
|    | 其中：债券             | 178,803,181.02 | 98.82         |
|    | 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      | 2,139,787.29   | 1.18          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,871.33       | 0.00          |
| 9  | 合计                | 180,945,839.64 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

##### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入或卖出股票。

#### 7.5 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 30,562,191.78  | 17.01        |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,562,191.78  | 17.01        |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 105,706,865.21 | 58.84        |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 42,534,124.03  | 23.67        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 178,803,181.02 | 99.52        |

#### 7.6 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  | 210306 | 21 进出 06 | 300,000 | 30,562,191.78 | 17.01        |

|   |           |                    |         |               |      |
|---|-----------|--------------------|---------|---------------|------|
| 2 | 012103884 | 21 鲁高速<br>SCP004   | 100,000 | 10,184,674.52 | 5.67 |
| 3 | 012280177 | 22 京基投<br>SCP001   | 100,000 | 10,115,491.51 | 5.63 |
| 4 | 072210023 | 22 申万宏<br>源 CP002  | 100,000 | 10,110,130.96 | 5.63 |
| 5 | 012280683 | 22 北京国<br>资 SCP002 | 100,000 | 10,079,124.93 | 5.61 |

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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投资。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

##### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

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。

### 7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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。

### 7.12.3 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 | 2,871.33 |
| 2  | 应收清算款 | -        |
| 3  | 应收股利  | -        |
| 4  | 应收利息  | -        |
| 5  | 应收申购款 | -        |
| 6  | 其他应收款 | -        |
| 7  | 待摊费用  | -        |
| 8  | 其他    | -        |
| 9  | 合计    | 2,871.33 |

### 7.12.4 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  | 110079 | 杭银转债  | 7,564,551.97 | 4.21         |
| 2  | 113050 | 南银转债  | 7,361,041.64 | 4.10         |
| 3  | 127049 | 希望转 2 | 6,140,782.19 | 3.42         |
| 4  | 110053 | 苏银转债  | 5,669,076.58 | 3.16         |
| 5  | 128139 | 祥鑫转债  | 4,789,007.81 | 2.67         |
| 6  | 123107 | 温氏转债  | 3,282,325.34 | 1.83         |
| 7  | 128083 | 新北转债  | 1,954,508.22 | 1.09         |
| 8  | 123105 | 拓尔转债  | 1,303,967.67 | 0.73         |
| 9  | 128119 | 龙大转债  | 1,134,970.72 | 0.63         |
| 10 | 113599 | 嘉友转债  | 660,169.86   | 0.37         |
| 11 | 113542 | 好客转债  | 556,810.27   | 0.31         |
| 12 | 110062 | 烽火转债  | 544,212.33   | 0.30         |
| 13 | 127024 | 盈峰转债  | 538,959.59   | 0.30         |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 14 | 123097 | 美力转债 | 409,703.42 | 0.23 |
| 15 | 113584 | 家悦转债 | 34,652.31  | 0.02 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别      | 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  |
| 华安年年红债券 A | 3,718    | 37,561.60 | 0.00  | 0.00%  | 139,654,011.19 | 100.00% |
| 华安年年红债券 C | 1,881    | 17,115.53 | 0.00  | 0.00%  | 32,194,310.94  | 100.00% |
| 合计        | 5,599    | 30,692.68 | 0.00  | 0.00%  | 171,848,322.13 | 100.00% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别      | 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 | 华安年年红债券 A | 0.00      | 0.00%    |
|                  | 华安年年红债券 C | 0.94      | 0.00%    |
|                  | 合计        | 0.94      | 0.00%    |

### 8.3 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的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。



## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 华安年年红债券 A      | 华安年年红债券 C     |
|---------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2013 年 11 月 14 日）基金份额总额 | 297,880,059.75 | -             |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 295,549,334.97 | 40,456,606.97 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 799,916.03     | 139,224.33    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 156,695,239.81 | 8,401,520.36  |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              | -             |
| 本报告期末基金份额总额                     | 139,654,011.19 | 32,194,310.94 |

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2022 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告》，范伟隽先生离任本基金管理人的首席信息官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 |    |
| 长城证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东兴证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 北京高华证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国都证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中天证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 瑞银证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 川财证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中银国际   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 恒泰证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华融证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中金财富证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华金证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广发华福证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 信达证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 红塔证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中金公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 开源证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 银河证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 财富里昂   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 上海证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中泰证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 民生证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方财富   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 申港证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调调整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.7.2 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          |                  | 回购交易      |                  | 权证交易 |                  |
|--------|---------------|------------------|-----------|------------------|------|------------------|
|        | 成交金额          | 占当期债券成交总额的<br>比例 | 成交金额      | 占当期回购成交总<br>额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总<br>额的比例 |
| 长城证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 东兴证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 兴业证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 招商证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 北京高华证券 | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 国都证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 中天证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 瑞银证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 川财证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 中银国际   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 安信证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 国金证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 申万宏源   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 恒泰证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 华融证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 中金财富证券 | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 华金证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 广发华福证券 | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 国信证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 长江证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 东北证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 信达证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 红塔证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 中信建投   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 国泰君安证券 | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 中金公司   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 开源证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 天风证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 银河证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 财富里昂   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 上海证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 中泰证券   | -             | -                | -         | -                | -    | -                |
| 中信证券   | 18,339,916.40 | 20.45%           | -         | -                | -    | -                |
| 民生证券   | 15,896,752.1  | 17.72%           | 50,000.00 | 79.37%           | -    | -                |

|      |               |        |               |        |   |   |
|------|---------------|--------|---------------|--------|---|---|
|      | 0             |        | 0.00          |        |   |   |
| 东方财富 | 13,187,832.47 | 14.70% | -             | -      | - | - |
| 申港证券 | 10,913,945.86 | 12.17% | -             | -      | - | - |
| 华创证券 | 9,231,078.90  | 10.29% | 13,000,000.00 | 20.63% | - | - |
| 华西证券 | 7,357,031.30  | 8.20%  | -             | -      | - | - |
| 东吴证券 | 6,551,731.52  | 7.30%  | -             | -      | - | - |
| 德邦证券 | 3,623,797.90  | 4.04%  | -             | -      | - | - |
| 华泰证券 | 2,833,502.88  | 3.16%  | -             | -      | - | - |
| 广发证券 | 1,757,582.93  | 1.96%  | -             | -      | - | - |

### 10.8 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  | 华安基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-06 |
| 2  | 华安年年红定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告        | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-21 |
| 3  | 华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告     | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-26 |
| 4  | 华安年年红定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书(2022 年第 1 号)  | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-03-04 |
| 5  | 华安年年红定期开放债券型证券投资基金(华安年年红债券 A)基金产品资料概要更新  | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-03-04 |
| 6  | 华安年年红定期开放债券型证券投资基金(华安年年红债券 C)基金产品资料概要更新  | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-03-04 |
| 7  | 华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告                    | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-03-15 |
| 8  | 华安年年红定期开放债券型证券投资基金 2021 年年度报告            | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-03-30 |
| 9  | 关于华安年年红定期开放债券型证券投资基                      | 中国证监会基金电子披              | 2022-04-13 |

|    |                                      |                         |            |
|----|--------------------------------------|-------------------------|------------|
|    | 金分红公告                                | 露网站和公司网站等指定媒介           |            |
| 10 | 华安年年红定期开放债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告    | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-04-21 |
| 11 | 华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告               | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-04-30 |
| 12 | 关于华安年年红定期开放债券型证券投资基金第八个封闭运作期结束的提示性公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-06-02 |
| 13 | 关于华安年年红定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告  | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-06-10 |
| 14 | 关于华安年年红定期开放债券型证券投资基金第八个封闭运作期管理费调整的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-06-10 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安年年红定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安年年红定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安年年红定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安年年红定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

## 12.2 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>。

## 12.3 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

二〇二二年八月三十日