

# 华安乾煜债券型发起式证券投资基金

## 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：招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。

基金托管人招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 3 月 31 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>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	11
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	12
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	13
<b>5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
<b>8 基金份额持有人信息</b>	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	49
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
<b>12 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	华安乾煜债券型发起式证券投资基金
基金简称	华安乾煜债券发起式
基金主代码	013650
交易代码	013650
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 3 月 31 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	270,889,296.08 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，给出股票、债券和货币市场工具等大类资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×85%+中证 800 指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 本基金若投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	张燕
	联系电话	021-38969999	0755-83199084
	电子邮箱	service@huanan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦

	-32层	
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	深圳市深南大道7088号招商银 行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	朱学华	缪建民

## 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3月31日（基金合同生效日） 至2022年6月30日）
本期已实现收益	1,893,554.26
本期利润	3,141,716.24
加权平均基金份额本期利润	0.0127
本期加权平均净值利润率	1.26%
本期基金份额净值增长率	1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	2,363,647.18
期末可供分配基金份额利润	0.0087
期末基金资产净值	275,532,001.91
期末基金份额净值	1.0171
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.71%

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）。

### 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

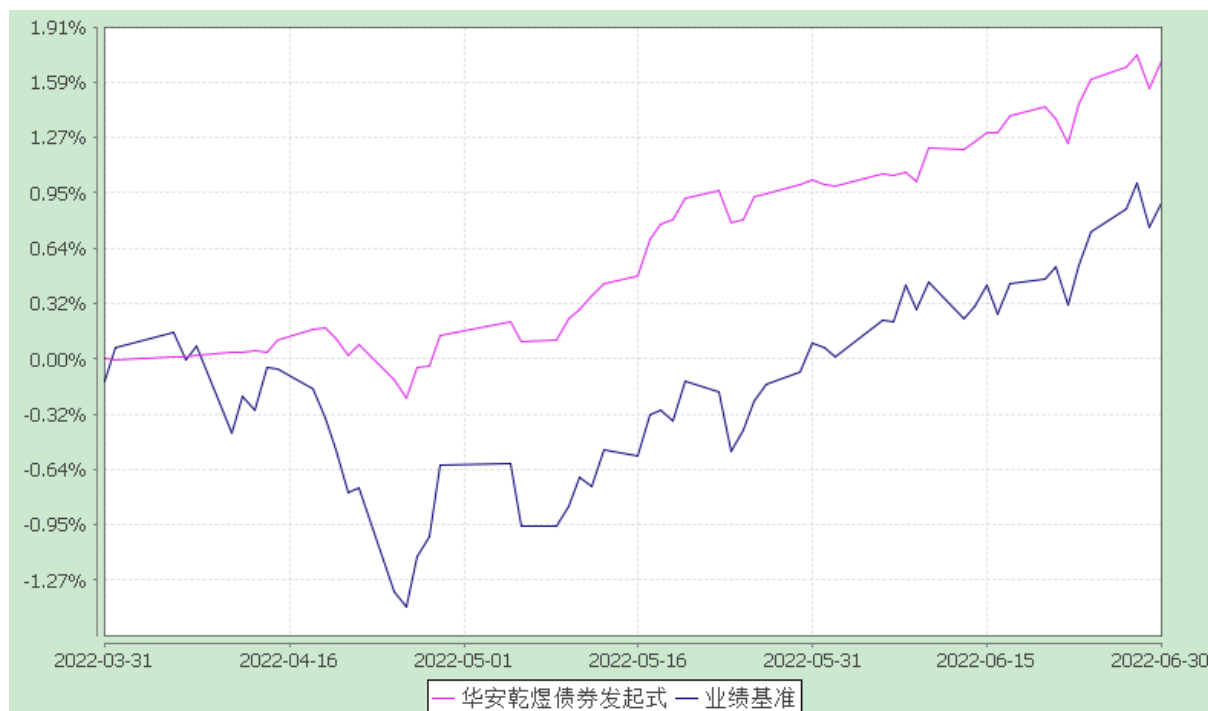
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.67%	0.10%	0.85%	0.15%	-0.18%	-0.05%
过去三个月	1.71%	0.09%	1.04%	0.20%	0.67%	-0.11%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.71%	0.09%	0.90%	0.20%	0.81%	-0.11%

#### 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

华安乾煜债券型发起式证券投资基金

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

（2022 年 3 月 31 日至 2022 年 6 月 30 日）



注：1、本基金于 2022 年 3 月 31 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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

## 4 管理人报告

### 4.1 基金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 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏媛媛	本基金的基金 经理	2022-03- 31	-	8 年	硕士研究生，CFA（特许金融分析师），8 年金融、基金行业从业经历。曾任中债资信评估有限责任公司高级分析师、嘉实基金管理有限公司信用研究员，2021 年 6 月加入华安基金，历任绝对收益投资部基金经理助理。2021 年 8 月起，同时担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起，同时担任华安顺穗债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月起，同时担任华安乾煜债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月起，同时担任华安添锦债券型证券投资基金的基金经理。
郑伟山	本基金的基金 经理	2022-05- 25	-	13 年	硕士研究生，13 年金融行业从业经验。曾任红色资本量化分析师、中国诚信信用管理股份有限公司定量分析师、阳光资产管理股份有限公司高级投资经理。2022 年 3 月加入华安基金，2022 年 5 月起，担任华安乾煜债券型发起式证券投资基金、华安新乐享灵活配置混合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市交易的投资品种、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

2022 年上半年，GDP 同比增长 2.5%，其中一季度、二季度分别同比增长 4.8% 和 0.4%，二季度经济受疫情影响较大。上半年，固定资产投资同比增长 6.1%，其中基建、制造业投资分别同比增长 7.1%、10.4%，而地产投资同比下降 5.4%，地产投资依然低迷，基建和制造业投资成为重要支撑。上半年，出口同比增长 13.2%，出口增速仍然维持在较高水平。受疫情影响，上半年社零同比下降 0.7%。资金面整体较为平稳。从市场走势看，上半年债券市场收益率短端下行较多，截至 6 月末，1 年国开债收益率较年初下行 30bp 至 2.02%，10 年国开收益率下行 3bp 至 3.05%，利率债曲线陡峭化下行。信用债方面，截至 6 月末，1 年 AAA 中票较年初下行 33bp 至 2.42%，3 年期 AAA 中票较年初上行 4bp 至 2.95%，短端表现好于长端。策略上，我们精选中高评级信用债，保持适度杠杆和久期，灵活调整持仓结构。

上半年，股票市场趋势性下行，期间主要经历了三波下跌，其中，第一波下跌主要是估值高位回调，第二波是俄乌战争引起的风险偏好快速回落，第三波是上海和北京疫情引致的经济增长担忧，另外，三波下跌都有反弹，前两波反弹力度一般，第三波反弹力度大回撤小。从指数层面看，期间主要宽基指数出现明显分化，其中，上证 50 指数下跌 6.59%、沪深 300 指数下跌 9.22%、中证 500 指数下跌 12.30%、创业板指数下跌 15.41%、科创 50 指数下跌 20.92%。从行业板块上看，分化剧烈，其中，煤炭板块一枝独秀，上涨 31%，紧随其后的有交通运输和美容护理等，跌幅在 2% 以内，表现最差的电子、计算机、传媒和国防军工，跌幅都在 20% 以上。估值方面，过去几年累积的高估值有所缓解，主要宽基指数的估值重新回到中位数附近。本基金成立于一季度末，二季度在市场大幅波动中逐步加仓，考虑到投资者风险偏好快速变化，市场波动较大，考虑建仓期客户体验我们维持了中性偏低的仓位，持仓结构上整体偏均衡，根据景气度和估值匹配程度，优选部分行业进行了重点配置。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0171 元，本报告期份额净值增长率为 1.71%，同期业绩比较基准增长率为 0.90%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增长方面，短期疫情得到有效控制，经济开始处于缓慢修复阶段，不过目前多数指标和疫情前相比还有距离。地产和疫情仍是影响宏观经济运行的两条主线，后续重点观察疫情反复的风险以及房地产政策放松的效果。中期来看，债券市场走势要与中长期基本面和流动性环境相匹配，本轮经济宽信用难度较大，国内疫情形势复杂，经济压力仍然较大。由于要实现全年经济增长目标难度较大，宏观政策可能会继续加力，货币政策整体基调仍需要呵护经济修复。操作上，将灵活调整久期和杠杆，配置集中于高等级信用债，精选品种和个券增厚收益，在收益率曲线上寻找凸点，把握交易性机会。

股票方面，当前 A 股整体估值分位数回到了历史中位数附近，估值吸引力略有下降，考虑到外部包括美联储加息缩表、地缘政治以及通胀高企等负面因素尚未消除，而国内经济弱复苏，宽松的流动性环境还将延续，行情演绎的高度取决于内外部力量的对比，短期内可能会出现指数波动加大的情况，中长期维度，以我为主会是主基调，情绪修复后权益类产品常态化发行和外资流入将带来增量资金，本基金将根据市场情况，适当调整股票配置。

可转债方面，当前的相对估值水平和绝对价位水平都在历史高位，风险收益匹配度不高，估值压缩的压力可能持续存在，需要谨慎挑选标的进行配置。

#### 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

本报告期不进行收益分配。

#### 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

本基金为发起式证券投资基金，报告期内不存在基金资产净值低于 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 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：华安乾煜债券型发起式证券投资基金

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 2022 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	1,476,001.57
结算备付金		583,973.46
存出保证金		143,526.58
交易性金融资产	6.4.7.2	219,516,184.37
其中：股票投资		25,239,291.20
基金投资		-
债券投资		194,276,893.17
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	54,003,108.28
应收清算款		5,312.38
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
<b>资产总计</b>		<b>275,728,106.64</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		-
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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		87,348.72
应付托管费		21,837.18
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		8,689.99
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	78,228.84
<b>负债合计</b>		<b>196,104.73</b>
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	270,889,296.08
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	4,642,705.83

净资产合计		275,532,001.91
负债和净资产总计		275,728,106.64

注：报告截至日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0171 元，基金份额总额 270,889,296.08 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安乾煜债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>3,676,497.98</b>
1.利息收入		484,515.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	60,554.28
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		423,961.66
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,349,623.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-58,338.75
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	1,260,614.44
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.12	147,348.13
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	1,248,161.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	594,196.24
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>534,781.74</b>
1. 管理人报酬		374,788.42
2. 托管费		93,697.10
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		9,737.08
其中：卖出回购金融资产支出		9,737.08
6. 信用减值损失		-

7.税金及附加		1,420.27
8. 其他费用	6.4.7.15	55,138.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,141,716.24</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,141,716.24</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,141,716.24</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安乾煜债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	641,010,092.47	-	-	641,010,092.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-370,120,796.39	-	4,642,705.83	-365,478,090.56
（一）、综合收益总额	-	-	3,141,716.24	3,141,716.24
（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）	-370,120,796.39	-	1,500,989.59	-368,619,806.80
其中：1.基金申购款	167,860,286.94	-	2,156,451.73	170,016,738.67
2.基金赎回款	-537,981,083.33	-	-655,462.14	-538,636,545.47
（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）	-	-	-	-
四、本期期末净	270,889,296.08	-	4,642,705.83	275,532,001.91



资产(基金净值)				
----------	--	--	--	--

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

华安乾煜债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2021]第 2864 号《关于准予华安乾煜债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 640,995,000.80 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0235 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 3 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 641,010,092.47 份基金份额，认购资金利息折合 15,091.67 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、债券回购、股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、国债期货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)。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等资产的比例合计不超过基金资产的 20%，港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保

证金后，现金或者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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率 x85%+中证 800 指数收益率 x10%+中证港股通综合指数收益率 x5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日止期间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 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 3 月 31 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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和资产支持证券投资，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。

#### 6.4.4.4 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。

#### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以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金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的

指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(3) 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(4) 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 2022年6月30日
活期存款	1,476,001.57
等于：本金	1,475,701.31
加：应计利息	300.26
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	1,476,001.57

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	23,888,705.80	-	25,239,291.20	1,350,585.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	163,796.96	28,935,053.16	9,962.06
	银行间市场	162,914,385.48	2,539,840.01	-112,385.48
	合计	191,675,679.62	2,703,636.97	194,276,893.17
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	215,564,385.42	2,703,636.97	219,516,184.37	1,248,161.98

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	35,000,000.00	-
银行间市场	19,003,108.28	-
合计	54,003,108.28	-

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	28,228.68
其中：交易所市场	23,482.06
银行间市场	4,746.62
应付利息	-
预提信息披露费	30,000.28
预提审计费	19,999.88
合计	78,228.84

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	641,010,092.47	641,010,092.47
本期申购	167,860,286.94	167,860,286.94
本期赎回（以“-”号填列）	-537,981,083.33	-537,981,083.33
本期末	270,889,296.08	270,889,296.08

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

本期利润	1,893,554.26	1,248,161.98	3,141,716.24
本期基金份额交易产生的变动数	470,092.92	1,030,896.67	1,500,989.59
其中：基金申购款	1,297,039.56	859,412.17	2,156,451.73
基金赎回款	-826,946.64	171,484.50	-655,462.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,363,647.18	2,279,058.65	4,642,705.83

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	45,432.29
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	14,706.62
其他	415.37
合计	60,554.28

### 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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-58,338.75
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-58,338.75

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	736,764.20
减：卖出股票成本总额	768,800.00
减：交易费用	26,302.95

买卖股票差价收入	-58,338.75
----------	------------

#### 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3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,103,188.08
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	157,426.36
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	1,260,614.44

##### 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3月31日（基金合同生效日）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	506,876,885.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	500,476,087.79
减：应计利息总额	6,238,706.22
减：交易费用	4,664.93
买卖债券差价收入	157,426.36

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	147,348.13
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	147,348.13

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日
1.交易性金融资产	1,248,161.98
——股票投资	1,350,585.40
——债券投资	-102,423.42
——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 预估增值税	-
合计	1,248,161.98

## 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日
基金赎回费收入	594,196.24
合计	594,196.24

## 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日
审计费用	19,999.88
信息披露费	30,000.28
证券出借违约金	-
银行汇划费	4,738.71
其他费用	400.00
合计	55,138.87

## 6.4.8 关联方关系

## 6.4.8.1 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。

#### 6.4.8.2 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人

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。

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 关联方报酬

##### 6.4.9.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	374,788.42
其中：支付销售机构的客户维护费	4,058.50

注：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 0.6% 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×0.6% / 当年天数。

##### 6.4.9.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	93,697.10

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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×0.15% / 当年天数。

##### 6.4.9.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

##### 6.4.9.3 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日
基金合同生效日（2022年3月31日）持	10,000,000.00

有的基金份额	
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.69%

#### 6.4.9.4 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 2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,476,001.57	45,432.29

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.9.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年3月31日（基金合同生效日）至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	113059	福莱转债	老股东配售	10.00	1,000.00

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

##### 6.4.10.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.10.1.1 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为 0，无抵押债券。

###### 6.4.10.1.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。



### 6.4.11 金融工具风险及管理

本基金是一只债券型证券投资基金，其预期的风险收益水平低于股票基金和混合基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资。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。本基金在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

#### 6.4.11.1 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，将风险控制在此可承受的范围内。

#### 6.4.11.2 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。

**6.4.11.2.1 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 2022年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	22,785,855.00
合计	22,785,855.00

注：未评级债券为国债。

**6.4.11.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.11.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.11.2.4 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 2022年6月30日
AAA	144,375,618.09
AAA 以下	10,448,117.81
未评级	16,667,302.27
合计	171,491,038.17

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

**6.4.11.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.11.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.11.3 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可随时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

格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.11.3.1 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》及《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期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%。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%。

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。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 272,294,009.85 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 6.4.11.4 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。

##### 6.4.11.4.1 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。

本基金的基金管理人定期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。

本基金主要投资于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。

##### 6.4.11.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,476,001.57	-	-	-	1,476,001.57
结算备付金	583,973.46	-	-	-	583,973.46
存出保证金	143,526.58	-	-	-	143,526.58
交易性金融资产	59,292,932.61	103,601,642.75	31,382,317.81	25,239,291.20	219,516,184.37
买入返售金融资产	54,003,108.28	-	-	-	54,003,108.28
应收清算款	-	-	-	5,312.38	5,312.38
资产总计	115,499,542.50	103,601,642.75	31,382,317.81	25,244,603.58	275,728,106.64

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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	87,348.72	87,348.72
应付托管费	-	-	-	21,837.18	21,837.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	8,689.99	8,689.99
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	78,228.84	78,228.84
负债总计	-	-	-	196,104.73	196,104.73
利率敏感度缺口	115,499,542.50	103,601,642.75	31,382,317.81	25,048,498.85	275,532,001.91

#### 6.4.11.4.1.2 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 2022 年 6 月 30 日
	市场利率上升 25 个基点	-921,917.37
	市场利率下降 25 个基点	926,604.41

#### 6.4.11.4.2 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。本基金主要投资于证券交易所上市或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。

##### 6.4.11.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 6 月 30 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	25,239,291.20	9.16
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	25,239,291.20	9.16

## 6.4.12 公允价值

### 6.4.12.1 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。

### 6.4.12.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.12.2.1 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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	25,239,291.20
第二层次	194,276,893.17
第三层次	-
合计	219,516,184.37

#### 6.4.12.2.2 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。

#### 6.4.12.3 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。

#### 6.4.12.4 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若。

### 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	25,239,291.20	9.15
	其中：股票	25,239,291.20	9.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	194,276,893.17	70.46
	其中：债券	194,276,893.17	70.46
	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	54,003,108.28	19.59
	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	2,059,975.03	0.75
8	其他各项资产	148,838.96	0.05
9	合计	275,728,106.64	100.00

## 7.2 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	254,169.00	0.09
B	采矿业	834,430.00	0.30
C	制造业	15,395,432.80	5.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,027,701.00	0.37
E	建筑业	447,900.00	0.16
F	批发和零售业	11,268.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	114,545.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,503,843.00	0.55
J	金融业	5,126,580.40	1.86
K	房地产业	52,954.00	0.02
L	租赁和商务服务业	60,719.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	97,982.00	0.04
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	294,084.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	17,683.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	25,239,291.20	9.16

## 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

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	占基金资产净值比例(%)
1	300034	钢研高纳	27,500	1,159,950.00	0.42
2	300059	东方财富	45,140	1,146,556.00	0.42
3	000301	东方盛虹	56,400	953,724.00	0.35
4	600989	宝丰能源	61,900	906,835.00	0.33
5	600919	江苏银行	120,700	859,384.00	0.31
6	601899	紫金矿业	85,200	794,916.00	0.29
7	002389	航天彩虹	42,900	787,644.00	0.29



8	601985	中国核电	112,700	773,122.00	0.28
9	603833	欧派家居	4,900	738,332.00	0.27
10	002839	张家港行	119,460	631,943.40	0.23
11	300529	健帆生物	10,700	544,523.00	0.20
12	600030	中信证券	25,100	543,666.00	0.20
13	603501	韦尔股份	3,100	536,393.00	0.19
14	600760	中航沈飞	8,800	531,960.00	0.19
15	601128	常熟银行	69,000	527,160.00	0.19
16	300454	深信服	5,000	518,900.00	0.19
17	601799	星宇股份	2,900	495,900.00	0.18
18	600926	杭州银行	33,100	495,838.00	0.18
19	300750	宁德时代	900	480,600.00	0.17
20	000902	新洋丰	28,100	474,609.00	0.17
21	002415	海康威视	13,100	474,220.00	0.17
22	300850	新强联	5,300	471,859.00	0.17
23	600600	青岛啤酒	4,200	436,464.00	0.16
24	601668	中国建筑	81,400	433,048.00	0.16
25	600519	贵州茅台	200	409,000.00	0.15
26	600031	三一重工	21,300	405,978.00	0.15
27	002475	立讯精密	11,800	398,722.00	0.14
28	300770	新媒股份	10,200	385,866.00	0.14
29	002241	歌尔股份	10,700	359,520.00	0.13
30	601318	中国平安	7,100	331,499.00	0.12
31	600933	爱柯迪	20,000	327,600.00	0.12
32	002049	紫光国微	1,600	303,552.00	0.11
33	300682	朗新科技	12,000	302,280.00	0.11
34	300015	爱尔眼科	6,200	277,574.00	0.10
35	600887	伊利股份	6,800	264,860.00	0.10
36	600745	闻泰科技	3,000	255,330.00	0.09
37	603197	保隆科技	5,000	245,950.00	0.09
38	600893	航发动力	5,400	245,754.00	0.09
39	601628	中国人寿	7,500	233,100.00	0.08
40	300498	温氏股份	10,900	232,061.00	0.08
41	002555	三七互娱	10,400	220,792.00	0.08
42	002304	洋河股份	1,200	219,780.00	0.08
43	601688	华泰证券	15,300	217,260.00	0.08
44	002032	苏泊尔	3,800	214,092.00	0.08
45	600905	三峡能源	31,800	200,022.00	0.07
46	300896	爱美客	300	180,003.00	0.07
47	603986	兆易创新	900	127,989.00	0.05
48	002487	大金重工	3,000	125,190.00	0.05
49	300207	欣旺达	3,300	104,280.00	0.04
50	601988	中国银行	30,200	98,452.00	0.04
51	002821	凯莱英	300	86,700.00	0.03

52	000858	五粮液	400	80,772.00	0.03
53	300274	阳光电源	800	78,600.00	0.03
54	000596	古井贡酒	300	74,898.00	0.03
55	600436	片仔癀	200	71,346.00	0.03
56	002594	比亚迪	200	66,698.00	0.02
57	603288	海天味业	720	65,059.20	0.02
58	600809	山西汾酒	200	64,960.00	0.02
59	300782	卓胜微	480	64,800.00	0.02
60	300760	迈瑞医疗	200	62,640.00	0.02
61	002371	北方华创	200	55,424.00	0.02
62	605499	东鹏饮料	300	51,258.00	0.02
63	002812	恩捷股份	200	50,090.00	0.02
64	600309	万华化学	500	48,495.00	0.02
65	000333	美的集团	800	48,312.00	0.02
66	600438	通威股份	800	47,888.00	0.02
67	000661	长春高新	200	46,684.00	0.02
68	601888	中国中免	200	46,586.00	0.02
69	603195	公牛集团	300	45,873.00	0.02
70	600132	重庆啤酒	300	43,980.00	0.02
71	300759	康龙化成	450	42,849.00	0.02
72	601012	隆基绿能	560	37,312.80	0.01
73	600276	恒瑞医药	1,000	37,090.00	0.01
74	600900	长江电力	1,600	36,992.00	0.01
75	300347	泰格医药	300	34,335.00	0.01
76	603659	璞泰来	400	33,760.00	0.01
77	002459	晶澳科技	420	33,138.00	0.01
78	300124	汇川技术	500	32,935.00	0.01
79	000002	万科 A	1,500	30,750.00	0.01
80	002460	赣锋锂业	200	29,740.00	0.01
81	002129	TCL 中环	500	29,445.00	0.01
82	300014	亿纬锂能	300	29,250.00	0.01
83	002352	顺丰控股	500	27,905.00	0.01
84	002179	中航光电	420	26,594.40	0.01
85	002791	坚朗五金	200	25,944.00	0.01
86	600406	国电南瑞	960	25,920.00	0.01
87	002466	天齐锂业	200	24,960.00	0.01
88	603806	福斯特	380	24,897.60	0.01
89	603799	华友钴业	260	24,861.20	0.01
90	000568	泸州老窖	100	24,654.00	0.01
91	000538	云南白药	380	22,948.20	0.01
92	000725	京东方 A	5,800	22,852.00	0.01
93	300628	亿联网络	300	22,845.00	0.01
94	002714	牧原股份	400	22,108.00	0.01
95	600585	海螺水泥	600	21,168.00	0.01

96	000001	平安银行	1,400	20,972.00	0.01
97	603259	药明康德	200	20,798.00	0.01
98	000063	中兴通讯	800	20,424.00	0.01
99	300316	晶盛机电	300	20,277.00	0.01
100	300866	安克创新	300	19,896.00	0.01
101	300142	沃森生物	400	19,356.00	0.01
102	300450	先导智能	300	18,954.00	0.01
103	603160	汇顶科技	300	18,579.00	0.01
104	601816	京沪高铁	3,700	18,574.00	0.01
105	601100	恒立液压	300	18,516.00	0.01
106	601919	中远海控	1,300	18,070.00	0.01
107	000625	长安汽车	1,040	18,012.80	0.01
108	002311	海大集团	300	18,003.00	0.01
109	600104	上汽集团	1,000	17,810.00	0.01
110	600196	复星医药	400	17,636.00	0.01
111	600111	北方稀土	500	17,580.00	0.01
112	601021	春秋航空	300	17,505.00	0.01
113	603517	绝味食品	300	17,346.00	0.01
114	300595	欧普康视	300	17,157.00	0.01
115	600009	上海机场	300	17,010.00	0.01
116	603882	金域医学	200	16,510.00	0.01
117	600690	海尔智家	600	16,476.00	0.01
118	600845	宝信软件	300	16,380.00	0.01
119	002410	广联达	300	16,332.00	0.01
120	600048	保利发展	900	15,714.00	0.01
121	603338	浙江鼎力	300	15,210.00	0.01
122	000768	中航西飞	500	15,145.00	0.01
123	000895	双汇发展	500	14,650.00	0.01
124	600426	华鲁恒升	500	14,600.00	0.01
125	002027	分众传媒	2,100	14,133.00	0.01
126	601601	中国太保	600	14,118.00	0.01
127	002050	三花智控	500	13,740.00	0.00
128	300888	稳健医疗	200	13,300.00	0.00
129	002001	新和成	580	13,229.80	0.00
130	600570	恒生电子	300	13,062.00	0.00
131	002568	百润股份	420	12,616.80	0.00
132	600660	福耀玻璃	300	12,543.00	0.00
133	000338	潍柴动力	1,000	12,470.00	0.00
134	601865	福莱特	300	11,430.00	0.00
135	603233	大参林	360	11,268.00	0.00
136	600346	恒力石化	500	11,120.00	0.00
137	601633	长城汽车	300	11,112.00	0.00
138	601877	正泰电器	300	10,734.00	0.00
139	600085	同仁堂	200	10,576.00	0.00

140	600019	宝钢股份	1,700	10,234.00	0.00
141	300413	芒果超媒	300	10,008.00	0.00
142	601088	中国神华	300	9,990.00	0.00
143	002008	大族激光	300	9,939.00	0.00
144	600547	山东黄金	500	9,280.00	0.00
145	600741	华域汽车	400	9,200.00	0.00
146	300408	三环集团	300	9,030.00	0.00
147	603019	中科曙光	300	8,706.00	0.00
148	601186	中国铁建	1,100	8,690.00	0.00
149	600028	中国石化	2,000	8,160.00	0.00
150	600029	南方航空	1,100	8,041.00	0.00
151	300144	宋城演艺	500	7,675.00	0.00
152	000876	新希望	500	7,650.00	0.00
153	601238	广汽集团	500	7,620.00	0.00
154	600886	国投电力	700	7,350.00	0.00
155	600176	中国巨石	400	6,964.00	0.00
156	000157	中联重科	1,100	6,776.00	0.00
157	003816	中国广核	2,400	6,720.00	0.00
158	601838	成都银行	400	6,632.00	0.00
159	000069	华侨城 A	1,000	6,490.00	0.00
160	601225	陕西煤业	300	6,354.00	0.00
161	601868	中国能建	2,600	6,162.00	0.00
162	000425	徐工机械	1,100	5,929.00	0.00
163	603993	洛阳钼业	1,000	5,730.00	0.00
164	600584	长电科技	200	5,400.00	0.00
165	002120	韵达股份	300	5,118.00	0.00
166	002624	完美世界	300	4,311.00	0.00
167	600025	华能水电	500	3,495.00	0.00
168	601111	中国国航	200	2,322.00	0.00

## 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	300059	东方财富	1,056,709.80	0.38
2	600989	宝丰能源	928,053.00	0.34
3	300034	钢研高纳	925,993.00	0.34
4	601899	紫金矿业	890,273.00	0.32
5	600919	江苏银行	843,389.00	0.31
6	000301	东方盛虹	839,756.00	0.30

7	601985	中国核电	811,046.00	0.29
8	002389	航天彩虹	697,736.00	0.25
9	002839	张家港行	639,409.00	0.23
10	603833	欧派家居	615,021.00	0.22
11	601128	常熟银行	551,578.00	0.20
12	300454	深信服	518,804.00	0.19
13	600030	中信证券	517,566.00	0.19
14	603501	韦尔股份	513,679.00	0.19
15	600760	中航沈飞	505,914.00	0.18
16	300850	新强联	491,909.00	0.18
17	000902	新洋丰	480,904.00	0.17
18	002415	海康威视	470,198.00	0.17
19	300529	健帆生物	465,824.00	0.17
20	601799	星宇股份	456,892.00	0.17

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	603392	万泰生物	50,575.20	0.02
2	601398	工商银行	30,360.00	0.01
3	600763	通策医疗	27,939.00	0.01
4	000651	格力电器	26,800.00	0.01
5	300033	同花顺	26,001.00	0.01
6	601328	交通银行	25,428.00	0.01
7	002142	宁波银行	24,880.00	0.01
8	603486	科沃斯	22,606.00	0.01
9	002709	天赐材料	22,350.00	0.01
10	601166	兴业银行	20,955.00	0.01
11	601288	农业银行	19,800.00	0.01
12	002916	深南电路	19,260.00	0.01
13	002230	科大讯飞	18,910.00	0.01
14	300601	康泰生物	18,651.00	0.01
15	600837	海通证券	18,183.00	0.01
16	600016	民生银行	17,672.00	0.01
17	002271	东方雨虹	13,563.00	0.00
18	000776	广发证券	13,409.00	0.00
19	600050	中国联通	12,765.00	0.00
20	601229	上海银行	12,760.00	0.00

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	24,657,505.80
卖出股票的收入（成交）总额	736,764.20

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	28,935,053.16	10.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,918,056.44	18.84
	其中：政策性金融债	10,518,104.11	3.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	113,423,783.57	41.17
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	194,276,893.17	70.51

### 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	019674	22 国债 09	200,000	20,077,221.92	7.29

2	2028038	20 中国银行二级 01	100,000	10,655,515.07	3.87
3	2028041	20 工商银行二级 01	100,000	10,652,753.42	3.87
4	101800854	18 豫交投 MTN002	100,000	10,578,285.48	3.84
5	101800997	18 北控集 MTN001	100,000	10,561,682.19	3.83

#### 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投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲资产组合的系统性风险和流动性风险等。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 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

2021 年 9 月 30 日，张家港农商行因流动资金贷款“三查”不到位，被中国银行保险监督管理委员会苏州监管分局（苏州银保监罚决字（2021）32 号）给予罚款人民币 30 万元的行政处罚。

2022 年 3 月 21 日，中国银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在不良贷款余

额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）13 号）给予罚款 480 万元的行政处罚。2022 年 5 月 26 日，中国银行因老产品规模在部分时点出现反弹，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）29 号）给予罚款 200 万元的行政处罚。

2022 年 3 月 21 日，工商银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在抵押物价值 EAST 数据存在偏差、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）11 号）给予罚款 360 万元的行政处罚。

本基金投资张家港行、20 中国银行二级 01、20 工商银行二级 01 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 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	143,526.58
2	应收清算款	5,312.38
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	148,838.96

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明



本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 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

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
19	14,257,331.37	270,869,218.09	99.99%	20,077.99	0.01%

### 8.2 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	0.00	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、基金投资和研究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。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额总 数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.0 0	3.69%	10,000,000.0 0	3.69%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.0 0	3.69%	10,000,000.0 0	3.69%	-

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 3 月 31 日）基金份额总额	641,010,092.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	167,860,286.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	537,981,083.33
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	270,889,296.08

## 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	
中信证券	3	11,084,475.20	43.65%	10,311.66	43.91%	-
浙商证券	1	9,665,725.00	38.06%	8,860.46	37.73%	-
东吴证券	1	3,115,832.00	12.27%	2,901.93	12.36%	-
信达证券	1	1,273,160.80	5.01%	1,173.00	5.00%	-
招商证券	1	255,077.00	1.00%	235.01	1.00%	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	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，最大限度地调动整体资源，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：

2022 年 1 月完成租用托管在招商银行的招商证券深交所 014828 交易单元。

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 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
中信证券	133,718,246.23	13.88%	1,041,500,000.00	43.58%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	829,878,198.57	86.12%	1,348,200,000.00	56.42%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

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	华安乾煜债券型发起式证券投资基金及招募说明书提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-02-22
2	华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-02-22

3	华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-02-22
4	华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-02-22
5	华安乾煜债券型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-02-22
6	华安乾煜债券型发起式证券投资基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-02-22
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	华安乾煜债券型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-31
9	华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-01
10	关于华安乾煜债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-13
11	华安基金管理有限公司关于华安乾煜债券型发起式证券投资基金实施赎回费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-13
12	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
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（福莱转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-24
14	华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-25
15	华安乾煜债券型发起式证券投资基金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	2022-05-27
16	华安乾煜债券型发起式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	2022-05-27

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220418-20220515	0.00	49,999,000.00	49,999,000.00	0.00	0.00%
	2	20220419-20220619	0.00	49,827,249.25	10,000,000.00	39,827,249.25	14.70%
	3	20220516-20220626	0.00	49,854,881.79	0.00	49,854,881.79	18.40%
	4	20220620-20220630	0.00	74,001,487.67	0.00	74,001,487.67	27.32%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

### 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、《华安乾煜债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 2、《华安乾煜债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安乾煜债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安乾煜债券型发起式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