

华安安心收益债券型证券投资基金
2023 年第 1 季度报告
2023 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华安安心收益债券 |
| 基金主代码 | 040036 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012 年 9 月 7 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 95,012,148.95 份 |
| 投资目标 | 在有效控制流动性和风险的前提下，力争持续稳定地实现超越比较基准的当期收益。 |
| 投资策略 | 本基金以“3 年运作周期滚动”的方式投资运作。在每个运作期内采用“华安避险增值机制”，动态调整基础资产和风险资产的配置比例，定期锁定投资收益，控制基金资产净值的波动幅度，实现基金资产的长期稳定增值。同时，本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工 |

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| | 具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定风险资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种和权益类资产之间的配置比例。 | |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款收益率（税后） | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的品种，其预期的风险和预期收益水平低于股票基金和混合基金，高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华安安心收益债券 A | 华安安心收益债券 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 040036 | 040037 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 75,731,388.70 份 | 19,280,760.25 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日) | |
|----------------|---|---------------|
| | 华安安心收益债券 A | 华安安心收益债券 B |
| 1.本期已实现收益 | -352,582.51 | -104,749.73 |
| 2.本期利润 | 681,425.65 | 149,392.77 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0087 | 0.0075 |
| 4.期末基金资产净值 | 77,056,049.82 | 19,462,206.18 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.017 | 1.009 |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低

于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、华安安心收益债券 A:

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.79% | 0.24% | 0.68% | 0.00% | 0.11% | 0.24% |
| 过去六个月 | -3.42% | 0.24% | 1.37% | 0.00% | -4.79% | 0.24% |
| 过去一年 | -2.21% | 0.29% | 2.75% | 0.00% | -4.96% | 0.29% |
| 过去三年 | 7.46% | 0.42% | 8.25% | 0.00% | -0.79% | 0.42% |
| 过去五年 | 18.80% | 0.45% | 13.76% | 0.00% | 5.04% | 0.45% |
| 自基金合同 生效起至今 | 96.43% | 0.47% | 33.13% | 0.00% | 63.30% | 0.47% |

2、华安安心收益债券 B:

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.70% | 0.24% | 0.68% | 0.00% | 0.02% | 0.24% |
| 过去六个月 | -3.54% | 0.24% | 1.37% | 0.00% | -4.91% | 0.24% |
| 过去一年 | -2.61% | 0.29% | 2.75% | 0.00% | -5.36% | 0.29% |
| 过去三年 | 6.28% | 0.42% | 8.25% | 0.00% | -1.97% | 0.42% |
| 过去五年 | 15.58% | 0.45% | 13.76% | 0.00% | 1.82% | 0.45% |
| 自基金合同 生效起至今 | 93.71% | 0.47% | 33.13% | 0.00% | 60.58% | 0.47% |

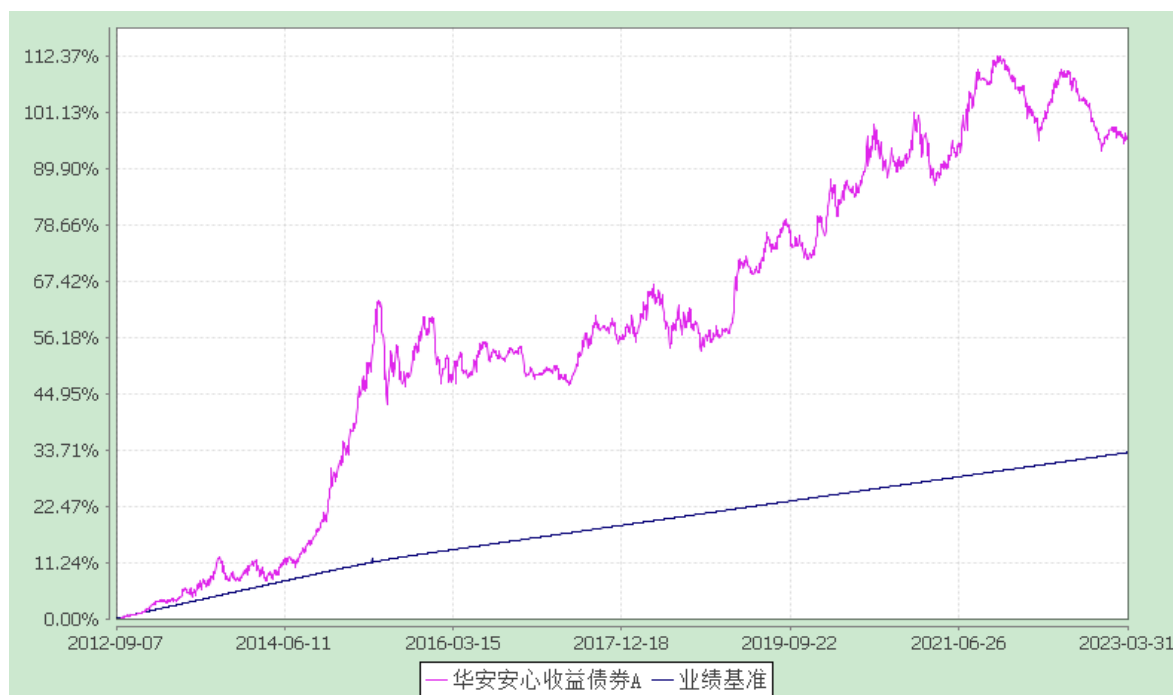
3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安安心收益债券型证券投资基金

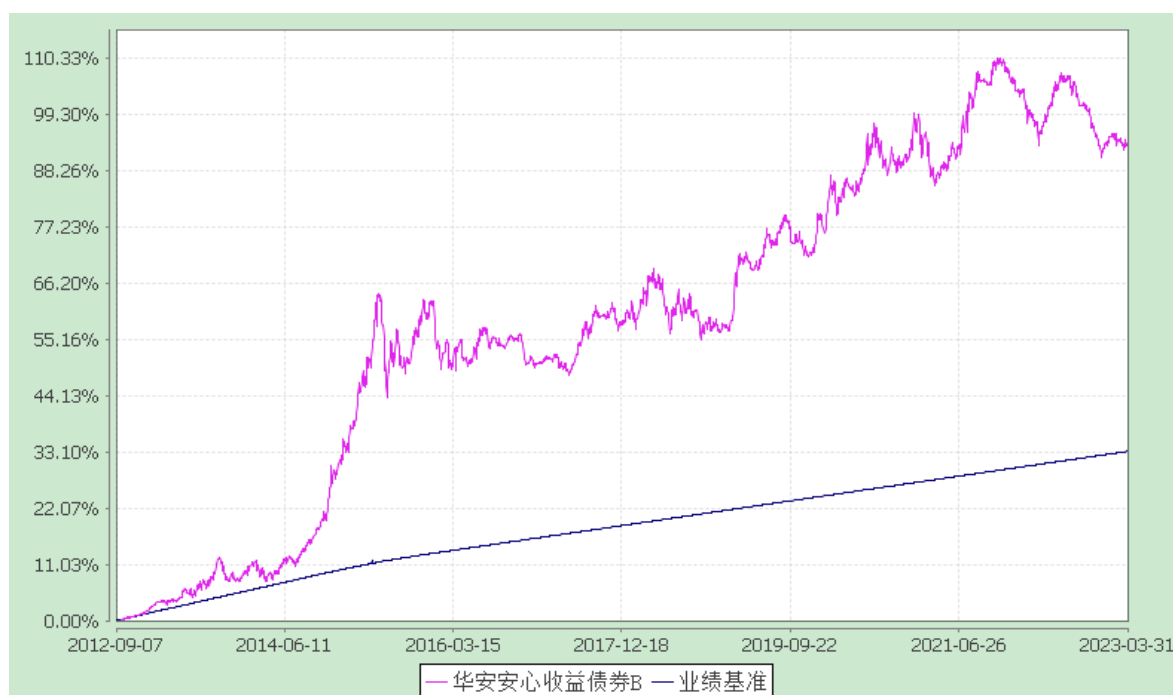
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 9 月 7 日至 2023 年 3 月 31 日)

1. 华安安心收益债券 A:



2. 华安安心收益债券 B:



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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

| | | 限 | | 年限 | |
|-----|-------------------|------------|------------|------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郑可成 | 本基金的基金经理、固定收益部副总监 | 2012-09-07 | 2023-03-28 | 21 年 | <p>硕士研究生，21 年证券基金从业经历。曾任闽发证券有限责任公司高级研究员，益民基金管理有限公司基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月至 2023 年 3 月，担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月至 2023 年 3 月，同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月至 2017 年 7 月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012 年 12 月至 2019 年 2 月，同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月至 2019 年 4 月，同时担任华安添鑫中短债债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月至 2019 年 6 月，同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2023 年 3 月，同时担任华安稳健回报混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月至 2015 年 1 月同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 8 月至 2019 年 12 月，同时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。2015 年 3 月至 2022 年 5 月，同时担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2019 年 12 月，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。2015 年 5 月至 2018 年 6 月，同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月至 2019 年 12 月，同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2019 年 12 月同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的</p> |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|------|---|
| | | | | | <p>基金经理。2015 年 11 月至 2018 年 5 月,同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月至 2020 年 10 月,同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理; 2015 年 12 月至 2018 年 1 月,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2017 年 7 月,同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 7 月,同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月至 2018 年 1 月,同时担任华安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月至 2022 年 9 月,同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 8 月,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 3 月,同时担任华安现金润利浮动净值型发起式货币市场基金的基金经理。2021 年 3 月至 2023 年 3 月,同时担任华安添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 3 月,同时担任华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 周益鸣 | 本基金的基金经理 | 2023-03-28 | - | 14 年 | <p>硕士, 14 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</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>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 月去，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。2023 年 1 月起，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安安心收益债券型证券投资基金、华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报

告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 2 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾今年一季度，债券市场利率整体是先上后下的走势，与之对应的是市场对于宏观经济的判断在强预期和弱现实之间摇摆。春节之前，随着北京等地出行消费的恢复，市场对于全年的经济预期有所上调，利率在此期间小幅走高，但节后随着消费数据并没有超预期上行，同时部分城市二手房带看量和成交在 3 月有所下降，导致利率走势重新回归到弱现实的轨道上。由于去年四季度信用债调整幅度较大，今年以来信用利差得以压缩，因此一季度信用债表现整体强于利率债。可转债类资产在一季度有不错的表现，受益于股市的上涨而上行，同时转股溢价率并没有出现明显的压缩，维持在相对高位，我们认为支撑溢价率高位震荡的重要因素是相对偏低的利率环境。

股票市场整体在一季度有所上涨，结构分化非常明显，中小市值个股表现略强，且以 TMT 为首的成长类个股表现非常突出。价值板块也有机会，尤其是中国特色估值体系相关的大央企，成为市场新的投资方向。

本基金在一季度采取“固收+”的策略，增厚基金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 3 月 31 日，华安安心收益债券 A 份额净值为 1.017 元，B 份额净值为 1.009 元；华安安心收益债券 A 份额净值增长率为 0.79%，B 份额净值增长率为 0.70%，同期业绩比较基准增长率为 0.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，海外经济和金融环境依然存在较大不确定性。美国近期的就业和制造业数据都开始有所下滑，同时 SVB 事件导致银行存款大幅流向货币市场基金，但货币市场基金的投资会使得资金再度回流到银行体系，并没有完全消除风险。国内方面，需要观察房地产销售数据能否持续改善。而消费方面，由于去年二季度的低基数效应，叠加近期出入境旅游等限制政策的放松，预计会有不错的增长。整体看，国内经济向好的概率偏大，债券市场利率下行空间可能有限。

金融市场方面，我们认为二季度货币政策并不会出现明显收紧，在经济复苏态势尚不牢固的情况下，依然会为实体经济提供相对偏低的利率环境，也有利于各类金融资产的定价。在大类资

产配置上，随着经济修复和风险偏好的提高，含权类资产的表现可能会持续强于纯债类资产。股市风格方面，成长和风格可能都有机会，积极关注半导体、数字经济、大金融和泛消费的投资机会。

本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 13,778,577.29 | 12.95 |
| | 其中：股票 | 13,778,577.29 | 12.95 |
| 2 | 固定收益投资 | 86,635,570.65 | 81.42 |
| | 其中：债券 | 86,635,570.65 | 81.42 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,224,336.93 | 4.91 |
| 7 | 其他各项资产 | 772,050.55 | 0.73 |
| 8 | 合计 | 106,410,535.42 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 1,650,600.00 | 1.71 |
| C | 制造业 | 8,070,377.29 | 8.36 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 912,400.00 | 0.95 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 533,600.00 | 0.55 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 922,000.00 | 0.96 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,244,400.00 | 1.29 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 445,200.00 | 0.46 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 13,778,577.29 | 14.28 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 600559 | 老白干酒 | 20,000 | 741,200.00 | 0.77 |
| 2 | 300795 | 米奥会展 | 12,000 | 694,800.00 | 0.72 |
| 3 | 300633 | 开立医疗 | 12,000 | 664,320.00 | 0.69 |
| 4 | 300316 | 晶盛机电 | 10,000 | 652,900.00 | 0.68 |
| 5 | 000922 | 佳电股份 | 50,000 | 574,500.00 | 0.60 |
| 6 | 002568 | 百润股份 | 14,000 | 572,740.00 | 0.59 |
| 7 | 300607 | 拓斯达 | 35,000 | 565,250.00 | 0.59 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 8 | 600028 | 中国石化 | 100,000 | 562,000.00 | 0.58 |
| 9 | 002027 | 分众传媒 | 80,000 | 549,600.00 | 0.57 |
| 10 | 000983 | 山西焦煤 | 50,000 | 549,500.00 | 0.57 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 11,990,793.39 | 12.42 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 41,140,295.89 | 42.62 |
| | 其中：政策性金融债 | 41,140,295.89 | 42.62 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 33,504,481.37 | 34.71 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 86,635,570.65 | 89.76 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 200208 | 20 国开 08 | 400,000 | 41,140,295.89 | 42.62 |
| 2 | 019679 | 22 国债 14 | 60,000 | 6,074,950.68 | 6.29 |
| 3 | 019694 | 23 国债 01 | 59,000 | 5,915,842.71 | 6.13 |
| 4 | 128140 | 润建转债 | 10,000 | 2,140,020.55 | 2.22 |
| 5 | 111010 | 立昂转债 | 15,000 | 2,044,661.10 | 2.12 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 51,334.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | 712,591.59 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 8,124.20 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 772,050.55 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 128140 | 润建转债 | 2,140,020.55 | 2.22 |
| 2 | 113027 | 华钰转债 | 1,665,967.12 | 1.73 |
| 3 | 113021 | 中信转债 | 1,478,673.65 | 1.53 |
| 4 | 113057 | 中银转债 | 1,451,004.16 | 1.50 |
| 5 | 127043 | 川恒转债 | 1,435,150.96 | 1.49 |
| 6 | 123131 | 奥飞转债 | 1,412,525.75 | 1.46 |
| 7 | 113647 | 禾丰转债 | 1,305,061.92 | 1.35 |
| 8 | 113585 | 寿仙转债 | 1,239,643.84 | 1.28 |
| 9 | 127071 | 天箭转债 | 1,108,775.84 | 1.15 |
| 10 | 110048 | 福能转债 | 1,105,702.19 | 1.15 |
| 11 | 123075 | 贝斯转债 | 1,002,230.14 | 1.04 |
| 12 | 113639 | 华正转债 | 990,629.92 | 1.03 |
| 13 | 127056 | 中特转债 | 673,804.11 | 0.70 |
| 14 | 123122 | 富瀚转债 | 615,204.11 | 0.64 |
| 15 | 123146 | 中环转 2 | 587,634.93 | 0.61 |
| 16 | 123098 | 一品转债 | 556,764.25 | 0.58 |
| 17 | 113615 | 金诚转债 | 555,973.97 | 0.58 |
| 18 | 113649 | 丰山转债 | 527,611.18 | 0.55 |
| 19 | 123107 | 温氏转债 | 513,386.30 | 0.53 |
| 20 | 113052 | 兴业转债 | 506,766.44 | 0.53 |
| 21 | 127047 | 帝欧转债 | 494,015.75 | 0.51 |
| 22 | 110083 | 苏租转债 | 441,117.66 | 0.46 |
| 23 | 110090 | 爱迪转债 | 430,244.79 | 0.45 |
| 24 | 123085 | 万顺转 2 | 420,309.86 | 0.44 |
| 25 | 113643 | 风语转债 | 412,523.01 | 0.43 |
| 26 | 127020 | 中金转债 | 375,226.03 | 0.39 |
| 27 | 110085 | 通 22 转债 | 371,314.68 | 0.38 |
| 28 | 127006 | 敖东转债 | 359,799.86 | 0.37 |
| 29 | 123044 | 红相转债 | 350,846.71 | 0.36 |
| 30 | 127058 | 科伦转债 | 347,804.55 | 0.36 |
| 31 | 110052 | 贵广转债 | 325,496.71 | 0.34 |
| 32 | 113626 | 伯特转债 | 321,708.70 | 0.33 |
| 33 | 113056 | 重银转债 | 291,983.67 | 0.30 |
| 34 | 128087 | 孚日转债 | 260,822.03 | 0.27 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 35 | 113656 | 嘉诚转债 | 233,398.79 | 0.24 |
| 36 | 127042 | 嘉美转债 | 228,795.07 | 0.24 |
| 37 | 118012 | 微芯转债 | 150,754.32 | 0.16 |
| 38 | 110075 | 南航转债 | 126,415.77 | 0.13 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华安安心收益债券A | 华安安心收益债券B |
|----------------|---------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 82,879,311.40 | 20,386,857.29 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 945,290.08 | 308,016.45 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 8,093,212.78 | 1,414,113.49 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 75,731,388.70 | 19,280,760.25 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安安心收益债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安心收益债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安安心收益债券型证券投资基金托管协议》

9.2存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

9.3查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二三年四月二十一日