

**华安沅悦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       | 华安沅悦债券   |
| 基金主代码      | 016142   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022 年 8 月 23 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 734,856,476.88 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。  |
| 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、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×90%+中证 800 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率×2%   |                 |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，但低于股票型基金、混合型基金。<br>本基金若投资港股通标的股票，将面临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。 |                 |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司  |                 |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安沅悦债券 A  | 华安沅悦债券 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 016142  | 016143          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 709,637,418.93 份  | 25,219,057.95 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<br>(2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日) |               |
|----------------|---|---------------|
|                | 华安沅悦债券 A                                | 华安沅悦债券 C      |
| 1.本期已实现收益      | 1,639,621.28                            | 37,013.74     |
| 2.本期利润         | 5,882,306.88                            | 216,968.88    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0075                                  | 0.0075        |
| 4.期末基金资产净值     | 707,490,674.62                          | 25,089,933.93 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9970                                  | 0.9949        |

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、本基金于2022年8月23日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年；

### 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、华安沅悦债券 A：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.59%      | 0.15%         | 0.69%          | 0.08%                 | -0.10% | 0.07% |
| 过去六个月          | 0.49%      | 0.17%         | 0.62%          | 0.11%                 | -0.13% | 0.06% |
| 过去一年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 过去三年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 过去五年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -0.30%     | 0.16%         | -0.77%         | 0.11%                 | 0.47%  | 0.05% |

##### 2、华安沅悦债券 C：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.49%      | 0.15%         | 0.69%          | 0.08%                 | -0.20% | 0.07% |
| 过去六个月          | 0.31%      | 0.17%         | 0.62%          | 0.11%                 | -0.31% | 0.06% |
| 过去一年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 过去三年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 过去五年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -0.51%     | 0.16%         | -0.77%         | 0.11%                 | 0.26%  | 0.05% |

注：1、本基金于2022年8月23日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年；

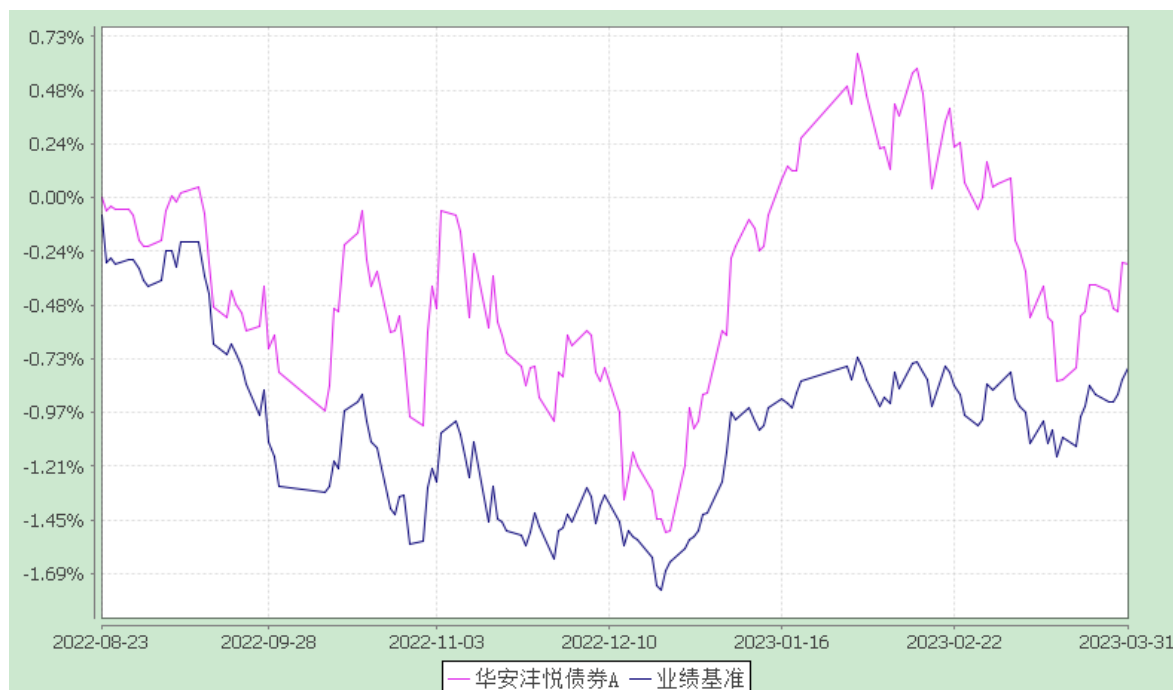
2、根据本基金合同规定，本基金建仓期为6个月，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

#### 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

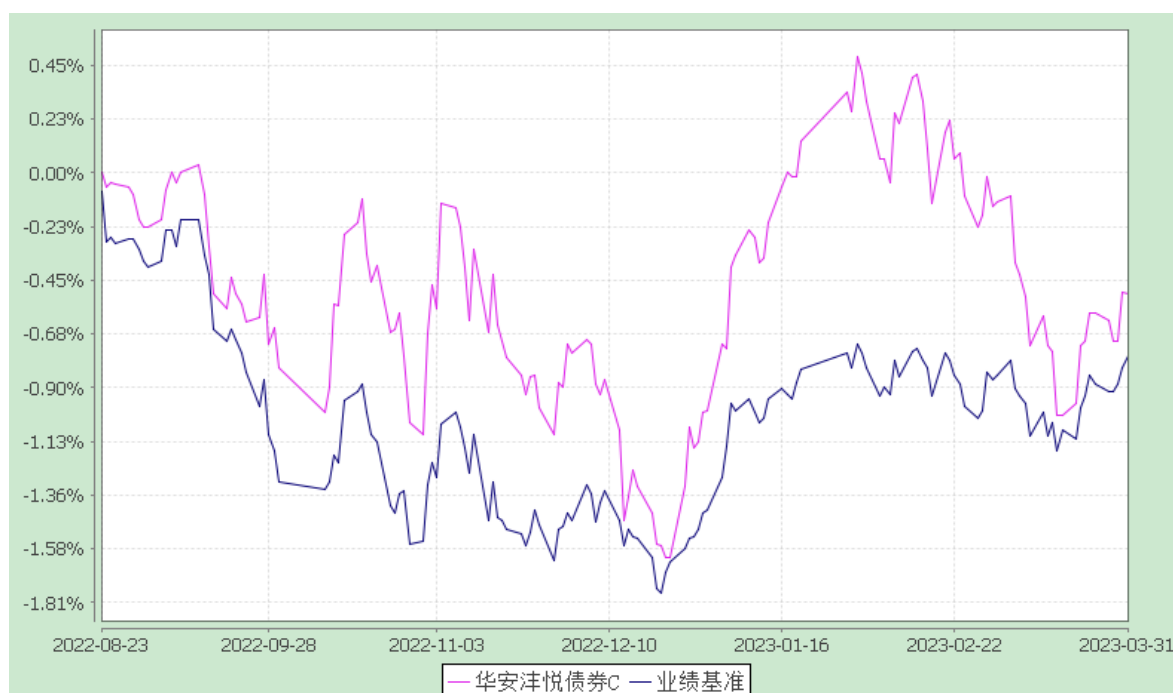
华安沅悦债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022 年 8 月 23 日至 2023 年 3 月 31 日)

1. 华安沅悦债券 A:



2. 华安沅悦债券 C:



## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------|-------------|------|--------|--|
|     |          | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 吴文明 | 本基金的基金经理 | 2022-08-23  | -    | 13 年   | 13 年金融、基金行业从业经验。曾任威海市商业银行交易员、银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理、银华基金管理股份有限公司投资管理三部基金经理。2021 年 7 月加入华安基金，现任绝对收益投资部基金经理。2021 年 11 月起担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月起，同时担任华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起，同时担任华安沅悦债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起，同时担任华安沅裕债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安招裕一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 郑伟山 | 本基金的基金经理 | 2023-03-23  | -    | 14 年   | 硕士研究生，14 年金融、基金行业从业经验。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，任职于绝对收益投资部。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。2022 年 9 月起，同时担任华安强化收益债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金、华安沅悦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 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。

#### 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

一季度经济渐进修复，结构仍然存在分化。从需求端来看：1-2 月固定资产投资同比增长 5.5%，主要依靠基建和制造业拉动，地产投资好于预期，降幅收窄。1-2 月地产投资同比下降 5.7%，降幅显著收窄，地产销售面积同比下降 3.6%、销售额同比下降 0.1%，投资和销售表现均好于预期，但拿地数据尚在低位。1-2 月基建投资同比增长 12.2%，财政前置支撑基建投资维持较高增速。1-2 月制造业投资表现出一定韧性，同比增长 8.1%。出口方面，1-2 月按美元计价出口同比下降 6.8%，延续负增长。消费方面，1-2 月社会零售品销售总额同比增长 3.5%，年初以来消费从底部修复，接触性消费表现较好，汽车等大宗消费表现偏弱。从生产端看：受出口低迷、库存偏高、基数较高等因素影响，1-2 月工业增加值同比增长 2.4%，增速不高。

货币政策方面，3 月 17 日央行宣布决定于 2023 年 3 月 27 日降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，体现呵护市场流动性的态度。一季度伴随银行信贷投放增加，超储率下降，资金利率中枢向政策利率回归，资金面波动有所加大。

债券市场方面，截至 3 月底，1 年期国开债估值收益率较去年 12 月底上行 16BP 至 2.39%，



10 年期国开债上行 3BP 至 3.02%，曲线平坦化上行。1 年期 AAA 中票估值收益率较去年 12 月底上行 6BP 至 2.77%，信用利差压缩 10BP；3 年期 AAA 中票下行 11BP 至 3.07%，信用利差压缩 23BP，信用表现好于利率。策略上，组合灵活调整久期和杠杆，结构上配置集中于高等级信用债，精选品种和个券增厚收益，同时在收益率曲线上寻找凸点，把握交易性机会。

股票市场方面，一季度上证指数上涨 5.9%，行情主要分为两个阶段，一月份股票市场在防疫政策优化和经济修复提速等利好下呈单边上涨趋势，二月以来外围扰动增加、市场震荡分化。结构上，科技行业涨幅大幅领先，计算机、传媒、通信和电子一季度分别收涨 38.7%、34.2%、28.9% 和 16.9%，“中特估”相关板块表现也较为亮眼，如建筑、石油石化和机械分别上涨 11.5%、10.8% 和 7.4%，消费者服务、房地产、综合、银行和电力设备新能源等行业收跌。策略上，本基金基于行业景气度和估值匹配程度，进行了均衡配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 3 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.9970 元，本报告期份额净值增长率为 0.59%；本基金 C 类份额净值为 0.9949 元，本报告期份额净值增长率为 0.49%。同期业绩比较基准增长率为 0.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济体现为不均衡的复苏，基建等部门仍是重要支撑，内生动能尚不强劲，地产和消费恢复的斜率和持续性仍需要观察。目前看消费整体上可能是渐进修复，居民收入的改善、居民消费倾向的提升依然需要时间。年初地产销售和投资表现均好于预期，目前拿地数据未有明显起色，房地产尚未进入全局性改善的阶段。货币政策方面，当前经济复苏基础尚不稳固，货币政策暂无收紧基础。

债券方面，组合将灵活调整久期和杠杆，在严格控制信用风险的前提下，精选中高评级信用债。

权益方面，股票市场整体和多数行业估值处于合理或偏低位置，股市性价比仍处于较高水平，本基金将根据市场情况，围绕政策、景气提速、经济复苏三个方向优选行业与个券，适当调整股票持仓结构。转债方面，估值水平整体处于历史较高位置，估值仍是未来转债投资收益的掣肘因素，组合将自下而上择优进行配置。

#### 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              | 121,039,152.40 | 16.09        |
|    | 其中：股票             | 121,039,152.40 | 16.09        |
| 2  | 固定收益投资            | 627,075,983.68 | 83.34        |
|    | 其中：债券             | 627,075,983.68 | 83.34        |
|    | 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      | 4,246,225.57   | 0.56         |
| 7  | 其他各项资产            | 99,068.05      | 0.01         |
| 8  | 合计                | 752,460,429.70 | 100.00       |

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为226118.40元，占基金资产净值比例为0.03%。

## 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 | 1,746,091.00 | 0.24         |
| B  | 采矿业      | 4,025,511.00 | 0.55         |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业              | 82,841,258.00  | 11.31 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 748,020.00     | 0.10  |
| E | 建筑业              | 3,900,237.00   | 0.53  |
| F | 批发和零售业           | 3,713,220.00   | 0.51  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,599,651.00   | 0.22  |
| J | 金融业              | 10,308,234.00  | 1.41  |
| K | 房地产业             | 3,242,835.00   | 0.44  |
| L | 租赁和商务服务业         | 4,633,931.00   | 0.63  |
| M | 科学研究和技术服务业       | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 4,054,046.00   | 0.55  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 120,813,034.00 | 16.49 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币）  | 占基金资产净值比例（%） |
|------|------------|--------------|
| 医疗保健 | 226,118.40 | 0.03         |
| 合计   | 226,118.40 | 0.03         |

### 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  | 603606 | 东方电缆 | 97,200  | 4,792,932.00 | 0.65         |
| 2  | 601899 | 紫金矿业 | 324,900 | 4,025,511.00 | 0.55         |
| 3  | 601888 | 中国中免 | 20,400  | 3,738,096.00 | 0.51         |
| 4  | 300015 | 爱尔眼科 | 109,800 | 3,411,486.00 | 0.47         |
| 5  | 600048 | 保利发展 | 229,500 | 3,242,835.00 | 0.44         |
| 6  | 601100 | 恒立液压 | 48,300  | 3,198,426.00 | 0.44         |
| 7  | 002389 | 航天彩虹 | 134,300 | 3,045,924.00 | 0.42         |
| 8  | 000831 | 中国稀土 | 88,400  | 2,985,268.00 | 0.41         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 9  | 300059 | 东方财富 | 140,500 | 2,814,215.00 | 0.38 |
| 10 | 600989 | 宝丰能源 | 186,300 | 2,747,925.00 | 0.38 |

#### 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      | 60,799,289.83  | 8.30         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 233,443,532.39 | 31.87        |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 81,028,032.34  | 11.06        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 233,994,540.59 | 31.94        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 17,810,588.53  | 2.43         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 627,075,983.68 | 85.60        |

#### 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  | 2028013   | 20 农业银行二级 01        | 500,000 | 51,426,095.89 | 7.02         |
| 2  | 1928019   | 19 交通银行二级 01        | 400,000 | 41,631,550.68 | 5.68         |
| 3  | 019679    | 22 国债 14            | 400,300 | 40,530,045.99 | 5.53         |
| 4  | 102280642 | 22 申能股 MTN001(碳中和债) | 400,000 | 40,006,491.80 | 5.46         |
| 5  | 1828008   | 18 中信银行二级 01        | 300,000 | 31,099,273.97 | 4.25         |

#### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易。本基金按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎参与国债期货投资交易。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2022 年 9 月 30 日，农业银行因理财业务存在（1）作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况（2）理财托管业务违反资产独立性原则要求，操作管理不到位的违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕52 号）给予罚款 150 万元的行政处罚。

2022 年 9 月 9 日，交通银行因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人消费贷款违规流入房地产市场等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕46 号）给予罚款 500 万元的行政处罚。

本基金投资上述证券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。

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   | 99,068.05 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 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      | 99,068.05 |

### 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  | 113052 | 兴业转债 | 5,067,664.38 | 0.69         |
| 2  | 113044 | 大秦转债 | 4,303,255.91 | 0.59         |
| 3  | 127032 | 苏行转债 | 2,690,484.28 | 0.37         |
| 4  | 110067 | 华安转债 | 2,665,950.62 | 0.36         |
| 5  | 128136 | 立讯转债 | 1,742,407.87 | 0.24         |
| 6  | 127061 | 美锦转债 | 1,021,750.74 | 0.14         |
| 7  | 110079 | 杭银转债 | 319,074.73   | 0.04         |

### 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             | 华安沅悦债券A        | 华安沅悦债券C       |
|----------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 874,396,382.56 | 34,091,928.71 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 21,504,325.85  | 386,460.83    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 186,263,289.48 | 9,259,331.59  |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额   | 709,637,418.93 | 25,219,057.95 |

## §7 影响投资者决策的其他重要信息

### 7.1 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。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、《华安沅悦债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安沅悦债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安沅悦债券型证券投资基金托管协议》

### 8.2 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>。

### 8.3 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