

---

汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月24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7月1日起至2023年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	汇安永福90天持有期中短债债券	
基金主代码	010577	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年05月10日	
报告期末基金份额总额	135,169,319.38份	
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险和保持良好流动性的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金的投资策略包括债券投资策略、资产支持证券等品种投资策略。在进行债券投资时，本基金将会考量利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略和债券选择策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。	
业绩比较基准	中债总财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇安永福90天持有期中短债债券A	汇安永福90天持有期中短债债券C

下属分级基金的交易代码	010577	010578
报告期末下属分级基金的份额总额	115,924,800.15份	19,244,519.23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07月01日 - 2023年09月30日)	
	汇安永福90天持有期中短债债券A	汇安永福90天持有期中短债债券C
1.本期已实现收益	191,206.97	85,870.02
2.本期利润	125,674.83	48,392.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0040	0.0033
4.期末基金资产净值	119,265,688.21	19,744,252.04
5.期末基金份额净值	1.0288	1.0260

注：1、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。

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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

汇安永福90天持有期中短债债券A净值表现

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	0.32%	0.01%	0.40%	0.02%	-0.08%	-0.01%
过去六个月	1.08%	0.01%	1.39%	0.02%	-0.31%	-0.01%
过去一年	1.87%	0.02%	2.18%	0.03%	-0.31%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.19%	0.02%	3.41%	0.03%	-0.22%	-0.01%

汇安永福90天持有期中短债债券C净值表现

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	0.28%	0.01%	0.40%	0.02%	-0.12%	-0.01%
过去六个月	0.99%	0.01%	1.39%	0.02%	-0.40%	-0.01%
过去一年	1.67%	0.02%	2.18%	0.03%	-0.51%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.91%	0.02%	3.41%	0.03%	-0.50%	-0.01%

### 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

汇安永福90天持有期中短债债券A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05月10日-2023年09月30日)



汇安永福90天持有期中短债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：①基金合同生效日为2022年5月10日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

②根据《汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、中期票据，短期融资券、超短期融资券、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分及其他经证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具等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的相关规定）。本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金投资组合资产配置比例：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的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。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期为2022年5月10日至2022年11月9日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

## §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	证券	说明
----	----	--------	----	----

		基金经理期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
黄济宽	固定收益投资部高级经理、本基金的基金经理	2022-05-10	-	11年	黄济宽先生，英国纽卡斯尔大学金融学硕士研究生，11年证券、基金行业从业经验。曾任西藏同信证券股份有限公司固定收益业务委员会产品管理总部投资主办人，新沃基金管理有限公司特定客户资产投资部投资经理，华创证券有限责任公司资产管理总部高级投资经理。2019年9月加入汇安基金管理有限责任公司，担任固定收益投资部基金经理一职。2019年12月11日至2021年7月23日、2022年7月1日至2023年7月19日，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年7月23日，任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年7月28日，任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年7月28日，任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年8月4日，任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至2021年8月4日，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理；2019年11月13

					<p>日至今，任汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2020年4月29日至今，任汇安短债债券型证券投资基金基金经理；2020年4月29日至今，任汇安中短债债券型证券投资基金基金经理；2022年3月10日至今，任汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金基金经理；2022年5月10日至今，任汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金基金经理；2023年6月29日至今，任汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。



#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度中旬起债券市场受房地产政策放松、资金面偏紧以及政府债供给影响，收益率出现明显反弹。虽然从基本面因素来看尚未对债券资产造成压力，但市场层面的因素正在增加债市的不确定性。

报告期内本基金因申购导致规模增加，资产组合处于重新配置阶段。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安永福90天持有期中短债债券A基金份额净值为1.0288元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.32%，同期业绩比较基准收益率为0.40%；截至报告期末汇安永福90天持有期中短债债券C基金份额净值为1.0260元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.28%，同期业绩比较基准收益率为0.40%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至2023年9月10日，本基金连续超过二十个工作日基金资产净值低于五千万元。2023年9月11日至本报告期末，本基金未出现连续超过二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

### §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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	114,480,043.85	82.28
	其中：债券	114,480,043.85	82.28
	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	23,773,370.08	17.09
	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	185,219.40	0.13
8	其他资产	697,285.78	0.50
9	合计	139,135,919.11	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	2,027,525.48	1.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	92,281,780.67	66.39
	其中：政策性金融债	30,771,679.46	22.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,164,672.13	7.31
6	中期票据	10,006,065.57	7.20
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	114,480,043.85	82.35

## 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例 (%)
1	210202	21国开02	200,000	20,480,345.21	14.73
2	1828011	18中国银行二级02	100,000	10,476,591.78	7.54
3	2128035	21华夏银行02	100,000	10,317,835.62	7.42
4	2128041	21广发银行小微债	100,000	10,312,850.96	7.42
5	210218	21国开18	100,000	10,291,334.25	7.40

**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。

**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。

**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**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**5.11 投资组合报告附注**

**5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、太平石化金融租赁有限责任公司在本报告期编制前一年内曾受行政处罚，相关主体作为债券发行人，经营稳健，业绩良好，所受处罚不影响发行人的实际经营，经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，相关债券被纳入本基金的实际投资组合。

本基金投资的前十名证券的发行主体中其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.11.2 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。**

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,342.81
2	应收证券清算款	36,616.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	657,326.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	697,285.78

**5.11.4 报告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。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

	汇安永福90天持有期中短债债券A	汇安永福90天持有期中短债债券C
报告期期初基金份额总额	21,391,708.39	18,999,250.71

报告期期间基金总申购份额	107,155,188.04	11,458,528.51
减：报告期期间基金总赎回份额	12,622,096.28	11,213,259.99
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	115,924,800.15	19,244,519.23

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 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

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	20230918-20230930	-	53,495,768.89	-	53,495,768.89	39.58%
个人	1	20230911-20230917	2,950,137.72	20,472,167.68	2,950,137.72	20,472,167.68	15.15%
	2	20230906-20230910	-	9,725,681.33	-	9,725,681.33	7.20%

#### 产品特有风险

本基金本报告期内存在单一基金份额持有人持有基金份额比例超过20%的情况，投资人在投资本基金时，可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险，具体包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于5000万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理，保护中小投资者利益。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金招募说明书》

- (4) 《汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

## 9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

## 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2023年10月25日