

华安稳固收益债券型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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：二〇二二年十月二十五日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 21 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华安稳固收益债券 |
| 基金主代码 | 040019 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010 年 12 月 21 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 344,253,415.06 份 |
| 投资目标 | 在追求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造高于比较基准收益的当期收益。 |
| 投资策略 | 本基金将通过分析宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，优化基金资产在固定收益类资产和权益类资产之间，以及各类固定收益类金融工具之间的配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中较低风险的品种，其预期的风 |

| | | |
|-----------------|----------------------------------|------------------|
| | 险水平和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，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 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华安稳固收益债券 A | 华安稳固收益债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002534 | 040019 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 64,354,921.00 份 | 279,898,494.06 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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日) | |
|----------------|---|----------------|
| | 华安稳固收益债券 A | 华安稳固收益债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 825,932.63 | 3,310,747.58 |
| 2.本期利润 | 142,021.36 | 473,248.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0022 | 0.0016 |
| 4.期末基金资产净值 | 75,982,348.40 | 319,146,411.91 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.181 | 1.140 |

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、华安稳固收益债券 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 | 0.25% | 0.12% | 0.73% | 0.05% | -0.48% | 0.07% |
| 过去六个月 | 1.29% | 0.14% | 1.03% | 0.04% | 0.26% | 0.10% |
| 过去一年 | 1.64% | 0.19% | 1.73% | 0.05% | -0.09% | 0.14% |
| 过去三年 | 13.39% | 0.23% | 3.81% | 0.07% | 9.58% | 0.16% |
| 过去五年 | 23.60% | 0.19% | 8.27% | 0.06% | 15.33% | 0.13% |
| 自基金合同 生效起至今 | 81.39% | 1.13% | 6.33% | 0.07% | 75.06% | 1.06% |

2、华安稳固收益债券 C:

| 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 | 0.09% | 0.12% | 0.73% | 0.05% | -0.64% | 0.07% |
| 过去六个月 | 1.06% | 0.13% | 1.03% | 0.04% | 0.03% | 0.09% |
| 过去一年 | 1.33% | 0.19% | 1.73% | 0.05% | -0.40% | 0.14% |
| 过去三年 | 12.13% | 0.23% | 3.81% | 0.07% | 8.32% | 0.16% |
| 过去五年 | 21.12% | 0.19% | 8.27% | 0.06% | 12.85% | 0.13% |
| 自基金合同 生效起至今 | 82.17% | 0.23% | 37.31% | 0.05% | 44.86% | 0.18% |

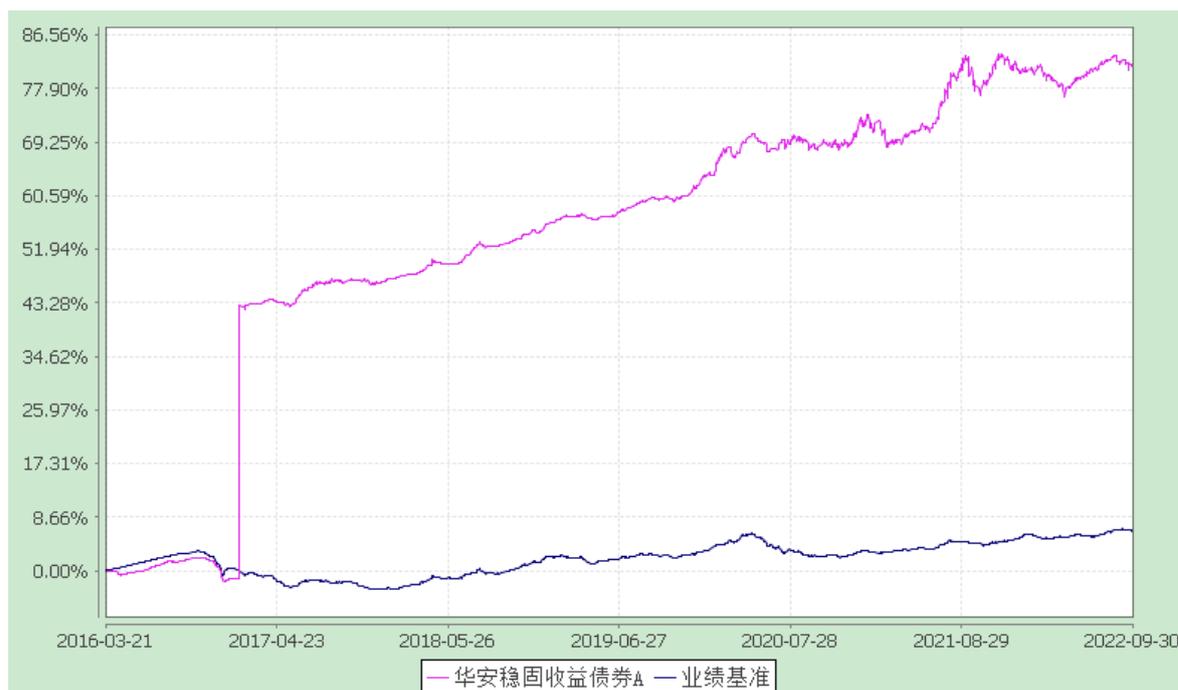
3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安稳固收益债券型证券投资基金

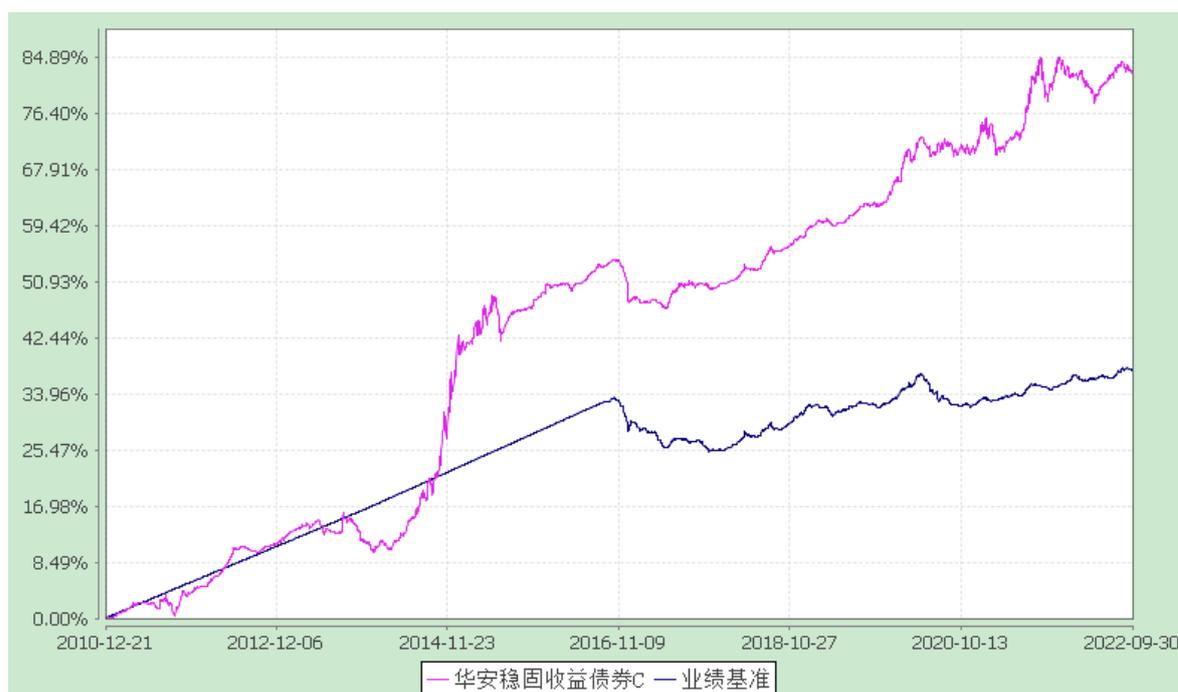
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010 年 12 月 21 日至 2022 年 9 月 30 日)

1. 华安稳固收益债券 A:



2. 华安稳固收益债券 C:



注：自 2016 年 3 月 22 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 | | |
| 郑可成 | 本基金的基金经理、固定收益部副总监 | 2010-12-21 | - | 21 年 | <p>硕士研究生，21 年证券基金从业经历。历任闽发证券有限责任公司担任研究员，福建儒林投资顾问有限公司任研究员，益民基金管理有限公司基金经理。2009 年 8 月加入华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月起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 月起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 月起，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，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</p> |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|------|--|
| | | | | | <p>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 月起，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 月起，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 月起，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> |
| 石雨欣 | 本基金的基金经理 | 2015-07-17 | - | 16 年 | <p>硕士研究生，16 年相关行业从业经验，曾任联合资信评估有限公司高级分析师。2008 年 1 月加入华安基金管理有限公司，历任固定收益部信用分析师。2015 年 7 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月至 2017 年 6 月担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>理。2016 年 2 月至 2018 年 8 月，担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 8 月起，同时担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月至 2018 年 9 月，同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 2 月至 2018 年 6 月，同时担任华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 2 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。2021 年 3 月起，同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月起，同时担任华安鼎安优选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 0 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

2022 年三季度海外通胀压力进一步上升，美联储紧缩政策再次加码，美债利率大幅上行，人民币汇率承压。国内经济受地产拖累以及消费修复受阻，经济基本面的回升压力有所增大，货币政策更加积极，8 月份央行进一步下调政策性利率并加大了 5 年期 LPR 利率的下调幅度，加大了对实体经济的支持力度。财政方面继续推进留底退税以及加快专项债的发行和投入使用，基建投资成为投资回升的主要动能。随着货币和财政政策的逐步落实，社融开始出现回升，银行体系资金利率中枢有所上行，债券利率出现回调。总体看，三季度债券收益率先下后上总体小幅下降，信用债整体表现好于利率债，期内中债综合全价(总值)指数上涨 0.73%。权益市场三季度受海外货币政策紧缩进一步加剧以及国内经济修复不及预期的影响，整体出现一定幅度调整，成长板块调整幅度相对较大，价值板块表现相对抗跌。

期内组合阶段性参与了利率债的波段投资机会，保持了一定杠杆水平，根据市场变化灵活调整组合的久期；期内组合压缩了可转债及对应正股的持仓，降低了权益市场的调整对基金净值的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日，华安稳固收益债券 A 份额净值为 1.181 元，C 份额净值为 1.140 元；华安稳固收益债券 A 份额净值增长率为 0.25%，C 份额净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准增长率为 0.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，海外通胀韧性较强，海外的货币紧缩压力依然存在。国内随着房地产刺激政策进一步加码，预计房地产销售和投资将逐步改善，基建将继续成为投资回升的主力，国内基本面的边际改善有望逐步显现。资金利率中枢将可能小幅抬升，短期内债市的压力有所上升，所以债市投资略偏谨慎，投资上控制债券久期，提高组合流动性。

本基金下一阶段将继续保持继续控制组合久期，由于信用利差处于历史较低水平，组合将逐步降低信用债持仓比重，提高组合流动性，合理进行杠杆操作；继续控制转债及对应正股的权益性仓位，精选业绩增长有持续性、估值合理的优质可转债进行配置。

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 | 9,003,801.66 | 2.28 |
| | 其中：股票 | 9,003,801.66 | 2.28 |
| 2 | 固定收益投资 | 324,686,104.08 | 82.06 |
| | 其中：债券 | 324,686,104.08 | 82.06 |
| | 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 | 59,872,507.26 | 15.13 |
| | 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 | 2,092,599.57 | 0.53 |
| 7 | 其他各项资产 | 21,437.49 | 0.01 |
| 8 | 合计 | 395,676,450.06 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 6,078,822.28 | 1.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,490,169.38 | 0.38 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,434,810.00 | 0.36 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 9,003,801.66 | 2.28 |

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 | 603606 | 东方电缆 | 28,000 | 1,952,440.00 | 0.49 |
| 2 | 603871 | 嘉友国际 | 78,554 | 1,490,169.38 | 0.38 |
| 3 | 600845 | 宝信软件 | 39,000 | 1,434,810.00 | 0.36 |
| 4 | 002756 | 永兴材料 | 10,000 | 1,242,000.00 | 0.31 |
| 5 | 002832 | 比音勒芬 | 38,864 | 855,396.64 | 0.22 |
| 6 | 601222 | 林洋能源 | 100,000 | 671,000.00 | 0.17 |
| 7 | 300657 | 弘信电子 | 60,000 | 660,000.00 | 0.17 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 8 | 603305 | 旭升股份 | 9,079 | 328,296.64 | 0.08 |
| 9 | 603035 | 常熟汽饰 | 12,540 | 220,453.20 | 0.06 |
| 10 | 002538 | 司尔特 | 17,353 | 149,235.80 | 0.04 |

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 | 3,027,752.88 | 0.77 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 50,910,739.72 | 12.88 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,910,739.72 | 12.88 |
| 4 | 企业债券 | 62,047,650.41 | 15.70 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 186,353,420.84 | 47.16 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 22,346,540.23 | 5.66 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 324,686,104.08 | 82.17 |

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 | 102100090 | 21 南通高新 MTN001 | 300,000 | 31,506,881.10 | 7.97 |
| 2 | 143605 | 18 扬城控 | 300,000 | 31,119,780.82 | 7.88 |
| 3 | 102100074 | 21 惠山国投 MTN001 | 300,000 | 30,933,115.07 | 7.83 |
| 4 | 163231 | 20 首创 01 | 300,000 | 30,927,869.59 | 7.83 |
| 5 | 102280913 | 22 光明 MTN002 | 300,000 | 30,574,648.77 | 7.74 |

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

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**

无。

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 3 月 21 日，国家开发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据、漏报贸易融资业务 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〕8 号）给予罚款 440 万元的行政处罚。

本基金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 | 5,954.51 |

| | | |
|---|---------|-----------|
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 15,482.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 21,437.49 |

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 | 113042 | 上银转债 | 2,666,165.07 | 0.67 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 2,528,865.21 | 0.64 |
| 3 | 110059 | 浦发转债 | 2,151,024.66 | 0.54 |
| 4 | 123044 | 红相转债 | 1,843,676.14 | 0.47 |
| 5 | 128116 | 瑞达转债 | 1,602,990.41 | 0.41 |
| 6 | 128046 | 利尔转债 | 1,536,973.97 | 0.39 |
| 7 | 132018 | G 三峡 EB1 | 1,428,417.81 | 0.36 |
| 8 | 110061 | 川投转债 | 1,367,001.37 | 0.35 |
| 9 | 113051 | 节能转债 | 1,352,064.27 | 0.34 |
| 10 | 113048 | 晶科转债 | 1,171,264.38 | 0.30 |
| 11 | 123123 | 江丰转债 | 932,528.77 | 0.24 |
| 12 | 123107 | 温氏转债 | 656,019.18 | 0.17 |
| 13 | 113621 | 彤程转债 | 640,808.90 | 0.16 |
| 14 | 127040 | 国泰转债 | 595,176.99 | 0.15 |
| 15 | 123049 | 维尔转债 | 542,998.77 | 0.14 |
| 16 | 110075 | 南航转债 | 539,590.90 | 0.14 |
| 17 | 113626 | 伯特转债 | 492,966.03 | 0.12 |
| 18 | 123071 | 天能转债 | 298,007.40 | 0.08 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华安稳固收益债券A | 华安稳固收益债券C |
|----------------|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 64,501,265.93 | 298,293,663.32 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,174,154.04 | 891,923.48 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,320,498.97 | 19,287,092.74 |
| 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 | 64,354,921.00 | 279,898,494.06 |

§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

| 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 | 20220701-20220930 | 113,935,144.61 | 0.00 | 16,050,000.00 | 97,885,144.61 | 28.43% |
| | 2 | 20220701-20220930 | 148,685,813.35 | 0.00 | 0.00 | 148,685,813.35 | 43.19% |
| 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。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安稳固收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安稳固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

二〇二二年十月二十五日