

**华安强化收益债券型证券投资基金**  
**2022 年第 4 季度报告**  
**2022 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

## §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 2023 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                        |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华安强化收益债券                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 040012                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2009 年 4 月 13 日                                                                                                                                        |
| 报告期末基金份额总额 | 55,006,337.92 份                                                                                                                                        |
| 投资目标       | 在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过增强信用产品的投资，以获取资产的长期增值。                                                                                                              |
| 投资策略       | 本基金将以宏观经济、市场利率研究主导固定收益资产投资，在控制风险和保持资产流动性的前提下，获取债券市场平均收益；同时在严格的信用评估和利差分析基础上，通过投资于有一定信用风险、具有较高收益率的信用类债券，以获取超越市场平均水平的收益；此外，本基金还将通过积极的新股申购和个股精选来增强基金资产的收益。 |
| 业绩比较基准     | 中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率                                                                                                                              |

|                 |                                                                                  |                 |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                 | ×10%                                                                             |                 |
| 风险收益特征          | 本基金属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险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，属于证券投资基金中的中低风险和中低等收益品种。 |                 |
| 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     | 华安强化收益债券 A                                                                       | 华安强化收益债券 B      |
| 下属分级基金的交易代码     | 040012                                                                           | 040013          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 32,201,884.64 份                                                                  | 22,804,453.28 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>(2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日) |               |
|----------------|-------------------------------------------|---------------|
|                | 华安强化收益债券 A                                | 华安强化收益债券 B    |
| 1.本期已实现收益      | 33,578.04                                 | -3,037.62     |
| 2.本期利润         | -374,801.82                               | -295,478.83   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0113                                   | -0.0126       |
| 4.期末基金资产净值     | 35,825,746.88                             | 25,182,836.77 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.113                                     | 1.104         |

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、华安强化收益债券 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          | -0.98%     | 0.38%         | -0.43%         | 0.10%                 | -0.55%  | 0.28% |
| 过去六个月          | -3.80%     | 0.45%         | -0.24%         | 0.11%                 | -3.56%  | 0.34% |
| 过去一年           | -7.04%     | 0.40%         | -0.09%         | 0.14%                 | -6.95%  | 0.26% |
| 过去三年           | 7.13%      | 0.48%         | 3.39%          | 0.12%                 | 3.74%   | 0.36% |
| 过去五年           | 22.52%     | 0.41%         | 8.35%          | 0.12%                 | 14.17%  | 0.29% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 130.39%    | 0.44%         | 20.00%         | 0.16%                 | 110.39% | 0.28% |

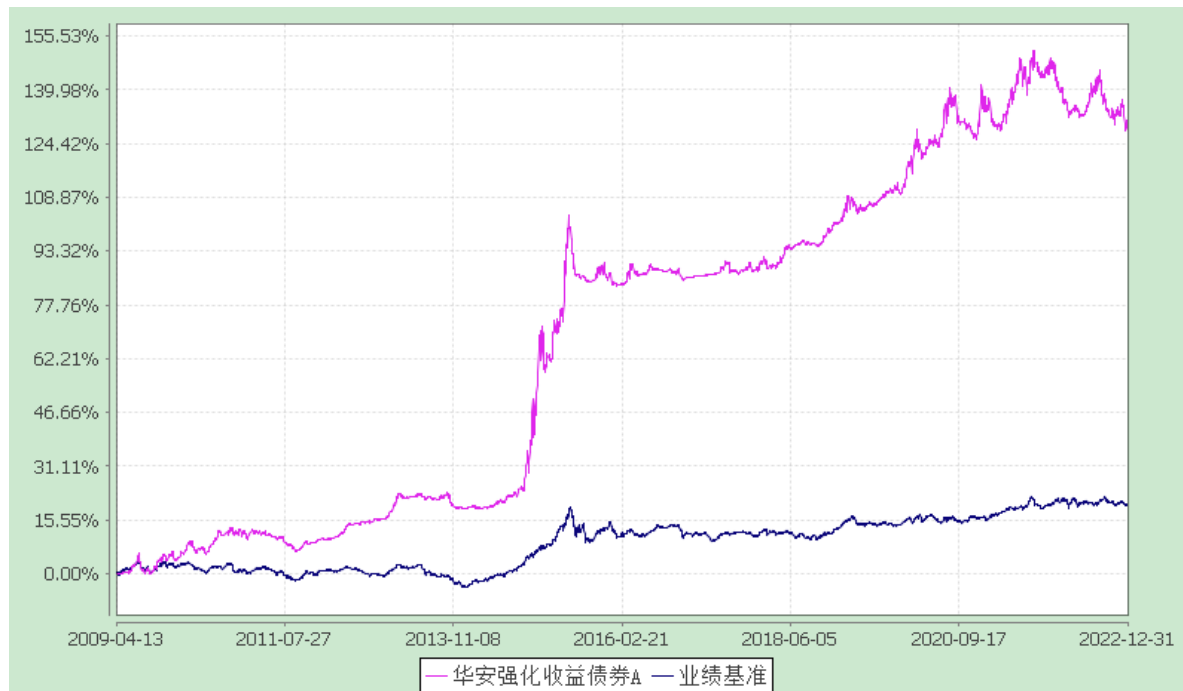
#### 2、华安强化收益债券 B:

| 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          | -1.16%     | 0.40%         | -0.43%         | 0.10%                 | -0.73% | 0.30% |
| 过去六个月          | -4.08%     | 0.46%         | -0.24%         | 0.11%                 | -3.84% | 0.35% |
| 过去一年           | -7.48%     | 0.40%         | -0.09%         | 0.14%                 | -7.39% | 0.26% |
| 过去三年           | 5.67%      | 0.48%         | 3.39%          | 0.12%                 | 2.28%  | 0.36% |
| 过去五年           | 19.85%     | 0.41%         | 8.35%          | 0.12%                 | 11.50% | 0.29% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 117.35%    | 0.44%         | 20.00%         | 0.16%                 | 97.35% | 0.28% |

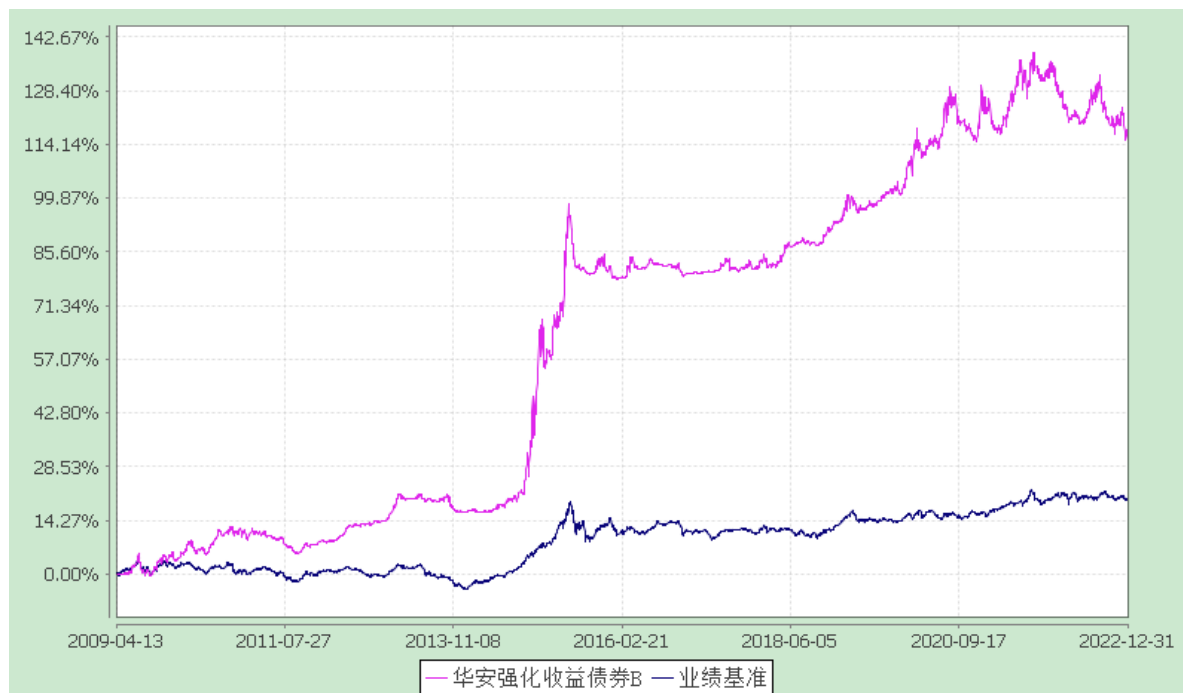
### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安强化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  
(2009 年 4 月 13 日至 2022 年 12 月 31 日)

#### 1. 华安强化收益债券 A:



## 2. 华安强化收益债券 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 |    |                                                                                                                                                                                     |
| 郑伟山 | 本基金的基金经理 | 2022-09-16 | -    | 14 | 硕士研究生，14 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。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。 |

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

四季度市场的关注点集中在疫情管控政策优化和地产政策多箭齐发，实际经济数据表现疲弱。

投资端，主要依靠基建和制造业拉动，地产投资持续下滑；出口端，以美元计价，已经连续两个月负增长，疫情以来的出口韧性不再；消费端，疫情反复导致消费品零售总额出现同比下滑。流动性方面，四季度央行年内二次降准，显示出对市场的呵护态度，资金面整体平稳，跨年资金也较为宽松。

从债券市场表现看，10 月在较为宽松的资金面支撑下，收益率下行；11 月在疫情和地产政策放松的影响下，收益率明显上行，理财赎回引发负反馈，加大了市场的波动；12 月中旬，收益率调整至高位后吸引力凸显，同时资金面较为宽松，收益率转为下行。截至 12 月底，1 年国开债收益率较 9 月末上行 34bp 至 2.23%，10 年国开债收益率上行 6bp 至 2.99%，曲线平坦化上行；1 年 AAA 中票收益率较 9 月末上行 55bp 至 2.71%，3 年 AAA 中票上行 50bp 至 3.17%。利率表现好于信用，信用利差走阔。四季度，本基金主要在利率债和高评级信用债之中寻找机会，久期较短。

四季度股票市场震荡上行。期间主要指数普涨，按涨跌幅降序排列，依次是创业板 50 指数上涨 3.34%、中证 500 指数上涨 2.63%、科创 50 指数上涨 2.19%、沪深 300 指数上涨 1.75%和上证 50 指数上涨 0.96%，小盘风格相对占优。从行业板块上看，分化明显，排名靠前的有社会服务、计算机、传媒、医药生物和美容护理，涨幅都在 10%以上，排名倒数的煤炭、石油石化、电力设备、有色金属和房地产，出现逆市下跌，整体来看，消费相关板块相对占优。四季度股票市场走势向好，主要是疫情和地产政策变化带来的经济修复预期增强和风险偏好回暖推动市场向上，但是由于高频数据相对疲弱，期间市场出现大幅波动。四季度，本基金维持了中性仓位和均衡持仓，行业相对集中，整体风格偏向于周期和成长。

四季度转债市场普跌，期间中证转债指数下跌 2.48%，表现不如股票，主要是因为转债自身估值高位，且赶上了季末信用债的大幅调整。四季度，本基金在转债市场调整过程中，逐步增加仓位，持仓品种整体偏防守，以均衡型和偏债型转债为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，华安强化收益债券 A 份额净值为 1.113 元，B 份额净值为 1.104 元；华安强化收益债券 A 份额净值增长率为-0.98%，同期业绩比较基准增长率为-0.43%；B 份额净值增长率为-1.16%，同期业绩比较基准增长率为-0.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期经济受疫情冲击将偏弱，2023 年各类政策协调配合，经济有望出现好转，但幅度需要观察。出口在外需和份额双重走弱下，面临较大下滑压力。经济动能从外需拉动转向内需为主，消费潜力释放和稳地产政策的效果尤为关键。地产供给端政策支持力度较大，优质头部房企风险有



所缓释，需求端有待进一步放松，地产整体改善需要一定时间。财政注重可持续和债务约束，发力度待观察。在经济尚未企稳的情况下，货币政策有望继续保持宽松。债券操作上，关注中短端利率债和信用债的投资机会。

股票方面，当前 A 股主要宽基指数的估值分位数处于历史低位，大部分行业估值水平也处在相对低位，考虑到 2023 年经济复苏的确定性高，企业盈利恢复性增长，后续可能还会有经济刺激政策发力，流动性大概率维持宽松，预计股票市场会维持震荡向上的趋势。结构上，可以关注安全、高质量发展和疫后修复相关板块。本基金将根据市场情况，适时调整股票持仓结构。

转债方面，估值压缩的压力仍然存在，但经过调整之后，市场绝对价位水平逐步进入配置区间，部分转债呈现出一定性价比，可以结合估值和基本面因素，挑选标的进行重点配置，根据市场行情演进，优化持仓结构。

#### 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            | 9,965,820.00  | 13.80        |
|    | 其中：股票           | 9,965,820.00  | 13.80        |
| 2  | 固定收益投资          | 60,783,246.27 | 84.19        |
|    | 其中：债券           | 60,783,246.27 | 84.19        |
|    | 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 | 1,238,463.59  | 1.72   |
| 7 | 其他各项资产       | 209,507.40    | 0.29   |
| 8 | 合计           | 72,197,037.26 | 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         | 563,500.00   | 0.92         |
| B  | 采矿业              | 660,000.00   | 1.08         |
| C  | 制造业              | 4,703,100.00 | 7.71         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | 956,120.00   | 1.57         |
| F  | 批发和零售业           | 608,400.00   | 1.00         |
| 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  | 1,069,400.00 | 1.75         |
| J  | 金融业              | 1,405,300.00 | 2.30         |
| 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               | 9,965,820.00 | 16.34        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

### 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  | 002555 | 三七互娱 | 38,000 | 687,800.00 | 1.13         |
| 2  | 601899 | 紫金矿业 | 66,000 | 660,000.00 | 1.08         |
| 3  | 000963 | 华东医药 | 13,000 | 608,400.00 | 1.00         |
| 4  | 000831 | 中国稀土 | 18,000 | 591,840.00 | 0.97         |
| 5  | 300087 | 荃银高科 | 35,000 | 563,500.00 | 0.92         |
| 6  | 300059 | 东方财富 | 27,000 | 523,800.00 | 0.86         |
| 7  | 600919 | 江苏银行 | 70,000 | 510,300.00 | 0.84         |
| 8  | 600893 | 航发动力 | 12,000 | 507,360.00 | 0.83         |
| 9  | 601669 | 中国电建 | 70,000 | 495,600.00 | 0.81         |
| 10 | 600760 | 中航沈飞 | 8,000  | 469,040.00 | 0.77         |

### 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      | 13,329,580.00 | 21.85        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,131,060.27 | 16.61        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,131,060.27 | 16.61        |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 6,060,230.96  | 9.93         |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 31,262,375.04 | 51.24        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 60,783,246.27 | 99.63        |

### 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  | 200202 | 20 国开 02 | 100,000 | 10,131,060.27 | 16.61        |

|   |           |                  |        |              |      |
|---|-----------|------------------|--------|--------------|------|
| 2 | 019663    | 21 国债 15         | 56,000 | 5,646,759.23 | 9.26 |
| 3 | 113044    | 大秦转债             | 28,000 | 3,074,664.66 | 5.04 |
| 4 | 113052    | 兴业转债             | 30,000 | 3,054,431.51 | 5.01 |
| 5 | 012281611 | 22 深燃气<br>SCP002 | 30,000 | 3,050,335.07 | 5.00 |

## 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

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 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。

2022 年 3 月 21 日，兴业银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 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〕22 号）给予罚款 350 万元的行政处罚。2022 年 9 月 9 日，兴业银行因债券承销业务严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕41 号）给予罚款 150 万元的行政处罚。2022 年 9 月 28 日，兴业银行因理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹、未按规定开展理财业务内部审计等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕50 号）给予罚款 450 万元的行政处罚。

2022 年 5 月 23 日，杭州银行因未按规定履行客户身份识别义务等违法违规事项，被中国人民银行杭州中心支行（杭银处罚字〔2022〕30 号）给予罚款 580 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   | 13,000.01  |
| 2  | 应收证券清算款 | 193,690.96 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 2,816.43   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 209,507.40 |

#### 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  | 113044 | 大秦转债 | 3,074,664.66 | 5.04         |

|    |        |          |              |      |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 2  | 113052 | 兴业转债     | 3,054,431.51 | 5.01 |
| 3  | 110067 | 华安转债     | 2,912,164.52 | 4.77 |
| 4  | 110079 | 杭银转债     | 2,364,745.82 | 3.88 |
| 5  | 127032 | 苏行转债     | 2,331,448.46 | 3.82 |
| 6  | 127061 | 美锦转债     | 1,970,034.08 | 3.23 |
| 7  | 110081 | 闻泰转债     | 1,723,501.15 | 2.83 |
| 8  | 128136 | 立讯转债     | 1,525,283.12 | 2.50 |
| 9  | 113053 | 隆 22 转债  | 1,314,544.84 | 2.15 |
| 10 | 110082 | 宏发转债     | 1,308,974.79 | 2.15 |
| 11 | 123107 | 温氏转债     | 1,307,312.66 | 2.14 |
| 12 | 123099 | 普利转债     | 1,304,585.84 | 2.14 |
| 13 | 127049 | 希望转 2    | 1,224,658.63 | 2.01 |
| 14 | 127031 | 洋丰转债     | 1,077,990.41 | 1.77 |
| 15 | 113605 | 大参转债     | 1,012,460.55 | 1.66 |
| 16 | 132018 | G 三峡 EB1 | 929,478.22   | 1.52 |
| 17 | 113045 | 环旭转债     | 913,222.58   | 1.50 |
| 18 | 128119 | 龙大转债     | 814,078.90   | 1.33 |
| 19 | 113634 | 珀莱转债     | 662,286.25   | 1.09 |
| 20 | 110086 | 精工转债     | 436,508.05   | 0.72 |

#### 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             | 华安强化收益债券A     | 华安强化收益债券B     |
|----------------|---------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 33,743,103.24 | 23,843,222.38 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 655,680.13    | 267,894.75    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,196,898.73  | 1,306,663.85  |
| 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   | 32,201,884.64 | 22,804,453.28 |

### §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、《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安强化收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安强化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

二〇二三年一月二十日