汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金
2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 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 2021 年 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇安嘉鑫纯债债券
基金主代码	006625
交易代码	006625
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 26 日
报告期末基金份额总额	488,605,335.30 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，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大类资产配置策略、债券组合管理策略。本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。债券组合管理策略包括利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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（ 2021 年 10 月 1 日 － 2021 年 12 月 31 日 ）
1.本期已实现收益	1,877,685.83
2.本期利润	5,144,654.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0126
4.期末基金资产净值	504,356,527.41
5.期末基金份额净值	1.0322

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。

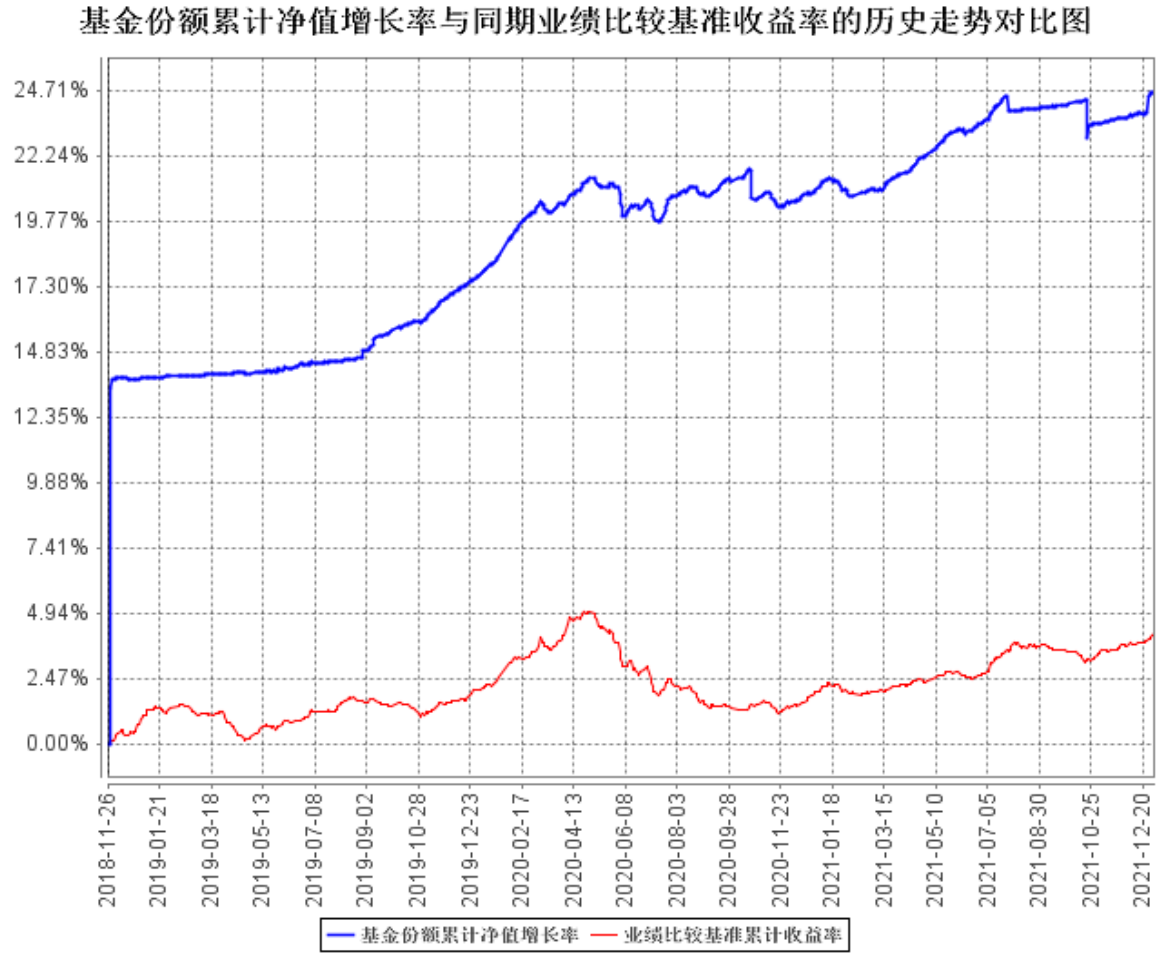
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	0.39%	0.17%	0.60%	0.05%	-0.21%	0.12%
过去六个月	0.96%	0.13%	1.44%	0.05%	-0.48%	0.08%
过去一年	3.05%	0.10%	2.10%	0.05%	0.95%	0.05%
过去三年	9.56%	0.08%	3.37%	0.07%	6.19%	0.01%
自基金合同生效起至今	24.71%	0.49%	4.16%	0.07%	20.55%	0.42%

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



注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
金鸿峰	多策略投资部高级经理、本基金的基金经理	2021 年 7 月 28 日	-	5 年	金鸿峰女士，中央财经大学国防经济学硕士研究生，5 年证券、基金行业从业经历。曾任北京市农产品电子商务公司市场部经理，2016 年 5 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任多策略投资部基金经理。2021 年 7 月 13 日至今，任汇安中债-广西壮族

					自治区公司信用类债券指数证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 13 日至今，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 13 日至今，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 23 日至今，任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 23 日至今，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 28 日至今，任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 28 日至今，任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 4 日至今，任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 4 日至今，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：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《证券从业人员资格管理办法》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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度国内消费修复依然偏缓，制造业受到供给侧能耗双控以及限电限产等政策纠偏影响，生产回暖。 出口指数四季度依然处于收缩状态，与出口货运量增速波动下行相符合。12 月建筑业景气度高位回落，建筑业需求走弱与房地产需求下滑相关，表明房地产依然承压。后续展望：目前的利率已经在一定程度上透支了后续进一步降准或者降息的预期。从政策工具选择来看，预计央行会优先采用结构性工具和调整宏观审慎考核体系，同时结合已落地的降准等政策效果、基建稳增长情况、房地产市场运行态势以及通货膨胀水平，不会急于启用价格型工具。接下来一段时间，债市的长端利率可能会进入阶段性震荡调整过程，在调整过程中把握调仓机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0322 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.39%，业绩比较基准收益率为 0.60%。

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 2021 年 11 月 22 日，本基金连续超过六十个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案，解决方案为持续营销。2021 年 11 月 23 日至本报告期期末，本基金未出现连续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	491,902,500.00	97.45
	其中：债券	461,902,500.00	91.50
	资产支持证券	30,000,000.00	5.94
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	5,078,835.23	1.01
8	其他资产	7,814,502.32	1.55
9	合计	504,795,837.55	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	央行票据	-	-
3	金融债券	362,559,000.00	71.89
	其中：政策性金融债	307,364,500.00	60.94
4	企业债券	39,058,000.00	7.74
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	60,285,500.00	11.95
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	461,902,500.00	91.58

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	190305	19 进出 05	500,000	50,710,000.00	10.05
2	210213	21 国开 13	500,000	50,345,000.00	9.98
3	190203	19 国开 03	450,000	45,697,500.00	9.06
4	210303	21 进出 03	450,000	45,562,500.00	9.03
5	210306	21 进出 06	450,000	44,968,500.00	8.92

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	136860	悦福 01A	300,000	30,000,000.00	5.95

注：本基金本报告期末持有 1 只资产支持证券，截至本报告披露日，该只证券尚未上市，证券名称根据专项计划管理人提供的说明填写。

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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

（1）2021 年 7 月 16 日，未依法履行其他职责，中国进出口银行因如下原因被中国银行保险

监督管理委员会（银保监罚决字(2021)31 号，《中华人民共和国银行业监督管理法》第 21 条,第 45 条,第 46 条）公开处罚：7345.6 万元：一、违规投资企业股权。二、个别高管人员未经核准实际履职。三、监管数据漏报错报。四、违规向地方政府购买服务提供融资。五、违规变相发放土地储备贷款。六、向用地未获国务院批准的项目发放贷款。七、违规开展租金保理业务变相支持地方政府举债。八、租金保理业务基础交易不真实。九、向租赁公司发放用途不合规的流动资金贷款。十、违规向个别医疗机构新增融资。十一、个别并购贷款金额占比超出监管上限。十二、借并购贷款之名违规发放股权收购贷款。十三、违规向未取得“四证”的固定资产项目发放贷款。十四、违规发放流动资金贷款用于固定资产投资。十五、授信额度核定不审慎。十六、向无实际用款需求的企业发放贷款导致损失。十七、突破产能过剩行业限额要求授信。十八、项目贷款未按规定设定抵质押担保。十九、贷款风险分类不审慎。二十、信贷资产买断业务贷前调查不尽职。二十一、向借款人转嫁评估费用。二十二、同业业务交易对手名单制管理落实不到位。二十三、贸易背景审查不审慎。二十四、对以往监管通报问题整改不到位。

（2）2021 年 1 月 8 日，未依法履行其他职责，国家开发银行因如下原因被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字(2020)67 号《中华人民共和国银行业监督管理法》第 21 条,第 46 条）公开处罚：罚款 4880 万元：一、为违规的政府购买服务项目提供融资。二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况。三、违规变相发放土地储备贷款。四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款。五、贷款风险分类不准确。六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产。七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量。八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品。九、扶贫贷款存贷挂钩。十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁。十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求。十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理。十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理。十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务。十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况。十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务。十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表。十八、违规收取小微企业贷款承诺费。十九、收取财务顾问费质价不符。二十、利用银团贷款承诺费浮利分费。二十一、向检查组提供虚假整改说明材料。二十二、未如实提供信贷资产转让台账。二十三、案件信息迟报、瞒报。二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。

（3）2021 年 6 月 1 日，富滇银行股份有限公司因未依法履行职责，被云南省通信管理局责令改正。

（4）2021 年 11 月 25 日，富滇银行股份有限公司因违规经营，被云南省银保监局罚款。

本基金投资的其余前十名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收到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金无股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,915.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,810,587.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,814,502.32

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	770,987.23
报告期期间基金总申购份额	977,133,085.80
减:报告期期间基金总赎回份额	489,298,737.73
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	488,605,335.30

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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资产投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资产投资本基金。

§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	20211123-20211231	-	488,566,542.90	-	488,566,542.90	99.99%
	2	20211123-20211223	-	488,566,542.90	488,566,542.90	-	0.00%
	3	20211001-20211122	243,493.67	-	243,493.67	-	0.00%
	4	20211001-20211122	243,493.67	-	243,493.67	-	0.00%
	5	20211001-20211122	243,493.67	-	243,493.67	-	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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嘉鑫纯债债券型证券投资基金募集的文件

2、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金合同

3、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金托管协议

4、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书

5、报告期内在规定报刊及规定网站上披露的各项公告

6、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 02-03 室

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，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。

公司网站：http://www.huianfund.cn/

汇安基金管理有限责任公司

2022 年 1 月 24 日