

汇安嘉诚债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 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。

根据《汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金基金合同》的约定，本基金在基金合同生效之日起一年（含一年）的期间内封闭式运作。封闭期为自基金合同生效之日起至一个公历年后对应日的前一日（含该日）止，若一年后该对应日为非工作日或不存在该对应日的，封闭期到期日相应顺延。封闭期届满后，本基金转为开放式运作。本基金的封闭期自 2019 年 8 月 9 日起至 2020 年 8 月 9 日止，自 2020 年 8 月 10 日起转为开放式运作。本基金在转为开放式运作后，自 2020 年 8 月 10 日开始办理日常申购、赎回、转换、定期定额投资等业务，并适用基金合同中关于转为开放式运作后的有关规定。

封闭期届满后，本基金转为开放式运作，基金名称相应变更为“汇安嘉诚债券型证券投资基金”。自 2020 年 8 月 10 日起本基金基金名称变更为“汇安嘉诚债券型证券投资基金”，基金简称变更为“汇安嘉诚债券”，基金代码不变。

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 2020 年 7 月 1 日起至 2020 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	汇安嘉诚债券
基金主代码	007609
交易代码	007609
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 9 日
报告期末基金份额总额	556,120,901.73 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险并保持资产流动性的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的主要投资策略为债券组合管理策略，其中包括利率策略、类属配置策略、信用债策略、

	相对价值策略、债券选择策略、资产支持证券投资策略、可转换债券投资策略、国债期货投资策略。	
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	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇安嘉诚债券 A	汇安嘉诚债券 C
下属分级基金的交易代码	007609	007610
报告期末下属分级基金的份额总额	188,981,017.21 份	367,139,884.52 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（2020年7月1日—2020年9月30日）	
	汇安嘉诚债券 A	汇安嘉诚债券 C
1. 本期已实现收益	7,279,941.27	12,155,957.09
2. 本期利润	6,348,684.08	10,423,119.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0200	0.0182
4. 期末基金资产净值	193,225,010.64	375,090,295.25
5. 期末基金份额净值	1.0225	1.0217

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

汇安嘉诚债券 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	1.70%	0.06%	-1.48%	0.08%	3.18%	-0.02%

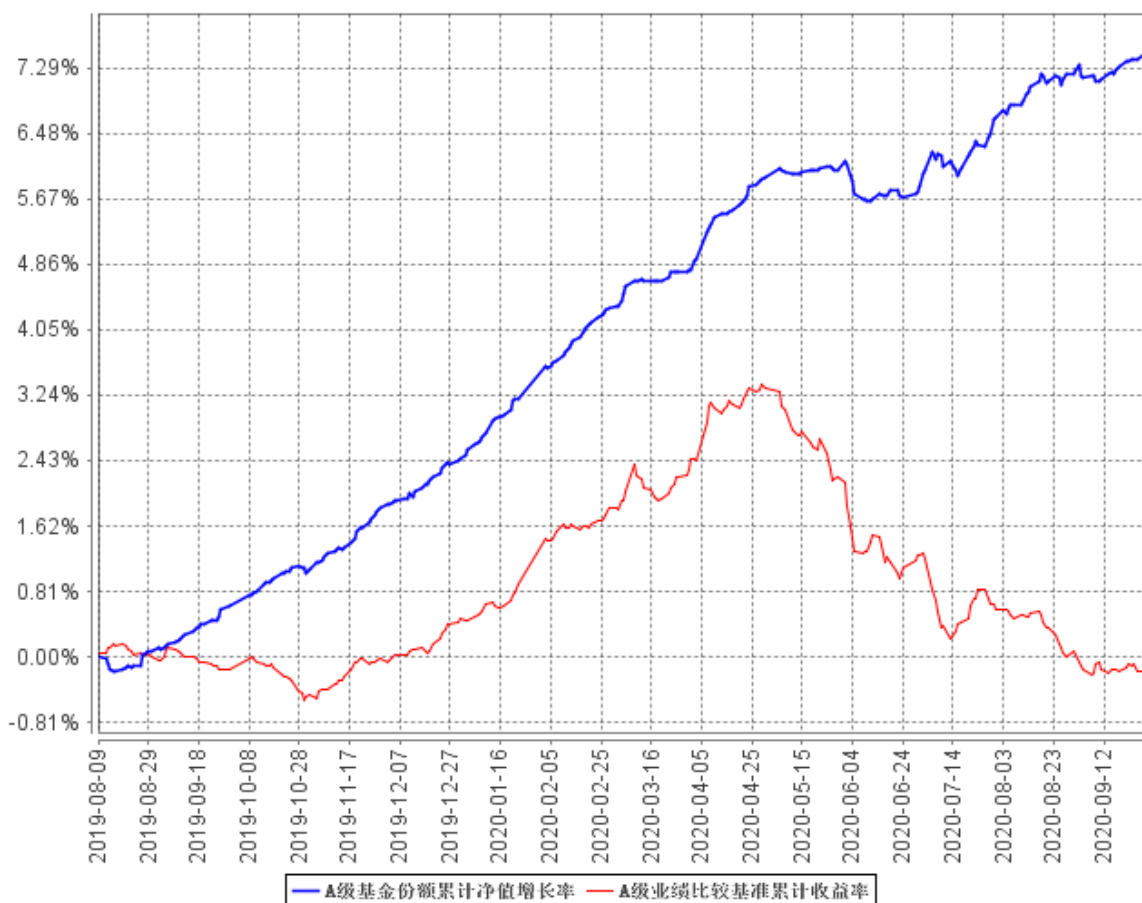
月						
过去六个月	2.63%	0.06%	-2.50%	0.10%	5.13%	-0.04%
过去一年	6.88%	0.06%	-0.09%	0.09%	6.97%	-0.03%
自基金合同生效起至今	7.56%	0.05%	-0.23%	0.09%	7.79%	-0.04%

汇安嘉诚债券 C

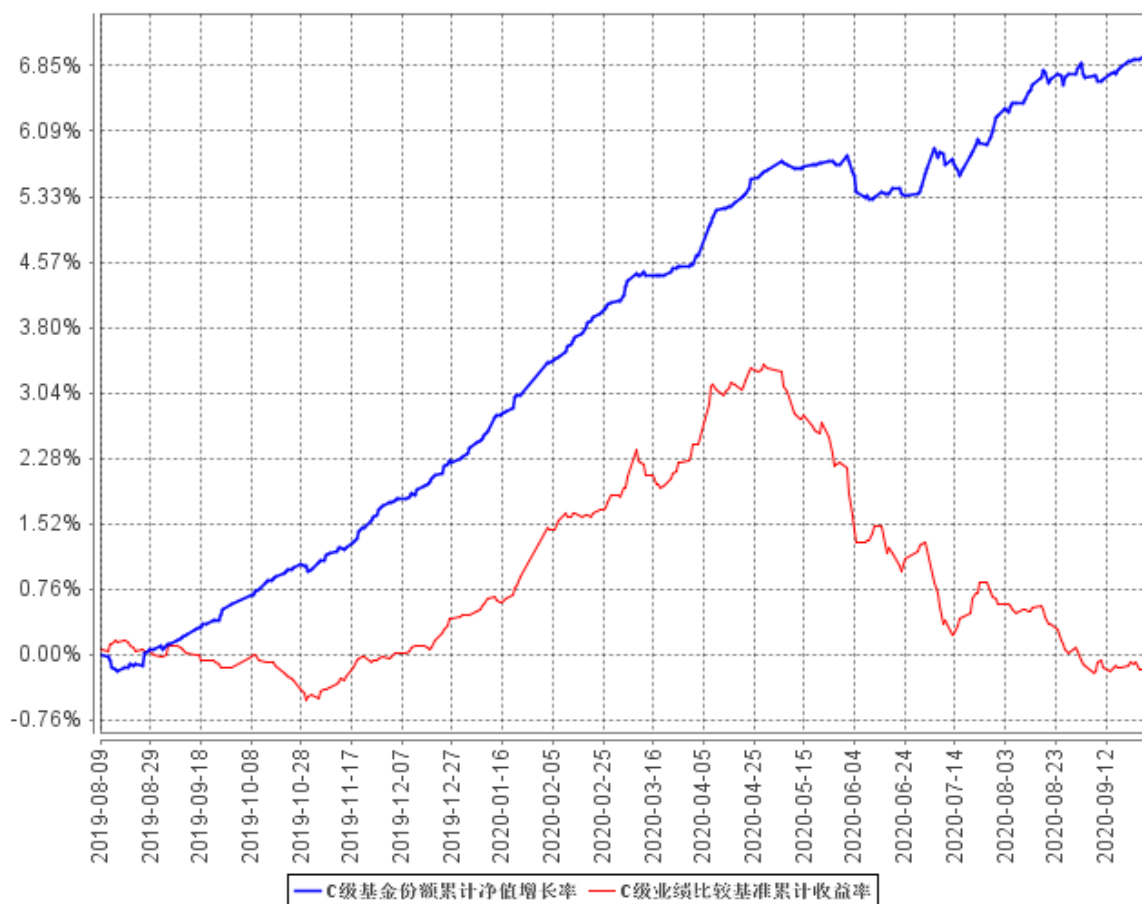
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.61%	0.07%	-1.48%	0.08%	3.09%	-0.01%
过去六个月	2.43%	0.06%	-2.50%	0.10%	4.93%	-0.04%
过去一年	6.44%	0.06%	-0.09%	0.09%	6.53%	-0.03%
自基金合同生效起至今	7.07%	0.05%	-0.23%	0.09%	7.30%	-0.04%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金合同生效日为 2019 年 8 月 9 日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。本基金的封闭期自 2019 年 8 月 9 日起至 2020 年 8 月 9 日止，自 2020 年 8 月 10 日起转为开放式运作。

②根据《汇安嘉诚债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票等权益类资产，也不参与一级市场新股申购或增发新股，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票等。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在封闭期届满转为开放式运作的前后各一个月内，基金投资不受上述比例限制；本基金持有的因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票等权益类资产投资比例不超过基金资产的 10%。本基金封闭期届满转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或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%；在封闭期间，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 2019 年 8 月 9

日至 2020 年 2 月 8 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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
仇秉则	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2019 年 8 月 9 日	-	14 年	仇秉则, CFA, CPA, 中山大学经济学学士, 14 年证券、基金行业从业经历, 曾任普华永道中天会计师事务所审计经理, 嘉实基金管理有限公司固定收益部高级信用分析师。2016 年 6 月加入汇安基金管理有限责任公司, 担任固定收益投资部副总经理一职, 从事信用债投资研究工作。2016 年 12 月 19 日至 2018 年 2 月 9 日, 任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 25 日至 2018 年 2 月 9 日, 任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日, 任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日, 任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日, 任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日, 任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基

				<p>金经理；2016 年 12 月 5 日至 2019 年 10 月 11 日，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日，任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2017 年 7 月 27 日至 2019 年 10 月 11 日，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 8 月 10 日至 2019 年 10 月 11 日，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 5 月 10 日至 2020 年 5 月 11 日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 8 月 9 日至今任汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金基金经理；2019 年 10 月 14 日至今任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理；2020 年 3 月 5 日至今任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 21 日至今任汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

2020 年进入第三季度，国内国际经济呈现分化走势。除中国外全球主要经济体均受到新冠疫情的持续影响，部分地区发生了疫情二次乃至多次反弹，从而对经济的复工复产形成了抑制。国外主要经济体央行均大概率长期保持了超常规货币宽松政策。中国经济需求端持续修复，生产端维持稳定。社会消费零售总额 8 月首次转正，家电、汽车等可选消费品稳步恢复，商品房销售额累计值也实现转正，房地产投资、基建投资保持较高增速，制造业投资增速相对较低，但仍呈修复态势；工业增加值维持在 5% 附近波动，PMI 连续 7 个月维持扩张区间。

政策方面，报告期内社会融资规模与 M2 维持了明显高于名义国内生产总值的水平，有力地支持了实体经济的修复，中国央行通过公开市场操作维持流动性合理充裕，但在稳增长和防风险之间保持平衡。资金利率、同业存单利率围绕 OMO、MLF 等政策利率附近波动，收益率曲线呈现期限利差相对较窄的较平坦的形态。

本基金在投资操作上，债券方面，合理控制久期，继续严控信用风险，在收益率相对高点积极配置优质信用债；转债方面，合理控制仓位，优选行业景气度高、具有一定安全边际的品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安嘉诚债券 A 基金份额净值为 1.0225 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.70%；截至本报告期末汇安嘉诚债券 C 基金份额净值为 1.0217 元，本报告期基金份额净值增长

率为 1.61%；同期业绩比较基准收益率为-1.48%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期，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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	6,209,909.57	0.97
	其中：股票	6,209,909.57	0.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	563,125,642.30	88.25
	其中：债券	503,429,642.30	78.90
	资产支持证券	59,696,000.00	9.36
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	32,000,000.00	5.01
	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	23,140,514.22	3.63
8	其他资产	13,614,879.95	2.13
9	合计	638,090,946.04	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	6,209,909.57	1.09
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	6,209,909.57	1.09

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

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	600372	中航电子	147,025	2,505,306.00	0.44
2	002851	麦格米特	58,540	1,986,847.60	0.35
3	601137	博威合金	127,147	1,717,755.97	0.30

注：本基金本报告期末本报告期末仅持有上述 3 只股票。

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	29,895,000.00	5.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	430,455,542.30	75.74
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	43,079,100.00	7.58
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	503,429,642.30	88.58

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	155977	18 环球 Y1	500,000	50,490,000.00	8.88
2	136780	16 腾越 02	401,560	40,111,828.40	7.06
3	149220	20 荣盛 G2	400,000	39,980,000.00	7.03
4	163793	20 唐租 Y1	400,000	39,572,000.00	6.96
5	155313	19 碧地 01	350,000	35,511,000.00	6.25

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

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	138787	诚悦 01 优	300,000	29,937,000.00	5.27
2	168456	惠盈 1A	200,000	19,826,000.00	3.49
3	168034	君美 2 优	100,000	9,933,000.00	1.75

注：本基金本报告期末仅持有三只资产支持证券。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	59,696.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,084,691.13
5	应收申购款	2,470,492.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,614,879.95

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

项目	汇安嘉诚债券 A	汇安嘉诚债券 C
报告期期初基金份额总额	472,641,992.19	784,519,282.57
报告期期间基金总申购份额	111,574,615.13	195,866,193.88
减：报告期期间基金总赎回份额	395,235,590.11	613,245,591.93
报告期期末基金份额总额	188,981,017.21	367,139,884.52

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

本基金本报告期内未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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金基金合同》的约定，本基金在基金合同生效之日起一年（含一年）的期间内封闭式运作。封闭期为自基金合同生效之日起至一个公历年后对应日的前一日（含该日）止，若一年后该对应日为非工作日或不存在该对应日的，封闭期到期日相应顺延。封闭期届满后，本基金转为开放式运作。本基金的封闭期自 2019 年 8 月 9 日起至 2020 年 8 月 9 日止，自 2020 年 8 月 10 日起转为开放式运作。本基金在转为开放式运作后，自 2020 年 8 月 10 日开始办理日常申购、赎回、转换、定期定额投资等业务，并适用基金合同中关于转为开放式运作后的有关规定。

封闭期届满后，本基金转为开放式运作，基金名称相应变更为“汇安嘉诚债券型证券投资基金”。自 2020 年 8 月 10 日起本基金基金名称变更为“汇安嘉诚债券型证券投资基金”，基金简称变更为“汇安嘉诚债券”，基金代码不变。

§ 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诚一年封闭运作债券型证券投资基金募集的文件

- 2、汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金基金合同
- 3、汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金托管协议
- 4、汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 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

2020 年 10 月 28 日