
华安证券汇赢增利一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:华安证券股份有限公司

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:2021年10月27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 2021 年 10 月 25 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 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华安证券汇赢增利
场内简称	-
基金主代码	970006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 07 月 15 日
报告期末基金份额总额	1,143,913,333.47 份
投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本集合计划在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本集合计划将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	基准指数 = 沪深 300 指数 × 40% + 中证全债指数 × 5

	0%+一年定期存款利率×10%。		
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，属于中等风险/收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。		
基金管理人	华安证券股份有限公司		
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华安证券汇赢增利A	华安证券汇赢增利B	华安证券汇赢增利C
下属分级基金场内简称	华安证券汇赢增利A	华安证券汇赢增利B	华安证券汇赢增利C
下属分级基金的交易代码	970006	970007	970008
报告期末下属分级基金的份额总额	23,584,411.83份	764,837,087.18份	355,491,834.46份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

§ 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07月01日 - 2021年09月30日)		
	华安证券汇赢增利A	华安证券汇赢增利B	华安证券汇赢增利C
1. 本期已实现收益	444,025.54	10,165,408.89	4,966,701.23
2. 本期利润	1,249,340.01	29,555,435.40	12,201,920.93
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0424	0.0419	0.0447
4. 期末基金资产净值	25,011,878.29	853,182,068.60	400,362,743.18
5. 期末基金份额净值	1.0605	1.1155	1.1262

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，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

华安证券汇赢增利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	4.16%	0.34%	-1.75%	0.48%	5.91%	-0.14%
过去六个月	7.96%	0.28%	0.36%	0.44%	7.60%	-0.16%
过去一年	11.73%	0.23%	5.82%	0.49%	5.91%	-0.26%
自基金合同生效起至今	12.70%	0.22%	4.61%	0.50%	8.09%	-0.28%

华安证券汇赢增利B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	3.96%	0.34%	-1.75%	0.48%	5.71%	-0.14%
过去六个月	7.53%	0.28%	0.36%	0.44%	7.17%	-0.16%
过去一年	10.83%	0.23%	5.82%	0.49%	5.01%	-0.26%

自基金合同生效起至今	11.55%	0.22%	4.61%	0.50%	6.94%	-0.28%
------------	--------	-------	-------	-------	-------	--------

华安证券汇赢增利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	4.17%	0.34%	-1.75%	0.48%	5.92%	-0.14%
过去六个月	7.96%	0.28%	0.36%	0.44%	7.60%	-0.16%
过去一年	11.72%	0.23%	5.82%	0.49%	5.90%	-0.26%
自基金合同生效起至今	12.62%	0.22%	4.61%	0.50%	8.01%	-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

华安证券汇赢增利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

(2020年07月15日-2021年09月30日)



华安证券汇赢增利B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年07月15日-2021年09月30日)



华安证券汇赢增利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



§ 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		
汪志健	基金经理	2018-11-06	-	10年	-
樊艳	基金经理	2020-10-12	-	22年	-

注：本产品由大集合公募改造而来，有关基金经理任职日期从担任原大集合产品投资经理时间起算。

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，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华安证券股份有限公司公募资产管理业务公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在2021年三季度期间，本基金通过重点配置电力、基建、交运设施等行业的可转债与股票资产，较好地把握住了结构性行情中的投资机会。在同期股指大幅度波动的情况下，本基金配置的可转债及股票价值得以体现，资产价格上涨带动了本基金净值的上升，使得本基金取得了优于同期绝大多数同类产品的收益水平。因此产品净值在经历了短暂的波动之后，在今年三季度的行情中整体依然获得良好回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华安证券汇赢增利A基金份额净值为1.0605元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.16%，同期业绩比较基准收益率为-1.75%；截至报告期末华安证券汇赢增利B基金份额净值为1.1155元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.96%，同期业绩比较基准收益率为-1.75%；截至报告期末华安证券汇赢增利C基金份额净值为1.1262元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.17%，同期业绩比较基准收益率为-1.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	101,054,576.95	7.75
	其中：股票	101,054,576.95	7.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	918,097,243.96	70.44
	其中：债券	918,097,243.96	70.44
	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	226,633,239.00	17.39
	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	34,625,491.50	2.66
8	其他资产	22,968,881.29	1.76
9	合计	1,303,379,432.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,740,468.75	2.95
E	建筑业	32,464,111.20	2.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	28,654,497.00	2.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,055,000.00	0.16
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	140,500.00	0.01
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	101,054,576.95	7.90

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	003816	中国广核	6,000,000	20,220,000.00	1.58
2	600018	上港集团	3,163,300	19,264,497.00	1.51
3	601390	中国中铁	2,600,000	14,716,000.00	1.15
4	600795	国电电力	3,000,000	9,750,000.00	0.76
5	601006	大秦铁路	1,500,000	9,390,000.00	0.73
6	601668	中国建筑	1,900,000	9,120,000.00	0.71
7	600502	安徽建工	2,223,740	8,628,111.20	0.67
8	600863	内蒙华电	1,890,625	7,770,468.75	0.61
9	600050	中国联通	500,000	2,055,000.00	0.16
10	002717	岭南股份	50,000	140,500.00	0.01

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	79,919,800.20	6.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	232,637,511.30	18.20
5	企业短期融资券	40,196,000.00	3.14
6	中期票据	119,574,000.00	9.35
7	可转债（可交换债）	445,769,932.46	34.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	918,097,243.96	71.81

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	019628	20国债02	500,000	49,985,000.00	3.91
2	042100142	21丹投CP002	400,000	40,196,000.00	3.14
3	128105	长集转债	285,660	32,737,207.32	2.56
4	110041	蒙电转债	212,440	32,709,386.80	2.56
5	110072	广汇转债	310,590	31,009,305.60	2.43

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体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 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	37,619.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,209,189.44
5	应收申购款	6,722,072.61
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	22,968,881.29

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	128105	长集转债	32,737,207.32	2.56
2	110041	蒙电转债	32,709,386.80	2.56
3	110072	广汇转债	31,009,305.60	2.43
4	110064	建工转债	29,940,656.40	2.34
5	113044	大秦转债	29,634,250.80	2.32
6	113017	吉视转债	29,251,857.60	2.29
7	128044	岭南转债	27,617,957.46	2.16
8	127013	创维转债	17,504,199.90	1.37
9	113519	长久转债	16,425,580.60	1.28
10	123004	铁汉转债	13,970,911.68	1.09
11	110052	贵广转债	12,219,009.60	0.96
12	123023	迪森转债	11,525,908.74	0.90
13	123049	维尔转债	11,278,108.25	0.88

14	128107	交科转债	11,249,658.96	0.88
15	127003	海印转债	10,767,800.00	0.84
16	127028	英特转债	10,745,803.09	0.84
17	113530	大丰转债	10,739,979.00	0.84
18	113036	宁建转债	10,237,804.00	0.80
19	127007	湖广转债	10,209,870.07	0.80
20	128127	文科转债	9,582,034.79	0.75
21	113589	天创转债	9,479,540.00	0.74
22	113024	核建转债	8,783,436.00	0.69
23	113584	家悦转债	7,977,897.50	0.62
24	113535	大业转债	7,680,938.20	0.60
25	110057	现代转债	6,903,090.90	0.54
26	123077	汉得转债	5,001,990.56	0.39
27	113601	塞力转债	3,909,405.50	0.31
28	123056	雪榕转债	2,073,568.40	0.16
29	128071	合兴转债	1,401,241.60	0.11
30	128116	瑞达转债	1,243,273.14	0.10
31	113591	胜达转债	784,620.00	0.06

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。

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

	华安证券汇赢增利A	华安证券汇赢增利B	华安证券汇赢增利C
报告期期初基金份额总额	31,565,193.51	678,904,002.49	233,142,334.49
报告期期间基金总申购份额	-	266,257,555.43	169,216,431.22
减：报告期期间基金总赎回份额	7,980,781.68	180,324,470.74	46,866,931.25

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	23,584,411.83	764,837,087.18	355,491,834.46

注：本基金合同生效日为2020年7月15日

截至本报告期末，本公司从业人员及其配偶购买持有华安证券汇赢增利一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划A份额合计2139362.55份，华安证券汇赢增利B份额合计13688529.71份，华安证券汇赢增利C份额合计7798231.72份。

§ 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

报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 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

无。

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、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、华安证券汇赢增利一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、华安证券汇赢增利一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议；
- 4、华安证券汇赢增利一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号。

9.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95318

公司网址：<http://www.hazq.com/>

华安证券股份有限公司

2021年10月27日