

华安合鑫大成长一期私募证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	华安合鑫大成长一期私募证券投资基金
基金编码	SGB057
基金管理人	深圳市华安合鑫资产管理有限公司
基金托管人（如有）	华泰证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2019 年 02 月 13 日
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	10,083.361891
投资目标	本基金在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置，在降低市场风险的同时追求更高收益。
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本私募基金属于 [进取级（R5）] 风险投资品种

2、基金净值表现

阶段	净值增长率 (%)	净值增长率标准差 (%)	业绩比较基准收益率 (%)	业绩比较基准收益率标准差 (%)
当季	-7.37	-	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	301.34	-	0.00	0.00

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率=（本季度末累计净值-上季度末累计净值）/上季度末累计净值

如为分级基金，应按级别分别列示。

表中指标均以不带百分号数值形式填写，请保留至小数点后 2 位。

2.1 分级基金净值表现

CZYQ01 级基金净值表现

阶段	净值增长率 (%)	净值增长率标准差 (%)	业绩比较基准收益率 (%)	业绩比较基准收益率标准差 (%)
当季	-7.37	-	-	-
自基金合同生效起至今	301.34	-	-	-

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2022-04-01 至 2022-06-30
本期已实现收益	4,863,204.00
本期利润	-31,160,431.78
期末基金净资产	293,772,881.45
报告期期末单位净值	2.9134

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

3.1 分级基金主要财务指标

CZYQ01 级主要财务指标

金额单位：元

项目	2022-04-01 至 2022-06-30
本期已实现收益	-
本期利润	-
期末基金净资产	293,772,881.45
报告期期末单位净值	2.9134

4、投资组合报告

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	12,884.58
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	33,092,968.98
	存出保证金	26,190,858.40
	股票投资	127,312,070.14
	债券投资	0.00
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	0.00
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	0.00

	期货及衍生品交易保证金	26,190,858.40
	买入返售金融资产	0.00
	其他证券类标的	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	
	信托计划投资	
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
	保险资产管理计划投资	
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	
	私募基金产品投资	
	未在协会备案的合伙企业份额	
另类投资	另类投资	
境内债权类投资	银行委托贷款规模	
	信托贷款	
	应收账款投资	
	各类受（收）益权投资	
	票据（承兑汇票等）投资	
	其他债权投资	
境外投资	境外投资	
其他资产	其他资产	应收股利#4049380.95；HAHXDCZ1Q-SWHY#104282516.53；
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	

4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含沪港通)

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	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	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	62,576,688.00	21.30
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	62,576,688.00	21.30

4.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
港股通	64,735,382.14	22.04
合计	64,735,382.14	22.04

5、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	7,749.221301
报告期期间基金总申购份额	2,822.383022
减：报告期期间基金总赎回份额	488.242432
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
期末基金总份额/期末基金实缴总额	10,083.361891

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

5.1 分级基金基金份额变动情况

CZYQ01 级基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	7,749.221301
报告期期间基金总申购份额	2,822.383022
减：报告期期间基金总赎回份额	488.242432
报告期期间基金拆分变动份额（份额	-

减少以“-”填列)	
期末基金总份额/期末基金实缴总额	10,083.361891

6、管理人报告

2022 年 2 季度，国内市场的矛盾仍然是 omicron 疫情反复导致的内需不足，经济在 4 月份探底之后缓慢修复，地产销售同比继续大幅下滑，民营房企不断暴雷；同时货币政策维持宽松，使得资本市场剩余流动性较为充裕，资本市场迎来了一轮流动性驱动的反弹。海外方面，俄乌冲突延续，油价高位震荡，欧美通胀持续往上，但消费信心的不足及衰退预期使得部分大宗商品高位回落。

往后看，稳增长仍然是国内经济政策的重心，新的常态化防控下，经济环比改善的趋势是确定的，但是最终改善的幅度仍需观察，地产产业链的危机状态仍未解除。流动性上，随着实体经济恢复和输入性通胀压力渐起，资本市场剩余流动性最宽松的时点或已过去。综合来看，未来经济前景的不确定性仍然较大，虽然过去部分高景气行业的公司估值提升较快，但市场整体估值已经处于历史底部区域，我们维持谨慎乐观的态度。方向上，我们看好长期资本开支不足、价格维持高位的能源开采行业；价值极度低估、出口维持高景气的集运；以及受益海内外能源价格差异部分制造业。

信息披露报告是否经托管机构复核：是