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

2022年第3季度报告

2022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:2022年10月26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10月24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07月01日起至2022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	1,954,996,008.65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	18,375,741.36份	1,088,365,213.34份	848,255,053.95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(2022年07月01日 - 2022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	193,710.27	8,954,605.27	8,960,654.79
2.本期利润	3,359.22	-2,649,343.33	-210,359.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0002	-0.0024	-0.0002
4.期末基金资产净值	20,363,082.66	1,258,473,894.81	998,181,755.55
5.期末基金份额净值	1.1082	1.1563	1.1767

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。

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 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	0.01%	0.14%	-5.48%	0.35%	5.49%	-0.21%
过去六个月	1.26%	0.16%	-2.45%	0.47%	3.71%	-0.31%
过去一年	4.50%	0.25%	-6.59%	0.47%	11.09%	-0.22%
自基金合同生效起至今	17.77%	0.23%	-2.29%	0.49%	20.06%	-0.26%

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	-0.19%	0.14%	-5.48%	0.35%	5.29%	-0.21%
过去六个月	0.85%	0.16%	-2.45%	0.47%	3.30%	-0.31%
过去一年	3.66%	0.25%	-6.59%	0.47%	10.25%	-0.22%
自基金合同生效起至今	15.63%	0.23%	-2.29%	0.49%	17.92%	-0.26%

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	0.01%	0.14%	-5.48%	0.35%	5.49%	-0.21%
过去六个月	1.25%	0.16%	-2.45%	0.47%	3.70%	-0.31%
过去一年	4.48%	0.25%	-6.59%	0.47%	11.07%	-0.22%

自基金合同生效起至今	17.67%	0.23%	-2.29%	0.49%	19.96%	-0.26%

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

§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	-	12年	工学博士。专注于金融工程、量化投资、交易策略及系统架构设计。具备扎实的数学、统计学与计算机技术功底，丰富的量化交易策略模型构建、算法设计、程序开发以及投资管理经验。现任华安证券合赢九个月持有、华安证券聚赢一年持有、华安证券汇赢增利一年持有的投

					资经理。
樊艳	基金经理	2020-10-12	-	22年	1999年加入华安证券，曾任证券投资部研究员、投资经理，现任资产管理总部投资经理，目前担任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、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢三个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划投资经理。
刘杰	基金经理	2021-12-07	-	12年	硕士研究生。曾任职于招商证券研究所、海富通基金投资部、华泰证券资管权益投资部。2017年加入华安证券，现担任华安证券合赢添利、华安证券合赢三个月持有、华安证券睿赢一年持有、华安证券汇赢增利一年持有的投资经理。

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，本基金管理人严格按照《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

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2022年三季度期间，本基金通过对配置的可转债与股票资产进行结构性微调，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，经受了市场行情的严峻考验；此外信用债及利率债还取得了利息和价差收益。产品大部分资产价格上涨稳定了本基金净值，部分子份额的净值在股指大幅度下跌的情况下仍取得了正收益，使得本基金长期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相对回报。

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1.1082元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.01%，同期业绩比较基准收益率为-5.48%；截至报告期末华安证券汇赢增利B基金份额净值为1.1563元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.19%，同期业绩比较基准收益率为-5.48%；截至报告期末华安证券汇赢增利C基金份额净值为1.1767元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.01%，同期业绩比较基准收益率为-5.48%。

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	188,893,411.46	8.22
	其中：股票	188,893,411.46	8.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,031,942,561.95	88.42

	其中：债券	2,021,721,329.07	87.97
	资产支持证券	10,221,232.88	0.44
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	14,968,814.03	0.65
	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	13,338,622.92	0.58
8	其他资产	49,015,978.50	2.13
9	合计	2,298,159,388.86	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	3,406,800.00	0.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,711,026.40	1.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,889,491.60	2.28
E	建筑业	41,006,223.78	1.80
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	58,168,969.68	2.55
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	4,000,500.00	0.18
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	7,710,400.00	0.34
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	188,893,411.46	8.30

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	600018	上港集团	4,833,178	26,872,469.68	1.18
2	601006	大秦铁路	3,600,000	24,372,000.00	1.07
3	003816	中国广核	9,000,000	23,760,000.00	1.04
4	601390	中国中铁	3,600,000	18,828,000.00	0.83
5	601668	中国建筑	3,600,000	18,540,000.00	0.81
6	600795	国电电力	3,000,000	12,210,000.00	0.54
7	300335	迪森股份	1,654,148	8,700,818.48	0.38
8	300692	中环环保	1,220,000	7,710,400.00	0.34
9	000810	创维数字	472,680	7,553,426.40	0.33
10	600498	烽火通信	600,000	7,452,000.00	0.33

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	256,693,928.34	11.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	121,446,845.88	5.33
	其中：政策性金融债	121,446,845.88	5.33
4	企业债券	356,570,142.20	15.66

5	企业短期融资券	374,449,589.06	16.44
6	中期票据	301,616,763.02	13.25
7	可转债（可交换债）	432,113,675.20	18.98
8	同业存单	178,830,385.37	7.85
9	其他	-	-
10	合计	2,021,721,329.07	88.79

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	019666	22国债01	500,000	50,810,821.92	2.23
2	019536	16国债08	472,510	50,624,896.16	2.22
3	042280168	22中石油CP001	500,000	50,534,232.88	2.22
4	102001109	20中石化MTN003	500,000	50,429,726.03	2.21
5	113042	上银转债	471,200	50,252,892.61	2.21

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	183768	22郎川01	100,000	10,221,232.88	0.45

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国石油天然气集团有限公司于2022年8月16日受到唐山市应急管理局（（冀唐）应急罚（2022）察三012号）的行政处罚；

上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局沪银保监罚决字(2022)13号、沪银保监罚决字(2021)174号的处罚；中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳银保监局深银保监罚决字(2022)87号、杭银罚决字(2022)21号、银保监会银保监罚决字(2022)17号、国家市场监督管理总局国市监处罚〔2021〕79号的处罚；交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到银保监会银保监罚决字(2022)15号、国家外汇管理局上海市分局上海汇管罚字(2021)3111210701号的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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	48,400.59
2	应收证券清算款	46,762,725.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,204,852.21
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	49,015,978.50

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	113042	上银转债	50,252,892.61	2.21

2	113037	紫银转债	40,386,585.15	1.77
3	110072	广汇转债	39,467,435.90	1.73
4	110064	建工转债	32,006,428.74	1.41
5	113017	吉视转债	31,431,440.69	1.38
6	113044	大秦转债	31,164,879.98	1.37
7	110062	烽火转债	25,608,220.82	1.12
8	128044	岭南转债	24,087,224.74	1.06
9	128105	长集转债	22,395,700.49	0.98
10	113519	长久转债	17,618,137.72	0.77
11	127028	英特转债	11,954,448.02	0.53
12	113530	大丰转债	11,214,063.90	0.49
13	110080	东湖转债	11,185,061.64	0.49
14	123049	维尔转债	10,769,861.19	0.47
15	127033	中装转2	10,106,863.51	0.44
16	113589	天创转债	9,817,823.29	0.43
17	113584	家悦转债	8,242,323.76	0.36
18	123077	汉得转债	5,447,198.68	0.24
19	113024	核建转债	5,264,699.34	0.23
20	113601	塞力转债	4,036,710.36	0.18
21	123004	铁汉转债	3,871,437.10	0.17
22	123056	雪榕转债	2,165,296.02	0.10
23	113056	重银转债	1,992,764.11	0.09
24	128071	合兴转债	1,337,014.20	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。

§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	19,640,848.34	1,147,200,363.55	849,498,550.26
报告期期间基金总申购份额	-	87,817,402.38	85,857,056.64

减：报告期期间基金总赎回份额	1,265,106.98	146,652,552.59	87,100,552.95
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	18,375,741.36	1,088,365,213.34	848,255,053.95

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1656186.34份；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B份额合计16804901.56份；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C份额合计15256827.21份。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

2022年10月26日