

华安合鑫大成长一期私募证券投资基金 2022 年年度报告

年报

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

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
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2019 年 02 月 13 日
基金管理人	深圳市华安合鑫私募证券投资基金管理有限公司
基金托管人（如有）	华泰证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	9,329.157525
基金到期日期	2029 年 02 月 12 日

1.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活应用多种投资策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求合理的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
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	无
风险收益特征	R5

1.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	深圳市华安合鑫私募证券投资基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	袁佳穗	刘璐
	联系电话	13560736206	025-83388177
	电子邮箱	13260736206@163.com	liu.lu@htsc.com
传真	0755-83257019	025-83387215	
注册地址	深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2001B	南京市江东中路 228 号	
办公地址	深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2001B	南京市江东中路 228 号	

邮政编码	518000	210019
法定代表人	袁巍	张伟

1.4 信息披露方式

基金管理人向基金委托人提供报告、发送通知或者基金委托人向基金管理人查询本基金的相关信息，均可通过以下至少一种方式进行：

1、信函

基金管理人以邮寄信函方式向基金委托人提供定期报告、临时报告、信息查询结果、本基金运作的重要通知。基金管理人以基金委托人在签署基金合同时提供的通信地址为邮寄信函的送达地址，在基金管理人寄出信函三个工作日后未被退回的，视为将相关信息送达基金委托人。

2、电话或传真

基金管理人以电话、传真方式向基金委托人提供信息查询结果、本基金运作的重要通知。基金管理人以基金委托人在签署基金合同时提供的联系电话为联系方式。通过传真方式发送的，以传真机报告确认时视为将相关信息送达基金委托人。

3、电子邮件或手机短信

基金管理人以电子邮件或手机短信方式向基金委托人提供定期报告、临时报告、信息查询结果、本基金运作的重要通知。基金管理人以基金委托人在签署基金合同时提供的电子邮件或手机电话为联系方式。在基金管理人发出电子邮件或手机短信一个工作日后未被退回的，视为将相关信息送达基金委托人。

4、其他方式通知

基金管理人通过本机构、基金行政服务机构或销售机构的网站或者金融监管部门指定媒体向基金委托人提供定期报告、临时报告、本基金运作的重要通知。在基金管理人发布相关信息三个工作日后视为将相关信息送达基金委托人。

基金委托人的通信地址、电话、传真、电子邮件等联系方式如有变更，应当及时通知基金管理人。



1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	华泰证券股份有限公司	南京市江东中路 228 号
外包机构	华泰证券股份有限公司	南京市江东中路 228 号
-		

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2022	2021	2020
本期已实现收益	10,671,715.10	14,522,853.12	7,364,758.72
本期利润	-20,087,461.71	27,295,202.85	7,356,204.84
期末数据和指标	2022	2021	2020
期末可供分配利润	124,367,664.37	50,955,186.38	7,926,622.84
期末可供分配基金份额	1.3331	1.7493	0.8113

利润			
期末基金净资产	288,796,266.14	113,480,928.72	18,438,327.27
报告期期末单位净值	3.0956	3.8958	1.8872
累计期末指标	2022	2021	2020
基金份额累计净值增长率(%)	319.56	339.58	138.72

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

CZYQ01 级基金主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2022	2021	2020
本期已实现收益	0.00	0.00	0.00
本期利润	0.00	0.00	0.00
期末数据和指标	2022	2021	2020
期末可供分配利润	0.00	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.0000	0.0000	0.0000
期末基金净资产	288,796,266.14	113,480,928.72	18,438,327.27
报告期期末单位净值	3.0956	3.8958	1.8872
累计期末指标	2022	2021	2020
基金份额累计净值增长率(%)	319.56	339.58	138.72

2.2 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(%)
当年	-4.55	-	-	-
自基金合同生效起至今	319.56	-	-	-

注：净值增长率 = (期末累计净值 - 期初累计净值) / 期初累计净值

当年净值增长率 = (本年度末累计净值 - 上年度末累计净值) / 上年度末累计净值

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，一般保留至小数点后 2 位。

CZYQ01

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(%)
当年	-4.55	-	-	-
自基金合同生效起至今	319.56	-	-	-

2.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注

2022	0.6000	5,919,711.74	9,042,469.04	14,962,180.78	-
2021	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
2020	0.5000	866,766.26	488,622.30	1,355,388.56	-

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

CZYQ01 级基金过去三年基金的利润分配情况

年度	每份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2022	0.6000	5,919,711.74	9,042,469.04	14,962,180.78	-
2021	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
2020	0.5000	866,766.26	488,622.30	1,355,388.56	-

3、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	2,912.920149
报告期期间基金总申购份额	8,814.515881
减：报告期期间基金总赎回份额	2,398.278505
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	9,329.157525

备注：

-

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。

CZYQ01 级基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额	2,912.920149
报告期期间基金总申购份额	8,814.515881
减：报告期期间基金总赎回份额	2,398.278505
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	9,329.157525

4、管理人说明的其他情况

1、报告期内高管、基金经理及其关联基金经验：

报告期内管理人高管无变更，详细高管经验履历见中国证券投资基金业协会信息公示。

基金经理袁巍：复旦大学理学学士、清华大学金融学硕士。拥有三年 IT 行业、九年以上公开产品管理经验、十三年以上基金行业工作经验。历任大成基金研究员、基金经理、展博投资管理有限公司基金经理、投资总监等职位。擅长市场趋势分析及成长股自下而上个股研究，基金管理期间业绩持续优秀。

2、基金运作合规守信情况：

报告期内，本基金投资运作符合基金合同的约定。

3、基金投资策略和业绩表现：

本基金将根据个股标的分析和整体行业市场估值水平的变化自下而上的进行资产配置，在降低市场风险的同时追求相对投资收益。

截止 2021 年 12 月 31 日华安合鑫大成长一期私募证券投资基金 A 期末基金单位净值为 3.0956 元，期末基金累计单位净值 4.1956 元。

4、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望：

2022 年 4 季度，国内资本市场剩余流动性仍然维持在较为宽松的水平，股票市场恐慌下跌后企稳反弹，港股迎来 V 形反转。中国经济的核心矛盾之一疫情防控政策发生较大的转向，虽然短期经济仍在低位徘徊，但对于未来经济复苏的预期开始主导市场情绪；地产政策也密集出台，行业最差时点或已过去；出口由高位回落，成为短期经济的拖累项。海外方面，欧美通胀在 11 月份迎来拐点，同比增速见顶回落，美联储加息幅度也开始放缓，市场预期美联储 24 年上半年停止加息。

往后看，未来一个季度资本市场剩余流动性仍然宽裕、同时叠加经济快速复苏，国内股票市场处于较为积极的宏观环境中，尤其是受益于美联储加息放缓的港股有望迎来估值和基本面的戴维斯双击。我们将维持积极进攻的高仓位水平，方向上更看好受益中国经济复苏的互联网、地产及地产链、通信、交运、上游能源开采等板块。

5、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况：

截至报告期末，本基金资产总值为 289883099.54 元，净资产为 288796266.14 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.38%。

6、投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期未进行利润分配，无损失承担情况发生，符合相关法规及基金合同的规定。详见年报‘2.3 过去三年基金的利润分配情况’章节。

7、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项：

无。

8、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等：

本报告期内，本基金未设置预警线及止损线，未出现任何预警情况。

9、其他情况说明：

报告期内我司于 2022 年 10 月 17 日经深圳市市场监督管理局批准，公司名由“深圳市华安合鑫资产管理有限公司”变更为“深圳市华安合鑫私募证券投资基金管理有限公司”。



5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司及时完成了基金名下的资金划拨，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，并严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、费用开支方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金年度报告中的有关财务数据、净值表现、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	2022/12/31	2021/12/31
资产：		
银行存款	9,263.85	2,136.93
结算备付金	16,550,885.86	6,170.34
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	173,749,366.46	98,423,934.28
其中：股票投资	173,749,366.46	98,423,934.28
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	99,552,763.69	16,396,330.29
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	139.01
应收股利	20,819.68	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	289,883,099.54	114,828,710.85
负债和所有者权益		
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	1,051,774.32	863,185.07
应付托管费	17,529.54	11,838.89
应付销售服务费	17,529.54	11,838.89
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	460,919.28
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00

递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	1,086,833.40	1,347,782.13
所有者权益：		
实收基金	93,291,575.25	29,129,201.49
未分配利润	195,504,690.89	84,351,727.23
所有者权益合计	288,796,266.14	113,480,928.72
负债和所有者权益总计	289,883,099.54	114,828,710.85

备注：

-

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2022/01/01 至 2022/12/31	2021/01/01 至 2021/12/31
一、收入	-14,038,374.76	28,788,492.50
1. 利息收入	208,818.85	59,192.83
其中：存款利息收入	78,144.91	17,253.78
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	134,594.15	43,197.31
其他利息收入	-3,920.21	-1,258.26
2. 投资收益（损失以“-”填列）	16,953,239.70	16,357,983.25
其中：股票投资收益	-1,343,093.62	9,984,837.40
基金投资收益	14,347,079.24	3,452,402.75
债券投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	-17,591,720.00	1,915,936.00
股利收益	21,540,974.08	1,004,807.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-30,807,508.78	12,818,496.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-392,924.53	-447,179.89
减：二、费用	6,049,086.95	1,493,289.65
1. 管理人报酬	3,835,184.14	935,780.36
其中：固定管理费	3,835,184.14	935,780.36

业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	92,079.32	31,192.58
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	92,079.32	31,192.58
5. 交易费用	2,014,289.19	296,583.48
6. 利息支出	0.00	90,531.67
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	15,454.98	108,008.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-20,087,461.71	27,295,202.85
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-20,087,461.71	27,295,202.85

备注：

-

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2022/01/01 至 2022/12/31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	29,129,201.49	84,351,727.23	113,480,928.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-20,087,461.71	-20,087,461.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	64,162,373.76	151,463,871.82	215,626,245.58
其中：1. 基金申购款	88,145,158.81	202,447,408.23	290,592,567.04
2. 基金赎回款	-23,982,785.05	-50,983,536.41	-74,966,321.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	-20,223,446.45	-20,223,446.45
五、期末所有者权益（基金净值）	93,291,575.25	195,504,690.89	288,796,266.14
项目	上年度可比期间 2021/01/01 至 2021/12/31		
	实收基金	未分配利润	未分配利润
一、期初所有者权益（基金净值）	9,770,124.37	8,668,202.90	18,438,327.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动	0.00	27,295,202.85	27,295,202.85

数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	19,359,077.12	48,388,321.48	67,747,398.60
其中：1. 基金申购款	28,277,560.78	67,482,439.22	95,760,000.00
2. 基金赎回款	-8,918,483.66	-19,094,117.74	-28,012,601.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	29,129,201.49	84,351,727.23	113,480,928.72

备注：

-

7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

项目		金额	金额单位：元
现金类资产	银行存款	9,263.85	
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	16,550,885.86	
	存出保证金	0.00	
	股票投资	173,749,366.46	
	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	0.00		

	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#20819.68；HAHXDCZ1Q-SWHY#99552763.69；
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	



备注：

-

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合（不含港股通）

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00

C	制造业	14,427,314.00	5.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	8,188,600.00	2.84
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	255,816.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	22,871,730.00	7.92

备注：

-



7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
港股通	150,877,636.46	52.24
合计	150,877,636.46	52.24

备注：

-

信息披露报告是否经托管机构复核：

是