

华安合鑫大成长一期私募证券投资基金
2024 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）	
基金运作方式	开放式
基金合同生效日期	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）	8,799.096947
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（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，适合专业投资者和风险识别、评估、承受能力为 C5 的合格投资者。

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	19.23	-	-	-
自基金合同生效起至今	389.53	-	-	-

分级代码：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 (%)
当季	19.23	-	-	-
自基金合同生效起至今	389.53	-	-	-

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。

3 主要财务指标

金额单位：元

项目	2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
本期已实现收益	12,612,479.14
本期利润	70,453,188.08
期末基金净资产	333,950,414.70
报告期期末单位净值	3.7953

分级代码：CZYQ01

金额单位：元

项目	2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
本期已实现收益	-
本期利润	-
期末基金净资产	333,950,414.70
报告期期末单位净值	3.7953

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

4 投资组合情况

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	25,921.37	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	-
	其中：优先股	-
	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	19,224,660.70
	存出保证金	106,582,758.33
	股票投资	186,131,572.37
	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)	-
	其中：货币基金	0.00
	期货及衍生品交易保证金	106,582,758.33
	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	0.00
其他资产	其他资产	应收股利#130,040.95;
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 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.2.1 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	-	-
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	10,329,448.00	3.09
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	10,329,448.00	3.09

4.2.2 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（人民币）	占基金资产净值比例（%）
港股通	175,802,124.37	52.64
合计	175,802,124.37	52.64

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	9,008.777694
报告期期间基金总申购份额	418.943659
减：报告期期间基金总赎回份额	628.624406
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	0.00
期末基金总份额/期末基金实缴总额	8,799.096947

分级代码：CZYQ01

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	9,008.777694
报告期期间基金总申购份额	418.943659
减：报告期期间基金总赎回份额	628.624406
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	0.00
期末基金总份额/期末基金实缴总额	8,799.096947

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。

6 管理人报告(如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、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、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、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)

一、报告期内高管、基金经理及其管理基金经验

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：深圳市华安合鑫私募证券投资基金管理有限公司董事长、创始人兼投资总监。复旦大学理学学士、清华大学经济学硕士，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。拥有 3 年 IT 行业、15 年基金行业工作经验。拥有 11 年公开产品管理经验，研究功底深厚，坚持基本面分析，极其看重企业股东回报，擅长通过自主研究挖掘优质股，致力于长期绝对收益。

二、报告期内基金运作合规守信情况

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》、《私募投资基金监督管理办法》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合基金合同的约定。

三、报告期内基金投资策略和业绩表现

1、本基金投资策略：

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。

2、本基金业绩表现：

本基金华安合鑫大成长一期私募证券投资基金：本报告期初单位净值 3.0058 元，累计单位净值 4.1058 元，期末单位净值 3.7953 元，累计单位净值 4.8953 元。本报告期份额净值增长率为 19.23%。

四、报告期内对宏观经济及其行业走势展望

2024 年 2 季度，上证指数下跌 2.43%，创业板指数下跌 7.41%，恒生指数上涨 7.12%；同为中国资产的 A/H 股走出了明显的分化走势，同时内部结构上以红利为代表的稳定类资产继续走强，和内需相关的消费、医药等板块回落。2 季度以来，中国经济基本面延续弱修复格局，制造业 PMI 有所改善，尤其是出口持续回升表现亮眼；地产销量仍在寻底，但跌幅放缓；消费增速缓慢下滑。海外方面，全球 PMI 延续回升，但回升速度放缓；美国就业及制造业数据开始走弱，美联储降息预期大幅升温。

值得一提的是，今年 2 季度股票市场和经济基本面出现了一定的背离。从宏观经济数据上看，经济基本面是在弱修复的，但是由于微观个体感受较差，股票市场信心进一步恶化，导致 A 股继续下跌。

往后看，随着美国零售业补库周期的开始，出口仍然是经济的积极因素；而我们观察到随着地产政策的加码，从 6 月份开始新房销量跌幅放缓、二手房销量开始双位数增长，3 季度或许能看到这一内需的核心变量逐渐从 3 年的快速下滑中企稳。同时股票市场，尤其是港股的估值仍然处于极具吸引的状态，我们维持较为乐观积极的仓位，继续看好互联网、汽车、上游资源等行业。

五、报告期内内部基金监察稽核工作

报告期内，本基金整体运作合法合规，本基金管理人严格遵循监管要求及基金合同约定，将保护基金份额持有人的合法权益放在首位，不断完善公司内部控制机制与合规管理体系，有效保障公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

六、报告期内基金估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每 T+1 日完成对基金资产 T 日估值后，与基金托管人以约定的方式进行核对。估值原则应符合本基金合同约定及其他法律、法规的规定。

3、基金财产净值计算和会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金财产有关的会计问题，会计责任方是基金管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以基金管理人对基金财产净值的计算结果为准。

七、报告期内基金运作情况和运用杠杆情况

截止 2024 年 06 月 30 日本基金资产总值为 344,444,669.89 元，资产净值为 333,950,414.70 元，本基金总资产与净资产的比例为 103.14%。

八、报告期内投资收益分配和损失承担情况

报告期内，本基金未进行利润分配，基金投资人层面的损失承担情况视个人买入及交易情形而定。

九、报告期内会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项

报告期内，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

十、报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形

报告期内，本基金未设置预警线和止损线。

十一、报告期内可能存在的利益冲突

报告期内，本基金无可能存在的利益冲突。

十二、报告期内其他情况说明

报告期内，本基金无其他情况说明。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

