

---

# 汇安嘉诚债券型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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2024年7月1日起至2024年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	汇安嘉诚债券	
基金主代码	007609	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年08月09日	
报告期末基金份额总额	53,868,160.27份	
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险并保持资产流动性的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	1、债券投资策略 2、资产支持证券投资策略 3、可转换债券投资策略 4、国债期货投资策略	
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇安嘉诚债券A	汇安嘉诚债券C

下属分级基金的交易代码	007609	007610
报告期末下属分级基金的份额总额	23,046,735.59份	30,821,424.68份

### §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(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	汇安嘉诚债券A	汇安嘉诚债券C
1.本期已实现收益	-400.69	-90,842.57
2.本期利润	-57,971.03	-102,147.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0020	-0.0031
4.期末基金资产净值	23,710,740.94	31,180,817.01
5.期末基金份额净值	1.0288	1.0117

注：1、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。

2、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

汇安嘉诚债券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	-0.19%	0.11%	0.26%	0.10%	-0.45%	0.01%
过去六个月	0.97%	0.12%	1.32%	0.09%	-0.35%	0.03%
过去一年	0.19%	0.18%	3.53%	0.07%	-3.34%	0.11%
过去三年	-4.62%	0.18%	5.97%	0.06%	-10.59%	0.12%
过去五年	7.53%	0.14%	8.14%	0.06%	-0.61%	0.08%
自基金合同生效起至今	8.22%	0.14%	7.98%	0.06%	0.24%	0.08%

汇安嘉诚债券C净值表现

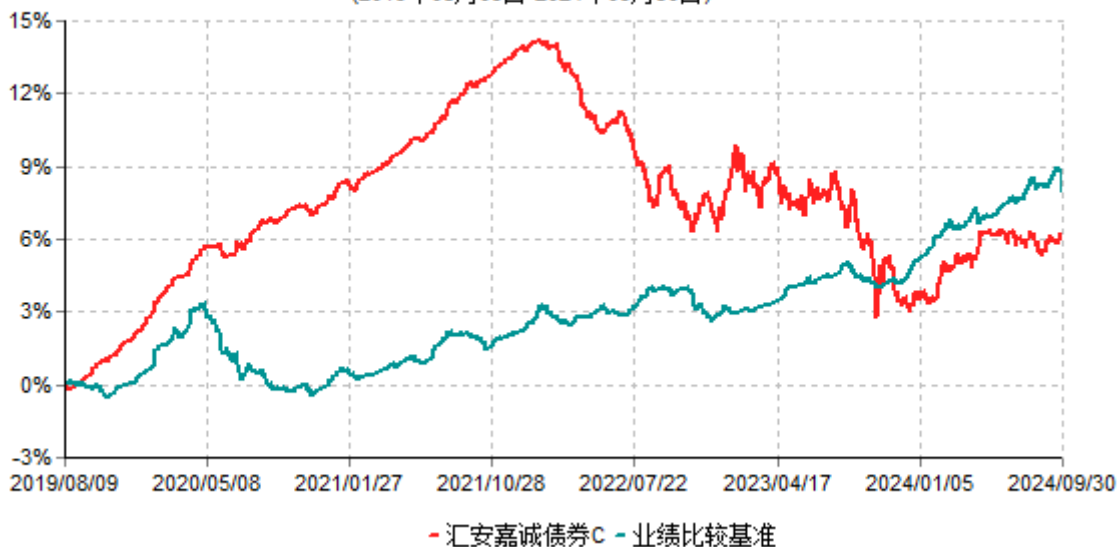
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.29%	0.11%	0.26%	0.10%	-0.55%	0.01%
过去六个月	0.77%	0.12%	1.32%	0.09%	-0.55%	0.03%
过去一年	-0.22%	0.18%	3.53%	0.07%	-3.75%	0.11%
过去三年	-5.77%	0.18%	5.97%	0.06%	-11.74%	0.12%
过去五年	5.40%	0.14%	8.14%	0.06%	-2.74%	0.08%
自基金合同生效起至今	6.02%	0.14%	7.98%	0.06%	-1.96%	0.08%

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

汇安嘉诚债券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  
(2019年08月09日-2024年09月30日)



汇安嘉诚债券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  
(2019年08月09日-2024年09月30日)



注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

#### §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		
仇秉则	绝对收益组基金经理、本基金的基金经理	2019-08-09	2024-08-08	18年	仇秉则先生，CFA，CPA，中山大学经济学学士，18年证券、基金行业从业经验。曾任普华永道中天会计师事务所审计经理，嘉实基金管理有限公司固定收益部高级信用分析师。2016年6月加入汇安基金管理有限责任公司，担任绝对收益组基金经理。2016年12月2日至2019年10月11日，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2016年12月5日至2019年10月11日，任汇安嘉裕纯债债券型证券

				<p>投资基金基金经理；2016年12月19日至2018年2月9日，2019年5月10日至2020年5月11日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年12月22日至2019年10月11日，任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2016年12月22日至2019年11月19日，任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年1月25日至2018年2月9日，任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年1月10日至2019年1月10日，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年1月13日至2018年5月14日，任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年3月13日至2018年5月14日，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年7月27日至2019年10月11日，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年8月10日至2019年10月11日，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年10月14日至2021年4月21日任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理；2020年12月18日至2021年12月31日，任汇安恒利39个月定期</p>
--	--	--	--	--

					<p>开放纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年2月2日至2022年11月11日，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理；2021年10月12日至2022年12月8日，任汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2021年11月9日至2024年3月26日，任汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2019年8月9日至2024年8月8日，任汇安嘉诚债券型证券投资基金基金经理；2020年3月5日至2024年8月8日，任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2020年4月21日至2024年8月8日，任汇安嘉利混合型证券投资基金基金经理；2021年5月6日至2024年8月8日，任汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021年8月3日至2024年8月8日，任汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2022年8月10日至2024年8月8日，任汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
杨坤河	绝对收益组基金经理、本基金的基金经理	2023-02-02	-	8年	<p>杨坤河先生，清华大学管理科学与工程硕士研究生，8年证券、基金行业从业经验。曾任中国五矿集团公司黑流中心风控主管、高级业</p>

				务经理；东北证券股份有限公司研究所分析师；太平洋证券股份有限公司研究院首席分析师，2021年2月加入汇安基金管理有限责任公司，担任绝对收益组基金经理。2021年9月27日至今，任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2022年7月27日至今，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理；2023年2月2日至今，任汇安嘉诚债券型证券投资基金基金经理；2024年7月19日至今，任汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--

上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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，本基金管理人严格遵守《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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明



基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场核心交易两点，一是9月美联储降息50BP开启本轮降息周期，美债一度定价了150BP降息空间，导致美元走弱，黄金、美债均快速上涨。二是从国内看，9月24日三部门释放稳增长信号，叠加海外降息，市场快速反转，风险偏好明显提振，债市则迅速回调，超长债和信用债跌幅居前。

三季度我们整体降低了久期，同时降低权益仓位，尽管错失了阶段性的债券资本利得，但较为有效控制了波动。三季度末我们权益仓位略有提升，但整体仍然较为谨慎。

展望四季度，基本面预计仍将惯性承压。从国内看，以财政为焦点的政策如何验证高层稳增长决心，将是市场博弈的核心。此外也要关注12月份中央经济工作会议释放的关于明年的信号。若财政或中央经济工作会议超预期，市场风险偏好还将继续提升。从海外看，11月美国大选、美联储降息节奏是核心关注点。

四季度我们整体看好股票和可转债，对纯债保持中性。对权益而言，当前仍处于政策转向阶段，除非政策转向被证伪，否则权益仍可能普涨；预计明年初是政策效果验证期，或表现为震荡加剧；明年下半年预计进入基本面驱动期，重回结构性行情。对国内债券市场而言，鉴于高层稳增长意愿提升，且后续存在财政超预期和理财赎回负反馈风险，同时三年债券牛市的获利盘需要防守，我们对债券保持中性。可转债方面，随着权益市场回升，转债期权价值有所修复，但转债涨幅仍然滞后，估值修复较慢，目前尚在底部区域。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安嘉诚债券A基金份额净值为1.0288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0.26%；截至报告期末汇安嘉诚债券C基金份额净值为1.0117元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.29%，同期业绩比较基准收益率为0.26%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,955,021.35	74.36
	其中：债券	45,955,021.35	74.36
	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	14,501,236.15	23.46
	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	725,062.64	1.17
8	其他资产	621,630.78	1.01
9	合计	61,802,950.92	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	23,414,792.33	42.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,551,772.02	26.51
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,988,457.00	14.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,955,021.35	83.72

### 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	019740	24国债09	110,000	11,086,089.32	20.20
2	019728	23国债25	60,000	6,210,320.55	11.31
3	232380073	23农行二级资本 债03A	50,000	5,357,688.52	9.76
4	2220030	22重庆银行二级	50,000	5,246,439.45	9.56
5	019739	24国债08	40,000	4,069,567.12	7.41

**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**

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**  
本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**  
本基金本报告期末未持有股指期货。

**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**  
本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、重庆银行股份有限公司在本报告编制前一年内曾受监管处罚，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

本基金投资的其余前十名证券的发行主体本期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 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,582.21
2	应收证券清算款	603,168.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,879.81
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	621,630.78

### 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	113059	福莱转债	1,335,278.08	2.43
2	123121	帝尔转债	787,481.78	1.43
3	118022	锂科转债	600,114.25	1.09
4	118038	金宏转债	576,466.44	1.05
5	118033	华特转债	506,011.97	0.92

6	127084	柳工转2	490,664.47	0.89
7	123088	威唐转债	451,016.44	0.82
8	128117	道恩转债	443,395.62	0.81
9	123169	正海转债	386,004.72	0.70
10	128097	奥佳转债	374,115.19	0.68
11	113069	博23转债	247,212.16	0.45
12	113666	爱玛转债	238,762.19	0.43
13	128116	瑞达转债	214,002.90	0.39
14	123192	科思转债	210,206.10	0.38
15	123233	凯盛转债	203,108.27	0.37
16	113657	再22转债	199,708.77	0.36
17	123109	昌红转债	198,884.96	0.36
18	127066	科利转债	165,744.45	0.30
19	127020	中金转债	121,990.00	0.22
20	118037	上声转债	121,375.34	0.22
21	123231	信测转债	116,912.90	0.21

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

	汇安嘉诚债券A	汇安嘉诚债券C
报告期期初基金份额总额	34,506,872.80	33,953,502.18
报告期期间基金总申购份额	34,212.91	26,060.43
减：报告期期间基金总赎回份额	11,494,350.12	3,158,137.93
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	23,046,735.59	30,821,424.68

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	汇安嘉诚债券A	汇安嘉诚债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	9,712,509.71	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	9,712,509.71	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00	-

注：

1.基金管理人汇安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

2.报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自类别的份额总额计算。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2024-08-08	9,712,509.71	-10,003,885.00	0
合计			9,712,509.71	-10,003,885.00	

基金管理人汇安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

## §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存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （1）中国证监会批准汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金募集的文件
- （2）《汇安嘉诚债券型证券投资基金基金合同》

- (3) 《汇安嘉诚债券型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安嘉诚债券型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

## 9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

## 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2024年10月25日