
汇安嘉利混合型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024年06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07月19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7月18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4月1日起至2024年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇安嘉利混合
基金主代码	009133
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年04月21日
报告期末基金份额总额	107,838,352.84份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资业务投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*15%+中债综合财富指数收益率*85%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
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	汇安嘉利混合A 汇安嘉利混合C

下属分级基金的交易代码	009133	009134
报告期末下属分级基金的份额总额	85,623,633.15份	22,214,719.69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04月01日 - 2024年06月30日)	
	汇安嘉利混合A	汇安嘉利混合C
1.本期已实现收益	867,252.44	203,468.25
2.本期利润	134,292.39	15,394.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0015	0.0007
4.期末基金资产净值	83,387,217.24	21,274,181.04
5.期末基金份额净值	0.9739	0.9577

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

汇安嘉利混合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	0.14%	0.11%	1.17%	0.11%	-1.03%	0.00%
过去六个月	0.56%	0.15%	3.39%	0.13%	-2.83%	0.02%
过去一年	-4.86%	0.24%	3.51%	0.13%	-8.37%	0.11%
过去三年	-10.40%	0.27%	6.87%	0.16%	-17.27%	0.11%
自基金合同生效起至今	-2.61%	0.24%	13.68%	0.17%	-16.29%	0.07%

汇安嘉利混合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	0.04%	0.11%	1.17%	0.11%	-1.13%	0.00%
过去六个月	0.36%	0.15%	3.39%	0.13%	-3.03%	0.02%
过去一年	-5.23%	0.24%	3.51%	0.13%	-8.74%	0.11%
过去三年	-11.46%	0.27%	6.87%	0.16%	-18.33%	0.11%
自基金合同生效起至今	-4.23%	0.24%	13.68%	0.17%	-17.91%	0.07%

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

汇安嘉利混合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
(2020年04月21日-2024年06月30日)



汇安嘉利混合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
(2020年04月21日-2024年06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	2020-04-21	-	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日至今，任汇安嘉诚债券型证券投资基金基金经理；2020年3月5日至今，任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2020年4月21日至今，任汇安嘉利混合型证券投资基金基金经理；2021年5月6日至今，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日至今，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。</p>
--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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所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

二季度宏观经济延续弱复苏状态，出口表现亮眼，消费具有一定韧性。生产端保持稳定，工业企业营收和工业增加值延续增长，固定资产投资完成额稳定增长。政策方面不断释放积极信号，政治局会议提出“及早发行并用好超长期特别国债，加快专项债发行使用进度”，5月起政府债发行加速，对于基建起到一定支撑作用。货币政策方面，提到“降低社会综合融资成本”，并明确将实施支持性的货币政策，预计流动性有望持续宽松。

权益市场方面，4月伴随消费韧性和生产量恢复，宏观数据有所企稳，出口对于经济支撑效果明显，两会确定的广义赤字增加，使得市场对于财政发力有一定期待，美国通胀持续回落使得美债利率回落，对流动性形成支撑。5月市场对于地产政策的预期升温，带动地产链大幅走高，政策落地后市场走出利多出尽行情，从预期政策出台转向观察实施效果，情绪逐渐降温，市场重回分红与高成长并存的哑铃型结构。

债市方面，4月自律机制要求取消手工补息后，银行存款转为非银负债，债券配置需求明显增加。债券供给方面，4月城投债持续净偿还，政府债净融资偏慢，使得合意资产供不应求，地产预期逐步降温后，市场避险情绪延续，利率出现持续下行。自4月底起，央行开始频繁关注长期收益率，但由于供需关系仍不平衡，利率经历短期快速调整后再度创下新低。

在报告期内，基金组合总体维持中性的久期策略，获取了一定的债券净价收益。在股票上维持相对稳健的投资比例，以高分红的稳定类品种为核心持仓，此外提高了出口链相关标的仓位。可转债维持较低投资比例，在可转债市场剧烈调整的过程中得以规避

一部分损失，同时根据对可转债股票基本面与信用的分析，用相对分散的策略增加了部分超调转债的持仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安嘉利混合A基金份额净值为0.9739元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.14%，同期业绩比较基准收益率为1.17%；截至报告期末汇安嘉利混合C基金份额净值为0.9577元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.04%，同期业绩比较基准收益率为1.17%。

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	8,104,709.60	7.67
	其中：股票	8,104,709.60	7.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	95,069,745.06	90.01
	其中：债券	95,069,745.06	90.01
	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	1,000,000.00	0.95
	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	1,408,969.73	1.33
8	其他资产	34,565.14	0.03
9	合计	105,617,989.53	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

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	-	-
B	采矿业	1,121,100.00	1.07
C	制造业	6,190,860.60	5.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	255,249.00	0.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	537,500.00	0.51
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	8,104,709.60	7.74

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

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	600938	中国海油	18,000	594,000.00	0.57
2	600519	贵州茅台	400	586,956.00	0.56

3	603658	安图生物	12,200	562,054.00	0.54
4	600941	中国移动	5,000	537,500.00	0.51
5	601899	紫金矿业	30,000	527,100.00	0.50
6	600309	万华化学	6,300	509,418.00	0.49
7	600079	人福医药	28,300	485,911.00	0.46
8	600887	伊利股份	16,000	413,440.00	0.40
9	600563	法拉电子	5,400	411,372.00	0.39
10	300750	宁德时代	2,000	360,060.00	0.34

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	51,079,964.64	48.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,834,076.50	19.91
	其中：政策性金融债	20,834,076.50	19.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,461,680.33	5.22
7	可转债（可交换债）	17,694,023.59	16.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	95,069,745.06	90.84

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	230415	23农发15	200,000	20,834,076.50	19.91
2	019696	23国债03	189,000	19,309,487.92	18.45
3	019725	23国债22	130,000	13,548,528.77	12.95
4	019709	23国债16	100,000	10,156,150.69	9.70
5	019739	24国债08	80,000	8,065,797.26	7.71

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，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 基金投资的前十名股票没有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	14,451.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	20,114.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	34,565.14

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	118000	嘉元转债	1,057,488.83	1.01
2	127020	中金转债	1,003,334.81	0.96
3	123179	立高转债	958,651.93	0.92
4	127044	蒙娜转债	721,102.46	0.69
5	123113	仙乐转债	693,000.00	0.66
6	123158	宙邦转债	656,133.57	0.63
7	113657	再22转债	619,256.08	0.59
8	118015	芯海转债	539,363.45	0.52
9	123133	佩蒂转债	534,483.52	0.51
10	113640	苏利转债	533,990.45	0.51
11	113044	大秦转债	523,153.17	0.50
12	132026	G三峡EB2	517,826.30	0.49
13	127085	韵达转债	513,070.72	0.49
14	118013	道通转债	501,348.22	0.48
15	118009	华锐转债	495,720.58	0.47
16	113659	莱克转债	423,983.44	0.41
17	118022	锂科转债	417,666.60	0.40
18	113625	江山转债	408,019.23	0.39
19	118037	上声转债	388,907.28	0.37
20	118038	金宏转债	316,743.72	0.30
21	113624	正川转债	308,400.35	0.29
22	110089	兴发转债	278,700.02	0.27
23	110076	华海转债	273,677.87	0.26
24	123121	帝尔转债	269,002.79	0.26
25	110085	通22转债	263,359.86	0.25
26	127051	博杰转债	261,000.77	0.25

27	113047	旗滨转债	260,971.56	0.25
28	127038	国微转债	259,296.75	0.25
29	123210	信服转债	245,538.88	0.23
30	113064	东材转债	231,644.46	0.22
31	127088	赫达转债	206,904.77	0.20
32	118032	建龙转债	177,832.73	0.17
33	113669	景23转债	150,852.14	0.14
34	113045	环旭转债	149,674.23	0.14
35	118033	华特转债	137,479.29	0.13
36	127074	麦米转2	136,692.87	0.13
37	123115	捷捷转债	135,097.45	0.13
38	127031	洋丰转债	133,877.61	0.13
39	113638	台21转债	133,391.01	0.13
40	118024	冠宇转债	132,681.31	0.13
41	123124	晶瑞转2	132,031.08	0.13
42	123109	昌红转债	132,005.63	0.13
43	113677	华懋转债	132,004.84	0.13
44	118006	阿拉转债	130,948.87	0.13
45	113542	好客转债	129,266.96	0.12
46	123093	金陵转债	129,037.19	0.12
47	113627	太平转债	126,370.90	0.12
48	123169	正海转债	125,399.34	0.12
49	113664	大元转债	125,097.48	0.12
50	113641	华友转债	124,804.43	0.12
51	128144	利民转债	121,963.17	0.12
52	118042	奥维转债	118,386.76	0.11
53	123145	药石转债	70,182.64	0.07

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。

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

	汇安嘉利混合A	汇安嘉利混合C
报告期期初基金份额总额	88,733,029.65	23,667,117.05
报告期期间基金总申购份额	36,341.55	32,897.72
减：报告期期间基金总赎回份额	3,145,738.05	1,485,295.08
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	85,623,633.15	22,214,719.69

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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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利一年封闭运作混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安嘉利混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安嘉利混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安嘉利混合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07月19日