汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022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:2022年07月21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2022年7月20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4月1日起至2022年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇安泓利一年持有期混合
基金主代码	011991
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年05月06日
报告期末基金份额总额	933,455,232.58份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、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、股票期权投资策略、参与融资业务策略等。
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率×85%+沪深300指数收益率×12.5%＋恒生指数收益率×2.5%
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。 本基金通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	汇安泓利一年持有期混合A	汇安泓利一年持有期混合C
下属分级基金的交易代码	011991	011992
报告期末下属分级基金的份额总额	507,102,192.48份	426,353,040.10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(2022年04月01日 - 2022年06月30日)	
	汇安泓利一年持有期混合A	汇安泓利一年持有期混合C
1.本期已实现收益	-5,298,012.96	-4,984,228.16
2.本期利润	-1,812,286.62	-2,195,669.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0031	-0.0045
4.期末基金资产净值	508,997,899.42	425,977,436.19
5.期末基金份额净值	1.0037	0.9991

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

汇安泓利一年持有期混合A净值表现

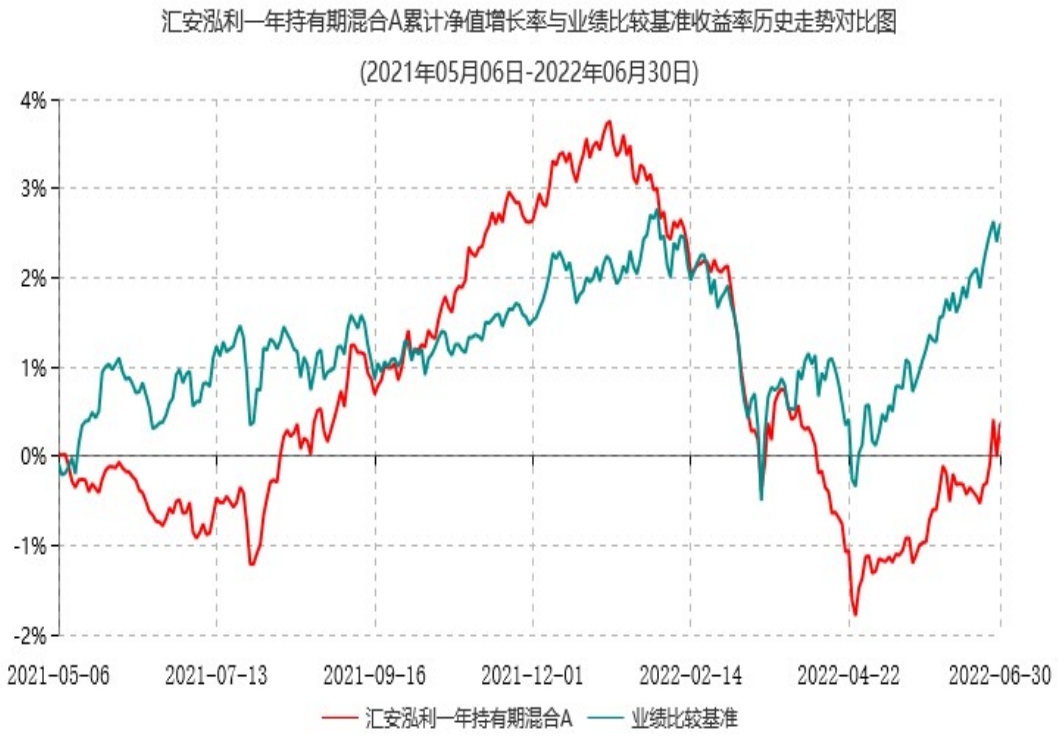
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.03%	0.19%	1.73%	0.21%	-1.70%	-0.02%

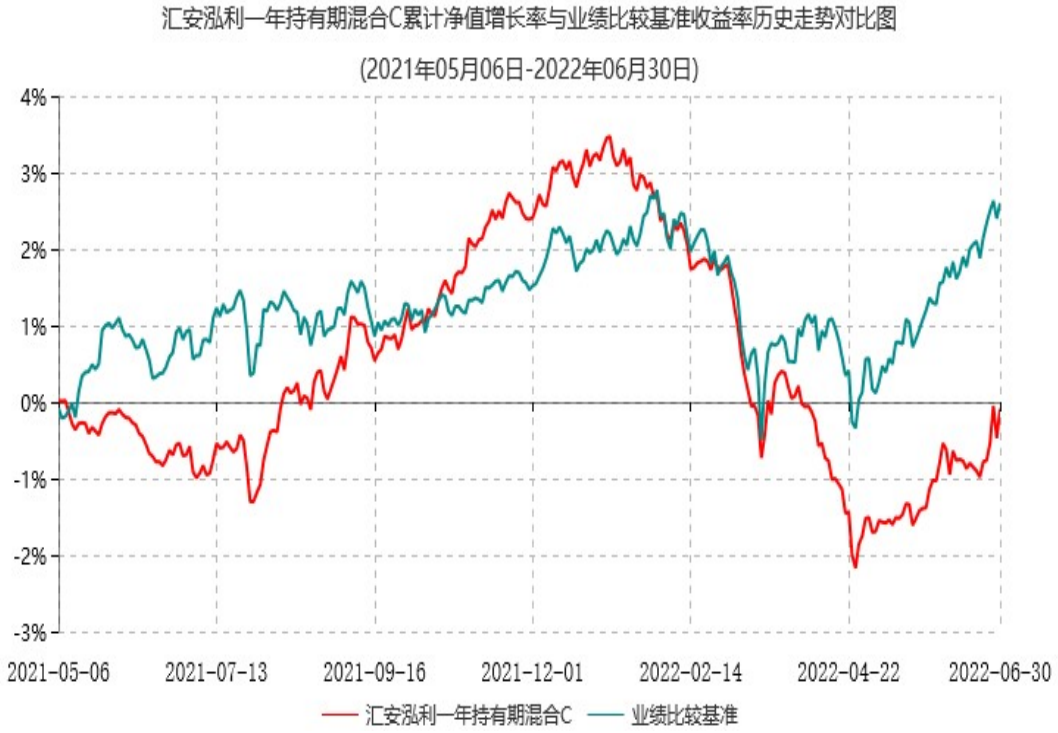
过去六个月	-3.23%	0.19%	0.35%	0.23%	-3.58%	-0.04%
过去一年	1.01%	0.18%	1.66%	0.19%	-0.65%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.37%	0.17%	2.60%	0.19%	-2.23%	-0.02%

汇安泓利一年持有期混合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	-0.07%	0.19%	1.73%	0.21%	-1.80%	-0.02%
过去六个月	-3.42%	0.19%	0.35%	0.23%	-3.77%	-0.04%
过去一年	0.60%	0.18%	1.66%	0.19%	-1.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-0.09%	0.17%	2.60%	0.19%	-2.69%	-0.02%

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





注：①基金合同生效日为 2021 年 5 月 6 日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。②根据《汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协

议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，不需要召开基金份额持有人大会。本基金投资于股票资产（含存托凭证）的比例不高于基金资产的 30%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过本基金所投资股票资产的 50%；本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20％；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期为 2021 年 5 月 6 日至 2021 年 11 月 5 日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

§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	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2021-05-06	-	16年	仇秉则先生，CFA，CPA，中山大学经济学学士，16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，担任固定收益研究部总经理一职，从事信用债投资研究工作。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；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；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；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；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1

					2月31日，任汇安恒利39个月定期开放纯债债券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2月2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；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;2021年10月12日至今，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日至今，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。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

报告期内，海内外政策节奏继续呈现差异。美联储快速加息缩表，以期避免工资通胀循环,中国央行则引导银行降低贷款利率，并降低了五年期贷款报价利率。在国内疫情受控后，复工复产进展迅速，供给端持续修复，消费和投资边际回暖，地产销售也逐步触底回升，出口仍保持较强韧性。但判断经济活动回升的斜率将小于2020的疫后复苏，整体呈现慢复苏的态势。

债市整体窄幅震荡行情，资金价格处于历史低位，整体利率水平与信用息差亦处于历史低位，信用分化则继续演绎。报告期内，本基金继续采取短久期的债券投资策略并有效控制信用风险，

权益市场在疫情缓解、政策持续发力下，于4月末迎来全面转折，市场情绪得到有效修复，成长风格表现突出，并进一步向大消费、地产产业链扩散。报告期内，本基金相对灵活谨慎的调整权益仓位和行业配置，在控制下行风险的同时部分获取了股票市场和转债市场反弹的收益。

展望后市，基本面延续慢复苏趋势，政策将维持支持力度，同时需关注海外经济滞涨、国内通胀上行以及股债估值变化等风险因素，组合将继续采取相对灵活的资产配置策略与行业配置策略，在复杂多变的市场中争取获得相对平稳的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安泓利一年持有期混合A基金份额净值为1.0037元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.03%，同期业绩比较基准收益率为1.73%；截至报告期末汇

安泓利一年持有期混合C基金份额净值为0.9991元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.07%，同期业绩比较基准收益率为1.73%。

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	115,601,751.64	12.23
	其中：股票	115,601,751.64	12.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	794,836,457.29	84.06
	其中：债券	764,167,802.49	80.81
	资产支持证券	30,668,654.80	3.24
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	7,000,000.00	0.74
	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	27,878,461.24	2.95
8	其他资产	262,689.30	0.03
9	合计	945,579,359.47	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	1,332,303.44	0.14
C	制造业	92,494,013.70	9.89
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	39,368.28	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	18,332,306.00	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,191.35	0.00
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	3,341,843.30	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	18,754.05	0.00
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	115,588,780.12	12.36

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	600026	中远海能	898,600	9,282,538.00	0.99
2	601975	招商南油	2,245,600	9,049,768.00	0.97
3	002129	TCL中环	140,000	8,244,600.00	0.88
4	603566	普莱柯	300,000	8,019,000.00	0.86
5	000792	盐湖股份	183,600	5,500,656.00	0.59
6	002304	洋河股份	30,000	5,494,500.00	0.59
7	000858	五 粮 液	27,000	5,452,110.00	0.58

8	002001	新 和 成	237,500	5,417,375.00	0.58
9	600276	恒瑞医药	145,000	5,378,050.00	0.58
10	600585	海螺水泥	150,000	5,292,000.00	0.57

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	172,953,800.01	18.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	244,726,766.03	26.17
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	200,718,139.26	21.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	69,991,695.89	7.49
7	可转债（可交换债）	75,777,401.30	8.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	764,167,802.49	81.73

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	019664	21国债16	1,100,000	111,810,841.10	11.96
2	2128051	21工商银行二级02	800,000	81,744,179.73	8.74
3	2128028	21邮储银行二级01	700,000	72,283,676.16	7.73
4	2028015	20兴业银行小微债01	700,000	70,123,441.64	7.50
5	019658	21国债10	600,000	61,142,958.91	6.54

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	189135	21君粤1A	300,000	30,668,654.80	3.28

注：本基金本报告期末仅持有上述1只资产支持证券。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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中，邮储银行、工商银行和兴业银行在本报告编制前一年内曾受行政处罚，相关主体作为债券发行人，经营稳健，业绩良好，所受处罚不影响发行人的实际经营，经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，相关债券被纳入本基金的实际投资组合。

本基金投资的前十名证券的发行主体中其余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 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	262,689.30

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	262,689.30

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	128035	大族转债	14,790,391.63	1.58
2	127044	蒙娜转债	14,099,970.41	1.51
3	127022	恒逸转债	11,444,111.57	1.22
4	123107	温氏转债	8,140,166.85	0.87
5	113606	荣泰转债	6,822,861.37	0.73
6	113616	韦尔转债	5,974,844.13	0.64
7	113622	杭叉转债	4,985,436.71	0.53

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未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安泓利一年持有期混合A	汇安泓利一年持有期混合C
报告期期初基金份额总额	646,218,850.48	558,550,482.49
报告期期间基金总申购份额	6,742.32	2,649.94
减：报告期期间基金总赎回份额	139,123,400.32	132,200,092.33
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	507,102,192.48	426,353,040.10

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泓利一年持有期混合型证券投资基金募集的文件

（2）《汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》

（3）《汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》

（4）《汇安泓利一年持有期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

2022年07月21日