
汇安嘉诚债券型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022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:2022年10月26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10月25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7月1日起至2022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	220,262,264.48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 在进行债券投资时，本基金将会考量利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略和债券选择策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。 2、资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 3、可转换债券投资策略

	可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。 4、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。	
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	72,694,960.30份	147,567,304.18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07月01日 - 2022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	-2,511,651.17	-4,746,160.28

2. 本期利润	-2,968,441.32	-5,543,850.85
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0335	-0.0333
4. 期末基金资产净值	75,489,978.75	151,904,719.40
5. 期末基金份额净值	1.0384	1.0294

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

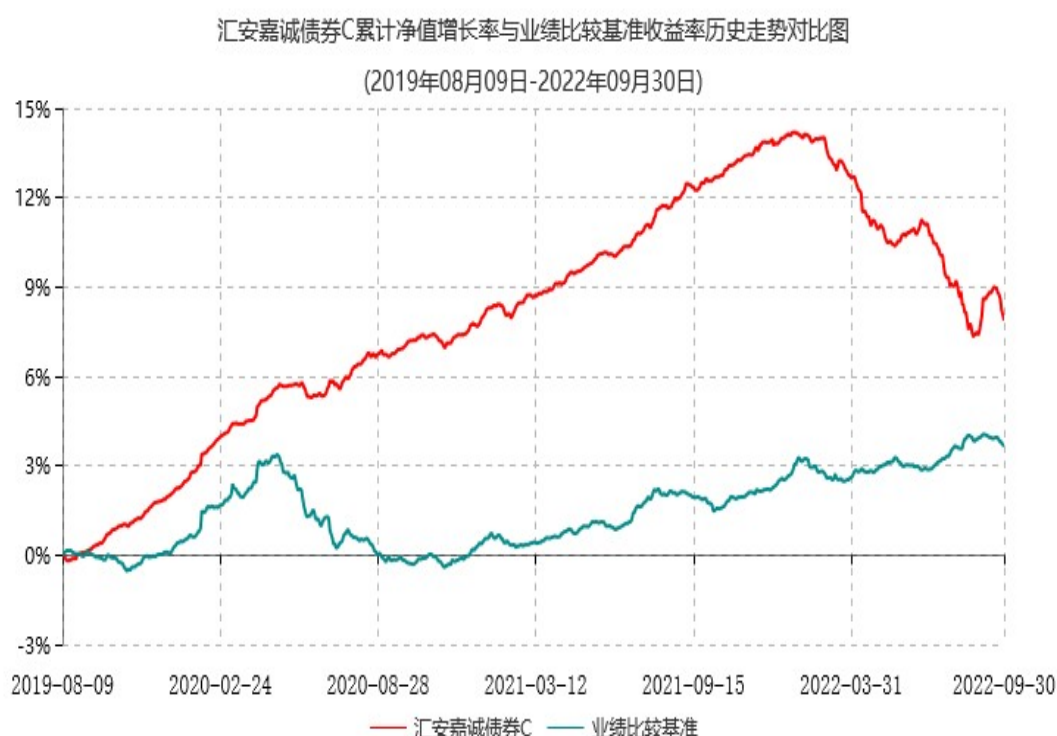
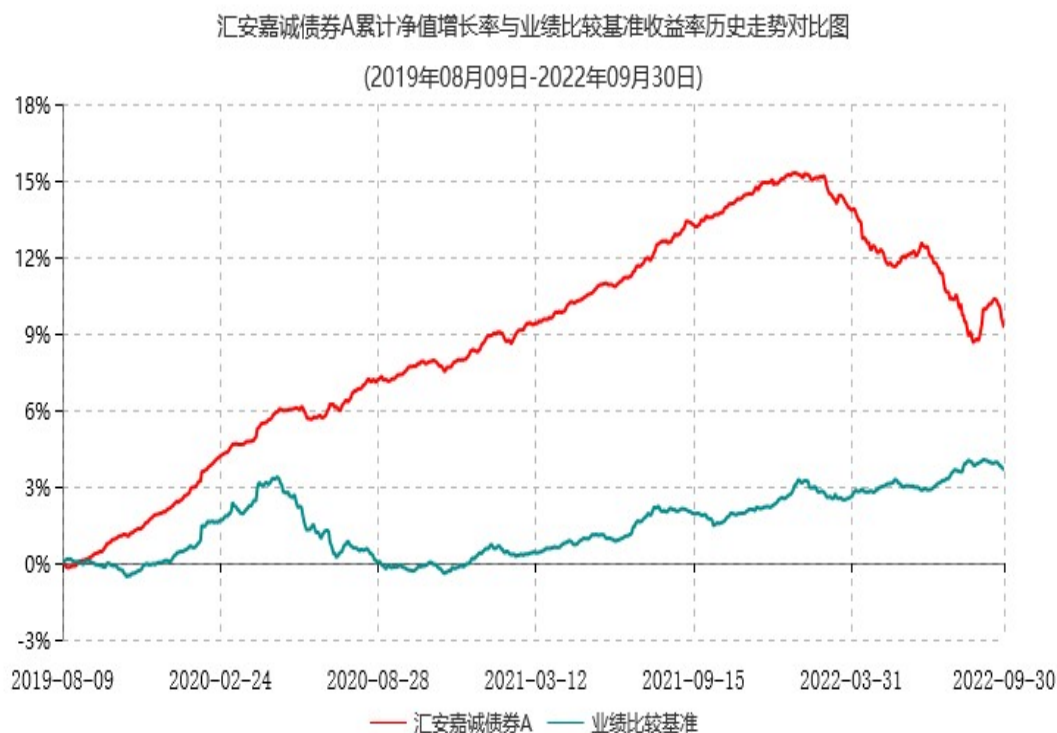
汇安嘉诚债券A净值表现

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	-2.84%	0.16%	0.73%	0.05%	-3.57%	0.11%
过去六个月	-4.05%	0.13%	1.03%	0.04%	-5.08%	0.09%
过去一年	-3.73%	0.11%	1.73%	0.05%	-5.46%	0.06%
过去三年	8.54%	0.08%	3.81%	0.07%	4.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	9.23%	0.08%	3.66%	0.06%	5.57%	0.02%

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	-2.93%	0.15%	0.73%	0.05%	-3.66%	0.10%
过去六个月	-4.24%	0.13%	1.03%	0.04%	-5.27%	0.09%
过去一年	-4.12%	0.11%	1.73%	0.05%	-5.85%	0.06%
过去三年	7.25%	0.08%	3.81%	0.07%	3.44%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.88%	0.08%	3.66%	0.06%	4.22%	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：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	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2019-08-09	-	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12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；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。
--	--	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、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

无

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，国内经济曲折弱复苏，结构分化明显，国内经济维持韧性的一方面来自外需支撑下的出口，另一方面来自稳增长一揽子政策逐步落地下的基建和制造业投资。地产和消费三季度对经济仍有掣肘，其中房地产企业新增投资在保交楼压力持续回落，但三季度地产销售和竣工数据或已基本探明底部。居民消费受散发疫情影响相对疲软，预防性储蓄增加较快。

美国在持续通胀压力下货币政策紧缩程度大幅超预期，催生强势美元。俄乌冲突进入新阶段，欧洲能源危机继续发酵，全球金融市场的不确定性进一步加大，人民币汇率亦面对一定压力。

报告期内，流动性是债市的确定性利好，信用利差大幅压缩。短端宽松的确定性和长端的不确定性交织，拉动期限结构显著陡峭化。转债方面，继续平衡型及偏债型转债方面布局，并及时控制组合风险敞口，三季度转债估值有所调整，将积极布局被市场错杀的优质转债标的。

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1.0384元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.84%，同期业绩比较基准收益率为0.73%；截至报告期末汇安嘉诚债券C基金份额净值为1.0294元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.93%，同期业绩比较基准收益率为0.73%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	250,441,677.94	99.16
	其中：债券	250,441,677.94	99.16
	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	-832.19	0.00
	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	1,561,181.10	0.62
8	其他资产	555,307.72	0.22
9	合计	252,557,334.57	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	91,431,441.10	40.21
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	98,444,994.50	43.29
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	29,973,722.74	13.18
7	可转债（可交换债）	30,591,519.60	13.45
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—

10	合计	250,441,677.94	110.14
----	----	----------------	--------

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	210016	21付息国债16	300,000	30,634,734.25	13.47
2	102101097	21今世缘MTN001	200,000	20,568,944.66	9.05
3	019666	22国债01	200,000	20,324,328.77	8.94
4	019656	21国债08	200,000	20,282,701.37	8.92
5	019638	20国债09	200,000	20,189,676.71	8.88

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

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投资国债期货。

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，棕榈股份、珠海投资控股有限公司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 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票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	58,624.13
2	应收证券清算款	479,041.12
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	17,642.47
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	555,307.72

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	3,249,033.70	1.43
2	113639	华正转债	2,506,289.38	1.10
3	113641	华友转债	2,379,920.00	1.05
4	113619	世运转债	2,337,480.55	1.03
5	127036	三花转债	1,903,957.42	0.84
6	123107	温氏转债	1,312,038.36	0.58
7	110085	通22转债	1,278,960.00	0.56
8	123076	强力转债	1,268,346.74	0.56
9	128117	道恩转债	1,214,994.52	0.53
10	127040	国泰转债	1,190,353.97	0.52
11	113049	长汽转债	1,171,490.68	0.52
12	113616	韦尔转债	1,137,728.49	0.50
13	123115	捷捷转债	1,134,012.33	0.50

14	123124	晶瑞转2	1,098,102.47	0.48
15	123113	仙乐转债	1,077,969.86	0.47
16	123101	拓斯转债	1,032,825.99	0.45
17	127056	中特转债	563,727.81	0.25
18	127044	蒙娜转债	434,441.64	0.19
19	113636	甬金转债	428,700.92	0.19

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	120,113,776.95	197,996,675.03
报告期期间基金总申购份额	1,706,771.75	4,085,368.38
减：报告期期间基金总赎回份额	49,125,588.40	54,514,739.23
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	72,694,960.30	147,567,304.18

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	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,712,509.71	-

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	13.36	—
---------------------------	-------	---

注：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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§ 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

2022年10月26日