

---

# 汇安嘉利混合型证券投资基金

## 2023年第3季度报告

2023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:2023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2023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2023年7月1日起至2023年9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 | 123,720,864.75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       | <p>本基金管理人在大类资产配置过程中，结合定量和定性分析，从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势，重点分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系，在此基础上，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券的比例。</p> <p>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。</p> |
| 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 | 97,880,356.38份                           | 25,840,508.37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(2023年07月01日 - 2023年09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      | -2,550,004.53                  | -668,289.41   |
| 2.本期利润         | -3,813,287.80                  | -989,516.67   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0367                        | -0.0372       |
| 4.期末基金资产净值     | 96,597,623.09                  | 25,152,577.99 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9869                         | 0.9734        |

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 | -3.59% | 0.29%     | 0.00%      | 0.13%         | -3.59% | 0.16% |

|            |        |       |       |       |         |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 过去六个月      | -6.06% | 0.31% | 0.65% | 0.12% | -6.71%  | 0.19% |
| 过去一年       | -7.55% | 0.34% | 2.49% | 0.14% | -10.04% | 0.20% |
| 过去三年       | -4.66% | 0.26% | 8.51% | 0.17% | -13.17% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.31% | 0.25% | 9.82% | 0.17% | -11.13% | 0.08% |

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      | -3.68% | 0.29%     | 0.00%      | 0.13%         | -3.68%  | 0.16% |
| 过去六个月      | -6.25% | 0.31%     | 0.65%      | 0.12%         | -6.90%  | 0.19% |
| 过去一年       | -7.92% | 0.34%     | 2.49%      | 0.14%         | -10.41% | 0.20% |
| 过去三年       | -5.80% | 0.26%     | 8.51%      | 0.17%         | -14.31% | 0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.66% | 0.25%     | 9.82%      | 0.17%         | -12.48% | 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-2023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<br>经理期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|------------------------------|-----------------|----------|----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                              | 任职<br>日期        | 离任<br>日期 |                |                                                                                                                                                                                                                      |
| 仇秉则 | 固定收益投资部副<br>总经理、本基金的基<br>金经理 | 2020-<br>04-21  | -        | 17年            | 仇秉则先生，CFA，CPA，<br>中山大学经济学学士，17年<br>证券、基金行业从业经验。<br>曾任普华永道中天会计师<br>事务所审计经理，嘉实基金<br>管理有限公司固定收益部<br>高级信用分析师。2016年6<br>月加入汇安基金管理有限<br>责任公司，担任固定收益研<br>究部总经理一职，从事信用<br>债投资研究工作。2016年1<br>2月2日至2019年10月11日，<br>任汇安嘉汇纯债债券型证 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>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</p> |
|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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；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；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；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。</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《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

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，美联储加息节奏有所放缓，但市场担忧加息将持续更长时间，10年美债利率创下2007年以来新高。国内方面，市场风险偏好的降低带动长债收益率下行。8月PMI及工业企业利润好转，CPI及PPI在消费缓慢复苏及商品价格上涨的带动下见底，基本面修复初现，长债收益率持续上行。由于地方专项债在8-9月集中发行，资金利率中枢系统性上移，带动短端利率大幅上行，并在一定程度上导致收益率曲线整体上移。

权益市场方面，报告期内迎来政策密集期，超预期降息、降低存量房贷、降低印花税、认房不认贷等一系列有力措施出台，对于地产和资本市场的支持力度不断加大。但由于市场此前预期较强，在政策兑现后走出利好落地后的下跌，对于政策落地效果不确定性的担忧，使得风险偏好未持续提升。

展望后市，流动性方面，10月专项债使用可能加快，跨季后恰逢大量逆回购到期，特殊再融资债加速发行，资金面存在不确定性。美国经济韧性超出市场预期，我国出口有望得到支撑，商品带动下的价格指数有望继续企稳回升。常规的地产拉动对经济的贡献在不断减弱，地产销售分化较为明显，M1增速依旧较低，经济复苏的方向确定但斜率或低于预期，进一步稳增长的政策有望出台。宏观经济与资本市场在探明底部后可次第回升，居民信心和风险偏好得到修复，从而带动权益市场的表现。

#### 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0.9869元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.59%，同期业绩比较基准收益率为0.00%；截至报告期末汇安嘉利混合C基金份额净值为0.9734元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.68%，同期业绩比较基准收益率为0.00%。

#### 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<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 25,945,707.19  | 19.26            |
|    | 其中：股票             | 25,945,707.19  | 19.26            |
| 2  | 基金投资              | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 106,287,525.38 | 78.90            |
|    | 其中：债券             | 106,287,525.38 | 78.90            |
|    | 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          | -              | -                |
|    | 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      | 2,400,700.83   | 1.78             |
| 8  | 其他资产              | 70,466.49      | 0.05             |
| 9  | 合计                | 134,704,399.89 | 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              | 2,334,956.00  | 1.92  |
| C | 制造业              | 19,794,545.19 | 16.26 |
| 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           | -             | -     |
| 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  | 2,002,030.00  | 1.64  |
| J | 金融业              | -             | -     |
| K | 房地产业             | 1,814,176.00  | 1.49  |
| 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               | 25,945,707.19 | 21.31 |

### 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  | 600048 | 保利发展 | 142,400 | 1,814,176.00 | 1.49         |
| 2  | 601899 | 紫金矿业 | 132,800 | 1,610,864.00 | 1.32         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 8,300   | 1,295,630.00 | 1.06         |
| 4  | 688072 | 拓荆科技 | 5,119   | 1,219,396.99 | 1.00         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 5  | 600941 | 中国移动 | 12,500 | 1,210,250.00 | 0.99 |
| 6  | 603816 | 顾家家居 | 29,200 | 1,182,308.00 | 0.97 |
| 7  | 603833 | 欧派家居 | 12,300 | 1,179,447.00 | 0.97 |
| 8  | 000661 | 长春高新 | 7,900  | 1,098,100.00 | 0.90 |
| 9  | 600612 | 老凤祥  | 15,702 | 1,011,208.80 | 0.83 |
| 10 | 603658 | 安图生物 | 21,600 | 987,768.00   | 0.81 |

#### 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      | 59,648,035.90  | 48.99        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 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） | 46,639,489.48  | 38.31        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 106,287,525.38 | 87.30        |

#### 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  | 019696 | 23国债03 | 220,000 | 22,386,464.66 | 18.39        |
| 2  | 019704 | 23国债11 | 220,000 | 22,179,495.89 | 18.22        |
| 3  | 019709 | 23国债16 | 100,000 | 9,991,739.73  | 8.21         |
| 4  | 113044 | 大秦转债   | 45,000  | 5,298,201.37  | 4.35         |
| 5  | 019693 | 22国债28 | 50,000  | 5,090,335.62  | 4.18         |

#### 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，广东嘉元科技股份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 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   | 70,115.53 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 4 | 应收利息  | -         |
| 5 | 应收申购款 | 350.96    |
| 6 | 其他应收款 | -         |
| 7 | 其他    | -         |
| 8 | 合计    | 70,466.49 |

#### 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  | 113044 | 大秦转债   | 5,298,201.37 | 4.35         |
| 2  | 113065 | 齐鲁转债   | 4,114,165.48 | 3.38         |
| 3  | 127076 | 中宠转2   | 3,212,249.52 | 2.64         |
| 4  | 118000 | 嘉元转债   | 3,145,085.03 | 2.58         |
| 5  | 113641 | 华友转债   | 2,597,128.62 | 2.13         |
| 6  | 118015 | 芯海转债   | 2,553,918.78 | 2.10         |
| 7  | 113666 | 爱玛转债   | 2,201,150.78 | 1.81         |
| 8  | 113623 | 凤21转债  | 2,174,325.01 | 1.79         |
| 9  | 113636 | 甬金转债   | 2,020,595.50 | 1.66         |
| 10 | 113060 | 浙22转债  | 1,876,283.42 | 1.54         |
| 11 | 110093 | 神马转债   | 1,763,358.49 | 1.45         |
| 12 | 127056 | 中特转债   | 1,610,961.00 | 1.32         |
| 13 | 127066 | 科利转债   | 1,482,530.49 | 1.22         |
| 14 | 132026 | G三峡EB2 | 1,456,347.62 | 1.20         |
| 15 | 113632 | 鹤21转债  | 1,384,418.89 | 1.14         |
| 16 | 123179 | 立高转债   | 1,383,635.06 | 1.14         |
| 17 | 113638 | 台21转债  | 1,145,624.66 | 0.94         |
| 18 | 127077 | 华宏转债   | 1,122,992.33 | 0.92         |
| 19 | 113655 | 欧22转债  | 1,018,405.96 | 0.84         |
| 20 | 127043 | 川恒转债   | 989,080.08   | 0.81         |

#### 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                   | 110,744,998.90 | 27,136,902.20 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 64,420.43      | 43,800.59     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 12,929,062.95  | 1,340,194.42  |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -              | -             |
| 报告期期末基金份额总额                   | 97,880,356.38  | 25,840,508.37 |

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

2023年10月25日