

华宝安盈混合型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华宝安盈混合 |
| 基金主代码 | 010868 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 6 月 8 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 343,012,702.09 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。 |
| 投资策略 | 本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*18%+中证综合债指数收益率*80%+恒生指数收益率*2% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，还可能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 | 华宝基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 2,557,664.71 |
| 2. 本期利润 | -3,159,308.59 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0085 |
| 4. 期末基金资产净值 | 344,343,605.60 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0039 |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于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

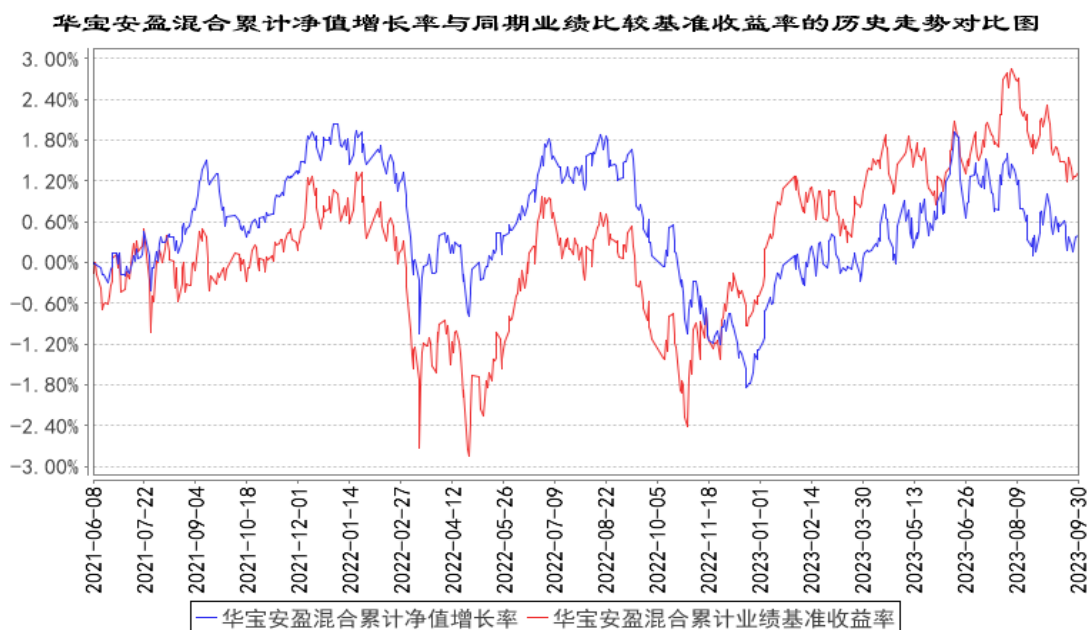
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -0.86% | 0.19% | -0.26% | 0.17% | -0.60% | 0.02% |
| 过去六个月 | 0.26% | 0.21% | 0.19% | 0.17% | 0.07% | 0.04% |
| 过去一年 | 0.29% | 0.19% | 2.48% | 0.19% | -2.19% | 0.00% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同 生效起至今 | 0.39% | 0.17% | 1.32% | 0.22% | -0.93% | -0.05% |

注：（1）基金业绩基准：沪深 300 指数收益率*18%+中证综合债指数收益率*80%+恒生指数收益率*2%；

（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2021 年 12 月 08 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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 | | |
| 曾健飞 | 本基金基金经理 | 2023-03-04 | - | 9 年 | 硕士。曾任前海开源基金管理有限公司研究员、基金经理，2022 年 8 月加入华宝基金管理有限公司任高级产品经理。2023 年 3 月起任华宝安盈混合型证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金基金经理。 |

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《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

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝安盈混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 3 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度以来部分数据显示经济边际修复，8 月规模以上工业企业利润向好同比上行 17.2%，新增社融 3.12 万亿元总量超预期；制造业 PMI 逐月好转，9 月升至荣枯线以上。而受全球经济下行压力，出口略有下滑。

政策方面：8 月央行再次调降 OMO 和 MLF 利率。受益于财政政策发力，8 月以来财政力度明显加强，8 月财政支出环比+11.4%。多地持续跟进地产需求侧放松政策，一线城市陆续放开“认房不认贷”，部分城市放松限购，以促进购房需求恢复。

三季度权益市场震荡下行，沪深 300 指数下跌 3.98%。债市在降息后收益率下行，而在政策出台后上行，总体 10 年期国债收益率曲线收益率从上季末的 2.635%上行 4 个基点至 2.675%。受

股债综合影响，转债调整，中证转债指数跌 0.52%。

本基金优化持仓结构，债券部分适当通过利率债波段操作增厚收益，力争在控制回撤的前提下提供稳健的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-0.86%，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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或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 | 61,481,856.60 | 17.63 |
| | 其中：股票 | 61,481,856.60 | 17.63 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 210,561,477.32 | 60.37 |
| | 其中：债券 | 210,561,477.32 | 60.37 |
| | 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 | 50,025,438.23 | 14.34 |
| | 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 | 26,597,834.57 | 7.63 |
| 8 | 其他资产 | 98,119.69 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 348,764,726.41 | 100.00 |

注：1、通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 7,388,866.88 元，占基金资产净值的比例为 2.15%。

2、本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

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 | 11,021,521.00 | 3.20 |
| C | 制造业 | 27,496,225.72 | 7.99 |
| 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 | 4,620,654.00 | 1.34 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,022,774.00 | 2.04 |
| J | 金融业 | 2,962,874.00 | 0.86 |
| K | 房地产业 | 968,941.00 | 0.28 |
| 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 | 54,092,989.72 | 15.71 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|--------------|--------------|
| 通讯 | 2,191,630.79 | 0.64 |
| 科技 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 非必须消费品 | 634,541.15 | 0.18 |
| 必须消费品 | 1,174,382.87 | 0.34 |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 医疗保健 | 1,754,967.38 | 0.51 |
| 工业 | - | - |
| 材料 | 1,633,344.69 | 0.47 |
| 合计 | 7,388,866.88 | 2.15 |

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 159,000 | 3,361,260.00 | 0.98 |
| 2 | 603979 | 金诚信 | 88,800 | 3,291,816.00 | 0.96 |
| 3 | 000060 | 中金岭南 | 605,000 | 3,109,700.00 | 0.90 |
| 4 | 601006 | 大秦铁路 | 408,700 | 2,979,423.00 | 0.87 |
| 5 | 300705 | 九典制药 | 112,100 | 2,650,044.00 | 0.77 |
| 6 | 601168 | 西部矿业 | 197,200 | 2,534,020.00 | 0.74 |
| 7 | 002049 | 紫光国微 | 27,000 | 2,354,400.00 | 0.68 |
| 8 | 00700 | 腾讯控股 | 7,800 | 2,191,630.79 | 0.64 |
| 9 | 601456 | 国联证券 | 201,000 | 2,130,600.00 | 0.62 |
| 10 | 002555 | 三七互娱 | 93,900 | 2,037,630.00 | 0.59 |

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 | 31,584,893.44 | 9.17 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 121,594,819.20 | 35.31 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,330,191.78 | 5.90 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 20,114,754.10 | 5.84 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 37,267,010.58 | 10.82 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 210,561,477.32 | 61.15 |

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 | 230009 | 23 附息国债 09 | 300,000 | 31,584,893.44 | 9.17 |
| 2 | 188119 | 21 浙商 01 | 300,000 | 30,450,797.26 | 8.84 |
| 3 | 188418 | 21 兴业 03 | 300,000 | 30,269,123.84 | 8.79 |
| 4 | 2128013 | 21 交通银行小微债 | 200,000 | 20,419,595.63 | 5.93 |
| 5 | 220308 | 22 进出 08 | 200,000 | 20,330,191.78 | 5.90 |

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

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

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

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

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是否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

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司因：“一是多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标，违背了公平公正原则，并影响了发行利率，对市场正常秩序造成了一定不良影响。二是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成，发行工作程序执行不到位、工作开展不规范。”；于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会警告，责令改正的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司因：一是多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标，违背了公平公正原则并影响了发行利率，对市场正常秩序造成了一定不良影响。二是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成，发行工作程序执行不到位、

工作开展不规范。；于 2023 年 01 月 18 日收到中国银行间市场交易商协会警告, 责令改正的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 浙商证券股份有限公司因发布 80 亿元定增预案, 募集资金净额将用于增加公司资本金、补充营运资金及偿还债务; 于 2023 年 01 月 19 日收到上海证券交易所监管工作函的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 广汇汽车服务集团股份有限公司因业绩预测结果不准确或不及时; 于 2023 年 01 月 30 日收到上海证券交易所监管工作函的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务, 未按规定保存客户身份资料和交易记录, 未按规定报送大额交易或者可疑交易报告; 于 2023 年 02 月 06 日收到中国人民银行罚款的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因定期报告披露超期限, 未履行信披义务, 内部制度不完善; 于 2023 年 04 月 04 日收到西藏证监局警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因: “经查, 我局发现你公司在 2023 年 6 月 19 日的网络安全事件中, 存在机房基础设施建设安全性不足, 信息系统设备可靠性管理疏漏等问题。上述行为违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》(证监会令第 218 号, 以下简称《网络和信息安全管理办法》) 第十三条相关规定。”; 于 2023 年 07 月 07 日收到深圳证监局警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 海通证券股份有限公司因信息披露不合格; 于 2023 年 07 月 15 日收到上海证券交易所监管工作函的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 浙商证券股份有限公司因违规经营; 于 2023 年 07 月 28 日收到浙江证监局警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 兴业证券股份有限公司因违规经营, 内部制度不完善; 于 2023 年 08 月 03 日收到福建证监局警示的处罚措施。

华宝安盈混合截止 2023 年 09 月 30 日持仓前十名证券的发行主体中, 中信证券股份有限公司因内部制度不完善; 于 2023 年 09 月 22 日收到证监会监管谈话、谈话提醒的处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析, 认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响, 因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内, 本基金投资的前十名证券的其余的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公

开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未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 | 82,247.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | 15,573.06 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 299.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 98,119.69 |

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 | 128108 | 蓝帆转债 | 5,339,199.61 | 1.55 |
| 2 | 110072 | 广汇转债 | 5,174,106.16 | 1.50 |
| 3 | 123128 | 首华转债 | 4,039,157.84 | 1.17 |
| 4 | 113532 | 海环转债 | 3,649,816.65 | 1.06 |
| 5 | 123104 | 卫宁转债 | 3,070,336.44 | 0.89 |
| 6 | 123056 | 雪榕转债 | 2,888,742.47 | 0.84 |
| 7 | 118004 | 博瑞转债 | 2,620,531.51 | 0.76 |
| 8 | 123113 | 仙乐转债 | 2,390,464.13 | 0.69 |
| 9 | 118005 | 天奈转债 | 2,371,775.75 | 0.69 |
| 10 | 118025 | 奕瑞转债 | 2,355,398.36 | 0.68 |
| 11 | 113044 | 大秦转债 | 2,119,280.55 | 0.62 |
| 12 | 128017 | 金禾转债 | 716,721.27 | 0.21 |
| 13 | 123064 | 万孚转债 | 15,485.21 | 0.00 |

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，合计数可能不等于分项之和。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 417,231,509.30 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 110,147.10 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 74,328,954.31 |
| 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 | 343,012,702.09 |

§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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2023 年 08 月 26 日发布华宝基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告，具体内容详见公司公告，请投资者予以关注。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
 华宝安盈混合型证券投资基金基金合同；
 华宝安盈混合型证券投资基金招募说明书；
 华宝安盈混合型证券投资基金托管协议；
 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
 基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
 基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人住所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日