

华安证券安赢套利1号 周开债券型集合资产管理计划 2019年年度报告

计划管理人：华安证券股份有限公司

计划托管人：交通银行股份有限公司

报告期间：2019年1月1日至2019年12月31日

目 录

一、集合资产管理计划简介.....	- 2 -
(一) 基本资料.....	- 2 -
(二) 管理人.....	- 2 -
(三) 托管人.....	- 2 -
(四) 会计师事务所简介.....	- 3 -
二、主要财务指标.....	- 3 -
(一) 主要财务指标.....	- 3 -
(二) 财务指标计算公式.....	- 4 -
(三) 集合计划累计净值历史走势图(20130516-20191231)	- 4 -
三、集合计划管理人报告.....	- 4 -
(一) 业绩表现.....	- 4 -
(二) 投资主办简介.....	- 4 -
(三) 投资主办工作报告.....	- 5 -
(四) 风险控制报告.....	- 6 -
四、集合计划财务报告.....	- 7 -
(一) 集合计划会计报表.....	- 7 -
(二) 会计报表附注.....	- 10 -
五、集合计划投资组合报告(2019年12月31日)	- 17 -
(一) 资产组合情况.....	- 17 -
(二) 集合计划份额变动.....	- 18 -
六、重要事项提示.....	- 18 -
七、备查文件目录.....	- 19 -
(一) 本集合计划备查文件目录.....	- 19 -
(二) 存放地点及查阅方式.....	- 19 -

重要提示

本报告依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关规定制作。

中国证监会对本集合计划出具了批准文件（《关于核准华安证券有限责任公司设立华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划的批复》证监许可[2013]651号），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2019年1月1日—2019年12月31日

一、集合资产管理计划简介

（一）基本资料

产品名称：华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划

产品类型：限额特定集合资产管理计划

集合计划管理人：华安证券股份有限公司

集合计划托管人：交通银行股份有限公司

成立日期：2013年5月16日

成立规模：70,915,669份

存续期：无固定期限

（二）管理人

名称：华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：章宏韬

成立时间：2001年1月8日

注册资本：人民币36.21亿元

经营期限：持续经营

电话：（0551）65161666

传真：（0551）65161600

（三）托管人

名称：交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：彭纯

企业类型：股份有限公司（上市）

经营期限：持续经营

电话：021-58766688

传真：021-58798398

（四）会计师事务所简介

单位名称：容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

地址：中国北京市西城区阜成门外大街22号外经贸大厦920-926

法定代表人：肖厚发

经办注册会计师：褚诗炜、鲍灵姬、洪雁南

联系电话：0551-63475800

传真：0551-62652879

二、主要财务指标

（一）主要财务指标

期初日期：2019-01-01

期末日期：2019-12-31

主要财务指标	本期间
本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	617,341.16
本期利润	858,656.63
其中：本期公允价值变动损益	241,315.47
加权平均份额本期利润	0.1359
加权平均净值利润率	12.4680%
本期单位净值增长率	12.1265%
期末可分配利润	274,146.26
期末可供分配份额利润	0.0025
期末资产净值	111,806,409.53
期末单位资产净值	1.0025
单位累计净值增长率	72.6271%

（二）财务指标计算公式

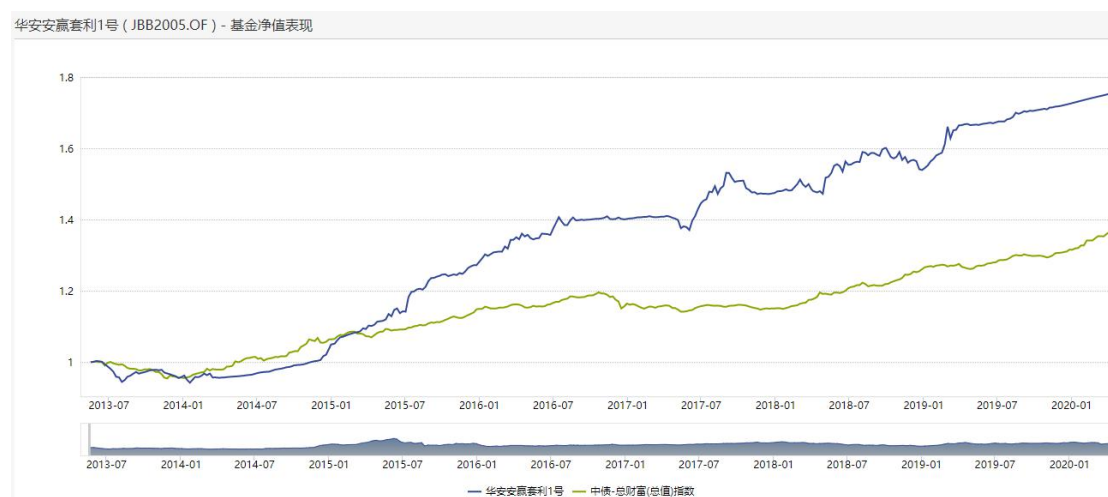
1、本期单位集合计划净收益=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额÷集合计划份额

2、单位集合计划净值=集合计划净值÷集合计划份额

3、本期集合计划净值增长率=[期末单位净值/(分红除权前单位净值-单位分红金额)*分红除权前单位净值/期初单位净值-1]*100%

4、集合计划累计净值增长率=(单位集合计划资产累计净值-1)*100%

（三）集合计划累计净值历史走势图（20130516-20191231）



三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

截至2019年12月31日，集合计划单位净值为1.0025元，本期净值增长率为12.1265%，累计净值增长率为72.6271%。

（二）投资主办简介

曲少伦，男，工商管理硕士。从事证券投资研究工作经历20年。先后在证券公司，保险公司，公募基金等机构从事固定收益的投资管理工作，擅长大类资

产配置，有较强的投资管理能力和风险控制意识。

（三）投资主办工作报告

1、2019年投资回顾

2019年度各项经济指标基本稳定，工业生产总体稳中有升，第三产业和高技术产业投资增速较快，就业形势总体稳定。10月经济数据延续了供需双弱的格局，其中消费同比增速显著下滑，意味着经济下行压力进一步加大。若消费疲弱的情况在11月得到验证，则四季度的GDP增长将受到拖累，逆周期调节客观上存在加码的必要。由于“猪通胀”仍在发酵，在11月5日央行下调MLF操作利率5bp之后，短期内货币政策进一步放松的概率较低，财政政策和消费支持政策的重要性上升，将成为逆周期调节的主要发力点。

2019年以来，上证综指涨幅逾22%，一季度大幅上涨后，二季度开始回调，随着科创板开市，中美贸易摩擦趋于平缓，5G产业链公司半年报业绩超预期，带动一轮科技板块的结构性行情，大盘企稳触底反弹缓慢上涨。国内经济同样在一季度短暂冲高之后再度面临严峻的下行压力，央行适时发布全面降准和定向降准，地方专项债发行加速，逆周期调节抵御风险。政策对冲将成为维稳经济、构筑市场底部的重要力量。在内外宏观环境有所恶化的近况之下，货币、财政政策的对冲力度都有显著加强，未来也有较为充足的工具包，关键还要看细分政策的落地，和政策实施的效果。

信用债发行规模上升，市场风险偏好趋紧，国有企业发行总量远远高于民营企业。从发行主体评级来看，近年来发行评级AAA与AA+占比较之前有了显著提高；2019年以来产业债发行的行业集中于公用事业、综合、采掘、非银以及房地产行业，中小银行的信用供给收缩，大银行与小银行之间流动性出现了分化。

货币政策方面，央行行长易纲表示，健全货币政策和宏观审慎政策双支柱调控框架，把保持币值稳定和维护金融稳定更好地结合起来。中国人民银行将坚持服务实体经济，防范金融风险，着力为供给侧结构性改革和高质量发展营造适宜的货币金融环境。一是总量适度，在经济由高速增长转向高质量发展过程中，把握好总量政策的取向和力度，实施好逆周期调节，保持流动性合理充裕，松紧适度，继续营造适宜的货币环境。易纲强调，中国经济增速仍处于合理区间，通货

通胀整体上也保持在较温和水平，加之我们有社会主义市场经济的制度优势，应尽量长时间保持正常的货币政策。即使世界主要经济体的货币政策向零利率方向趋近，我们也应坚持稳中求进、精准发力，不搞竞争性的零利率或量化宽松政策，始终坚守好货币政策维护币值稳定和保护最广大人民群众福祉的初心使命。同时，应主动作为，继续坚持以供给侧结构性改革为主线，不断健全金融宏观调控机制，更加重视发挥积极财政政策在优化结构、减税降费方面的重要作用，形成供给体系、需求体系和金融体系相互支撑的三角框架，保持中国经济平稳健康发展的好态势。我们判断国内经济的自身动力正在减弱，如果没有新的政策措施出台，经济下行压力仍然较大，资金面目前相对宽松，通胀水平在猪价开始下行后，整体处于可控范围，整体环境对债券市场仍然有利，虽然近期部分经济数据有改善迹象，但我们对债市仍谨慎乐观。

2、投资管理展望

今后产品投资上应着重做好以下几点：

（一）本产品每两周开放一次，主要策略以流动性管理为主，在保持产品流动性的前提下，关注投资范围内各品种的交易机会，增加本产品策略的丰富性，获得稳定的投资收益。

（二）鉴于全球货币政策宽松、国内经济内生增长动力不足以支撑较高的经济增速，整体上利好债券市场；但我们也注意到通胀、多地房地产政策的微调和一些突发事件对市场造成扰动。债券配置选择上，严格控制组合久期，适当配置短久期信用债。

（三）把握可转债市场出现的波段机会，重点关注网下一级申购、条款修正等低风险投资机会；选择久期合适、转债绝对价格相对较低、转股溢价相对较低、正股上涨潜力较大的转债进行少量配置，控制好仓位比例，同时做好净值回撤，获取投资收益。

（四）风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及

其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的风险控制部门和业务部门内设的风险控制岗位，加强对集合资产管理业务风险的事前分析、事中监控和事后评估，并提出风险控制措施。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和合规与风险管理部日常监控、重点检查的结果。

本集合计划管理人的风险控制工作主要通过资产管理业务部门内控和风险管理部外部监控来进行。为加强资产管理业务的风险管理，集合计划管理人资产管理部作为资产管理业务的执行部门，全面负责资产管理业务的内部风险控制管理。风险管理部作为公司层面的风险控制部门，严格按照中国证监会资产管理业务风险监管标准，以及公司相关制度和《华安理财安赢套利1号限额特定集合资产管理计划资产管理合同》的规定，对华安理财安赢套利1号开展风险管理工作，采用逐日监控、绩效评估以及定期与不定期检查等多种方法对集合计划的管理运作进行风险控制，定期对业务授权、投资交易及合规性进行了全面细致的审查。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

四、集合计划财务报告

（一）集合计划会计报表

1、集合计划资产负债表（2019年12月31日）

日期：2019-12-31

单位：人民币元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
资 产：		负 债：	
银行存款	18,916,698.33	短期借款	0.00
结算备付金	0.00	交易性金融负债	0.00
存出保证金	572.29	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	5.33	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	0.00	应付赎回款	12,169,445.21
基金投资	5.33	应付管理人报酬	17,648.44
权证投资	0.00	应付托管费	8,416.02
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	0.00
买入返售金融资产	104,995,000.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	0.00	应付利息	0.00
应收利息	102,643.25	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	13,000.00
应收申购款	0.00	负债合计	12,208,509.67
其他资产	0.00		
		所有者权益：	
		实收基金	111,532,263.27
		未分配利润	274,146.26
		所有者权益合计	111,806,409.53
资产合计	124,014,919.20	负债和所有者权益总计	124,014,919.20

2、集合计划经营业绩表（2019年1月1日至2019年12月31日）

单位：人民币元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	883,704.77	337,782.09
2	1、利息收入	238,031.98	9,218.56
3	其中：存款利息收入	4,913.17	3,559.80
4	债券利息收入	313.30	0.00
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	232,805.51	5,658.76
7	2、投资收益	404,357.32	575,065.64
8	其中：股票投资收益	63,397.00	0.00

9	债券投资收益	30,609.32	0.00
10	基金投资收益	289,877.37	496,498.72
11	权证投资收益	0.00	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
13	衍生工具收益	0.00	0.00
14	股利收益	20,473.63	78,566.92
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	3、公允价值变动收益	241,315.47	-250,402.81
17	4、其他收入	0.00	3,900.70
18	二、费用	25,048.14	54,502.52
19	1、管理人报酬	0.00	17,535.18
20	2、托管费	17,509.19	16,749.74
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	3,693.70	4,808.88
23	5、利息支出	0.00	0.00
24	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
25	6、其他费用	3,845.25	15,408.72
26	三、利润总和	858,656.63	283,279.57

3、集合计划净值变动表

项目	2019年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益
一、期初所有者权益（基金净值）	6,194,342.34	740,798.17	6,935,140.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期净利润）	0.00	858,656.63	858,656.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （减少以“-”号填列）	105,337,920.93	-676,990.26	104,660,930.67
其中：1. 基金申购款	173,294,935.80	505,075.36	173,800,011.16
2. 基金赎回款	-67,957,014.87	-1,182,065.62	-69,139,080.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	0.00	-648,318.28	-648,318.28

金净值变动数			
五、期末所有者权益（基金净值）	111,532,263.27	274,146.26	111,806,409.53

（二）会计报表附注

一、集合计划概况

华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是由华安证券股份有限公司（以下简称“华安证券”）作为计划管理人，交通银行股份有限公司作为计划托管人的限额特定集合资产管理计划。本集合计划推广期最低发行规模为1000万份，存续期无规模上限，本集合计划投资者数量为2人（含）以上200人（含）以下。管理人有权根据实际情况调整推广期的目标规模，并由管理人在管理人指定网站公告。本集合计划管理期限为自产品变更之日起【5】年，期满可展期。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本集合计划投资固定收益类资产（包括存款、债券）比例不低于资产总值的80%。

本计划采用非公开方式推广和募集。管理人应将资产管理合同、说明书等正式推广文件，以纸质资料或电子材料方式置备于推广机构营业场所。推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。管理人及推广机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电

话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体推广本集合计划。

二、集合计划采用的估值和会计核算

1、执行的会计准则和会计制度

本集合计划执行企业会计准则，同时参照《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的集合资产管理业务实务操作的有关规定编制。

2、会计年度

自公历1月1日起至12月31日止。

3、记账本位币

以人民币为记账本位币。

4、计划资产的估值原则

估值应符合本合同《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券投资基金业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

A. 投资固定收益品种的估值方法

(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(2) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，按估值日交易所收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种

的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 银行间债券、同业存单的估值采用第三方估值机构提供的价格数据确定公允价值。

(5) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。对在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的，按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券和私募债品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。若第三方估值机构无估值数据，且估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(6) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1)－(5)小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1)－(5)小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

B. 投资证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）、创新型分级基金等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(2) 持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值未公布

的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

(3) 持有的货币市场基金及理财债券基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日或节假日的每万份收益计提红利；

(4) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

(5) 如证券投资基金披露的净值未扣减业绩报酬，不能反映该金融产品的公允价值，管理人可根据该金融产品合同的具体情况，进行净值调整，按最能反映该金融产品公允价值进行估值。

C. 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

D. 债券回购以协议成本列示，按协议商定利率在实际持有期内逐日计提利息收入。

E. 如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

5、估值程序：

集合计划的日常估值由管理人进行，托管人复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果加盖业务章后电子邮件发送或传真至托管人，集合计划托管人进行复核，托管人复核无误后盖章返回给管理人。当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给集合计划财产或投资者造成损失的，由管理人承担责任，托管人不承担责任。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误、遗漏或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

6、证券投资成本计价方法

按移动加权平均法计算库存证券的成本。

A、证券

证券投资买入于成交日确认为证券投资。证券投资成本按成交的价款金额入账。卖出证券于成交日确认证券差价收入。出售证券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

B、买入返售证券

买入返售证券成本，按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

7、收入的确认和计量

(1) 利息收入

在相关的收入能够可靠计量，相关的经济利益能够收到时，按资金使用时间和约定的利率确认利息收入。

存款利息收入逐日计提，并按本金与适用的利率计提的金额入账。

债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额入账。

买入返售证券收入在证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。

(2) 投资收益

持有交易性金融资产期间取得的红息或现金股利确认为当期收益；处置交易性金融资产时其公允价值与初始入账金额之间的差额，确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

8、费用的确认和计量

A、本集合计划的管理费包括固定管理费以及业绩报酬。

(1) 固定管理费

本集合计划的固定管理费按前一日集合计划的资产净值计提，固定管理费的

年费率为0.5%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div 365$$

H为每日应计提的集合计划固定管理费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人划款指令授权书于次季度首日起5个工作日内自动从集合计划资产中一次性划款。

(2) 业绩报酬

1) 管理人收取业绩报酬的原则：

按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红日（具体以届时的分红公告为准，下同）、投资者退出日和计划终止日计提业绩报酬，提取频率不超过每6个月一次；在计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；在投资者退出和计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额包括一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算。

2) 业绩报酬的计提方法：

本集合计划每笔份额的业绩报酬以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为计划成立日，存续期参与的为申购参与当日，下同）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率R，作为计提业绩报酬的计算基础。年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

业绩报酬计提日为计划分红日、投资者退出日或计划终止日；

R为年化收益率

P1为业绩报酬计提日的份额累计净值；

P0为上一个发生业绩报酬计提日的份额累计净值；

P为上一个发生业绩报酬计提日的份额净值；

N表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数。

如R小于或者等于业绩报酬计提标准，则不计提业绩报酬；如R大于业绩

报酬计提标准，则对超过业绩报酬计提标准部分的60%计提业绩报酬。

具体业绩报酬计算方法如下

年化收益率(R)	提取比例	业绩报酬 (F)
R ≤ 业绩报酬计提基准	0	0
R > 业绩报酬计提基准	60%	$F = A \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times N/365$

注：①F为投资者每笔参与应提取的业绩报酬；

②R为年化收益率；

③A为投资者每笔参与在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

3) 业绩报酬支付：

业绩报酬由管理人向托管人发送业绩报酬划款指令，托管人收到指令后从本集合计划资产中以现金的方式一次性支付给管理人，管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不作复核。

B、本集合计划本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.08%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div 365$$

H为每日应计提的托管费；

E、为前一日集合计划资产净值。

集合计划托管费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人划款指令授权书于次季度首日起5个工作日内自动从集合计划资产中一次性划款。

C、集合计划投资运作期间发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，在收取时从集合计划中扣除。

D、集合计划成立后的会计师费、律师费和信息披露费用，以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由集合计划管理人本着保护委托人利益的原则，按

照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，上述费用分别在发生时扣除。计划推广期发生的会计师费、律师费和信息披露费等相关费用，不得列入计划费用。

E、银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费，分别在发生时一次计入集合计划费用。与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应该在该会计期间内按直线法摊销。

三、税项

本资产管理计划和本合同各方当事人应根据法律法规的规定各自履行纳税义务。本资产管理计划运营过程中发生的应税行为，相应税款由本资产管理计划资产承担，如依据相关法律法规或税务机关的规定，以管理人为纳税人或扣缴义务人的，管理人可以在委托资产中列支。本集合计划暂时无需托管人提供增值税发票，如后续需要提供时，可另行签署补充协议进行约定。本合同履行期间，法律法规发生变更的，按照变更后法律法规执行。

四、其他重要事项

无其他重要事项。

五、资产负债表日后事项

无重大资产负债表日后事项。

五、集合计划投资组合报告（2019年12月31日）

（一）资产组合情况

单位：人民币元

项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	------------------

权益投资	5.33	
其中：股票		
基金	5.33	
固定收益投资		
其中：债券		
资产支持证券		
金融衍生品投资		
买入返售金融资产	104,995,000.00	84.66
其中：买断式回购的买入返售金融资产		
银行存款和结算备付金合计	18,916,698.33	15.25
其他资产	103,215.54	0.08
合计	124,014,919.20	100.00

（二）集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
6,194,342.34	173,294,935.80	-67,957,014.87	111,532,263.27

六、重要事项提示

（一）本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

（二）本报告期内本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生重大变更。

（三）本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

（四）本报告期内本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级

管理人员没有受到任何处罚。

七、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

1. 华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划说明书
2. 华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划资产管理合同
3. 华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划风险揭示书
4. 华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划托管协议
5. 管理人业务资格批件、营业执照

（二）存放地点及查阅方式

查阅地址：安徽省合肥市政务区南二环路959号财智中心B1座601室

网址：<http://www.hazq.com>

信息披露电话：0551-65161552

联系人：于玲玲

投资者对本报告如有疑问，可咨询管理人华安证券股份有限公司资产管理部。

华安证券股份有限公司
二〇二〇年四月二十七日