

华安证券恒赢 36 号集合资产管理计划

2022 年第一季度资产管理报告

第一节 管理人履职报告

本报告期内，本计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、其他相关法律法规以及本计划说明书和合同的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，不存在违法违规、未履行承诺或损害本计划委托人利益的情形，但不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。

本报告期内，管理人通过独立的风险控制部门和业务部门内设的合规和风控岗位，加强对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。本次履职报告综合了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。

本管理人为加强资产管理业务的风险管理，管理人资产管理总部作为资产管理业务的执行部门，负责资产管理业务的内部风险控制管理。法律合规部和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合同的规定，开展风险管理工作，采用定期与不定期检查等多种方法对资产管理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，本管理人对本计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度的要求进行。本计划的投资决策、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。本报告中的内容由管理人负责解释。

第二节 托管人履职报告

本计划托管人根据资产管理合同，在托管本资产管理计划的过程中，严格遵守各项法规规定，对本计划管理人华安证券股份有限公司2022年01月01日至2022年03月31日对本计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害计划份额持有人利益的行为。本报告信息披露符合相关法规的规定。

第三节 资产管理计划概况

一、基本资料

本计划名称	华安证券恒赢36号集合资产管理计划
成立日期	2021年03月17日
本计划管理人	华安证券股份有限公司
本计划托管人	浙商银行股份有限公司
本报告起止时间	2022年01月01日起至2022年03月31日止。

二、管理人

法定名称：华安证券股份有限公司

办公地址：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

电话：0551-65161962

信息披露人：徐玉红

三、托管人

名称：浙商银行股份有限公司

办公地址：杭州市拱墅区延安路在地图中查看368号

法定代表人：张荣森（代为履行法定代表人职责）

电话：0571-87659806

信息披露人：朱巍

第四节 资产管理计划投资表现

单位：人民币元

主要财务指标	本报告期间
本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	1,243,473.75
本期利润	1,019,432.03
其中：本期公允价值变动损益	-224,041.72
加权平均份额本期利润	0.0139
加权平均净值利润率	1.3077%
本期单位净值增长率	1.3138%
期末可分配利润	365,646.37
期末可供分配份额利润	0.0046
期末资产净值	80,089,676.70
期末单位资产净值	1.0057
单位累计净值增长率	8.3855%

注：所述本计划业绩指标不包括持有人交易本计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

第五节 管理人报告

一、业绩表现

截至2022年03月31日，本计划单位净值1.0057元，累计单位净值1.0837元，本期计划收益率增长1.3138%。

二、投资经理简介

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。

操晓清，男，金融学硕士，证券从业经验12年，历任交易员、研究员、投资经理，具有较强的行业公司研究基础，投资风格稳健，有较强的投资管理能力和风险控制意识。

三、投资经理工作报告

第六节 投资组合报告

一、投资组合报告

项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
权益投资		
其中：股票		
基金		
固定收益投资	66,561,187.05	81.59
其中：债券	66,561,187.05	81.59
资产支持证券		
金融衍生品投资		
买入返售金融资产	9,002,315.17	11.03
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	6,001,456.85	7.36
其他资产	18,360.04	0.02
合计	81,583,319.11	100.00

二、资产管理计划运用杠杆情况

项目	金额	占资产净值的比例
报告期末回购融资余额	0.00	0.00
其中：买断式回购融资	0.00	0.00
其中：质押式回购融资	0.00	0.00

三、业绩报酬及费用的计提和支付（根据实际情况修改）

项目	报告期间计提金额（元）	报告期间支付金额（元）
管理费	153,822.76	153,728.01
托管费	994,628.23	0.00
业绩报酬	994,628.23	0.00

1、管理费

资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的【0.8】%年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年管理费率为【0.8】%

H为每日应计提的资产管理计划管理费

E为前一日资产管理计划资产净值

2、托管费

资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的【0.05】%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年托管费率为【0.05】%

H为每日应计提的资产管理计划托管费

E为前一日资产管理计划资产净值

3、业绩报酬（如有）

业绩报酬的计提方法：

（1）当计划分红日、投资者退出日或计划终止日时，若持有期年化收益率R小于或等于业绩报酬计提基准，管理人不提取业绩报酬。

（2）当计划分红日、投资者退出日或计划终止日时，若持有期年化收益率R大于业绩报酬计提基准，管理人提取超出部分的一定比例作为业绩报酬，具体计算方法见下文“（4）管理人以超额比例的方式提取业绩报酬”。

（3）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，募集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）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的年化收益率。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。

（4）管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

具体计算方法如下：

年化收益率(R)	提取比例	业绩报酬 (F)
$R \leq r$	0	0
$r < R$	55%	$F = A \times (R - r) \times 55\% \times N / 365$

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，r为业绩报酬计提基准；

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。

④业绩报酬计提基准仅作为管理人提取业绩报酬的计算标准，不代表对资产管理计划未来收益的承诺或保证。管理人不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

第七节 资产管理计划份额变动

一、本计划份额变动情况

单位：份

	期初份额	认/申购份额	赎回份额	期末份额
变动情况	72,664,447.85	29,670,515.71	22,698,321.99	79,636,641.57

二、管理人关联人员及自有资金的持有情况

单位：份

	持有计划份额
管理人董事、监事、从业人员及其配偶参与本计划的情况	1605710.72
控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的情况	
管理人自有资金参与本计划的情况	

第八节 资产管理计划投资收益分配情况

本产品在本报告期内投资收益分配：单位份额分配0.078元，合计分配金额5,667,827.19元。

第九节 重要事项提示

本报告期涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

- 1、本报告期内本资产管理计划投资经理没有发生变更。
- 2、本报告期内本资产管理计划未发生重大关联交易。
- 3、本计划管理人在本报告期内没有发生与本计划相关的诉讼事项。

4、本计划管理人办公地址未发生变更。

第十节 备查文件目录

一、本计划备查文件目录

- 1、华安证券恒赢36号集合资产管理计划说明书
- 2、华安证券恒赢36号集合资产管理计划资产管理合同
- 3、华安证券恒赢36号集合资产管理计划风险揭示书
- 4、华安证券恒赢36号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：0551-65161962

联系人：徐玉红

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总部。

华安证券股份有限公司

2022年04月28日

