

---

华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划  
2023年

第2季度报告

2023年06月30日

资产管理人:华安证券股份有限公司

资产托管人:交通银行股份有限公司

## §1 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。

本报告由管理人华安证券股份有限公司资产管理部编制，报告书中的内容由管理人华安证券资产管理部负责解释。

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。

本报告期自2023年04月01日起至2023年06月30日止。

## §2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	华安安赢套利1号
资产管理计划编码	BB2005
资产管理计划合同生效日	2013年05月16日
报告期末资产管理计划份额总额	262,605,193.34份
资产管理计划合同存续期	不定期
资产管理人	华安证券股份有限公司
资产托管人	交通银行股份有限公司

## §3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

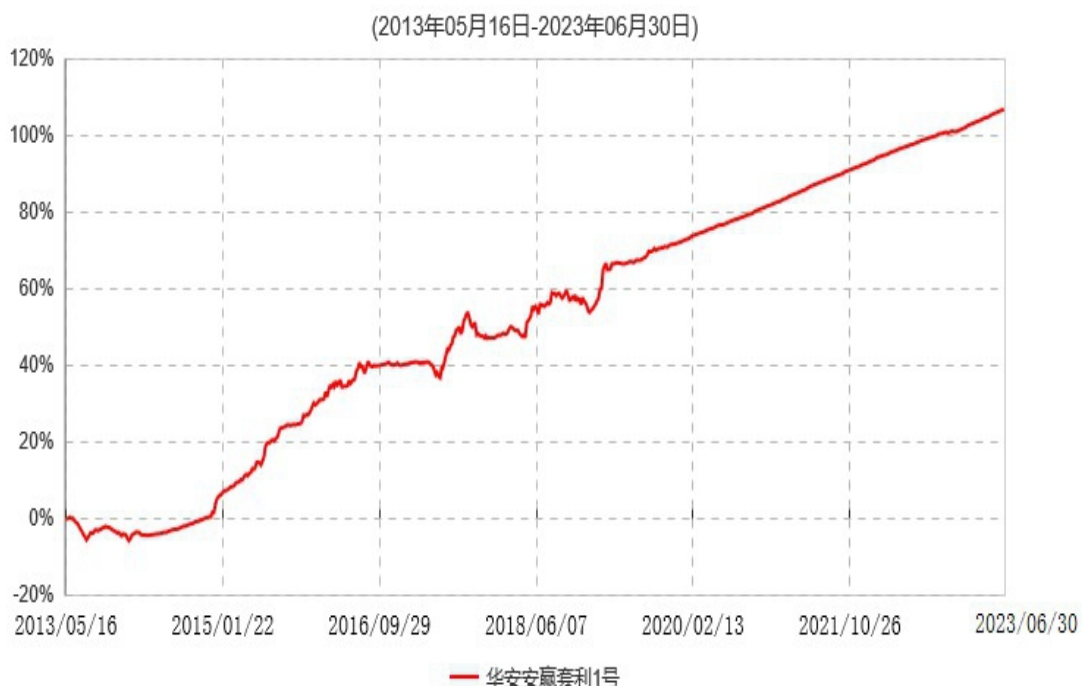
### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年04月01日 - 2023年06月30日）
本期已实现收益	4,394,104.34
本期利润	5,408,466.09
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0128
期末资产管理计划资产净值	311,297,143.43
期末资产管理计划份额净值	1.1854

### 3.2 自资产管理计划合同生效以来资产管理计划累计净值增长率变动

华安证券安赢套利1号周开债券型集合资产管理计划累计净值增长率走势图



## § 4 管理人报告

### 4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

姓名	职务	任本资产管理计划的投资经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王勤	投资经理	2021-03-31		16	经济学硕士。2007年7月至2020年就职于国元证券，2013年起从事固定收益品种的研究、交易与投资，2021年初加入华安证券资产管理总部，具有16年证券从业经历，10年固收投研经验，投资风格稳健，为产品创造了稳定收益。
张维维	投资经理	2020-		20	经济学学士，

		10-20		<p>2001年毕业于安徽大学国际金融专业。登记编号为S0010816090001。先后就职于华安证券资产管理部、证券投资部、资产管理总部。</p> <p>拥有二十年的证券市场投资交易经验、十二年固定收益类资产管理产品的投资运作经验。熟悉市场各类资产交易。擅长短久期、高流动性固定收益产品管理。</p> <p>具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守。</p> <p>现任华安证券资产管理总部投资经理。已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>
--	--	-------	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

#### 4.2 报告期内本资产管理计划运作遵规守信情况说明

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。

#### 4.3 报告期内资产管理计划的投资报告

二季度初，经济复苏的斜率一度显著放缓。一方面社交距离已逐步恢复常态，积压的出口和购房需求已经在一季度得到释放，另一方面，地产投资偏弱约束地

方土地出让收入和财政支出；与此同时传统制造业存在去库存压力。从PMI观测年初以来经济走势，1-2月处上行期，3-4月处下行期。5月以来，宏观数据显示经济已不再快速下行，呈现出较强韧性。但也需要看到的是，复苏的表现依旧弱于市场预期，民企投资两年复合增速低于0%，PMI企业经营预期持续转弱，均指向微观主体预期不强。当前时点，央行推动降息、发改委等部门推动降成本，政策积极发力的重要意义在于稳定预期，信心企稳有助于达成全年的经济增长目标。不同于一季度防疫放开的脉冲效应，也不同于二季度的低基数效应，三季度经济将呈现出更加真实的状态。展望三季度，经济中枢仍明显偏低，虽然消费逐季改善，但出口呈现出边际下行的趋势，外需走弱对我们出口的影响正在不断显现，因此，预计三季度政策面或继续偏宽松，为实体经济提供可持续支持。现阶段稳预期政策已在降息、发改委降成本等供给端发力，未来美联储货币政策转向的概率较大，人民币汇率持续走弱后也有望阶段性触顶，三季度宽货币或将持续。同时，在需求端改善收入、提高居民消费和企业投资意愿的相关政策值得期待。债券市场，二季度收益率整体先降后升、呈V型调整。4、5月基本面数据偏弱不及年初预期，长债利率由季度初2.90%附近下行至2.65%附近。6月央行行长强调“逆周期调节”，后续降息快速落地，政策利率和LPR各下调10个基点。受降息落地，叠加跨半年资金面收紧，以及预期后续稳增长政策出台，可能对债市产生扰动，10年国债收益率在季度末呈现温和上升态势。6月美联储自2022年3月以来连续10次加息后首次暂停加息，将联邦基金利率维持在5%-5.25%区间，预计美联储后续加息决策将更为谨慎。信用市场方面，2023年上半年信用债收益率整体震荡下行。一方面，在经历了2022年第四季度的调整后，信用债配置价值提升；另一方面，理财规模回升带来的配置需求旺盛，信用债供需关系较去年有所改善，同时3月份开始经济数据走弱也导致了信用债收益率下行。6月份，央行开启降息操作，也为信用债市场提供了较为有利的市场环境。三季度，适宜控制久期和杠杆，关注高等级短久期的央企、国企产业债，高等级短久期央企地产债，中短期的城投债。

可转债方面，从估值上看转股溢价率自去年四季度以来持续压缩，但仍然处于历史偏高水平，我们判断，三季度可转债市场较难出现全面趋势性行情，市场机会主要来自于权益市场带动下的结构性机会，适宜控制好仓位，波段操作，关注中低价可转的配置机会。

#### 4.4 报告期内资产管理计划的投资表现

报告期间，本资产管理计划净值季度增长率为1.31%。

#### 4.5 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

本资产管理计划本报告期内未有利润分配。

#### 4.6 产品运用杠杆情况

本资产管理计划本报告期末，因从事证券交易所、银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为100,065,279.18元。

#### 4.7 托管人履职报告

详见附件。

#### 4.8 资产管理计划投资经理变更情况

本报告期内本资产管理计划投资经理没有发生变更。

#### 4.9 报告期内本资产管理计划管理人履职报告

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。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	401,929,192.16	96.03
	其中：债券	391,840,668.87	93.62
	资产支持证券	10,088,523.29	2.41
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	15,098,097.38	3.61
	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	1,514,135.05	0.36
8	其他资产	17,870.35	0.00
9	合计	418,559,294.94	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股票投资组合

本资产管理计划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

本资产管理计划本报告期末未持有股票。

## 5.3 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)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	56,160,574.19	18.04
5	企业短期融资券	40,337,978.14	12.96
6	中期票据	36,381,630.14	11.69
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	258,960,486.40	83.19

10	合计	391,840,668.87	125.87
----	----	----------------	--------

## § 6 资产管理计划份额变动

单位：份

报告期期初资产管理计划份额总额	347,061,268.23
报告期期间资产管理计划总申购份额	193,565,251.40
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	278,021,326.29
报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末资产管理计划份额总额	262,605,193.34

截止报告期末，本公司董事、监事、从业人员及配偶购买持有本集合资产管理计划份额0份，控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划份额0份。

### § 6.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 6.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未有运用固有资金投资本基金。

### § 7 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、本报告期内本资产管理计划未发生重大关联交易。
- 2、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。
- 3、本计划管理人办公地址未发生变更。

4、管理人于2023年5月4日召开第四届董事会第一次会议，审议通过了《关于聘任公司高级管理人员的议案》，同意聘任赵万利先生为公司总经理；张建群先生、周庆华先生、唐泳先生、王孝佳先生为副总经理，徐峰先生为首席信息官，龚胜昔女士为财务总监，汲杨女士为总经理助理，刘晓东先生为合规总监，余海春先生为总经理助理，丁峰先生为首席风险官。上述人员任期自本次会议审议通过之日起至第四届董事会任期届满为止。会议审议通过了《关于指定公司高级管理人员代行董事会秘书职责的议案》。因工作职责分工调整原因，公司总经理助理汲杨女士将不再担任董事会秘书职务。在公司聘任新任董事会秘书前，公司董事会指定由汲杨女士代行董事会秘书职责，公司将根据有关规定尽快聘任新的董事会秘书。

管理人于2023年6月12日以通讯表决方式召开第四届董事会第三次会议，审议通过了《关于聘任公司高级管理人员的议案》。同意聘任顾勇先生为公司副总经理，任期自本次会议审议通过之日起至第四届董事会任期届满为止。



## § 8 业绩报酬及费用的计提和支付

	报告期间计提金额（元）	报告期间支付金额（元）
管理费	609,355.69	562,354.38
托管费	36,561.30	33,741.21
业绩报酬	996,044.00	7,675,856.36

### 8.1 两费及业绩报酬说明

#### 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【0.5%】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【0.5%】

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【0.03%】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【0.03%】

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

业绩报酬比例：【60%】

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 华安证券安赢套利1号集合资产管理计划说明书
2. 华安证券安赢套利1号集合资产管理计划资产管理合同
3. 华安证券安赢套利1号集合资产管理计划风险揭示书
4. 华安证券安赢套利1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

### 9.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号。

### 9.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95318

公司网址：<http://www.hazq.com/>

华安证券股份有限公司

2023年07月31日

## 免责声明

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供特定客户资产管理业务客户参考。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或删改，否则将构成侵权。

投资有风险，请理性选择。资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托资产一定盈利，也不保证最低收益。本委托资产的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的其他资产的业绩也不构成本委托资产业绩表现的保证。本特定客户资产管理业务的具体情况以该产品法律文件为准，请仔细阅读。