

**华安证券季季赢16号集合资产管理计划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:徽商银行股份有限公司**

## § 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	华安证券季季赢16号
资产管理计划编码	BB8016
资产管理计划运作方式	契约型开放式
资产管理计划合同生效日	2021年11月02日
报告期末资产管理计划份额总额	137,212,735.79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	徽商银行股份有限公司

## § 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	1,506,068.43
本期利润	1,863,708.31
期末资产管理计划资产净值	151,009,990.77
期末资产管理计划份额净值	1.1006

### 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



## § 4 管理人报告

### 4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

基金经理介绍：

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		
刘阳	投资经理	2021-11-2	-	5	刘阳，财务管理硕士，女，2014年毕业于上海财经大学财务管理专业。先后就职于公募基金、保险公司、华安证券资产管理部，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，有较强的投资管理能力和风险

					控制意识。
--	--	--	--	--	-------

## 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

### 4.3.1 债券市场展望

利率市场方面，逆周期调节窗口已经打开。短期看，降息落地后宽财政、宽地产、扩内需等稳增长政策协同发力预期下，投资者止盈情绪抬升；中长期看，经济基本面修复的内在动能不足，长债利率尚不具备中枢回升的催化。疲弱的数据表明经济复苏仍需进一步刺激，本轮降息后 MLF 处于 2.65% 的点位，为货币政策进一步宽松留足空间。在国内低通胀环境及美联储加息终点或已临近背景下，基本面数据和政策出台对债市影响程度加深，债券收益率波幅走阔，三季度关注利率受短期扰动调整后的交易机会。

信用市场方面，在经济、地产弱修复背景下，预计信用债配置需求仍有增量，不过需防范债券收益率处于历史低位下债券估值波动风险、部分区域城投非标违约带来的负面舆情风险等。

### 4.3.2 债券市场配置策略

综合来看，部门 2023 年第 3 季度债券投资上应着重做好以下几点：

1) 城投债板块：2023 年以来，各等级、期限城投债收益率持续下行，目前处于历史上较低的分位数，同时，3Y-1Y 期限和 5Y-3Y 期限利差也都处于历史上较低的分位数，拉长投资期限性价比不高。整体看，三季度重点配置 1 年期内品种，适当配置 3 年期内城投债。区域上，在充分尽调的基础上关注省级整体化债进度较好的区域，如山东、江苏、湖南等省份。评级方面，控制纯 AA 评级债券配置的比例，可重点关注有 AAA 评级担保方担保增信的中短久期城投债。

2) 产业债板块，从部分重点行业来看，二季度钢材价格结束上行趋势，自 4 月开始钢价走弱，地产基建对应的螺纹钢和制造业对应的热轧板卷价格均有回落。产业债信用利差下行较多，短期内建议回避业绩下滑现金流紧张行业的产业债，适当关注高等级的央企、国企产业债和金融债。

3) 地产债板块，5 月份以来，新房及二手房成交面积走低，商品房需求修复偏弱，个人住房贷款余额同比接近转负，居民杠杆收缩。债券二级市场方面，国企和高等级民企地产债信用利差总体下行，其中高等级民企地产债利差下行幅

度更大，低等级民企地产债大幅波动；4月份开始走势内部分化，国企地产债价格继续修复调整，但幅度较小，高等级民企地产债利差又有所回升，市场对民企地产债担忧仍存。基于上述基本面的判断，短期内适当关注高等级央企、国企地产债。

#### 4.4 报告期内资产管理计划的投资表现

报告期内，本资产管理计划净值季度增长率为1. 39%。

#### 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，无因从事证券交易所、银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 4.7 托管人履职报告

参见附件。

#### 4.8 资产管理计划基金经理变更情况

本报告期内本资产管理计划投资经理由曲少伦、刘阳变更为刘阳、孙文青。

#### 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	118,297,009.91	78.03
	其中：债券	118,297,009.91	78.03
	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	21,638,416.46	14.27
	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	11,667,062.18	7.70
8	其他资产	4,366.30	0.00
9	合计	151,606,854.85	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	35,503,252.05	23.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,128,885.25	6.71
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	72,664,872.61	48.12
10	合计	118,297,009.91	78.34

## § 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	126,211,727.52
报告期内期间资产管理计划总申购份额	78,033,971.53
减：报告期内期间资产管理计划总赎回份额	67,032,963.26
报告期内期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末资产管理计划份额总额	137,212,735.79

截止报告期末，本公司从业人员及配偶购买持有本集合资产管理计划份额  
1322276.53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

	报告期内计提金额（元）	报告期内支付金额（元）
管理费	217,720.13	212,983.26
托管费	10,886.00	10,649.16
业绩报酬	164,110.51	-

### 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【0.6%】年费率计提。  
计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{本资产管理计划年管理费率为【0.6%】}$$

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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{本资产管理计划年托管费率为【0.03%】}$$

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

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 
- 1、华安证券季季赢16号集合资产管理计划说明书
  - 2、华安证券季季赢16号集合资产管理计划资产管理合同
  - 3、华安证券季季赢16号集合资产管理计划风险揭示书
  - 4、华安证券季季赢16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印件或复印件。

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

## 免责说明

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，请详细阅读。