

---

华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划

2024年第1季度报告

2024年03月31日

基金管理人:华安证券股份有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2024年04月22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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年04月18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2024年01月01日起至2024年03月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华安证券聚赢一年持有
场内简称	华安证券聚赢一年
基金主代码	970024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年04月26日
报告期末基金份额总额	527,240,347.17份
投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划在严格控制投资风险的前提下，通过定性与定量相结合的方法研究宏观经济和资本市场发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，执行自上而下的资产配置及动态调整策略、自下而上的个券（股）选择策略，力求实现集合计划资产组合收益长期稳定增长。
业绩比较基准	基准指数 = 中证全债指数收益率 × 80% + 一年期定期存款利率（税后） × 20%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，属于中低风险/收益的投资品种，其预期风险和预期收益

	水平高于货币市场基金，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。	
基金管理人	华安证券股份有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安证券聚赢一年持有 A	华安证券聚赢一年持有 B
下属分级基金场内简称	华安证券聚赢一年持有 A	华安证券聚赢一年持有 B
下属分级基金的交易代码	970024	970025
报告期末下属分级基金的份额总额	53,758,714.96份	473,481,632.21份

注：本报告所述的"基金"也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### §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(2024年01月01日 - 2024年03月31日)	
	华安证券聚赢一年持有A	华安证券聚赢一年持有B
1.本期已实现收益	595,420.23	3,359,865.65
2.本期利润	1,007,964.78	5,997,063.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0185	0.0162
4.期末基金资产净值	64,248,333.56	555,396,787.09
5.期末基金份额净值	1.1951	1.1730

注：①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。

②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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 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

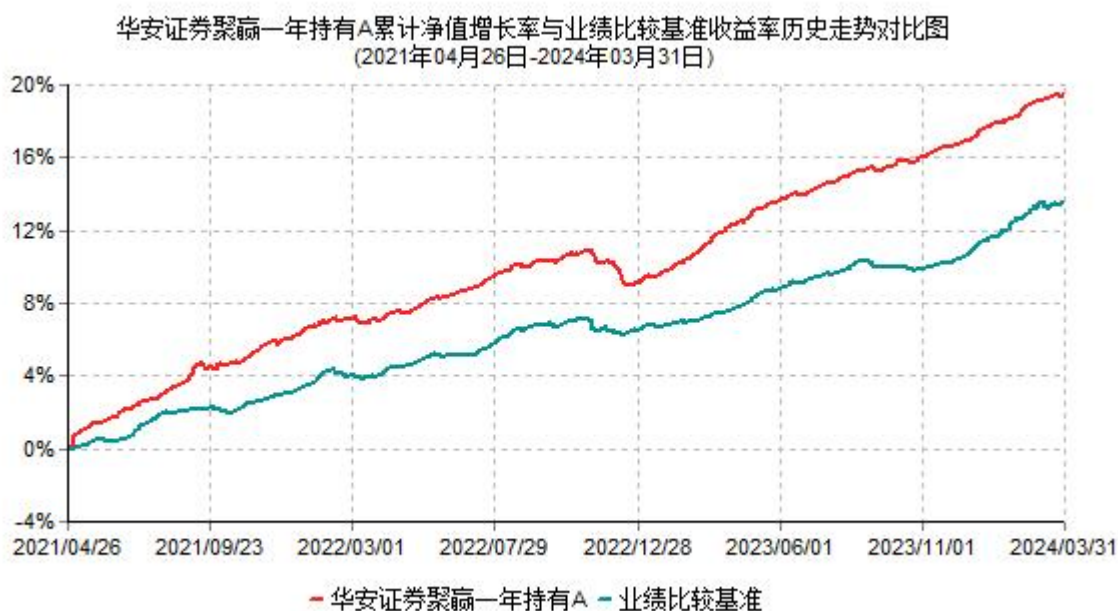
华安证券聚赢一年持有A净值表现

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	1.61%	0.04%	1.96%	0.07%	-0.35%	-0.03%
过去六个月	3.28%	0.04%	3.21%	0.06%	0.07%	-0.02%
过去一年	6.72%	0.04%	5.61%	0.05%	1.11%	-0.01%
自基金合同生效起至今	19.51%	0.06%	13.56%	0.05%	5.95%	0.01%

华安证券聚赢一年持有B净值表现

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	1.45%	0.04%	1.96%	0.07%	-0.51%	-0.03%
过去六个月	2.98%	0.04%	3.21%	0.06%	-0.23%	-0.02%
过去一年	6.08%	0.04%	5.61%	0.05%	0.47%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.30%	0.06%	13.56%	0.05%	3.74%	0.01%

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





## §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		
樊艳	基金经理	2020-07-02	-	20年	1999年加入华安证券，曾任证券投资部研究员、投资经理，现任资产管理总部投资经理，担任华安证券汇赢增利一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢三个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划投资经理。
刘杰	基金经理	2024-	-	14年	硕士研究生。曾任职于招商

		03-18			证券研究所、海富通基金投资部、华泰证券资管权益投资部。2017年加入华安证券，现担任华安证券合赢添利、华安证券合赢三个月持有、华安证券睿赢一年持有、华安证券汇赢增利一年持有的投资经理。
--	--	-------	--	--	--

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华安证券股份有限公司公募资产管理业务公平交易制度》的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度国内经济延续回升向好态势，稳增长政策发力，经济内生动能持续修复，主要生产需求指标稳中有升，外贸发展质量稳步提升、进出口规模再上新台阶，制造业新动能加快增长。预计二季度，积极的财政政策和稳健的货币政策将继续同向发力，助力经济稳中向好，消费将继续发挥经济增长压舱石的作用，新质生产力持续培育，产业转型升级的趋势延续，国内经济景气度有望继续保持回升态势。

一季度债市受到对央行宽松货币政策的预期和经济回升向好等因素的共同影响，十年期国债收益率从年初2.54%逐步下行至最低2.26%后回升，在2.30%附近徘徊，市场整体表现较强。预计二季度债券市场高位震荡，上下空间皆相对有限。

报告期内，本基金遵循稳健经营原则，根据市场情况调整资产结构。债券组合以中高等级信用债为主，控制组合久期，适当运用杠杆，提高组合收益；根据结构性行情适度调整可转债的持仓结构。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华安证券聚赢一年持有A基金份额净值为1.1951元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.61%，同期业绩比较基准收益率为1.96%；截至报告期末华安证券聚赢一年持有B基金份额净值为1.1730元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.45%，同期业绩比较基准收益率为1.96%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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	3,095,229.11	0.49
	其中：股票	3,095,229.11	0.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	595,748,854.59	94.39
	其中：债券	595,748,854.59	94.39
	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	17,005,429.59	2.69
	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	12,595,581.19	2.00
8	其他资产	2,713,403.38	0.43
9	合计	631,158,497.86	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-

C	制造业	883,295.40	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	249,250.00	0.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	697,565.36	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	165,551.84	0.03
J	金融业	1,088,581.25	0.18
K	房地产业	-	-
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	10,985.26	0.00
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	3,095,229.11	0.50

### 5.3 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	600919	江苏银行	127,736	1,009,114.40	0.16
2	000623	吉林敖东	31,666	457,890.36	0.07
3	001965	招商公路	31,766	358,955.80	0.06
4	601006	大秦铁路	24,115	177,486.40	0.03
5	603871	嘉友国际	6,598	161,123.16	0.03
6	603687	大胜达	11,520	137,779.20	0.02
7	600487	亨通光电	10,752	132,787.20	0.02



8	002061	浙江交科	35,000	129,150.00	0.02
9	600133	东湖高新	10,000	120,100.00	0.02
10	300170	汉得信息	15,000	100,500.00	0.02

#### 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	36,627,239.67	5.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	474,199,414.82	76.53
5	企业短期融资券	51,131,428.96	8.25
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	33,790,771.14	5.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	595,748,854.59	96.14

#### 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	185097	21中金G7	300,000	30,417,784.93	4.91
2	188701	国电投11	200,000	20,419,654.79	3.30
3	042380333	23电网CP001	200,000	20,321,071.04	3.28
4	185141	21石化01	200,000	20,266,550.68	3.27
5	138871	23中证G1	200,000	20,189,454.79	3.26

#### 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

本报告期末未持有股指期货。

## 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

本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体中，在报告编制日前一年内，中国国际金融股份有限公司于2024年1月8日受到中国证监会《关于对中国国际金融股份有限公司采取出具警示函措施的决定》、2024年2月5日受到北京证监局责令改正措施的处罚；中信证券股份有限公司于2023年4月12日受到深圳证券交易所深证函（2023）226号监管函、2023年7月13日受到深圳证监局行政监管措施决定书（2023）102号文、2023年8月29日受到上海证券交易所（2023）37号文书面警示、2023年9月25日受到深圳证券交易所深证函（2023）654号警示函、2023年9月28日受到中国证监会《关于对中信证券股份有限公司采取监管谈话措施的决定》、2024年1月12日受到中国证监会《关于对中信证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》的处罚，深圳证券交易所于2024年3月22日晚公告，决定对中信证券启动现场督导。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

### 5.11.2 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	6,596.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	520,000.00
5	应收申购款	2,186,807.05
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	2,713,403.38
---	----	--------------

#### 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	113042	上银转债	6,100,341.58	0.98
2	113021	中信转债	2,078,493.29	0.34
3	113056	重银转债	1,464,941.21	0.24
4	113044	大秦转债	1,198,046.03	0.19
5	127018	本钢转债	955,327.01	0.15
6	128138	侨银转债	939,967.41	0.15
7	113037	紫银转债	858,581.92	0.14
8	123059	银信转债	808,438.76	0.13
9	127044	蒙娜转债	796,043.66	0.13
10	127040	国泰转债	759,382.74	0.12
11	110076	华海转债	636,356.63	0.10
12	113033	利群转债	635,172.00	0.10
13	127084	柳工转2	560,259.81	0.09
14	127038	国微转债	553,516.66	0.09
15	123120	隆华转债	491,573.63	0.08
16	113628	晨丰转债	485,653.92	0.08
17	110073	国投转债	484,439.12	0.08
18	123099	普利转债	479,312.76	0.08
19	110089	兴发转债	477,034.40	0.08
20	123076	强力转债	444,096.70	0.07
21	113584	家悦转债	423,591.51	0.07
22	113640	苏利转债	412,650.19	0.07
23	110084	贵燃转债	400,103.46	0.06
24	113569	科达转债	395,049.49	0.06
25	127042	嘉美转债	378,817.02	0.06
26	123122	富瀚转债	375,278.59	0.06
27	127016	鲁泰转债	359,837.80	0.06
28	113530	大丰转债	347,544.29	0.06
29	113549	白电转债	344,908.85	0.06

30	128132	交建转债	343,020.60	0.06
31	123126	瑞丰转债	333,329.69	0.05
32	113625	江山转债	331,516.44	0.05
33	123133	佩蒂转债	317,707.42	0.05
34	113048	晶科转债	315,017.18	0.05
35	127069	小熊转债	308,653.17	0.05
36	123063	大禹转债	289,652.21	0.05
37	128135	洽洽转债	282,860.66	0.05
38	113045	环旭转债	272,109.32	0.04
39	127026	超声转债	266,645.48	0.04
40	128105	长集转债	262,795.56	0.04
41	113024	核建转债	248,166.87	0.04
42	128130	景兴转债	223,882.48	0.04
43	110095	双良转债	218,691.39	0.04
44	110082	宏发转债	215,885.32	0.03
45	123082	北陆转债	212,961.65	0.03
46	113049	长汽转债	208,777.86	0.03
47	128133	奇正转债	195,933.00	0.03
48	127028	英特转债	188,620.84	0.03
49	127061	美锦转债	185,280.36	0.03
50	110072	广汇转债	184,865.53	0.03
51	127092	运机转债	176,439.61	0.03
52	128087	孚日转债	173,641.36	0.03
53	123088	威唐转债	171,856.31	0.03
54	123160	泰福转债	169,486.19	0.03
55	110085	通22转债	162,082.77	0.03
56	127066	科利转债	161,884.13	0.03
57	113065	齐鲁转债	158,465.69	0.03
58	127019	国城转债	150,232.13	0.02
59	123050	聚飞转债	141,824.24	0.02
60	123129	锦鸡转债	127,305.48	0.02
61	113643	风语转债	118,572.18	0.02
62	113519	长久转债	116,107.52	0.02

63	123078	飞凯转债	112,981.20	0.02
64	128117	道恩转债	112,312.22	0.02
65	123106	正丹转债	111,532.18	0.02
66	113666	爱玛转债	110,443.68	0.02
67	113516	苏农转债	109,273.03	0.02
68	113605	大参转债	106,304.64	0.02
69	113608	威派转债	105,729.21	0.02
70	113610	灵康转债	103,778.26	0.02
71	127027	能化转债	102,696.46	0.02
72	123146	中环转2	102,250.27	0.02
73	123049	维尔转债	100,419.82	0.02
74	128083	新北转债	95,149.78	0.02
75	127024	盈峰转债	85,188.98	0.01
76	113588	润达转债	85,054.28	0.01
77	110064	建工转债	77,439.77	0.01
78	113534	鼎胜转债	63,920.77	0.01
79	113634	珀莱转债	62,420.66	0.01
80	123119	康泰转2	58,077.76	0.01
81	128116	瑞达转债	53,109.12	0.01
82	123151	康医转债	51,671.44	0.01
83	123154	火星转债	51,426.35	0.01
84	127053	豪美转债	50,560.18	0.01

### 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

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

	华安证券聚赢一年持有 A	华安证券聚赢一年持有 B
报告期期初基金份额总额	55,640,946.08	282,523,035.80

报告期期间基金总申购份额	-	210,118,727.58
减：报告期期间基金总赎回份额	1,882,231.12	19,160,131.17
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	53,758,714.96	473,481,632.21

截至本报告期末，本公司从业人员及其配偶购买持有本集合资产管理计划份额合计7,857,127.57份。

## §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

报告期内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

报告期内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

本基金本报告期内未出现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

因公司业务发展和经营需要，自2024年1月18日起，华安证券股份有限公司总部办公地址从安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号迁至安徽省合肥市滨湖新区紫云路1018号。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

## 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

2024年04月22日