

华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划
2023 年年度资产管理报告

2023 年 12 月 31 日

管理人：华源证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 04 月 10 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本报告由华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划（“本计划”）管理人华源证券股份有限公司（“华源证券”）编制。

托管人宁波银行股份有限公司根据《华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称：《资产管理合同》）规定，于 2024 年 03 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，但不保证计划财产一定盈利，不保证最低收益或者本金不受损失，也不限定投资损失金额或者比例。

本计划的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的资产管理计划或其他资产管理产品以及投资经理在其他公司管理的资产管理产品的业绩并不构成对本计划业绩表现的保证。管理人提醒投资者了解“买者自负”原则，投资者将自行承担投资于本计划的风险。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 05 月 30 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

本报告内容由管理人负责解释。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 概况	4
2.1 本计划基本情况	4
2.2 管理人和托管人	6
2.3 信息披露方式	6
2.4 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和投资表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 投资表现	7
3.3 报告期内本计划的收益分配情况	8
§4 管理人履职报告	9
4.1 管理人及投资经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明	10
4.2.2 报告期内管理人对风险管理与内部控制制度的落实情况	10
4.3 报告期内本计划的投资策略	10
4.3.2 市场展望与投资策略	11
§5 托管人履职报告	12
§6 审计报告	13
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益变动表	17
§8 投资组合报告	18
8.1 报告期末投资组合情况	18
8.3 报告期末按行业分类的股票投资组合情况	19
8.4 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排序的前十名股票投资明细	19
8.5 报告期内股票投资组合的重大变动	19
8.6 报告期末按债券品种分类的债券投资组合情况	19
8.7 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	20
8.8 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	20
8.9 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排名的前十名基金投资明细	20
8.10 投资组合报告附注	20
§9 投资者信息	22

9.1 报告期末投资者数量及投资者结构	22
§ 10 计划份额变动情况	22
§ 11 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式	22
§ 12 投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项	24
§ 13 备查文件目录	25
13.1 备查文件目录	25
13.2 存放地点	25
13.3 查阅方式	25

§ 2 概况

2.1 本计划基本情况

名称	华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划
简称	华源证券安鑫周周盈集合
交易代码	F29006
运作方式	开放式，每周二开放参与和退出（如遇法定节假日，则顺延至下一个工作日）。
成立日	2023年5月30日
报告期末计划份额总额	251,970,378.62份
存续期	10年
投资目标	通过对当前经济形势、货币政策、财政政策、产业政策及资本市场的细致分析研究，积极主动地对集合计划的大类资产进行配置调整，力争在有效控制风险的前提下，努力实现集合计划获取投资收益目标。
投资范围	<p>(1) 固定收益类及现金类资产：包括国债、中央银行票据、金融债（含次级债、二级资本债、混合资本债）、地方政府债、企业债、公司债（含公开及非公开发行的公司债）、短融、超短融、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产证券化产品（包括资产支持证券、资产支持票据（基础资产不包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权））的优先级、现金、同业存单、银行存款、债券逆回购、货币基金及公募债券型基金。</p> <p>(2) 债券正回购。</p>
投资策略	立足于研究，通过选择风险、收益性价比高的固定收益资产，从事固定收益资产的投资，获取适当风险的稳定收益，通过合理的投资

	<p>策略来构建与管理本集合资产管理计划。</p> <p>(1) 债券类属策略:根据公司债、企业债、金融债、国债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被相对低估的债券板块,减持价值被相对高估的债券板块,借以取得较高收益。</p> <p>(2) 期限结构策略:在确定债券资产组合平均久期的基础上,根据利率期限结构的特点,对债券市场收益率期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,预测收益率期限结构的变化方式,遵循风险调整后收益率最大化配比原则,建立最优化的债券投资组合,例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等,以达到投资收益最大化的目的。</p> <p>(3) 利差交易策略:对不同类型债券品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债和其他固定收益类资产的利差和变化趋势,制定利差交易策略,以获取不同固定收益类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>(4) 杠杆放大策略:杠杆放大操作即以组合现有债券为基础,利用回购等方式融入低成本资金,并配置较高收益的资产,以期获取超额收益的操作方式。</p> <p>(5) 持有到期策略:通过分析发债主体的信用状况、经营情况及财务指标等,以收取合同现金流量为目标,对所投债券品种持有到期,获取票息收益。跟踪所持债券的信用状况,对其信用风险进行评估并及时作出反应。</p> <p>(6) 折价债券交易策略:市场各类投资机构出于自身流动性、风险偏好不同,产生一定的流动性溢价以及风险溢价,进而形成折价债券。通过细致的个券研究和充分的组合分散,挖掘个体折价债券的定价偏离或价值洼地,获得超额回报。</p>
风险收益特征	本计划为中低风险,风险等级评价为 R2。
初始募集情况	本计划初始募集由华源证券股份有限公司负责,初始募集期限为自 2023 年 5 月 29 日至 2023 年 5 月 29 日。初始募集份额数为 10,000,000.00 份(参与资金利息计入份额),初始募集面值为人民币 1.0000 元。

2.2 管理人和托管人

项目	管理人	托管人
名称	华源证券股份有限公司	宁波银行股份有限公司
客户服务电话	95305	95574
传真	027-51663102	0574-83895886
注册地址	青海省西宁市工业园区创业路108号	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址	湖北省武汉市江汉区万松街道青年路278号中海中心32F-34F	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码	430021	315042
法定代表人	邓晖	陆华裕

2.3 信息披露方式

管理人向投资者提供的报告的查询方式	管理人网站 http://www.huayuanstock.com
-------------------	---

2.4 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	众华会计师事务所（特殊普通合伙）	华源证券股份有限公司
办公地址	上海市虹口区东大名路1089号北外滩来福士广场东塔楼18楼	湖北省武汉市江汉区万松街道青年路278号中海中心32F-34F

§3 主要财务指标和投资表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年05月30日至2023年12月31日)
本期已实现收益	4,005,434.81
本期利润	4,293,998.06
3.1.2 期末数据和指标	2023年年末
期末可供分配利润	6,254,418.89
期末可供分配集合计划份额利润	0.0248
期末计划财产净值	258,489,501.69
期末计划份额净值	1.0259
期末累计份额净值	1.0259
3.1.3 累计期末指标	2023年年末
计划份额累计净值增长率	2.59%

注：

①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。

②本期已实现收益指本计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12月31日。

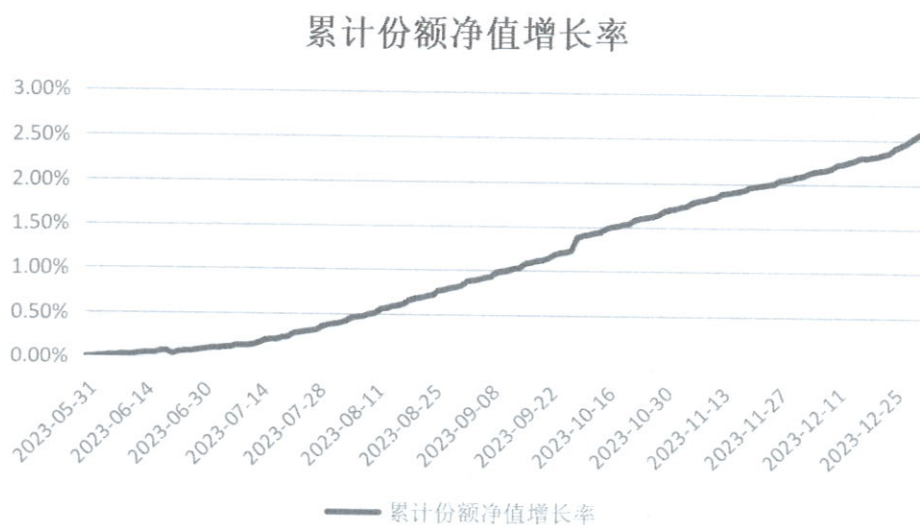
3.2 投资表现

3.2.1 报告期内计划份额净值增长率

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②
过去一年	2.59%	0.02%

3.2.2 自成立以来本计划累计份额净值增长率变动

华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划累计份额净值增长率历史走势图
(2023年05月30日至2023年12月31日)



3.3 报告期内本计划的收益分配情况

本计划报告期内无收益分配事项。

§ 4 管理人履职报告

4.1 管理人及投资经理情况

4.1.1 管理人情况

华源证券股份有限公司（以下简称“华源证券”）是由武汉金控集团实际控制、行政总部坐落在湖北武汉的综合性证券公司。华源证券设有财富管理、股权投资、固收投行、资产管理、自营投资、股权投资、期货业务、研究业务等业务模块和部门，构建了具有竞争力的全业务体系。华源证券在除西藏外的全国各省会城市、计划单列市开设了39家分支机构，搭建起辐射全国的业务开发体系和财富管理体系。此外，华源证券旗下设有九州期货、九证资本两家全资子公司。华源证券拥有证券业务全牌照，致力于为客户提供专业化的综合金融解决方案。华源证券以服务实体经济为导向，以满足客户需求为中心，以金融科技驱动财富管理转型作为战略突破口，致力于成为广受认可、具有竞争力、品牌影响力的数字化金融科技证券公司。

华源证券资产管理委员会为投资者提供集合、单一和专项资产管理计划，全方位对接投资者需求，竭力为投资者提供最全面的资产管理服务。资产管理委员会拥有一支具备国际化背景和丰富产品设计经验的专业团队。团队成员均毕业于海内外顶尖一流名校，拥有管理、金融、法律、数学等高度互补的复合型专业背景，工作经验丰富，对资产管理领域有独到而深刻的理解和实践。

4.1.2 投资经理简介

姓名	职务	任职期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曹丽萍	投资经理	2023-5-30	2023-12-25	7	曹丽萍女士，7年证券从业经历，目前无兼职情况，具有基金从业资格、证券从业资格、投资经理资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。
孙思齐	投资经理	2023-12-26	-	8	孙思齐女士，具有8年以上固定收益投资研究相关经验，历任国泰基金管理有限公司信用研究员，德邦基金管理有限公司固收研究部业务董事、专户投资部投资经

的消息影响，债市走势较为波动。进入四季度央行大额净回笼叠加政府债券发行速度较快，资金宽松不及预期，9月宏观数据不及预期，市场情绪有所好转，债市震荡下行。12月中央经济工作会议召开，强化宏观政策逆周期和跨周期调节，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，北京上海公布进一步优化调整房地产政策，但市场反应一般，央行加大资金投放力度后资金面转松，债市收益率有所下行。国有大行意外降息，催化降息行情，股市走势疲弱，股债跷跷板影响，债市收益率持续下行。

本计划及时跟踪投资者参与退出情况，在债市波动情况下，采取相对灵活的投资策略，在控制投资组合风险的前提下力求为投资者获取投资收益。

4.3.2 市场展望与投资策略

2024年年初，国内经济内生动力不足，资金面充裕，债市做多逻辑尚未改变，收益率曲线进一步下移，超长端韧性超市场预期，30年向下突破2.5%的历史低点。央行四季度货币政策执行报告强化宏观政策逆周期和跨周期调节释放积极信号。2024年3月5日政府工作报告公布，2024年GDP增长5%左右，赤字率拟按3%安排，赤字规模4.06万亿元，比上年年初预算增加1800亿元。为系统解决强国建设、民族复兴进程中一些重大项目建设的资金问题，从今年开始拟连续几年发行超长期特别国债，专项用于国家重大战略实施和重点领域安全能力建设，今年先发行1万亿元。同时提到积极的财政政策要适度有力，提质增效；稳健的货币政策要灵活适度，精准有效，加强总量和结构双重调节，盘活存量，提升效能。本次政府工作报告内容与此前市场预期较为一致。短期来看，债市趋势未改，但整体利差空间较低。后续关注经济增长动能好转情况、国内大循环改善情况、以及财政政策、货币政策的出台情况等。

§5 托管人履职报告

宁波银行股份有限公司根据《华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划资产管理合同》和《华源证券股份有限公司与宁波银行股份有限公司关于集合资产管理计划的总对总托管协议》，自2023年05月30日起托管华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划（以下简称“本计划”）资产。

2023年期间，宁波银行股份有限公司及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

2023年期间，宁波银行股份有限公司对管理人的投资运作行为按合同约定进行了监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

2023年期间，宁波银行股份有限公司对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

宁波银行股份有限公司复核了本计划资产管理报告(2023年年度报告)中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

众会字(2024)第 02710 号

华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划全体委托人：

审计意见

我们审计了华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划(以下简称“安鑫周周盈”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表和净值变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照附注二所述的编制基础编制，公允反映了安鑫周周盈 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和收益分配情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安鑫周周盈，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、其他信息

安鑫周周盈管理人对其他信息负责。其他信息包括安鑫周周盈 2023 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。2023 年度报告预期将在审计报告日后提供给我们。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是在能够获取上述其他信息时阅读这些信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

当我们阅读 2023 年度报告后，如果确定其中存在重大错报，审计准则要求我们与管理人沟通该事项并报告该事实。

四、管理人和托管人对财务报表的责任

安鑫周周盈管理人负责按照附注二所述的编制基础编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

托管人负责监督安鑫周周盈的财务报告过程。

五、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

(5) 就安鑫周周盈中业务活动的财务信息获取充分、适当的审计证据，以对财务报表发表审计意见。

我们与管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向管理人提供声明，并与管理人沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项，以及相关的防范措施。

众华会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱靓旻

中国注册会计师

邓马艳

中国，上海

2024年3月15日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划

本报告期：2023年05月30日(成立日)至2023年12月31日

单位：人民币元

资产	2023年12月31日	负债和所有者权益	2023年12月31日
资产：		负债：	
银行存款	1,310,659.45	短期借款	-
结算备付金	10,004.95	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	244,875,587.06	卖出回购金融资产款	148773193.13
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
债券投资	244,875,587.06	应付赎回款	-
基金投资	-	应付管理人报酬	343,717.95
权证投资	-	应付托管费	13,748.72
资产支持证券投资	-	应付销售服务费	-
衍生金融资产	-	应付交易费用	-
买入返售金融资产	161,471,298.44	应交税费	31,758.69
应收证券清算款	-	应付利息	-
应收利息	-	应付利润	-
应收股利	-	其他负债	15629.72
应收申购款	-	负债合计	149,178,048.21
其他资产	-		
		所有者权益：	
		实收基金	251,970,378.62
		未分配利润	6,519,123.07
		所有者权益合计	258,489,501.69
资产总计：	407,667,549.90	负债和所有者权益	407,667,549.90

	总计:	
--	-----	--

注:报告截止日,计划份额总额 251,970,378.62 份,计划财产净值(暂估业绩报酬前)258,489,501.69 元,暂估业绩报酬金额 567,191.83 元,计划财产净值(暂估业绩报酬后)257,922,309.86 元。

实际计提时的业绩报酬金额可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。其中,计划财产净值(暂估业绩报酬后)=计划财产净值(暂估业绩报酬前)-暂估业绩报酬金额。暂估业绩报酬为假设本计划于本报告期末按照当日的计划份额净值(计提业绩报酬前)清算,根据投资者持有的计划份额至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是各个投资者的暂估业绩报酬的合计,各个投资者实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

7.2 利润表

会计主体:华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划

本报告期:2023年05月30日(成立日)至2023年12月31日

单位:人民币元

项目	2023年05月30日(成立日)至2023年12月31日
一、收入	5,283,213.02
1、利息收入	4,211,529.04
其中:存款利息收入	15,600.09
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售证券收入	4,195,928.95
2、投资收益(损失以“-”填列)	782,078.15
其中:股票投资收益	-
债券投资收益	771,595.09
基金投资收益	10,483.06
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
其他投资收益	-
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	289,605.83
4、汇兑收益(损失以“-”填列)	-

5、其他收入（损失以“-”填列）	-
二、费用	989,214.96
1、管理人报酬	773,305.37
2、托管费	17,992.75
3、销售服务费	-
4、利息支出	178626.73
其中：卖出回购金融资产支出	178626.73
5、税金及附加	3890.11
6、其他费用	15,400.00
三、利润总额	4,293,998.06

7.3 所有者权益变动表

会计主体：华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划

本报告期：2023年05月30日(成立日)至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	2023年05月30日(成立日)至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）		-	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,293,998.06	4,293,998.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	251,970,378.62	2,225,125.01	254,195,503.63
其中：1、基金申购款	788,095,664.35	11,660,701.99	799,756,366.34
2、基金赎回款	-536,125,285.73	-9,435,576.98	-545,560,862.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	251,970,378.62	6,519,123.07	258,489,501.69

§8 投资组合报告

8.1 报告期末投资组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占计划财产总值的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	244,875,587.06	60.07%
	其中：债券	244,875,587.06	60.07%
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产①	161,471,298.44	39.61%
6	银行存款和结算备付金合计②	1,320,664.40	0.32%
7	其他资产	-	-
8	合计	407,667,549.90	100.00%

注①：买入返售金融资产主要为上交所债券质押式回购。

注②：银行存款、备付金、保证金及逆回购对应的利息计入对应的资产下统计。

8.2 本计划运用杠杆情况

本计划本报告期末的杠杆比例（计划财产总值/计划财产净值）为 157.71%。

8.3 报告期末按行业分类的股票投资组合情况

本计划本报告期末未持有股票。

8.4 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本计划本报告期末未持有股票。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初计划财产净值 2%或前十名的股票明细

本计划本报告期末未持有股票。

8.5.2 累计卖出金额超出期初计划财产净值 2%或前十名的股票明细

本计划本报告期末未持有股票。

8.6 报告期末按债券品种分类的债券投资组合情况

单位：人民币元

债券品种	公允价值(元)	占计划财产净值的比例 (%)
短期融资券	-	-
公司债	20,396,319.45	7.89%
企业债	39,548,452.22	15.30%
私募债	155,531,871.78	60.17%
同业存单	29,398,943.61	11.37%
中期票据	-	-
合计	244,875,587.06	94.73%

8.7 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

单位：人民币元

序号	证券名称	公允价值(元)	占计划财产净值的比例(%)
1	23 农业银行 CD234	29,398,943.61	11.37%
2	23 利民 02	27,904,029.51	10.80%
3	22 任兴 01	26,353,228.43	10.20%
4	22 滨海投资 PPN002	20,884,369.62	8.08%
5	21 港投 02	20,396,319.45	7.89%
	合计	124,936,890.62	48.33%

8.8 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本计划本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本计划本报告期末未持有基金。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1 报告期内本计划投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

报告期内本计划投资的前十名证券的发行主体不存在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。

8.10.2 其他资产构成

本计划本报告期末未持有其他资产。

8.10.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本计划本报告期末未持有可转换债券。

8.10.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本计划本报告期末未持有流通受限股票。

8.10.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 投资者信息

9.1 报告期末投资者数量及投资者结构

份额单位：份

投资者数量 (户)	户均持有的计划份额数	投资者结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占计划份额总额比例	持有份额	占计划份额总额比例
168	1,499,823.68	48,859,128.53	19.39%	203,111,250.09	80.61%

§10 计划份额变动情况

单位：份

报告期期初计划份额总额	-
报告期内总参与份额	788,095,664.35
报告期内总退出份额	536,125,285.73
报告期期间拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末计划份额总额	251,970,378.62

§11 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

11.1 管理费

计提基准	按前一自然日资产净值的0.50%/365日费率计提
------	---------------------------

计提方式	每日计提，逐日累计
支付方式	按季支付

11.2 托管费

计提基准	按前一自然日资产净值的 0.02%/365 日费率计提
计提方式	每日计提，逐日累计
支付方式	按季支付

11.3 业绩报酬

计提基准	每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日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基准
计提方式	期间年化收益率 (R) $\geq 3.5\%$ ，计提比例为 60%
支付方式	托管人于业绩报酬计提日当日按照管理人指令从本计划资产中一次性支取

§ 12 投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项

12.1 投资经理变更

孙思齐女士于 2023 年 12 月 26 日担任本计划投资经理。

曹丽萍女士于 2023 年 12 月 25 日离任本计划投资经理。

12.2 关联交易

本计划报告期内未发生关联交易。

12.3 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划情况

2023 年 05 月 30 日(成立日)至 2023 年 12 月 31 日期间,管理人收到管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方对本计划的参与申请,确认金额共计 24,671.58 万元人民币。

12.4 与本计划相关的重大诉讼、仲裁等情况

报告期内无涉及管理人资产管理业务、计划财产、托管人托管业务的重大诉讼、仲裁事项。

12.5 本计划投资策略的变更

报告期内本计划投资策略未发生变更。

12.6 为本计划提供审计服务的会计师事务所情况

报告期内由众华会计师事务所(特殊普通合伙)为本计划提供审计服务,本报告期内应支付给该会计师事务所审计费 12,000.00 元。

12.7 其他涉及投资者权益的重大事项

自 2023 年 10 月 26 日起,管理人分管资产管理业务的高级管理人员由邓晖先生变更为吴晨先生。

本报告期内,除已公告信息外,本计划未发生其他涉及投资者权益的重大事项。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

《华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划说明书》

《华源证券安鑫周周盈集合资产管理计划资产管理合同》

《华源证券股份有限公司与宁波银行股份有限公司关于集合资产管理计划的总对总托管协议》

管理人业务资格批件、营业执照

13.2 存放地点

备查文件存放于管理人和托管人的住所或办公地。

13.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的住所或办公地，或管理人网站（<http://www.huayuanstock.com>）查阅备查文件。

