

---

华安证券恒赢69号集合资产管理计划

2024年第1季度报告

2024年03月31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。本报告书的内容由管理人负责解释。

本报告期自2024年01月01日起至2024年03月31日止。

## § 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	华安证券恒赢69号
资产管理计划编码	BB2085
资产管理计划合同生效日	2023年11月02日
报告期末资产管理计划份额总额	37,998,809.21份
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

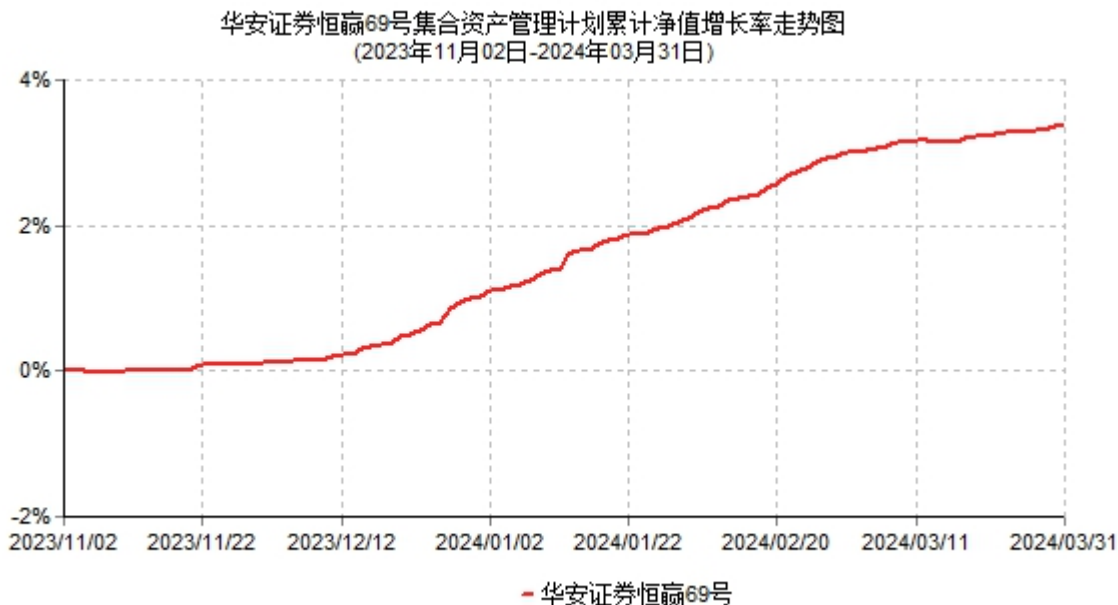
## § 3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年01月01日 - 2024年03月31日）
本期已实现收益	399,112.21
本期利润	893,001.90
期末资产管理计划资产净值	39,286,780.78
期末资产管理计划份额净值	1.0339

### 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：

张涛，金融学硕士，曾任安粮期货研究所商品研究员、华安证券资产管理总部交易员，一直从事证券、期货业的投资、研究、交易类工作，并能将各大类资产合理融合，发掘投资机会。现任华安证券资产管理部投资经理。

仇中群，中国科学技术大学金融工程硕士，证券从业经历12年，历任东吴证券研究所研究员、资产管理部研究员、固定收益总部高级经理、浙商证券债券投行部高级业务副总监，拥有多年的债券一级和二级市场经验。现任华安证券资产管理总部投资经理。

### 4.2 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

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

#### 4.4 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2.33%。

#### 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，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

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

本次履职报告综合了管理人全面自查和法律合规部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内部控制部门，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	36,514,023.33	92.81
	其中：债券	36,514,023.33	92.81
	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	-	-
	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	2,825,180.37	7.18
8	其他资产	3,948.52	0.01
9	合计	39,343,152.22	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	21,699,337.68	55.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,131,784.15	13.06
7	可转债（可交换债）	1,408,894.93	3.59
8	同业存单	-	-
9	其他	8,274,006.57	21.06
10	合计	36,514,023.33	92.94

## § 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	37,998,809.21
报告期期间资产管理计划总申购份额	-
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	-
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	37,998,809.21

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 基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

#### 6.1.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

管理人未运用自有资金投资本资产管理计划。

### § 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、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。

## § 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	67,745.86	67,177.66
托管费	2,903.40	2,879.07
业绩报酬	-	-

### 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【0.70%】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【0.70%】

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

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、华安证券恒赢 69 号集合资产管理计划说明书
- 2、华安证券恒赢 69 号集合资产管理计划资产管理合同
- 3、华安证券恒赢 69 号集合资产管理计划风险揭示书
- 4、华安证券恒赢 69 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/>





## 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。