

---

华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划

2024年第4季度报告

2024年12月31日

基金管理人:华安证券资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2025年01月21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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年01月20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10月01日起至2024年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华安证券合赢三个月定开
基金主代码	970034
基金运作方式	契约型，定期开放
基金合同生效日	2021年06月11日
报告期末基金份额总额	182,908,751.40份
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，追求资产的长期稳定增值，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划投资策略主要有持有到期策略、利率预期策略、收益率曲线策略、信用债投资策略、类属替换策略、个券优选策略等。
业绩比较基准	基准指数=沪深300指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×90%
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	华安证券资产管理有限公司

基金托管人	招商银行股份有限公司
-------	------------

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10月01日 - 2024年12月31日）
1.本期已实现收益	795,727.19
2.本期利润	1,619,295.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0080
4.期末基金资产净值	184,008,217.85
5.期末基金份额净值	1.0060

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

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	0.79%	0.03%	1.88%	0.18%	-1.09%	-0.15%
过去六个月	1.02%	0.02%	3.73%	0.16%	-2.71%	-0.14%
过去一年	2.78%	0.02%	6.13%	0.13%	-3.35%	-0.11%
过去三年	12.14%	0.04%	4.98%	0.12%	7.16%	-0.08%
自基金合同生效起至今	15.37%	0.04%	5.78%	0.12%	9.59%	-0.08%

##### 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

华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



## §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		
张欣	基金经理	2021-06-11	-	11年	张欣，2010年加入华安证券，历任资产管理总部研究、产品设计、交易、投资助理、投资经理、投资总监等岗位，担任华安证券合赢添利债券型集合资产管理计划、华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划、华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划投资经理。
张钰	基金经理	2021-06-11	-	8年	张钰，2016年加入华安证券，曾任资产管理总部交易员、投资助理，现任资产管

					理总部投资经理，担任华安证券合赢九个月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定期开放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。
--	--	--	--	--	--

#### 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》《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》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《华安证券资产管理有限公司资产管理业务公平交易实施细则》《华安证券资产管理有限公司资产管理业务异常交易监控与报告实施细则》《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

看基本面，第4季度生产端数据保持强势，当前宏观基本面的特点是供给端偏强、需求端偏弱，基本面数据仍缺乏一致性转好的信号，短期抢出口对经济有短期支撑，面临2025年的关税扰动，经济对内需的依赖度会明显上升。看政策面，第3季度末政治局会议分析研究当前经济形势，部署下一步经济工作后，四季度总量政策、产业政策持续协同发力，市场持续活跃。债券市场，12月中央政治局会议及中央经济工作会议大幅增强市场对资金面宽松的预期，受市场提前定价货币宽松政策以及机构跨年抢配置带来的年末行情影响，国债收益率屡创新低，城投债延续回暖。

报告期内，管理人继续加强流动性管理，延续高评级、偏低久期的固收组合。严控净值回撤。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华安证券合赢三个月定开基金份额净值为1.0060元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.79%，同期业绩比较基准收益率为1.88%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	165,029,066.17	89.46
	其中：债券	165,029,066.17	89.46
	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	16,999,292.88	9.22
	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	2,221,089.81	1.20
8	其他资产	213,217.78	0.12
9	合计	184,462,666.64	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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	20,266,848.78	11.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	215,169.66	0.12
	其中：政策性金融债	215,169.66	0.12
4	企业债券	144,547,047.74	78.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-0.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	165,029,066.17	89.69

#### 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	184668	22铜都03	100,000	10,808,020.55	5.87
2	184644	22登建01	100,000	10,557,316.44	5.74
3	152402	20鄂交01	100,000	10,307,812.33	5.60
4	163157	20中证G2	100,000	10,307,350.69	5.60
5	185312	22邮政02	100,000	10,274,516.44	5.58

#### 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 持仓前十证券中20中证02**，发行人中信证券收到处罚（证监会公布的行政处罚决定书显示，因违反限制性规定转让中核钛白（002145 SZ）2023年非公开发行股票、信息披露违法等违法违规行为，中核钛白实控人王泽龙及朋友洪浩炜、中核钛白原董秘韩雨辰、中信证券、海通证券及中信中证合计被罚没2.35亿元）；持仓前十证券中**22邮政02**，发行人中国邮政储蓄银行收到处罚（中国邮政储蓄银行湖北省分行党委书记、行长张雪松涉嫌严重违纪违法，目前正接受中央纪委国家监委驻中国邮政集团有限公司纪检监察组纪律审查和吉林省长春市监察委员会监察调查）；持仓前十证券中**22申宏03**，发行人申万宏源证券收到处罚（根据中国证券监督管理委员会上海监管局在2024年12月27日发布的公告，申万宏源证券有限公司因存在多项合规管理问题，收到了出具警示函的处罚。）

**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	10,779.52
2	应收证券清算款	202,438.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	213,217.77

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未有处于转股期的可转换债券。

### 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

报告期期初基金份额总额	210,650,325.89
报告期期间基金总申购份额	6,015,400.31
减：报告期期间基金总赎回份额	33,756,974.80
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	182,908,751.40

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 365184.39 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

无。

## §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、华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划合同；

- 3、华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划产品资料概要更新；
- 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/>

华安证券资产管理有限公司

2025年01月21日