
华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划

2021年第2季度报告

2021年06月30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:2021年07月21日

§ 1 重要提示

--

§ 2 基金产品概况

基金简称	华安证券聚赢一年	
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	217,267,239.04份	
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	161,519,196.68份	55,748,042.36份

§ 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(2021年04月26日 - 2021年06月30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	1,718,823.89	321,057.24
2. 本期利润	3,896,551.07	734,080.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0223	0.0195
4. 期末基金资产净值	165,087,128.04	56,864,119.84
5. 期末基金份额净值	1.0221	1.0200

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
自基金合同生效起至今	2.21%	0.10%	0.73%	0.03%	1.48%	0.07%

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
自基金合同生效起至今	2.00%	0.10%	0.73%	0.03%	1.27%	0.07%

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

华安证券聚赢一年持有A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年04月26日-2021年06月30日)



华安证券聚赢一年持有B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年04月26日-2021年06月30日)



§ 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	说明

		任职日期	离任日期	从业年限	
汪志健	基金经理	2020-05-26	-	10年	-
樊艳	基金经理	2020-07-02	-	22年	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

上半年国内经济增速恢复势头良好，投资出口消费均呈现增长态势，货币政策宽松，债券市场虽有波折，但整体走出了上涨行情，权益类市场主要指数涨幅不大，但热点轮动，市场有一定财富效应。产品于4月变更为公募化运作产品，信用债配置以短久期、高流动性品种为主，上半年可转债市场迎来系统性上涨机会，产品及时进行配置，获得了一定投资收益。预计下半年国内经济仍将保持复苏态势，货币政策将逐步回归中性，信用债投资仍以短久期为主，可转债投资注重结构性机会、波段投资机会。

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1.0221元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.21%，同期业绩比较基准收益率为0.73%；截至报告期末华安

证券聚赢一年持有B基金份额净值为1.0200元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.00%，同期业绩比较基准收益率为0.73%。

§ 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	202,506,681.83	84.72
	其中：债券	202,506,681.83	84.72
	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	14,851,485.00	6.21
	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	14,698,886.01	6.15
8	其他资产	6,970,995.23	2.92
9	合计	239,028,048.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	14,529,000.00	6.55

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	128,582,559.80	57.93
5	企业短期融资券	34,981,000.00	15.76
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	24,414,122.03	11.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	202,506,681.83	91.24

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	136744	16祥源债	200,000	20,000,000.00	9.01
2	112551	17合泰01	200,000	20,000,000.00	9.01
3	136042	15渝信02	193,000	19,300,000.00	8.70
4	188169	21淮投01	150,000	15,000,000.00	6.76
5	010107	21国债(7)	145,000	14,529,000.00	6.55

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

本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

5.11.2

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,129.79
2	应收证券清算款	692,601.01
3	应收股利	-
4	应收利息	5,720,054.43
5	应收申购款	540,210.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,970,995.23

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	110072	广汇转债	2,384,200.00	1.07
2	128037	岩土转债	2,039,460.00	0.92
3	113033	利群转债	1,803,060.00	0.81
4	113519	长久转债	1,739,610.00	0.78
5	127019	国城转债	1,457,120.00	0.66
6	128116	瑞达转债	1,114,300.00	0.50
7	113530	大丰转债	1,001,765.40	0.45
8	123077	汉得转债	988,996.57	0.45
9	113584	家悦转债	886,500.00	0.40
10	127013	创维转债	824,951.61	0.37
11	113534	鼎胜转债	802,920.00	0.36
12	128044	岭南转债	763,680.00	0.34
13	113589	天创转债	759,680.00	0.34
14	128132	交建转债	719,700.00	0.32

15	113017	吉视转债	487,450.00	0.22
16	113588	润达转债	485,325.00	0.22
17	128107	交科转债	434,160.00	0.20
18	113578	全筑转债	403,520.00	0.18
19	113532	海环转债	369,553.50	0.17
20	113036	宁建转债	367,682.70	0.17
21	128124	科华转债	315,120.00	0.14
22	110068	龙净转债	301,830.00	0.14
23	127017	万青转债	279,875.00	0.13
24	113039	嘉泽转债	228,900.00	0.10
25	113525	台华转债	220,340.00	0.10
26	113535	大业转债	201,940.00	0.09
27	127016	鲁泰转债	192,442.25	0.09
28	128105	长集转债	162,465.00	0.07
29	127026	超声转债	161,430.00	0.07
30	110064	建工转债	147,975.00	0.07
31	128122	兴森转债	111,920.00	0.05
32	113563	柳药转债	107,180.00	0.05
33	128042	凯中转债	107,150.00	0.05
34	113516	苏农转债	105,770.00	0.05
35	127003	海印转债	105,370.00	0.05
36	113549	白电转债	100,016.00	0.05

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末未持有股票。

§ 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
基金合同生效日(2021年04月26日)基金份额总额	187,131,487.73	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	55,748,043.35

减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	25,612,291.05	0.99
基金合同生效日起至报告期期末 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	161,519,196.68	55,748,042.36

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§ 8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号

8.3 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

2021年07月21日