
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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	628,751,478.07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	华安证券资产管理有限公司	
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	40,983,144.45份	587,768,333.62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10月01日 - 2024年12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	244,113.82	3,358,690.58
2.本期利润	510,065.15	6,938,384.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.0118
4.期末基金资产净值	50,447,195.59	706,886,724.68
5.期末基金份额净值	1.2309	1.2027

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	1.16%	0.06%	2.51%	0.09%	-1.35%	-0.03%
过去六个月	1.70%	0.05%	3.60%	0.10%	-1.90%	-0.05%
过去一年	4.65%	0.04%	7.31%	0.08%	-2.66%	-0.04%
过去三年	15.66%	0.05%	15.56%	0.06%	0.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	23.09%	0.05%	19.53%	0.06%	3.56%	-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	1.01%	0.06%	2.51%	0.09%	-1.50%	-0.03%
过去六个月	1.40%	0.05%	3.60%	0.10%	-2.20%	-0.05%
过去一年	4.02%	0.04%	7.31%	0.08%	-3.29%	-0.04%
过去三年	13.59%	0.05%	15.56%	0.06%	-1.97%	-0.01%
自基金合同生效起至今	20.27%	0.05%	19.53%	0.06%	0.74%	-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

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-2024年12月31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-2024年12月31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	证券从业	说明

		任职日期	离任日期	年限	
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	2024-03-18	-	14年	硕士研究生。曾任职于招商证券研究所、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

2024年中国经济总体平稳、稳中有进，高质量发展扎实推进。前三季度，国内生产总值同比增长4.8%，预计全年经济增长5%左右，增速仍在全球主要经济体中位居前列。在高质量发展方面，中国经济取得了显著成效。新质生产力正引领中国产业的未来，创新驱动发展成为经济高质量发展的重要引擎，传统产业加快升级，新兴产业加快发展，未来产业加快布局，现代化产业体系建设步伐加快。在政策层面，政府采取了一系列措施推动经济发展：包括推出一揽子增量政策，提出积极的财政政策要加力提效，积极的货币政策要适度宽松，积极的社会政策要更有温度，增强获得感；通过发行超长期特别国债、多次降准降息以及创设支持资本市场的货币政策工具等方式，为经济发展提供稳定的资金支持。

全年债券市场整体走牛，在债市监管加强、政策转向预期因素作用下，出现过数次短期震荡。货币政策和财政政策的协同发力，为债券市场提供了良好的宏观环境。央行采取了较为宽松的货币政策，有效支持了经济回升向好；财政政策则通过增大财政支出规模、组合使用多种政策工具等手段，进一步拉动投资、促进消费；地方政府化债政策的出台和实施，也为债券市场带来了新的机遇和挑战。全年债券市场的流动性较为充裕；高收益率的债券品种稀缺，债券市场出现“资产荒”现象；信用品种收益率整体跟随市场基准利率走势，特别国债和地方政府专项债成为利率债市场的重要品种，对债券市场的走势产生较大影响。

全年A股市场经历了波动中的逐步复苏，各主要指数均创2021年以来最佳年度表现。市场在年初经历了一段上涨后，二三季度转为弱势，9月下旬开始快速上涨，之后高位震荡，进入板块轮动阶段。政策面成为推动市场两轮上涨的主要因素，特别是9月底以来的政策组合拳，恢复了市场信心，吸引增量资金入市，促成了市场的快速修复。

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，控制净值波动幅度，努力实现净值稳定增长。债券组合以中高等级信用债为主，适度控制债券持仓比例和组合久期；根据行情调整可转债的持仓比例和持仓结构。

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1.2309元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.16%，同期业绩比较基准收益率为2.51%；截至报告期末华安证券聚赢一年持有B基金份额净值为1.2027元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.01%，同期业绩比较基准收益率为2.51%。

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	5,739,413.13	0.75
	其中：股票	5,739,413.13	0.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	658,536,449.73	86.47
	其中：债券	658,536,449.73	86.47
	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	84,013,355.16	11.03
	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	9,285,257.72	1.22
8	其他资产	4,036,656.56	0.53
9	合计	761,611,132.30	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	1,878,911.02	0.25

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	236,300.00	0.03
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,379,062.05	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	222,640.00	0.03
J	金融业	2,022,500.06	0.27
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	-	-
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	5,739,413.13	0.76

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	1,254,367.52	0.17
2	601006	大秦铁路	111,680	757,190.40	0.10
3	601878	浙商证券	49,751	608,952.24	0.08
4	300346	南大光电	14,792	570,823.28	0.08
5	000623	吉林敖东	26,666	460,521.82	0.06
6	001965	招商公路	31,766	443,135.70	0.06
7	300303	聚飞光电	34,171	233,046.22	0.03
8	002083	孚日股份	38,659	189,042.51	0.02

9	300170	汉得信息	15,000	186,000.00	0.02
10	600487	亨通光电	10,752	185,149.44	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	180,379,457.81	23.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	423,672,566.58	55.94
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	54,484,425.34	7.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	658,536,449.73	86.95

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	019733	24国债02	500,000	50,955,561.65	6.73
2	019740	24国债09	500,000	50,632,198.63	6.69
3	019749	24国债15	500,000	50,387,082.19	6.65
4	138541	22南网02	300,000	30,367,647.95	4.01
5	019723	23国债20	280,000	28,404,615.34	3.75

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，中信证券股份有限公司于2024年1月5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》（〔2024〕4号）处罚、2024年4月12日及4月19日公司及下属公司中信中证资本分别收到中国证监会《立案告知书》（证监立案字 03720240049 号、证监立案字 0032024018号）及《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2024〕56号）、2024年4月30日公司受到中国证监会《行政处罚决定书》（〔2024〕45号）处罚、2024年5月8日广东证监局对公司出具了警示函（〔2024〕41号）、2024年8月7日受到贵州证监局（行政监管措施决定书（2024）26号文）处罚、2024年8月26日受到北京证券交易所出具的《北京证券交易所自律监管措施决定书》（北证监管执行函（2024）9号）、2024年11月8日深圳证券交易所深证函（2024）702号文、2024年12月20日受到深圳证监局行政监管措施决定书（2024）254号文处罚。

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	18,600.39
2	应收证券清算款	4,018,056.17
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	4,036,656.56
---	----	--------------

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	10,564,302.36	1.39
2	113056	重银转债	4,115,662.16	0.54
3	113021	中信转债	2,250,675.86	0.30
4	132026	G三峡EB2	2,021,769.45	0.27
5	110073	国投转债	1,732,959.66	0.23
6	113037	紫银转债	1,444,490.73	0.19
7	128129	青农转债	1,203,993.77	0.16
8	110082	宏发转债	1,170,667.17	0.15
9	127084	柳工转2	1,077,576.82	0.14
10	127087	星帅转2	897,890.30	0.12
11	123059	银信转债	837,649.91	0.11
12	127040	国泰转债	806,589.05	0.11
13	110076	华海转债	791,790.23	0.10
14	113067	燃23转债	722,532.90	0.10
15	128137	洁美转债	704,760.16	0.09
16	123120	隆华转债	677,684.25	0.09
17	113621	彤程转债	666,101.30	0.09
18	118037	上声转债	644,211.03	0.09
19	128138	侨银转债	598,270.10	0.08
20	113044	大秦转债	594,266.10	0.08
21	118013	道通转债	585,953.69	0.08
22	127038	国微转债	579,499.83	0.08
23	110084	贵燃转债	551,216.47	0.07
24	127039	北港转债	543,749.93	0.07
25	110089	兴发转债	513,124.71	0.07
26	113065	齐鲁转债	494,605.64	0.07
27	123223	九典转02	492,800.16	0.07
28	127059	永东转2	491,674.71	0.06
29	127050	麒麟转债	468,999.96	0.06

30	118006	阿拉转债	462,068.00	0.06
31	113644	艾迪转债	460,984.86	0.06
32	127046	百润转债	456,000.01	0.06
33	123113	仙乐转债	452,279.86	0.06
34	113628	晨丰转债	450,431.23	0.06
35	113024	核建转债	439,129.97	0.06
36	113634	珀莱转债	429,770.71	0.06
37	113046	金田转债	429,036.93	0.06
38	128109	楚江转债	427,140.14	0.06
39	110062	烽火转债	402,014.84	0.05
40	123122	富瀚转债	401,327.57	0.05
41	128132	交建转债	380,220.01	0.05
42	113549	白电转债	380,089.60	0.05
43	127016	鲁泰转债	370,621.64	0.05
44	123076	强力转债	360,300.05	0.05
45	113625	江山转债	353,941.07	0.05
46	113584	家悦转债	351,439.85	0.05
47	127066	科利转债	339,000.09	0.04
48	113049	长汽转债	338,361.95	0.04
49	118042	奥维转债	326,039.42	0.04
50	123231	信测转债	322,075.01	0.04
51	110090	爱迪转债	308,492.43	0.04
52	123063	大禹转债	305,200.11	0.04
53	127069	小熊转债	299,227.60	0.04
54	127026	超声转债	290,499.89	0.04
55	128135	洽洽转债	290,000.00	0.04
56	113045	环旭转债	289,907.95	0.04
57	127037	银轮转债	279,536.99	0.04
58	127100	神码转债	265,861.37	0.04
59	113061	拓普转债	251,112.19	0.03
60	123133	佩蒂转债	245,397.99	0.03
61	127092	运机转债	243,681.98	0.03
62	127018	本钢转债	240,244.08	0.03

63	123126	瑞丰转债	238,039.93	0.03
64	113675	新23转债	235,483.78	0.03
65	113530	大丰转债	232,744.74	0.03
66	127105	龙星转债	231,578.03	0.03
67	127042	嘉美转债	217,799.98	0.03
68	113640	苏利转债	216,599.95	0.03
69	123160	泰福转债	204,329.96	0.03
70	127072	博实转债	202,350.74	0.03
71	118030	睿创转债	197,784.72	0.03
72	128133	奇正转债	192,455.03	0.03
73	123239	锋工转债	190,498.56	0.03
74	123088	威唐转债	188,684.97	0.02
75	127028	英特转债	186,959.94	0.02
76	113651	松霖转债	129,162.05	0.02
77	113666	爱玛转债	126,437.40	0.02
78	123129	锦鸡转债	120,599.96	0.02
79	127020	中金转债	120,499.98	0.02
80	127041	弘亚转债	119,652.96	0.02
81	128117	道恩转债	116,915.04	0.02
82	113605	大参转债	116,005.14	0.02
83	113606	荣泰转债	113,241.51	0.01
84	113656	嘉诚转债	111,071.40	0.01
85	110085	通22转债	110,577.23	0.01
86	127027	能化转债	106,340.39	0.01
87	127024	盈峰转债	86,669.62	0.01
88	113534	鼎胜转债	62,480.01	0.01
89	128121	宏川转债	53,752.00	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	49,231,847.90	588,425,247.98
报告期期间基金总申购份额	-	33,982,673.93
减：报告期期间基金总赎回份额	8,248,703.45	34,639,588.29
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	40,983,144.45	587,768,333.62

截至报告期末，本公司从业人员及配偶持有华安证券聚赢一年持有A0.00份，华安证券聚赢一年持有B474,896.28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/>

华安证券资产管理有限公司

2025年01月21日