

---

# 华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划

## 2023年第1季度报告

### 2023年03月31日

基金管理人:华安证券股份有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2023年04月23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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年04月21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2023年01月01日起至2023年03月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华安证券睿赢一年持有
场内简称	-
基金主代码	970036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月03日
报告期末基金份额总额	350,611,257.91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=中证综合债券指数收益率×75%+沪深300指数收益率×5%+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	华安证券股份有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安证券睿赢一年持有 A	华安证券睿赢一年持有 B
下属分级基金场内简称	-	华安证券睿赢一年持有 B
下属分级基金的交易代码	970036	970037
报告期末下属分级基金的份额总额	136,177,997.96份	214,433,259.95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(2023年01月01日 - 2023年03月31日)	
	华安证券睿赢一年持有 A	华安证券睿赢一年持有 B
1.本期已实现收益	1,936,943.74	3,041,743.91
2.本期利润	4,663,958.51	7,628,951.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0327	0.0315
4.期末基金资产净值	144,695,631.79	225,814,335.62
5.期末基金份额净值	1.0625	1.0531

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

华安证券睿赢一年持有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	3.16%	0.12%	1.01%	0.04%	2.15%	0.08%
过去六个月	2.12%	0.12%	1.16%	0.06%	0.96%	0.06%
过去一年	5.13%	0.11%	2.78%	0.06%	2.35%	0.05%
自基金合同生效起至今	6.25%	0.10%	3.20%	0.07%	3.05%	0.03%

华安证券睿赢一年持有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	3.06%	0.12%	1.01%	0.04%	2.05%	0.08%
过去六个月	1.94%	0.11%	1.16%	0.06%	0.78%	0.05%
过去一年	4.70%	0.10%	2.78%	0.06%	1.92%	0.04%
自基金合同生效起至今	5.31%	0.10%	3.20%	0.07%	2.11%	0.03%

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

华安证券睿赢一年持有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12月03日-2023年03月31日)



华安证券睿赢一年持有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



## §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	2021-12-03	-	12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。
刘杰	基金经理	2021-12-03	-	12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》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

在前期经济下行较为充分后，2022年年底稳增长措施陆续出台，政策的有效性在2023年1季度逐渐反映在经济和企业盈利上，宏观经济呈现出较强的复苏状态。一季度债券市场整体先抑后扬，期限利差、信用利差均快速收窄，中短债收益率下行，长债收益率区间内震荡，央行超量续作MLF，公开市场操作保持弹性，并宣布于3月27日降准0.25个百分点，释放长期流动性约5000亿元，资金面担忧有所缓释。年初由于跨年跨节、地方债发行前置以及信贷投放超预期等因素，10年国债到期收益率在一季度上行至新的中枢水平接近2.94%，3月两会经济增长基调确定后震荡下行至2.85%附近。报告期内，管理人根据针对市场变化，结合产品运行的实际情况，在自去年11月以来的赎回潮对导致债市巨幅震荡过程中，合理调整资产组合积极应对，密切跟踪去年四季度产品的净值修复，适度提高权益资产比重，增厚了产品收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华安证券睿赢一年持有A基金份额净值为1.0625元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.16%，同期业绩比较基准收益率为1.01%；截至报告期末华安证券睿赢一年持有B基金份额净值为1.0531元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.06%，同期业绩比较基准收益率为1.01%。

#### 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	42,137,028.00	9.13
	其中：股票	42,137,028.00	9.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	406,637,236.67	88.14
	其中：债券	406,637,236.67	88.14
	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	12,427,032.38	2.69
8	其他资产	136,846.97	0.03
9	合计	461,338,144.02	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	22,767,168.00	6.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,643,910.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政	2,000,560.00	0.54

	业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,683,420.00	2.34
J	金融业	3,652,000.00	0.99
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	1,737,500.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	652,470.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	42,137,028.00	11.37

### 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	601728	中国电信	600,000	3,798,000.00	1.03
2	600552	凯盛科技	220,000	2,574,000.00	0.69
3	600050	中国联通	400,000	2,168,000.00	0.59
4	002556	辉隆股份	235,000	1,995,150.00	0.54
5	600528	中铁工业	200,000	1,900,000.00	0.51
6	603617	君禾股份	220,000	1,883,200.00	0.51
7	300692	中环环保	250,000	1,737,500.00	0.47
8	002926	华西证券	200,000	1,646,000.00	0.44
9	000063	中兴通讯	50,000	1,628,000.00	0.44
10	601901	方正证券	200,000	1,394,000.00	0.38

### 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	20,343,948.21	5.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	273,590,933.59	73.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	111,926,656.65	30.21
7	可转债（可交换债）	775,698.22	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	406,637,236.67	109.75

#### 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	163423	20天风01	250,000	25,672,979.45	6.93
2	184542	22昭阳债	200,000	20,217,104.11	5.46
3	102002239	20大足城乡MT N001	200,000	20,175,589.04	5.45
4	184586	22珞璜债	200,000	20,007,068.49	5.40
5	184578	22潜江01	200,000	19,902,789.04	5.37

#### 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

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 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 天风证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

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	45,543.92
2	应收证券清算款	15,291.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	76,011.18
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	136,846.97

#### 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	123146	中环转2	775,698.22	0.21
---	--------	------	------------	------

### 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

	华安证券睿赢一年持有 A	华安证券睿赢一年持有 B
报告期期初基金份额总额	149,567,035.77	280,678,378.77
报告期期间基金总申购份额	-	13,884,933.00
减：报告期期间基金总赎回份额	13,389,037.81	80,130,051.82
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	136,177,997.96	214,433,259.95

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 8133345.39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、华安证券睿赢1年持有期债券型集合资产管理计划合同；
- 3、华安证券睿赢1年持有期债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、华安证券睿赢1年持有期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/>

华安证券股份有限公司

2023年04月23日