

---

**华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划**

**2021 年中期报告**

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

送出日期:2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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 2021年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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2021年04月26日起至2021年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	3
1.1 重要提示	3
1.2 目录	4
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 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	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 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贵金属投资明细	44
7.9 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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划	
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	
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	
报告期末基金份额总额	217,267,239.04份	
基金合同存续期	不定期	
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	161,519,196.68份	55,748,042.36份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐玉红	龚小武
	联系电话	0551-65161962	021-52629999-212056
	电子邮箱	402072670@qq.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		95318	95561
传真		0551-65161859	021-62159217
注册地址		安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号	福州市湖东路154号
办公地址		安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码		230081	200120
法定代表人		章宏韬	吕家进

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hazq.com">http://www.hazq.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年04月26日(基金合同生效日)-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
本期已实现收益	1,718,823.89	321,057.24
本期利润	3,896,551.07	734,080.03
加权平均基金份额本期利润	0.0223	0.0195
本期加权平均净值利润率	2.20%	1.92%
本期基金份额净值增长率	2.21%	2.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	1,585,797.31	465,329.76
期末可供分配基金份额利润	0.0098	0.0083
期末基金资产净值	165,087,128.04	56,864,119.84
期末基金份额净值	1.0221	1.0200
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.21%	2.00%

#### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.78%	0.05%	0.17%	0.03%	0.61%	0.02%
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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.72%	0.05%	0.17%	0.03%	0.55%	0.02%
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份额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 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人前身是1991年成立的安徽省证券公司，安徽省第一家专营证券机构。2001年，在整合原安徽省证券公司、安徽证券交易中心的证券类资产的基础上，成立了华安证券有限责任公司，是安徽省最早设立的综合类证券公司。此后，公司又经历了综合治理和多次增资扩股，2012年整体变更为股份制公司。2016年12月6日，公司首次公开发行股票在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：600909）。公司始终坚持稳健规范的经营风格，深化“合规风控至上”的理念，建立以合规管理和动态风险监控体系为核心的风险控制体系，完善董事会、经营层、风控线及业务单元的四级风险管理架构，努力推进风险管理转型，持续加强合规风控队伍建设、机制建设和文化建设，整体运行平稳。

华安证券根据《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，截至 2021年6月30日，旗下已有3只大集合产品完成公募化改造，即“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”、“华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划”。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪志健	基金经理	2020-05-26	-	10年	2011年加入华安证券，现任资产管理总部投资经理。
樊艳	基金经理	2020-07-02	-	22年	1999年加入华安证券，现任资产管理总部投资经理。

## 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金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。本基金于4月变更为公募化运作产品，信用债投资以短久期、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，本基金及时进行配置并不断优化投资组合。

#### 4.4.2 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%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年随着疫苗接种率的上升，疫情对全球经济的抑制作用将逐渐减弱，国内经济仍将保持复苏态势，债券市场和股票市场均有一定投资机会，股票市场波动率可能会加大。本基金将把握市场机会，调整组合久期和杠杆，优化持仓结构，可转债投资将注重结构性机会和波段投资机会。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25% 以上时所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

该基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体：华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	14,169,854.45
结算备付金		529,031.56
存出保证金		18,129.79
交易性金融资产	6.4.7.2	202,506,681.83
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		202,506,681.83
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	6.4.7.3	14,851,485.00
应收证券清算款		692,601.01
应收利息	6.4.7.4	5,720,054.43
应收股利		-
应收申购款		540,210.00
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		239,028,048.07
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-

交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		5,999,680.00
应付证券清算款		10,001,884.93
应付赎回款		910,895.28
应付管理人报酬		27,203.18
应付托管费		14,573.31
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.5	27,939.48
应交税费		26,547.70
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	68,076.31
负债合计		17,076,800.19
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.7	217,267,239.04
未分配利润	6.4.7.8	4,684,008.84
所有者权益合计		221,951,247.88
负债和所有者权益总计		239,028,048.07

## 6.2 利润表

会计主体：华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年04月26日（基金合同 生效日）至2021年06月30 日
<b>一、收入</b>		4,825,313.03
1. 利息收入		2,030,200.84

其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,540.13
债券利息收入		1,697,542.45
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		315,118.26
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		144,303.63
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	144,303.63
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	2,590,749.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	60,058.59
<b>减：二、费用</b>		194,681.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	41,486.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	31,241.55
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.13	44,425.17
5. 利息支出		21,832.22
其中：卖出回购金融资产支出		21,832.22
6. 税金及附加		5,864.10
7. 其他费用	6.4.7.14	49,832.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,630,631.10
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,630,631.10

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	230,667,539.91	-	230,667,539.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,630,631.10	4,630,631.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-13,400,300.87	53,377.74	-13,346,923.13
其中：1. 基金申购款	58,908,155.48	381,997.46	59,290,152.94
2. 基金赎回款	-72,308,456.35	-328,619.72	-72,637,076.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	217,267,239.04	4,684,008.84	221,951,247.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

章宏韬

龚胜昔

许琼

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划由华安理财5号日日赢集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。原集合计划为限定性集合资产管理计划，自2012年5月16日起开始推广，并于2013年5月24日结束，于2013年5月28日成立，于2013年6月5日取得中国证券业协会《关于华安证券股份有限公司发起设立华安理财5号日日赢集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函【2013】590号）。

本集合计划于2021年4月25日完成变更征询工作，于2021年4月26日生效。本集合计划自合同生效日起存续期不得超过3年，自合同生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。

本集合计划为契约型开放式，其中A类计划份额只开放赎回，不开放申购；B类计划份额每个开放日开放申购，但本集合计划对B类计划份额均设置一年的最短持有期限。在最短持有期限内，B类计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），B类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。

本集合计划的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券（含超短期融资券）、公司债、可交换债券、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本集合可参与一级市场新股申购或增发新股，还可持有因可转债转股、可交换债券换股所形成的股票，因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票等资产。

本集合计划的业绩比较基准为：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%

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本集合计划2021年06月30日的财务状况以及自2021年01月01日至2021年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历1月1日至12月31日止。本财务报表的实际编制期间自2021年01月01日至2021年06月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的债券投资、股票投资等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划计价持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具（主要为权证投资）等按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人可根据具体情况与计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

同时满足下列条件的，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的计划份额总额在扣除损益平准金分摊部分后所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于本计划申购确认日及本计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括本计划转换所引起的转入本计划的实收基金增加和转出本计划的实收基金减少。

每份计划份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的计划份额总额。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在集合计划份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

收入是本集合计划在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集合计划、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

基金红利收入按基金公司宣告的分红比例计算的金额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算本集合计划持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按本计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本计划投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为本计划费用计入当年损益。

本计划的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认。

本计划的其他费用如不影响估值日本计划份额净值小数点后第四位，发生时直接计入本集合计划损益；如果影响本集合计划份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入本集合计划损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一计划份额享有同等的分配权；当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；分配收益后每份额净值不能低于发行面值；分红后集合计划总份额不得超过最高规模限制；在符合上述分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为12次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的10%，若本集合计划合同生效不满3个月可不进行收益分配。

分配方案由管理人拟定，包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由托管人核实后确定，通过管理人网站和推广网点通告委托人。

本集合计划的收益分配包括现金分红和红利转份额两种方式。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红。若投资者选择现金红利转换为相应类别集合计划份额进行再投资的，再投资份额以红利再投日为登记日，且需满足相应类别持有期的规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

本报告期间本集合计划无需说明的外币交易。

#### 6.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期间本集合计划无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 增值税及附加税金

根据财政部和国家税务总局《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号），自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。此外，应按照增值税的7%计算城市建设维护税，按增值税的3%计算教育费附加，地方教育附加应按照本集合计划管理人所在地税务机关规定的比例计算。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 所得税

本集合计划非所得税纳税主体。资产管理计划份额持有人从资产管理计划中获得的各项收益，由资产管理计划份额持有人根据国家的法律法规，自行申报并履行纳税义务。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	14,169,854.45	
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计	14,169,854.45	

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	164,915,931.86	167,525,681.83	2,609,749.97
	银行间市场	35,000,000.00	34,981,000.00	-19,000.00
	合计	199,915,931.86	202,506,681.83	2,590,749.97
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	199,915,931.86	202,506,681.83	2,590,749.97	

#### 6.4.7.3 买入返售金融资产

##### 6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,851,485.00	-
银行间市场	-	-
合计	14,851,485.00	-

#### 6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	799.95
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	246.10
应收债券利息	5,697,536.93
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	21,471.45
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	5,720,054.43

#### 6.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	25,936.98
银行间市场应付交易费用	2,002.50
合计	27,939.48

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,836.31
预提费用	66,240.00
合计	68,076.31

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 华安证券聚赢一年持有A

金额单位：人民币元

项目 (华安证券聚赢一年持有A)	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	230,667,539.91	230,667,539.91
本期申购	3,160,112.13	3,160,112.13
本期赎回（以“-”号填列）	-72,308,455.36	-72,308,455.36
本期末	161,519,196.68	161,519,196.68

##### 6.4.7.7.2 华安证券聚赢一年持有B

金额单位：人民币元

项目 (华安证券聚赢一年持有B)	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	55,748,043.35	55,748,043.35
本期赎回（以“-”号填列）	-0.99	-0.99
本期末	55,748,042.36	55,748,042.36

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 华安证券聚赢一年持有A

单位：人民币元

项目 (华安证券聚赢一年持有A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,718,823.89	2,177,727.18	3,896,551.07
本期基金份额交易产生的变动数	-133,026.58	-195,593.13	-328,619.71
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-133,026.58	-195,593.13	-328,619.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,585,797.31	1,982,134.05	3,567,931.36

#### 6.4.7.8.2 华安证券聚赢一年持有B

单位：人民币元

项目 (华安证券聚赢一年持有B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	321,057.24	413,022.79	734,080.03
本期基金份额交易产生的变动数	144,272.52	237,724.93	381,997.45
其中：基金申购款	144,272.52	237,724.94	381,997.46
基金赎回款	-	-0.01	-0.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	465,329.76	650,747.72	1,116,077.48

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	14,923.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,616.45
其他	-
合计	17,540.13

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	144,303.63
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	144,303.63

##### 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	52,167,416.67
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	50,758,972.15

减：应收利息总额	1,264,140.89
买卖债券差价收入	144,303.63

#### 6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	2,590,749.97
——股票投资	-
——债券投资	2,590,749.97
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,590,749.97

#### 6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
基金赎回费收入	60,058.59
合计	60,058.59

#### 6.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
交易所市场交易费用	43,225.17
银行间市场交易费用	1,200.00
合计	44,425.17

#### 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
审计费用	2,640.00
信息披露费	39,600.00
汇划手续费	1,065.00
帐户维护费	6,527.50
合计	49,832.50

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本报告期末本集合计划不存在需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本集合计划报告报出日，本集合计划不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安证券股份有限公司	集合计划的管理人和销售机构
兴业银行股份有限公司	集合计划的托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
华安证券股份有限 公司	192,056,506.79	100.00%

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华安证券股份有限 公司	515,839,261.00	100.00%

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日			
	当期佣金	占 当 期	期末应付佣金余额	占 期 末

		佣金总量的比例		应付佣金总额的比例
华安证券股份有限公司	65,003.89	100.00%	25,936.98	100.00%

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	41,486.39
其中：支付销售机构的客户维护费	-

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,241.55

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期间本集合计划未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期间本集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，除管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年04月26日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	14,169,854.45	14,923.68

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间本集合计划未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本集合计划未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本集合计划未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本集合计划未持有银行间市场债券正回购。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本集合计划未持有交易所市场债券正回购。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划为公募混合型集合资产管理计划。可能投资股票资产，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险，在市场大幅上涨时也不能保证集合计划净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。本集合计划投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资。

本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划的基金管理人从事风险管理的主要目的是在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本集合计划的基金管理人对于金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险发生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

集合计划的管理人建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的集合计划财产和集合计划管理人的财产相互独立，对所管理的不同集合计划分别管理，分别记账，进行证券投资。

公司全面风险管理的组织体系由董事会、监事会、经理层、各部门、分支机构及子公司构成，各自履行全面风险管理的职责分工，建立多层次、相互衔接、有效制衡的运行机制。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，对公司全面风险管理的有效性承担最终责任；审议批准公司全面风险管理的基本制度；根据公司发展战略，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额，以实现对公司风险的总量控制；审议公司定期风险评估报告，提出风险管理意见；建立与首席风险官的直接沟通机制。董事会下设风险控制委员会，负责提出公司经营管理过程中防范风险的指导意见；审阅公司风险管理制度及策略；定期对公司风险管理状况、政策和程序进行评价，确保其与公司的资本实力、管理水平相一致。

公司监事会对公司董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况进行监督检查并督促整改。

公司经理层负责经营管理中的风险管理，负责组织制定风险管理制度；建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确各部门在风险管理中的职责分工，并督促各部门的履职；组织制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，并确保其有效落实；组织评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，并积极解决风险管理中存在的问题；组织建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；组织推进风险管理方面信息技术系统和数据质量控制机制的建设。

公司风险管理部在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，履行具体的风险管理职责。稽核部负责协助审计和评价重大风险问题。计划财务部负责流动性风险管理工作。合规管理部负责合规风险和洗钱风险管理工作。办公室负责声誉风险管理工作。

公司各部门、分支机构及子公司对各自所对接的业务或所管理的领域履行相应的风险管理职能。各单位负责人为本单位风险管理工作的第一责任人，承担风险管理的直接责任。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

集合计划的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

本集合计划债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日
A-1	19,994,000.00
A-1以下	-
未评级	14,987,000.00

合计	34,981,000.00
----	---------------

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本集合计划均未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本集合计划均未持有短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日
AAA	19,370,559.80
AAA以下	133,626,122.03
未评级	14,529,000.00
合计	167,525,681.83

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本集合计划未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本集合计划未持有长期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括集合计划出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

在本集合计划出现巨额赎回情形下，集合计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本集合计划单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，集合计划管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的股票、债券和货币市场工具等，同时

本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2021年06 月30日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	
银行存款	14,169,854.45	-	-	-	-	14,169,854.45
结算备付金	529,031.56	-	-	-	-	529,031.56
存出保证金	18,129.79	-	-	-	-	18,129.79
交易性金融资产	18,529,000.00	56,290,000.00	34,078,929.80	85,254,838.76	8,353,913.27	202,506,681.83
买入返售金融资产	14,850,000.00	-	-	-	-	14,850,000.00
资产总计	48,096,015.80	56,290,000.00	34,078,929.80	85,254,838.76	8,353,913.27	232,073,697.63
负债	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	6,000,000.00	-	-	-	-	6,000,000.00
负债总计	6,000,000.00	-	-	-	-	6,000,000.00
流动性净额	42,096,015.80	56,290,000.00	34,078,929.80	85,254,838.76	8,353,913.27	226,073,697.63

### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划的组

合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划的管理人管理的其他集合计划共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本集合计划与由本计划的管理人管理的其他开放式集合计划共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式集合计划及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本集合计划与由本集合计划的管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于 2021年06月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过15%。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划投资种类包括交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本集合计划的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	14,169,854.45	-	-	-	-	-	14,169,854.45
结算备	529,031.56	-	-	-	-	-	529,031.56

华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划 2021 年中期报告

付金							
存出保证金	18,129.79	-	-	-	-	-	18,129.79
交易性金融资产	20,520,310.00	56,290,000.00	34,078,929.80	85,035,768.76	6,581,673.27	-	202,506,681.83
买入返售金融资产	14,851,485.00	-	-	-	-	-	14,851,485.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	692,601.01	692,601.01
应收利息	-	-	-	-	-	5,720,054.43	5,720,054.43
应收申购款	-	-	-	-	-	540,210.00	540,210.00
资产总计	50,088,810.80	56,290,000.00	34,078,929.80	85,035,768.76	6,581,673.27	6,952,865.44	239,028,048.07
负债							
卖出回购金融资产款	5,999,680.00	-	-	-	-	-	5,999,680.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,001,884.93	10,001,884.93
应付赎回款	-	-	-	-	-	910,895.28	910,895.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,203.18	27,203.18
应付托管费	-	-	-	-	-	14,573.31	14,573.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	27,939.48	27,939.48
应交税费	-	-	-	-	-	26,547.70	26,547.70
其他负债	-	-	-	-	-	68,076.31	68,076.31
负债总计	5,999,680.00	0.00	0.00	0.00	0.00	11,077,120.19	17,076,800.19
利率敏感度缺口	44,089,130.80	56,290,000.00	34,078,929.80	85,035,768.76	6,581,673.27	-4,124,254.75	221,951,247.88

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末 2021年06月30日
市场利率上升25个基点	-800,804.20
市场利率下降25个基点	800,804.20

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	202,506,681.83	91.24
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	202,506,681.83	91.24

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为167,525,681.83元，属于第二层次的余额为34,981,000.00，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	6,970,995.23	2.92
9	合计	239,028,048.07	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	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

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体未出现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。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,970,995.23

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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

### 7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安证券聚赢一年持有A	1,163	138,881.51	1,068,349.28	0.66%	160,450,847.40	99.34%
华安证券聚赢一年持有B	743	75,031.01	0.00	0.00%	55,748,042.36	100.00%
合计	1,906	113,991.21	1,068,349.28	0.49%	216,198,889.76	99.51%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安证券聚赢一年持有A	4,772,246.06	2.95%
	华安证券聚赢一年持有B	2,060,009.65	3.70%
	合计	6,832,255.71	3.14%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安证券聚赢一年持有A	0
	华安证券聚赢一年持有B	0

	持有B	
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华安证券聚赢一年持有A	0
	华安证券聚赢一年持有B	0
	合计	0

### § 9 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	-	-
本报告期期末基金份额总额	161, 519, 196. 68	55, 748, 042. 36

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期未改聘会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	2	-	-	65,003.86	100.00%	-

##### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华安证券	105,544,606.75	100.00%	263,330,000.00	100.00%	-	-	-	-

#### 10.8 其他重大事件

无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号。

### 12.3 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  
二〇二一年八月三十一日