

---

# 华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划

2023年第4季度报告

2023年12月31日

基金管理人:华安证券股份有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2024年01月22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。

基金托管中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于2024年01月18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10月01日起至2023年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华安证券月月红现金
基金主代码	970173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年06月27日
报告期末基金份额总额	1,865,608,283.90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	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	华安证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司

## §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10月01日 - 2023年12月31日）
1.本期已实现收益	6,729,040.39
2.本期利润	6,729,040.39
3.期末基金资产净值	1,865,608,283.90

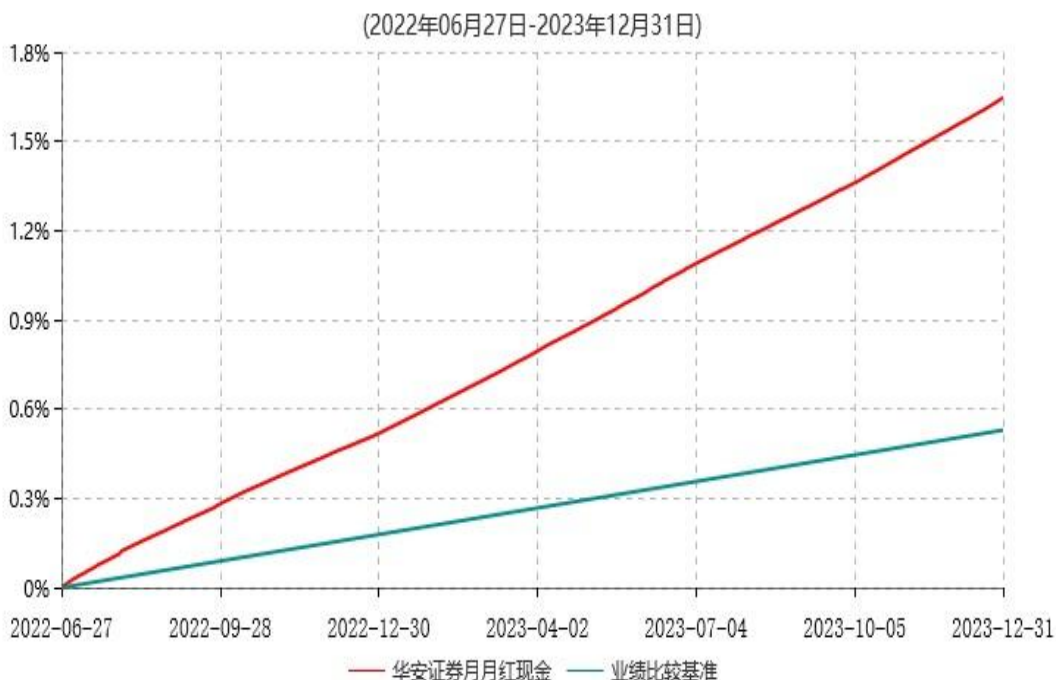
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.2970%	0.0002%	0.0878%	0.0000%	0.2092%	0.0002%
过去六个月	0.5634%	0.0003%	0.1758%	0.0000%	0.3876%	0.0003%
过去一年	1.1197%	0.0003%	0.3494%	0.0000%	0.7703%	0.0003%
自基金合同生效起至今	1.6467%	0.0005%	0.5293%	0.0000%	1.1174%	0.0005%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划累计净值收益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		
樊艳	基金经理	2022-06-27	-	19年	樊艳，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。
张钰	基金经理	2022-06-27	-	7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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

本报告期内，产品运作总原则是根据产品规模变动对产品资产结构、组合久期进行动态调整，在确保平稳运行的基础上实现收益最大化。

政策方面，央行四季度超额续做MLF投放流动性，但未调整MLF价格。10月以来地方省市特殊再融资债券、中央一万亿特别国债等政府债密集发行，10年国债收益率冲高至2.72%，后受降息预期影响回调至2.61%点位。在银行息差不断收窄，且面临化债、承

接政府债、支持实体等任务背景下，年内第三轮存款降息落地。短期限债券市场方面，央行数次提及“防空转”，银行间资金利率中枢上行，中短期高等级债券收益率上行，1年期国股存单价格11月份超2.6%。12月防空转效果初步显现，银行间杠杆率降低，同时随着12月美联储连续第三次暂停加息，宽松预期下外汇压力缓解，资金面转松，12月中旬短债收益率大幅下行。

具体投资上，产品首先保证存单、1年内利率债、信用债等标的的基本仓位以确保产品基础收益。同时，产品根据各类资金、债券资产轮动趋势进行择时配置。11月份产品积极配置存单及短债资产，适当增加了债券比例并拉长久期。12月份，受季末因素影响，产品规模较11月份下行，产品适当卖出前期配置的债券以降低久期并确保产品流动性。总体来看，报告期内产品根据市场资产价格波动趋势，组合及时调整了资产结构及组合久期，在保证流动性的基础上尽量提高了产品收益率。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华安证券月月红现金基金份额净值为1.000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.2970%，同期业绩比较基准收益率为0.0878%。

#### 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	固定收益投资	1,671,502,552.67	84.92
	其中：债券	1,671,502,552.67	84.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-4,721.93	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	256,754,158.14	13.04
4	其他资产	40,127,837.34	2.04
5	合计	1,968,379,826.22	100.00

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	1.56
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	100,012,241.27	5.36
	其中：买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内，未发生债券正回购的资金余额超过本基金资产净值的20%的情况。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内，未发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	26.62	5.36
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	5.89	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	22.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	14.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

5	120天(含)—397天(含)	34.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.25	5.36

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内，未发生投资组合平均剩余存期违规超过240天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	14,181,157.47	0.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	152,663,275.00	8.18
	其中：政策性金融债	152,663,275.00	8.18
4	企业债券	245,344,642.95	13.15
5	企业短期融资券	252,753,663.94	13.55
6	中期票据	412,609,405.36	22.12
7	同业存单	593,950,407.95	31.84
8	其他	-	-
9	合计	1,671,502,552.67	89.60
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190208	19国开08	500,000	51,194,866.65	2.74
2	190409	19农发09	500,000	50,986,040.65	2.73
3	230304	23进出04	500,000	50,482,367.70	2.71
4	112309107	23浦发银行C D107	500,000	49,503,360.44	2.65
5	112310234	23兴业银行C D234	500,000	49,345,921.50	2.65
6	102100437	21人才安居M	400,000	41,315,355.96	2.21



		TN001			
7	102100471	21苏国资MT N001	400,000	41,257,728.07	2.21
8	102100525	21苏国资MT N002	400,000	41,240,793.50	2.21
9	102100481	21宁波通商M TN001	400,000	41,204,097.58	2.21
10	175961	21国联G1	400,000	41,196,058.83	2.21

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0204%
报告期内偏离度的最低值	-0.0816%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0436%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内，产品未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内，未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金计划采用摊余成本法估值，并采用计算暂估收益率的方法每日进行估值，并按照下列方法确认各类金融工具的暂估收益：

(1) 银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益，直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际分配的收益率；分红期内遇银行存款提前解付的，按调整后利率预提收益，同时冲减前期已经预提的收益；

(2) 回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益；

(3) 债券以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日预提收益。

5.9.2 基金投资前十名证券的发行主体中，国开行受到交易商协会以不正当方式影响市场价格的调查，受到国家金融监督管理总局的行政处罚。农发行受到国家金融监督管理总局的行政处罚。进出口行受到国家金融监督管理总局的行政处罚，受到交易商协会自律调查。浦发银行受到国家金融监督管理总局的行政处罚。兴业银行受到国家金融监督管理总局的行政处罚，受到交易商协会自律调查。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	108,549.65
2	应收证券清算款	40,019,287.69
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	40,127,837.34

### 5.9.4 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	1,873,639,877.32
报告期期间基金总申购份额	14,004,441,035.15
报告期期间基金总赎回份额	14,012,472,628.57
报告期期末基金份额总额	1,865,608,283.90

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0份。

## §7 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

2023-10-12 华安证券股份有限公司关于旗下部分大集合产品投资科创板股票及相关风险提示的公告

2023-11-18 华安证券股份有限公司关于旗下大集合产品投资非公开发行股票的公告

2023-12-28 华安证券股份有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告

2023-12-29 关于华安证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的提示性公告

## §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、华安证券华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、华安证券华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划托管协议；
- 4、华安证券华安证券月月红现金管理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/>

华安证券股份有限公司

2024年01月22日