

**华安资管湘赢 6M002 号集合资产管理计划**  
**2026 年第 2 季度报告**  
**2026 年 6 月 30 日**

**资产管理人:**华安证券资产管理有限公司

**资产托管人:**招商银行股份有限公司

## § 1 重要提示

本报告依据《中华人民共和国证券法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关规定制作。本报告由管理人华安证券资产管理有限公司编制，报告书的内容由管理人华安证券资产管理有限公司负责解释。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。本报告书的内容由管理人负责解释。

本报告期自2026年04月01日起至2026年06月30日止。

## § 2 资产管理计划产品概况

|                |               |
|----------------|---------------|
| 资产管理计划简称       | 华安资管湘赢6M002号  |
| 资产管理计划编码       | BB2772        |
| 资产管理计划运作方式     | 契约型开放式        |
| 资产管理计划合同生效日    | 2024年11月15日   |
| 报告期末资产管理计划份额总额 | 26,523,491.66 |
| 资产管理计划合同存续期    | 10年           |
| 资产管理人          | 华安证券资产管理有限公司  |
| 资产托管人          | 招商银行股份有限公司    |

## § 3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标           | 报告期（2026年4月1日 - 2026年6月30日） |
|------------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益          | -50,294.37                  |
| 本期利润             | 571,004.67                  |
| 加权平均资产管理计划份额本期利润 | 0.0215                      |
| 期末资产管理计划资产净值     | 27,720,527.97               |
| 期末资产管理计划份额净值     | 1.0451                      |

### 3.2 自资产管理计划合同生效以来资产管理计划累计净值增长率变动

华安资管湘赢6M002号累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年11月15日-2026年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

| 姓名  | 职务   | 任本资产管理计划的<br>投资经理期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                            |
|-----|------|---------------------|------|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      | 任职日期                | 离任日期 |            |                                                                                                               |
| 仇中群 | 投资经理 | 2024-11-15          | -    | 16年        | 中国科学技术大学金融工程硕士，证券从业经历14年，历任东吴证券研究所研究员、资产管理部研究员、固定收益总部高级经理、浙商证券债券投行部高级业务副总监，拥有多年的债券一级和二级市场经验。现任华安证券资产管理总部投资经理。 |
| 刘阳  | 投资经理 | 2024-11-15          | -    | 7年         | 财务管理硕士，女，2014年毕业于上海财经大                                                                                        |

|  |  |  |  |  |                                                                                   |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 学财务管理专业。先后就职于公募基金、保险公司、华安证券资产管理部，熟悉市场各类资产交易，擅长短久期、高流动性固定收益产品管理，有较强的投资管理能力和风险控制意识。 |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------|

#### 4.2 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

#### 4.3 报告期内资产管理计划的投资报告

#### 4.4 报告期内资产管理计划的投资表现

报告期间，本资产管理计划净值季度增长率为2.10%。

#### 4.5 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

本资产管理计划本报告期内未有利润分配。

#### 4.6 产品运用杠杆情况

本资产管理计划本报告期末，因从事证券交易所、银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元。

#### 4.7 托管人履职报告

详见附件。

#### 4.8 资产管理计划投资经理变更情况

本报告期内本资产管理计划投资经理没有发生变更。

#### 4.9 报告期内本资产管理计划管理人履职报告

本次履职报告综合了管理人全面自查和风控合规部日常监控、重点检查的结果。风控合规部作为公司层面的风险管理和合规管理部门,严格按照中国证监会资产管理业务风险监管标准,监管法律法规以及公司相关制度规定和合同约定,开展公司风险管理及合规管理工作,采用流程审核、指标监控、风险查询、业务检查等多种方式对资产管理计划的管理运作进行风险控制,定期或不定期对业务授权、投资交易及合规性进行全面审查。

在本报告期内,管理人对本计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度的要求进行。本计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求;交易行为合法合规,未出现异常交易、操纵市场的现象;未发现内幕交易的情况;本计划持有的证券符合规定的比例要求;相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。本报告中的内容由管理人负责解释。

#### 4.10 资产管理计划关联方

| 关联方名称        | 与本基金的关系    |
|--------------|------------|
| 华安证券股份有限公司   | 管理人股东      |
| 华安证券资产管理有限公司 | 资产管理计划的管理人 |
| 招商银行股份有限公司   | 资产管理计划托管人  |

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)         | 占资产管理计划资产总值的比例(%) |
|----|--------|---------------|-------------------|
| 1  | 权益投资   | -             | -                 |
|    | 其中:股票  | -             | -                 |
| 2  | 基金投资   | 2,954,780.80  | 10.63             |
| 3  | 固定收益投资 | 22,004,871.91 | 79.16             |
|    | 其中:债券  | 22,004,871.91 | 79.16             |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
|   | 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      | 2,838,050.03  | 10.21  |
| 8 | 其他资产              | 143.67        | 0.00   |
| 9 | 合计                | 27,797,846.41 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本资产管理计划本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本资产管理计划本报告期末未持有港股通股票。

## 5.3 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)       | 占资产管理计划资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -                |
| 2  | 央行票据      | -             | -                |
| 3  | 金融债券      | -             | -                |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -                |
| 4  | 企业债券      | 16,700,646.57 | 60.25            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -                |
| 6  | 中期票据      | -             | -                |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -                |
| 8  | 同业存单      | -             | -                |
| 9  | 公司债       | 5,304,225.34  | 19.13            |
| 10 | 地方政府债     | -             | -                |

|    |        |               |       |
|----|--------|---------------|-------|
| 11 | 定向工具   | -             | -     |
| 12 | 私募债    | -             | -     |
| 13 | 资产支持证券 | -             | -     |
| 14 | 其他     | -             | -     |
| 15 | 合计     | 22,004,871.91 | 79.38 |

## § 6 资产管理计划份额变动

单位：份

|                               |               |
|-------------------------------|---------------|
| 报告期期初资产管理计划份额总额               | 26,523,491.66 |
| 报告期期间资产管理计划总申购份额              | -             |
| 减：报告期期间资产管理计划总赎回份额            | -             |
| 报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             |
| 报告期期末资产管理计划份额总额               | 26,523,491.66 |

注：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 0 份，控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划份额 0 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

注：基金管理人未有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

注：管理人未运用固有资金投资本资产管理计划。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、本报告期内本资产管理计划未发生重大关联交易。
- 2、本计划管理人在本报告期内没有发生与本计划相关的诉讼事项。
- 3、本计划管理人办公地址未发生变更。

## § 9 业绩报酬及费用的计提和支付

|     | 报告期间计提金额（元） | 报告期间支付金额（元） |
|-----|-------------|-------------|
| 管理费 | 34,277.56   | 34,206.01   |

|      |          |          |
|------|----------|----------|
| 托管费  | 2,056.69 | 2,060.01 |
| 业绩报酬 | —        | —        |

## 9.1 两费及业绩报酬说明

### 1、管理费

资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的【0.50%】年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年管理费率为【0.50%】

H为每日应计提的资产管理计划管理费

E为前一日资产管理计划资产净值

### 2、托管费

资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的【0.03%】年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年托管费率为【0.03%】

H为每日应计提的资产管理计划托管费

E为前一日资产管理计划资产净值

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1. 管理人业务资格批复、营业执照
2. 华安资管湘赢6M002号集合资产管理计划说明书
3. 华安资管湘赢6M002号集合资产管理计划风险揭示书
4. 华安资管湘赢6M002号集合资产管理计划资产管理合同
5. 华安资管湘赢6M002号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议一

### 10.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号。

### 10.3 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：<https://www.hazq.com/zg/home/index.shtml>

华安证券资产管理有限公司

2026年7月31日



## 免责声明

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供特定客户资产管理业务客户参考。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或删改，否则将构成侵权。

投资有风险，请理性选择。资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托资产一定盈利，也不保证最低收益。本委托资产的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的其他资产的业绩也不构成本委托资产业绩表现的保证。本特定客户资产管理业务的具体情况以该产品法律文件为准，请详细阅读。