

华安证券湘赢 36M006 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:兴业银行股份有限公司

§ 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	华安证券湘赢36M006号
资产管理计划编码	BB2766
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4月3日
报告期末资产管理计划份额总额	121,639,000.00
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	兴业银行股份有限公司

§ 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	1,625,556.83
本期利润	-550,610.76
加权平均资产管理计划份额本期利润	-0.0045
期末资产管理计划资产净值	125,191,201.17
期末资产管理计划份额净值	1.0292

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

华安证券湘赢36M006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04月03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 投资经理期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁晓雨	投资经理	2024-04-03	-	11年	女，金融学硕士。先后在外资券商、华安证券研究所从事投研工作，具有成熟的投资理念，深刻理解市场运行率，具备严谨的逻辑思维能力和灵敏的市场应变能力。
仇中群	投资经理	2024-04-03	-	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。
--	--	--	--	--	--

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1.01%。

4.5 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

本资产管理计划于2026年04月08日分配利润6,446,867.00元，单位分红金额0.0530元。

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
兴业银行股份有限公司	资产管理计划托管人
华安证券股份有限公司	原管理人、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

§ 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	4,580,361.66	3.60
	其中:股票	4,580,361.66	3.60
2	基金投资	36,299,401.28	28.55
3	固定收益投资	76,228,364.45	59.95
	其中:债券	76,228,364.45	59.95
	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	9,005,797.39	7.08
8	其他资产	1,042,970.56	0.82
9	合计	127,156,895.34	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,349,972.66	1.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	808,956.19	0.65
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	859,093.37	0.69
J	金融业	562,339.44	0.45
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	4,580,361.66	3.66

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	10,036,254.79	8.02
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,429,871.23	6.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,372,720.55	8.29
7	可转债（可交换债）	2,845,726.65	2.27
8	同业存单	-	-
9	公司债	44,543,791.23	35.58
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	76,228,364.45	60.89

§ 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	121,639,000.00
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	121,639,000.00

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	249,443.78	256,637.39
托管费	9,354.16	9,623.93
业绩报酬	1,800,665.69	—

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【0.80%】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【0.80%】

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. 华安证券湘赢36M006号集合资产管理计划说明书
3. 华安证券湘赢36M006号集合资产管理计划风险揭示书
4. 华安证券湘赢36M006号集合资产管理计划资产管理合同

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>



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。