

华鑫证券鑫鹏可转债1号集合资产管理计划

2021年第2季度报告

第一节 重要提示

本报告依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“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》（以下简称“管理规定”）及其他有关规定制作。

集合计划管理人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责任。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划的资管合同和招募说明书。

集合计划托管人于 2021 年 7 月 22 日复核了本报告中的财务指标和投资组合报告等内容，认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

第二节 资产管理计划概况

资产管理计划名称	华鑫证券鑫鹏可转债1号集合资产管理计划
成立日期	2021年03月08日
成立规模	15,040,044.45份
报告期末资产管理计划份额总额	21,469,741.44份
资产管理计划合同存续期	10年
资产管理人	华鑫证券有限责任公司
资产托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

第三节 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年04月01日 - 2021年06月30日）
本期已实现收益	272,620.77
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0609
期末资产管理计划资产净值	22,766,698.32
期末资产管理计划份额净值	1.0604

第四节 管理人报告

（一）投资经理简介

杨镭，投资经理，中国科学技术大学概率论与数理统计学学士、中山大学岭南学院管理学硕士，超过十年金融、证券从业经验，曾先后就职于平安人寿保险、平安证券、华鑫证券等多家金融机构，长期从事投资研究等相关工作，历任定向产品投资经理、集合产品投资经理。

杨靖磊，法国蒙彼利埃大学博士，工学硕士，清华大学汽车安全与节能国家重点实验室成员，国家 863 重点课题研究参与者。5 年科技行业从业经验，4 年证券研究经验，在可转债、类固收领域 2 年研究经验，热衷于从规则出发挖掘可转债投资机会。曾任华鑫证券研究发展部研究员，现任华鑫证券资产管理部投资经理。

（二）报告期内集合计划业绩表现

截止 2021 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值为 1.0604 元，累计单位净值为 1.0604 元，净值季度增长率 5.90%。

（三）投资经理工作报告

第一部分：市场回顾与操作情况

2021 年上半年全球经济在强势复苏，美国 GDP 产出已经快恢复到疫情前的水平；失业率回落至 6%以下。二季度我国经济平稳向好，整体工业生产仍然处于景气区间，服务业生产指数也维持较高水平，内需基本平稳，外需依然有韧性。

二季度，随着国内经济形势向好，叠加全球货币宽松的大环境，市场主要指数回升，成交量增加。6 月末，上证综合指数收于 3591.20 点，比 3 月末上涨了 4.34%；深证成份指数收 15161.70 点，比 3 月末上涨了 10.04%；创业板指数收于 3477.18 点，比 3 月末上涨了 26.05%。

二季度，本计划继续挖掘优秀基金管理人，加大权益类基金配置比例，通过优化配置结构，分散组合波动风险。

报告期内，本产品未运用杠杆进行投资。

第二部分：市场展望和投资计划

国家把建设股票市场提高了前所未有的高度，通过完善资本市场的机制，引导各类资金积极参与股票市场大方向并没有改变。下半年，我们将继续密切关注各个基金管理人的投资运作情况，持续的对组合进行优化，力争取得更好的投资业绩。

第五节 投资组合报告

（一）报告期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
1	权益投资	202,160.00	0.88
	其中：股票	202,160.00	0.88
2	基金投资	765,660.37	3.35
3	固定收益投资	16,950,325.01	74.15

	其中：债券	16,950,325.01	74.15
	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	3,700,018.50	16.19
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和券商保证金合计	1,183,799.56	5.18
8	其他资产	56,697.16	0.25
9	合计	22,858,660.60	100.00

1、报告期末按市值占净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	600859	王府井	7,000	202,160.00	0.89

2、报告期末按市值占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)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	128014	永东转债	14,148	1,479,979.84	6.50
2	128123	国光转债	13,505	1,376,078.47	6.04
3	113519	长久转债	11,070	1,132,793.10	4.98
4	113037	紫银转债	10,000	1,031,300.00	4.53
5	128042	凯中转债	8,510	911,820.97	4.01

3、报告期末按市值占净值比例大小排序的前五名基金投资明细

序号	名称	类型	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	大摩双利增强 C	开放式基金	765,660.37	3.36

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)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	128014	永东转债	1,479,979.84	6.50
2	128123	国光转债	1,376,078.47	6.04
3	113519	长久转债	1,132,793.10	4.98
4	113037	紫银转债	1,031,300.00	4.53

5	128042	凯中转债	911,820.97	4.01
6	113542	好客转债	691,911.00	3.04
7	123081	精研转债	643,620.00	2.83
8	123076	强力转债	604,950.00	2.66
9	123068	弘信转债	542,820.00	2.38
10	123075	贝斯转债	542,180.00	2.38
11	113599	嘉友转债	536,500.00	2.36
12	128035	大族转债	442,128.00	1.94
13	113549	白电转债	421,120.00	1.85
14	127027	靖远转债	399,972.00	1.76
15	128120	联诚转债	387,693.40	1.70
16	123087	明电转债	384,655.57	1.69
17	110045	海澜转债	334,440.00	1.47
18	128133	奇正转债	329,670.00	1.45
19	128032	双环转债	313,160.00	1.38
20	113591	胜达转债	311,880.00	1.37
21	128127	文科转债	303,979.80	1.34
22	123071	天能转债	232,516.00	1.02
23	113570	百达转债	105,060.00	0.46

4、报告期末本资产管理计划投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末未持有股指期货。

其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	56,697.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	56,697.16

(二) 投资组合报告附注：

(1) 报告期内集合计划投资的前五名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2) 集合计划投资的证券中，没有超出集合计划合同规定的可投资证券范围。

（三）集合计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）的计提基准、计提方式和支付方式

管理费按照前一日集合计划净值的 1.50% 年费率按日计提，按季支付；托管费按照前一日集合计划净值的 0.02% 年费率按日计提，按季支付。业绩报酬计提基准为年化收益率 7%，计提比例为 20%。业绩报酬计提及分配日为份额分红日、份额退出日以及计划终止日。

（四）资产管理计划投资收益分配情况

2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间未进行收益分配。

第六节 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	15,040,044.45
报告期期间资产管理计划总申购份额	6,429,696.99
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	21,469,741.44

第七节 关于风险管理与内部控制制度在报告期内执行情况

本报告期内，管理人严格遵守相关法律法规、公司制度的要求，产品运作严格按照产品合同约定进行，不存在任何损害投资者利益的行为。本报告期内，本计划运作合法合规，管理人严格遵守法律法规和公司制度，对资产管理业务的投资交易行为进行监控、分析和核查，监督投资交易的过程和结果，及时向客户披露本计划的运作管理情况，并严格遵守法律法规和公司制度关于投资决策、公平交易、会计核算、风险控制、合规管理等方面的要求，控制业务风险，维护客户合法权益。

第八节 重大事项揭示

本报告期内无重大事项。

第九节 其他事项

截至2021年6月30日，本公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合资产管理计划共计1,287,512.04 份。

第十节 备查文件目录

（一）备案文件目录

- 1、《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划说明书》；
- 3、《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划风险揭示书》
- 4、《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划托管协议》；
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

投资者可与本集合计划管理人办公时间预约查询，或者登陆集合计划管理人网站 <http://cfsc.com.cn> 查阅，还可以拨打本公司客服电话（95323）查询相关信息。



