

# 华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划 2021 年第四季度资产管理报告

管理人：华金证券股份有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 27 日



## 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》、《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。

本报告由资产管理计划管理人编制。管理人保证本报告所载资料真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

资产管理计划托管人兴业银行股份有限公司于2022年1月18日复核了本报告中的财务指标和投资组合报告等财务资料内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读资产管理计划资产管理合同。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期为2021年10月1日起，至2021年12月31日止。

本报告中的内容由管理人负责解释。

## 第二节 资产管理计划概况

名称	华金证券鸿盈1号集合资产管理计划
类型	固定收益类
成立日	2020年11月11日
成立份额总额	12,660,474.00份
报告期末份额总额	51,561,574.75份
管理人	华金证券股份有限公司
托管人	兴业银行股份有限公司

## 第三节 主要财务指标和资产管理计划净值表现

### 一、主要财务指标（单位：人民币元）

项目	报告期（2021年10月1日-2021年12月31日）
本期利润	3,626,206.93
每份额本期利润	0.0703
期末资产净值	58,071,335.30

期末每份额净值	1.1263
期末每份额累计净值	1.2707

## 二、报告期内收益分配情况

本报告期内，本资产管理计划未进行收益分配。

## 三、费用计提基准、计提方式和支付方式

序号	费用类型	费率	计提基准	计提及支付方式
1	管理费	1.00%	资产管理计划资产净值	按日计提，按季支付
2	托管费	0.02%	资产管理计划资产净值	按日计提，按季支付
3	业绩报酬	/	业绩报酬计提基准为 6%： 期间份额年化收益率超过业绩报酬计提基准，业绩报酬提取比例为 30%	计提日为收益分配日、份额退出日和终止日

## 第四节 管理人履职报告

### 一、业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本资产管理计划单位净值为 1.1263 元，累计单位净值 1.2707 元。报告期内，本资产管理计划的净值增长率为 9.84%。

### 二、投资经理简介

本资产管理计划投资经理为林碧波、魏源先生，简历如下：

林碧波先生：

10 年证券从业经历。历任信达证券资产管理事业部量化分析师、投资经理、投资总监。林碧波先生聚焦固收+、量化对冲投资领域，对风险套利、条款博弈等事件驱动另类投资策略、特定收益增强策略有丰富经验，对时间价值、波动性有深入的理解，投资风格擅长结合投资标的的基本面、波动性进行低风险投资。林碧波先生所管理的产品受到市场和客户的认可，由《证券时报》主办的中国财富管理机构君鼎奖评选中，信达证券睿丰 3 号集合资产管理计划连续两年分别荣获 2019(第十三届)“十大创新资管/基金产品君鼎奖”及 2020(第十四届)“绝对收益产品君鼎奖”。林碧波先生所在投研团队受到渠道及同业机构认可，与工行、邮储等国有大行等建立了合作关系，在 2020(第十四届)中国财富管理机构君鼎

奖评选中，信达证券资产管理事业部量化投资团队获得 2020 中国量化投资团队君鼎奖的荣誉。

魏源先生：

华金证券资管总部高级投资经理。美国罗格斯大学金融工程硕士，浙江大学应用数学系学士。6 年证券从业经验，2 年投资管理经验，曾任信达证券资产管理事业部量化研究员、投资助理、投资经理。在固收+、量化投资、衍生品套利、事件套利等方面有较深理解。曾担任信达睿丰系列产品、信达睿诚系列产品、信达睿鸿系列产品投资经理。

### 三、报告期内投资策略和运作分析

#### 1. 投资策略回顾

四季度在货币政策降准、降息的影响下，债市利率持续下行，股票市场延续结构化行情，转债市场继续反弹上行。行业方面，军工、传媒、电子、通信等行业四季度表现较好，石化、煤炭、钢铁等行业表现相对较弱，新能源车、光伏等高景气产业链四季度宽幅震荡，反映了市场在挖掘景气度向好的低位板块，产品积极把握市场风格变化，提前布局低位且行业景气度边际向好的相关标的。转债方面中证转债指数在经历三季度回调后震荡走高，在 12 月初两个交易日指数有幅度相对较大的回落。产品在市场短暂的回调中有效控制回撤，整体上四季度产品净值反弹并创出新高。转债市场新债发行、老债退市节奏均维持在较快水平，有利于产品投资逻辑的实现。

#### 2. 投资展望

转债市场当前估值水平处在历史相对高分位，对择券提出了更高的要求，产品后续运作中将更加关注正股质地，精选正股基本面优秀、转债估值合理的标的，坚持转股逻辑投资。我们认为债券市场流动性仍将保持稳健充裕，转债市场债底坚实，后续将继续把握行情轮动中转股逻辑的收益实现。同时在投研的过程中不断提升新券定价能力，把握新券上市较好的配置机会。另外在 2017 年发行且未退市的转债将陆续进入回售期，存在条款博弈的价值，积极参与此类投资机会，或为产品贡献额外的收益来源。

### 四、重大事项披露

#### 1. 报告期内投资经理变更情况

本报告期内，本资产管理计划未发生投资经理变更。

## 2. 报告期内关联交易情况

本报告期内，本资产管理计划未发生关联交易。

## 3. 期末计划管理人的从业人员及其配偶、关联方持有资产管理计划的情况

截至 2021 年 12 月 31 日，管理人的从业人员及其配偶、关联方持有本资产管理计划份额中，机构投资者 1 名，持有份额：2,393,776.18 份；个人投资者 6 名，合计持有份额：3,202,453.03 份。

## 4. 其他需披露的重大事项

本报告期内，本资产管理计划无其他需披露的重大事项。

## 五、其他履职情况说明

1. 本报告期内，管理人以诚实信用、审慎尽责的原则管理和运用委托资产，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，保证所管理的委托资产与自有资产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。

2. 本报告期内，管理人按照《企业会计准则》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定进行会计核算，与托管人定期对账，及时准确办理委托资产的清算交收。

3. 本报告期内，管理人依据合同约定的时间和方式，向投资者提供管理报告等资料，说明报告期内委托资产的配置状况、价值变动、收益分配等情况。

## 第五节 托管人履职报告

具体内容详见《华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划托管报告》。

## 第六节 投资组合报告

### 一、期末资产组合情况

资产类别	市值（元）	占总资产比例（%）
1. 权益类资产	0.00	0.00
2. 基金类资产	10,219,673.86	17.38
3. 固定收益类资产	40,379,301.10	68.69
其中：债券	40,379,301.10	68.69
资产支持证券	0.00	0.00
4. 买入返售金融资产	0.00	0.00
5. 银行存款及清算备付金合计	7,905,412.46	13.45
6. 其他资产	280,268.35	0.48
总资产合计	58,784,655.77	100.00

### 二、期末市值占计划资产净值前五名证券明细

序号	证券代码	证券名称	市值（元）	市值/净值（%）
1	511880	银华日利	6,007,380.00	10.34
2	511990	华宝添益	2,504,201.09	4.31
3	149305	20广开Y1	2,030,600.00	3.50
4	511660	建信添益	1,708,092.77	2.94
5	113024	核建转债	1,595,484.00	2.75

### 三、非标准化债权类资产投资情况

本资产管理计划不涉及非标准化债权类资产投资。

### 四、投资组合报告附注

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第七节 报告期内计划份额变动

单位：份

期初份额总额	21,333,784.54
红利再投资份额	0.00
报告期内赎回份额	4,060,140.00
报告期内申购份额	34,287,930.21
期末份额总额	51,561,574.75

## 第八节 备查文件及查阅方式

### 一、备查文件

1. 华金证券鸿盈1号集合资产管理计划资产管理合同及其补充协议；
2. 华金证券鸿盈1号集合资产管理计划说明书；
3. 华金证券鸿盈1号集合资产管理计划风险揭示书；
4. 报告期内华金证券鸿盈1号集合资产管理计划在指定网站上披露的各项公告；
5. 中国证监会要求的其他文件。

### 二、查询方式

网址：<http://www.huajinsc.cn/>

信息披露电话：956011

华金证券股份有限公司

2022年1月24日