

## 华闻期货华云欣盛一号集合资产管理计划 2021 年第 4 季度报告



### 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	华闻期货华云欣盛一号集合资产管理计划
基金编码	SLW806
基金管理人	华闻期货有限公司
基金托管人（如有）	中信证券股份有限公司
投资顾问（如有）	深圳雪杉基金管理有限公司
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020 年 11 月 11 日
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	1, 184. 282345
投资目标	本资产管理计划在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
投资策略	<p>本计划拟主要采取以下策略：</p> <p>本产品在对国内外宏观环境充分研究判断的基础上，以货币政策、债券供需为核心，基础策略为投资于利率品种及信用品种，结合债券市场具体投资品种的风格轮换，自上而下地决定组合久期及杠杆比例、动态调整各类金融资产配比，结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析，优化债券组合的期限结构和类属配置，灵活配置国债、金融债、产业债、城投债等债券品种的持仓；并时刻关注利率债、高收益债等投资品种波段操作所提供的资本利得机会。在严控风险的前提下，通过深入分析各类债券等固定收益金融工具的投资价值，力争实现资产的稳健增值。</p> <p>（1）债券配置策略：本计划重点在一级市场或二级市场选择资质较好、流动性较好的 AA 或 AA+级交易所或银行间上市的企业债券、公司债券和中短期债务融资工具进行投资。</p> <p>（2）息差策略：在基本面不确定性较大，市场缺乏趋势性机会时，组合收益来源从资本利得转变为息差收益，缩短组合久期，以防御为主，选择短久期高收益信用债或者存单进行配置，获取较为确定的息差收益。</p> <p>（3）骑乘策略：当债券收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的将是债券价格的走高，而这一期间债券的涨幅将会高于其他期间，即可以获得丰厚的价差收益即资本利得收入。</p>
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本计划为风险等级（R3）的资产管理计划。

中信证券股份有限公司 仅对本报告中的内容负责

## 2、基金净值表现

阶段	净值增长率 (%)	净值增长率标准差 (%)	业绩比较基准收益率 (%)	业绩比较基准收益率标准差 (%)
当季	1.28			
自基金合同生效起至今	5.91			

备注：

√无分级 □二级基金 □三级基金

## 3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2021年10月1日至2021年12月31日(元)
本期已实现收益	155,025.15
本期利润	155,025.15
期末基金净资产	12,543,173.95
报告期末单位净值	1.0591

备注：

## 4、投资组合情况

### 4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目	金额	
现金类资产	1,919.42	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	
	其中：优先股	
	其他股权类投资	
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	
新三板投资	新三板挂牌企业投资	
境内证券投资规模	结算备付金	1,297,228.92
	存出保证金	
	股票投资	
	债券投资	10,942,469
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	
	其中：信用债	10,942,469
	资产支持证券	
基金投资（公募基金）		

中信中证印章(如有)  
仅对本报告中的财务数据负责

	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	
	买入返售金融资产	
	其他证券类标的	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	
	信托计划投资	
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
	保险资产管理计划投资	
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	
	私募基金产品投资	
	未在协会备案的合伙企业份额	
另类投资	另类投资	
境内债权类投资	银行委托贷款规模	
	信托贷款	
	应收账款投资	
	各类受（收）益权投资	
	票据（承兑汇票等）投资	
	其他债权投资	
境外投资	境外投资	
其他资产	其他资产	应收利息#339,371.85;
基金负债情况	债券回购总额	
	融资、融券总额	
	其中：融券总额	
	银行借款总额	
	其他融资总额	

#### 4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00

F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	<b>合计</b>	0.00	0.00

备注：

#### 4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
合计		

备注：

#### 5、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	1,069.90092
报告期期间基金总申购份额	114.381425
减：报告期期间基金总赎回份额	0
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	1,184.282345

备注：

#### 6、管理人报告

--

信息披露报告是否经托管机构复核：是

# 华闻期货华云欣盛一号集合资产管理计划 2021年4季度托管人履职报告

本托管人依据华闻期货有限公司与我司签署的《资产管理合同》(以下简称《管理合同》)及相关法律法规履行托管责任,现将本报告期间托管情况报告如下:

一、本托管人在报告期间,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在损害资产委托人利益的行为。

(一)本托管人以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责,安全保管托管专户内委托资产;非依法规定、行政法规或管理合同约定,不得擅自动用或处分托管资产;

(二)根据管理合同约定,执行管理人划款指令,办理托管账户项下资金往来;

(三)妥善保管与委托资产有关的会计账册、凭证、合同等资料;

(四)根据《管理合同》规定,对资产管理人运用投资组合资产进行投资的行为进行了监督;

(五)为投资组合单独设立托管专户,与自有账户以及所托管的其他非本投资组合的托管专户分别保管,实行了严格的分账管理,维护投资组合资产的独立性。

二、依据基金管理人或委托的第三方机构提供的标的产品(包括但不限于场内及场外标的产品)的交易确认、行情和权益变动等信息进行估值或减值计量(其中数据的真实性、准确性、完整性、有效性和标的价值的公允性由基金管理人或委托的第三方机构负责);依据基金管理人提供的税务信息和纳税判定标准去识别并核算本基金运营过程中发生的增值税应税行为(其中税务信息和纳税判定标准的真实性、准确性、完整性以及适用性由基金管理人负责),根据《管理合同》、《证券投资基金法》及有关法律法规的规定;本计划托管人复核了管理人的2021年4季度报告中的财务数据,其中财务指标、净值表现、收益分配情况(如有)、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容与托管人计算的数据一致。

托管人 中信证券股份有限公司



二零二二年一月七日