

# 华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合 资产管理计划 2022 年第一季度 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南京分行

报告送出日期：2022 年 4 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南京分行于2022年4月20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2022年1月1日起，至2022年3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       | 华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划 |
| 类型       | 固定收益类                  |
| 成立日      | 2021年2月8日              |
| 成立份额总额   | 13,471,426.09份         |
| 报告期末份额总额 | 176,364,628.74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南京分行         |

## 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（2022年1月1日-2022年3月31日） |
|---------|---------------------------|
| 本期利润    | -6,883,631.58             |
| 每份额本期利润 | -0.0390                   |
| 期末资产净值  | 182,055,553.28            |

|           |        |
|-----------|--------|
| 期末每份额净值   | 1.0323 |
| 期末每份额累计净值 | 1.2087 |

## 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  | 1.20% | 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 6%和 8%:<br>若期间份额年化收益率超过业绩报酬计提基准,超过 6% 小于等于 8%的部分,业绩报酬提取比例为 25%;若超过 8% 部分业绩报酬提取比例为 40% | 业绩报酬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 2022 年 3 月 31 日,本资产管理计划单位净值为 1.0323 元,累计单位净值 1.2087 元。报告期内,本资产管理计划的净值增长率为-5.01%。

### 二、投资经理简介

本资产管理计划投资经理为林碧波、魏源、董立彬先生,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。

董立彬先生：

7 年证券投资研究经历。中央财经大学应用统计硕士、数理经济与数理金融学士。2014 年起从事日本十年期国债期货投资交易工作，2016 年起于信达证券资产管理部协助投资主办进行投资研究与交易工作，包括且不限于减持策略研究、产品波段交易、产品业绩归因。擅长使用数量化工具分析投资机会，对短线市场波动与市场情绪变化敏感。

### 三、报告期内投资策略和运作分析

#### 1. 投资策略回顾

2022 年一季度转债市场经历较为剧烈的波动。一月份权益市场下跌使得转债估值水平进一步被动抬升，2 月中旬转债迎来较为快速的杀估值行情，为期半个月的情绪修复后，由于外围地缘政治因素、海外市场加息预期及国内新冠疫情反复的多重因素叠加，权益及转债市场再次迎来快速下跌，整个一季度来看，中证转债指数最大回撤约 11%。对于市场的快速下跌，我们认为应该保持冷静客观，在操作层面，鸿盈系列产品整体仓位维持相对稳定，预留部分仓位用于布局下跌后性价比凸显的标的投资。

#### 2. 投资展望

经历一季度的下跌后，转债整体估值有所回落，目前接近 2021 年 8 月市场估值水平，依然难言估值低点。估值依旧偏高的市场环境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，本资产管理计划投资经理未发生变更。

##### 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 2022 年 3 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：17,682,917.70 份；个人投资者 6 名，合计持有份额：3,874,766.39 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《华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划2022年第1季度托管人报告》。

## 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        | 46,291,025.22  | 25.37     |
| 3. 固定收益类资产      | 120,330,498.72 | 65.95     |
| 其中：债券           | 120,330,498.72 | 65.95     |
| 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 | 5,590,932.54   | 3.06      |
| 6. 其他资产         | 10,230,986.16  | 5.61      |
| 总资产合计           | 182,443,442.64 | 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  | 511660    | 建信添益           | 22,517,998.42 | 12.37    |
| 2  | 511990    | 华宝添益           | 16,730,326.80 | 9.19     |
| 3  | 102103282 | 21 青岛国信 MTN004 | 10,013,000.00 | 5.50     |
| 4  | 511880    | 银华日利           | 7,042,700.00  | 3.87     |
| 5  | 136942    | 18 青城 Y2       | 6,342,000.00  | 3.48     |

### 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

1. 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。

2. 本报告中资产组合情况及前五大证券市值统计中债券投资市值未包含应计利息。

## 第七节 报告期内计划份额变动

单位：份

|          |                |
|----------|----------------|
| 期初份额总额   | 59,790,012.51  |
| 红利再投资份额  | 0.00           |
| 报告期间赎回份额 | 7,496,812.50   |
| 报告期间申购份额 | 124,071,428.73 |
| 期末份额总额   | 176,364,628.74 |

## 第八节 备查文件及查阅方式

### 一、备查文件

1. 华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合资产管理计划资产管理合同及其补充协议；
2. 华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合资产管理计划说明书；
3. 华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合资产管理计划风险揭示书；
4. 报告期内华金证券股份有限公司鸿盈 3 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4月25日



