
华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人:华创证券有限责任公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年7月1日起至2022年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华创证券创享一年持有期
基金主代码	970104
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月24日
报告期末基金份额总额	258,756,947.18份
投资目标	本集合计划主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制集合计划资产净值波动的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在股票、债券和银行存款等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。具体策略：大类资产配置策略、债券组合管理策略、股票投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+中证500指数收益率*10%。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益率低于股票型集合计划和混合型集合计划，高

	于货币市场集合计划。	
基金管理人	华创证券有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华创证券创享一年持有期A	华创证券创享一年持有期B
下属分级基金的交易代码	970103	970104
报告期末下属分级基金的份额总额	97,587,269.49份	161,169,677.69份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年07月01日 - 2022年09月30日)	
	华创证券创享一年持有期A	华创证券创享一年持有期B
1. 本期已实现收益	-213,959.32	478,163.40
2. 本期利润	-996,081.93	-365,039.91
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0101	-0.0023
4. 期末基金资产净值	156,214,478.30	162,989,169.29
5. 期末基金份额净值	1.6008	1.0113

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华创证券创享一年持有期A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.04%	0.11%	-1.96%	0.20%	1.92%	-0.09%

过去六个月	1.10%	0.09%	-0.26%	0.26%	1.36%	-0.17%
自基金合同生效起至今	1.85%	0.09%	-2.47%	0.26%	4.32%	-0.17%

华创证券创享一年持有期B净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.20%	0.11%	-1.96%	0.20%	1.76%	-0.09%
过去六个月	0.79%	0.09%	-0.26%	0.26%	1.05%	-0.17%
自基金合同生效起至今	1.13%	0.09%	-2.24%	0.27%	3.37%	-0.18%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华创证券创享一年持有期A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年12月24日-2022年09月30日)



注：本基金合同生效日至本报告期末不满一年。

华创证券创享一年持有期B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金合同生效日至本报告期末不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖帅	投资经理	2021-12-24	-	6年	肖帅女士，证券执业编号S0360120040012，已取得基金从业资格，证书编号：A20190703006421，中国科学院大学管理学院硕士，7年投资交易经验。2013年6月-2015年5月任职于包商银行股份有限公司资产管理部，从事理财产品的资产配置及投资交易工作，2015年6月加入华创证券有限责任公司，任固定收益投资经理，无兼职机构。最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

注：本基金投资经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年三季度，债券市场在资金宽松、降息等利好消息中下行，9月在稳增长措施出台、资金边际收紧及海外加息的影响下急速上行，10年国债整体仍在2.6%-2.85%的区间波动。期限利差方面，三季度国债期限利差窄幅震荡，其中7月中旬在资金面宽松的带动下，短端利率走势明显强于长端，导致期限利差被动走阔；8月中旬，随着降息利好落地，市场对经济增长预期有所减弱，带动长端下行，期限利差压缩。信用利差方面，在风险偏好压缩及资金欠配的背景下，三季度高等级信用债继续压缩，尤其是中长端幅度最为明显，其中5年AAA中票信用利差从季初的66bp压缩至42bp，叠加久期效应，整体资本利得收入明显。

转债方面，三季度，受经济预期较弱及海外加息、流动性收缩的影响，权益市场大幅下跌，转债也随之下行。8月后，转股溢价率也有所压缩。成交量方面，三季度随着权益市场下跌及悲观预期发酵，转债成交量来到了历史低位。

权益方面，三季度市场反弹后高位回落，各类风格资产均出现明显下跌，风险偏好下行带来的估值收缩是主要驱动。截至三季度末，沪深300下跌22.6%，中证500下跌22.3%，创业板指数下跌29.6%。

权益方面，本基金基于对市场的判断，自9月初开始大幅降低权益仓位，有效控制了产品在9月市场下跌中面临的回撤风险。债券方面，账户主要以中高等级信用债持有为主，获取稳定的票息收入。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华创证券创享一年持有期A基金份额净值为1.6008元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.04%，同期业绩比较基准收益率为-1.96%；截至报告期末华创证券创享一年持有期B基金份额净值为1.0113元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.20%，同期业绩比较基准收益率为-1.96%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,775,522.00	3.29
	其中：股票	11,775,522.00	3.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	333,306,274.65	93.05
	其中：债券	333,306,274.65	93.05
	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	7,980,734.71	2.23
	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	4,672,219.86	1.30
8	其他资产	474,356.23	0.13
9	合计	358,209,107.45	100.00

注：本基金报告期末资产组合情况的金额包含投资利息收入。

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境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	410,200.00	0.13
B	采矿业	624,955.00	0.20
C	制造业	5,553,066.00	1.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	4,827,301.00	1.51
K	房地产业	360,000.00	0.11
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	11,775,522.00	3.69

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	10,000	1,692,300.00	0.53
2	600036	招商银行	50,000	1,682,500.00	0.53

3	601318	中国平安	27,000	1,122,660.00	0.35
4	601166	兴业银行	60,000	999,000.00	0.31
5	300122	智飞生物	9,000	777,870.00	0.24
6	002415	海康威视	20,000	608,400.00	0.19
7	300059	东方财富	30,000	528,600.00	0.17
8	600887	伊利股份	14,000	461,720.00	0.14
9	600030	中信证券	24,000	418,080.00	0.13
10	300498	温氏股份	20,000	410,200.00	0.13

5.4 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)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,282,701.37	6.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	131,386,690.41	41.16
	其中：政策性金融债	50,491,315.07	15.82
4	企业债券	66,975,734.79	20.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	114,290,895.89	35.81
7	可转债（可交换债）	370,252.19	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	333,306,274.65	104.42

注：本基金报告期末按债券品种分类的债券投资组合的公允价值数据包含投资利息收入。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产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)	占基金资产净值比例(%)
1	220210	22国开10	500,000	50,491,315.07	15.82
2	102100446	21濂溪城投MTN001	200,000	21,488,657.53	6.73
3	102102246	21晋江城投MTN003	200,000	20,975,490.41	6.57

4	152420	20天长债	200,000	20,867,698.63	6.54
5	102103166	21诚通控股MTN007	200,000	20,815,046.58	6.52

注：本基金报告期末前五名债券明细的公允价值数据包括投资利息收入。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划参与国债期货投资用于管理债券组合的久期、流动性和风险水平，以套期保值为主要目的。本集合计划构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金本报告期末投资前十名股票中未发生超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	74,215.95
2	应收证券清算款	299,440.28
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100,700.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	474,356.23

5.11.4 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）	占基金资产净值比例（%）
1	113053	隆22转债	370,252.19	0.12

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	华创证券创享一年持有期A	华创证券创享一年持有期B
报告期期初基金份额总额	124,425,361.52	149,976,270.35
报告期期间基金总申购份额	-	11,193,407.34
减：报告期期间基金总赎回份额	26,838,092.03	-
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	97,587,269.49	161,169,677.69

§ 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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2022-8-31 华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划2022年中期报告
- 2、2022-9-21 华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划2022年开放日常申购、赎回业务公告

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 资产管理合同、托管协议、招募说明书；
2. 定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告；
3. 集合计划份额净值；
4. 集合计划销售机构及联系方式；
5. 其他重要资料。

9.2 存放地点

北京市西城区锦什坊街26号恒奥中心C座3A华创证券

9.3 查阅方式

本招募说明书存放在集合计划管理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

投资者还可以直接登录集合计划管理人的网站查阅和下载招募说明书。

管理人网站[网址：www.hczq.com] [客服电话：95513]

华创证券有限责任公司

2022年10月26日