

华鑫证券东家5号集合资产管理计划

2022年第1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 2022 年 4 月 26 日复核了本报告中的财务指标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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 3 月 31 日止。

第二节 资产管理计划计划概况

资产管理计划简称	东家5号
资产管理计划编码	D60093
资产管理计划运作方式	契约型开放式
资产管理计划合同生效日	2020年02月21日
报告期末资产管理计划份额总额	113,810,719.80份
资产管理计划合同存续期	5年
资产管理人	华鑫证券有限责任公司
资产托管人	宁波银行股份有限公司

第三节 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年01月01日 - 2022年03月31日）
本期已实现收益	1,311,986.11
本期利润	1,607,699.61
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0167
期末资产管理计划资产净值	114,108,074.72
期末资产管理计划份额净值	1.0026

第四节 管理人报告

（一）投资经理简介

袁馨，投资经理，南京大学金融学学士、北京大学金融学硕士，曾先后就职于天风证券股份有限公司、东证融汇证券资产管理有限公司(原东北证券股份有限公司上海分公司)，历任自营交易、投资经理助理、投资主办人。

赵睿，投资经理，利物浦大学金融数学学士，伦敦卡斯商学院数理金融与交易硕士，曾先后任职于浙江温州鹿城农商银行和华融证券固定收益部门，历任银行自营、资管投资经理和券商资管投资主办人，长期从事一线固收交易与投资工作，具有资深固定收益投资经验。

（二）报告期内集合计划业绩表现

截止 2022 年 3 月 31 日，本集合计划单位净值为 1.0026 元，累计单位净值为 1.1275 元，净值季度增长率 1.65%。

（三）投资经理工作报告

2022 年一季度债券市场先扬后抑。年初在降息及对经济基本面悲观预期推动下，10 年期国债活跃券收益率一度向下突破 2.7%。春节之后，多重因素带动债市回调，10 年期国债活跃券收益率突破 2.85%，一是 1-2 月金融、经济数据明显走强，对基本面的悲观预期扭转；二是市场对地产政策边际放松的预期，带来稳增长预期信心增强。后随着 3 月海外俄乌局势紧张和全球公共卫生事件再度发酵，市场避险情绪再度上升，利率有所下行。一季度末多数品种信用利差走阔，以高等级长品种为甚。主要是两个原因：一、债市进入调整，投资者调整组合久期，短品种更受青睐；二是股债双杀后，广义基金大量赎回带来的被动抛压。

对于国内市场后续走势，人民币汇率相对稳定，出口量降价升，依然强势。随着欧洲 PMI 下行，若名义价格上行动能趋缓，那么外需回落需要内需来支撑 5.5% 的经济增长大目标。中美名义利差缩窄加大央行维护币值稳定任务的重要程度，但从中美实际 GDP 增速差和中美实际利率差的角度来看，维护保持增速差以及近期仍相对稳定实际利率差下，后续货币政策必然继续迎来宽松。

整体来看，市场后续对基本面的预期趋于一致，基于货币政策宽松的大判断下，落地时间不确定会带来各种时间对市场情绪的扰动。后续会以息差策略为主，增配短久期信用债，并降低组合久期，减少市场波动冲击。

一季度末产品融资业务规模占比为 17.54%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	134,114,403.29	99.49
	其中：债券	134,114,403.29	99.49
	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	-	-
	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	690,426.97	0.51
8	其他资产	-	-
9	合计	134,804,830.26	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

本报告期末未持有股票

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	197974	21龙游01	200,000	19,496,849.32	17.09
2	032100531	21荔城国投PPN001	100,000	10,729,276.71	9.40
3	167249	20宿新01	100,000	10,713,013.70	9.39
4	167514	20弋阳02	100,000	10,613,315.07	9.30
5	151810	19盐高03	100,000	10,588,136.99	9.28

3、报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券

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	127006	敖东转债	10,955.33	0.01

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	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	-

(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

本集合计划管理费按照前一日集合计划净值的 0.50% 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。本集合计划收取业绩报酬，计提基准以管理人每次开放前公告为准，计提比例为 60%，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

2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间红利再投金额 967,120.64 元，现金分红金额 217,029.25 元。

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	94,215,924.30
报告期期间资产管理计划总申购份额	32,234,665.49
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	12,639,869.99
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	113,810,719.80
-----------------	----------------

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 2022 年 3 月 31 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 1,153,603.22 份。

第十节 备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划合同》
- 2、《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划说明书》
- 3、《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划风险揭示书》
- 4、《华鑫证券东家 5 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。

华鑫证券有限责任公司

2022年4月28日