

# 华林证券满天星 1 号

## 集合资产管理计划 2021 年第二季度报告

计划管理人：华林证券股份有限公司

计划托管人：宁波银行股份有限公司

报告期间：2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日



## 重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人已复核了本报告。本报告未经审计。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

托管人宁波银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，复核了本报告中的主要财务指标、会计报表和投资组合报告等内容。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告期起止时间：2021年4月1日至2021年6月30日。

## 一、集合计划简介

名称：华林证券满天星1号集合资产管理计划

简称：“满天星1号”

类型：集合计划

管理人：华林证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

成立日：2016年9月29日

成立规模：73,896,888.44份

存续期：10年

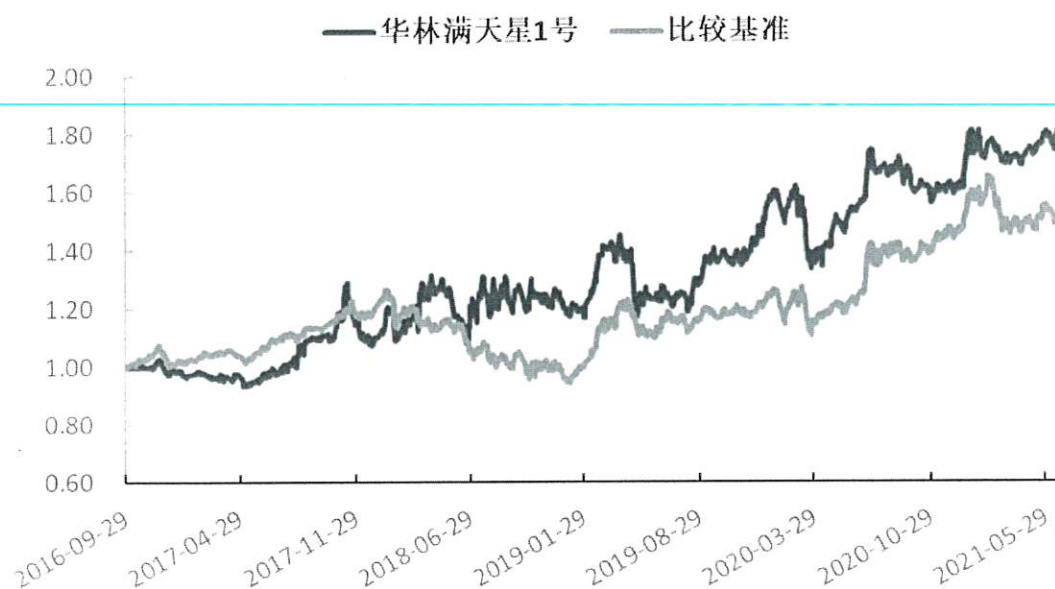
## 二、主要财务指标

### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

项目	主要财务指标	2021年4月1日至2021年6月30日
1	集合计划本期利润	1,854,571.64
2	本期已实现收益	1,395,631.7
3	期末集合计划资产净值	25,959,030.65
4	期末集合计划单位净值	1.6551
5	期末集合计划累计单位净值	1.8301
6	本期集合计划净值增长率	7.58%
7	集合计划累计净值增长率	91.27%

### (二) 集合计划累计净值历史走势图



备注：比较基准为沪深300指数收益率\*0.8+中债-国债总财富指数\*0.2

## 三、集合计划管理人报告

### (一) 业绩表现

截止到2021年6月30日，本集合计划单位净值为1.6551元，

累计单位净值为 1.8301 元，集合计划累计净值增长率为 91.27%。

## （二）投资主办人简介

隋江波先生，中国人民银行研究生部金融学硕士，10 年投资研究经验，历任诺安基金行业研究员、淡水泉投资股票投资经理。现任华林证券资产管理事业部投资主办人，对投资组合管理有深入研究。

王文静女士，南京大学金融工程硕士、数学系学士，FRM。10 年金融从业经验，曾在银行、券商从事金融市场及产品的研究，2016 年加入华林证券资产管理事业部，从事宏观量化及模型搭建、大类资产配置投资研究工作。

## （三）投资主办人工作报告

2021 年二季度市场呈现强势震荡走势，大小指数在强势震荡中开始明显分化，创指科创等为代表的小指数反弹显著，而上证沪深 300 等大指数相对疲软。结构上看，由于基金发行节奏放缓增量资金入市放缓，去年机构明显偏好的稳健永续增长类个股表现较弱，周期股则受制于商品价格及货币政策压制跌幅较大，部分新能源半导体医美华为等赛道股主题股极度活跃，市场冰火两重天，轮动较快，局部的赚钱效应与亏钱效应都比较明显。从操作来看，基金仓位在 5-7 成之间跟随市场震荡而波动，跌则加仓，涨则减仓，并对组合进行了优化调整。从持仓结构来看，减持了部分前期涨幅较大的个股，获利了结已经兑现的事件驱动与主题个股，对部分处于底部但有可能出现明显变化的股票加大了配置力度，组合以自上而下与自下而上结合的个股为主，对于行业、风格的偏离度不大，整体处于均衡状态。基于“变

化” 仍旧是组合构建的基础。

展望下半年，权益市场可能仍将延续鲜明的结构性特征。回顾2020年，权益市场在疫情、中美关系、经济走向、货币政策4大因素纠缠中走出了异常分化的结构性牛市行情，疫情受益医药股、永续增长类的龙头白马股、高增长的新能源、价格弹性的周期股轮番表现，最后演化为各类“茅”和中小股票的巨大跷跷板走势情形。2021年上半年，中小股票企稳走强，各类“茅”均较大调整后，市场在2季度明显转向医美新能源半导体等高成长板块，龙头白马股则出现较大调整。展望下半年，通胀走向、贸易谈判、中美货币政策走向这些底层变量仍将对市场走势产生较大影响，同时龙头白马股与高增长“赛道股”已经开始出现一定的跷跷板效应，权益市场可能仍将延续鲜明的结构性特征，投资团队将继续完善多策略、逆向投资体系，尊重趋势，相信常识，力争获取风险收益比更佳的回报。

#### （四）风险控制报告

##### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司监督管理条例》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的

行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

## 2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的风险管理部门，加强对集合资产管理业务风险的事前分析、事中监控和事后评估，并提出风险控制措施。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

本集合计划管理人的风险控制工作主要通过资产管理业务部门内控风险管理部的外部监控来进行。风险管理部全面负责风险的揭示及管理，采用授权管理、逐日监控、绩效评估以及定期与不定期检查等多种方法对集合计划的管理运作进行风险控制。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

## 四、集合计划财务报告

### （一）集合计划会计报告书

#### 1、集合计划资产负债表（2021年6月30日）

单位：人民币元

资产	期末余额	年初余额	负债与持有	期末余额	年初余额
----	------	------	-------	------	------

			人权益		
<b>资 产:</b>			<b>负 债:</b>		
银行存款	57,540.71	20,981,206.28	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	613,048.98	1,459,128.31	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	130,721.37	306,084.96	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	16,577,214.80	41,339,123.82	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
其中:股票投资	16,577,214.80	40,739,894.62	应付证券清算款	0.00	3,769,212.19
债券投资	0.00	599,229.20	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00	应付管理人报酬	66,842.24	151,644.96
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	3,342.13	7,603.03
资产支持证券投资	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00	应付交易费用	64,644.68	228,713.78
买入返售金融资产	0.00	0.00	应交税费	24,632.12	7.06
应收证券清算款	8,741,808.63	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收利息	3,116.73	11,031.14	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	其他负债	4,959.40	10,000.00
应收申购款	0.00	0.00	<b>负债合计</b>	164,420.57	4,167,181.02
其他资产	0.00	0.00			
			<b>所有者权益:</b>		
			实收基金	15,684,366.44	39,766,534.91
			未分配利润	10,274,664.21	20,162,858.58
			<b>所有者权益合计</b>	25,959,030.65	59,929,393.49
<b>资产合计</b>	26,123,451.22	64,096,574.51	<b>负债和所有者权益总计</b>	26,123,451.22	64,096,574.51

## 2、集合计划经营业绩表（2021年4月1日至2021年6月30日）

单位：人民币元



序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	2,047,904.05	4,603,495.21
2	1、利息收入	41,840.22	109,169.07
3	其中：存款利息收入	24,327.77	67,831.47
4	债券利息收入	0.00	91.39
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	存出保证金利息收入	625.16	1,504.56
7	买入返售证券收入	16,887.29	39,741.65
8	2、投资收益	1,547,123.89	8,004,901.71
9	其中：股票投资收益	1,520,499.49	8,429,696.84
10	债券投资收益	0.00	-117,737.78
11	基金投资收益	-45,338.39	-185,286.80
12	权证投资收益	0.00	0.00
13	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
14	衍生工具收益	0.00	0.00
15	股利收益	114,928.64	114,928.64
16	个股期权收益	0.00	0.00
17	差价收入增值税抵减	-42,965.85	-236,699.19
18	3、公允价值变动收益	458,939.94	-3,510,575.57
19	4、其他收入	0.00	0.00
20	二、费用	193,332.41	658,407.88
21	1、管理人报酬	66,842.24	167,034.40
22	2、托管费	3,342.13	8,351.72
23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	114,977.03	436,736.41
25	5、利息支出	0.00	0.00
26	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
27	6、其他费用	2,493.40	17,359.40
28	7、增值税金及附加税	5,677.61	28,925.95
29	三、利润总和	1,854,571.64	3,945,087.33

## (二) 集合计划投资组合报告 (2021年6月30日)

### 1、期末资产组合情况

单位：人民币元

项目	期末余额	占总资产比例
----	------	--------

银行存款	57,540.71	0.22%
结算备付金	613,048.98	2.35%
存出保证金	130,721.37	0.50%
股票投资	16,577,214.80	63.46%
应收利息	3,116.73	0.01%
应收证券清算款	8,741,808.63	33.46%
合计	26,123,451.22	100.00%

2、报告期末按市值占集合计划净值比例大小排序的前十大持仓证券明细

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占净值比
600079.SH	人福医药	69,000	1,950,630.00	7.51%
300391.SZ	康跃科技	84,000	1,522,920.00	5.87%
300233.SZ	金城医药	42,800	1,219,800.00	4.70%
300144.SZ	宋城演艺	62,600	1,051,680.00	4.05%
600037.SH	歌华有线	107,300	1,031,153.00	3.97%
600713.SH	南京医药	196,700	932,358.00	3.59%
600859.SH	王府井	30,400	877,952.00	3.38%
600521.SH	华海药业	41,000	856,080.00	3.30%
002653.SZ	海思科	39,600	852,192.00	3.28%
600519.SH	贵州茅台	400	822,680.00	3.17%

3、集合计划份额变动

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
21,752,633.14	819,453.19	6,887,719.89	15,684,366.44

## 五、重要事项提示

### (一) 本集合计划管理人及托管人相关事项

1、本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

2、本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

3、本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

## （二）本集合计划相关事项

1、本报告期内集合计划未进行收益分配。

2、截止报告期末，集合计划无公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或其他关联方参与的份额。

## 六、信息披露的查阅方式

查阅网址：[www.chinalin.com](http://www.chinalin.com)

咨询电话：400 188 3888

华林证券股份有限公司

2021年7月 日