

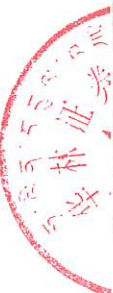
# 华林证券满天星 1 号

## 集合资产管理计划 2022 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：2022 年 4 月 1 日至 2022 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：2022年4月1日至2022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

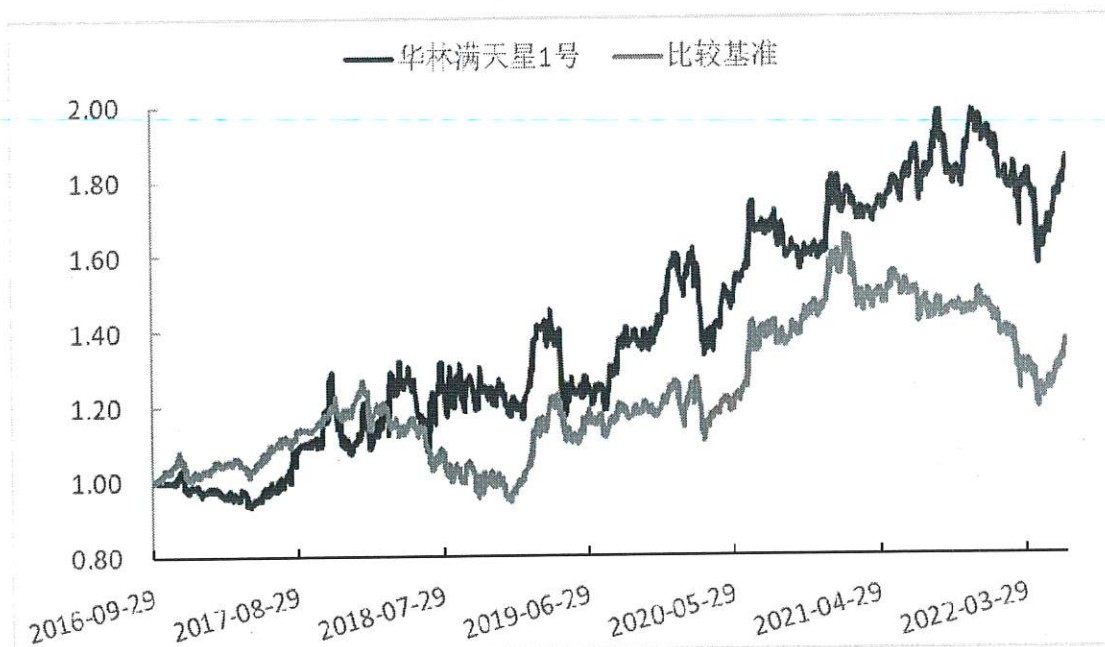
## 二、主要财务指标

### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

项目	主要财务指标	2022年4月1日至2022年6月30日
1	集合计划本期利润	869,190.39
2	本期已实现收益	40,823.80
3	期末集合计划资产净值	23,524,657.20
4	期末集合计划单位净值	1.6820
5	期末集合计划累计单位净值	1.8570
6	本期集合计划净值增长率	3.91%
7	集合计划累计净值增长率	94.38%

### (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 2022 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值为 1.6820 元，累计单位净值为 1.8570 元，集合计划累计净值增长率为 94.38%。

### （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，11 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。

庞福栋先生，中国人民银行研究生部金融学硕士，FRM。11 年投资研究经验，历任广发基金研究发展部高级医药研究员、华夏财富创新投资管理有限公司投资经理。现任华林证券资产管理事业部投资主办人，具备完备的投资框架，在医药等大消费领域投资研究经验丰富。

### （三）投资主办人工作报告

回顾上半年，权益市场在疫情、俄乌战争、政策波动等因素的纠缠中走出了异常分化的大幅波动行情，1-4 月市场绝大多数板块大幅下跌，仅有阶段性的新冠药、地产等题材性机会，而“新半军”等成长股则跌幅巨大，大部分腰斩；5-6 月市场强劲反弹，新半军等成长股又快速上涨引领市场，部分龙头股票修复绝大部分跌幅。上半年市场波动剧烈，稍有不慎，就容易出现较大幅度亏损。

上半年疫情爆发后，上海停工将近 2 个月，对处于长三角甚至全国的供应链都产生了较大负面影响，大量的企业出现了停工停产，并对经济前景、企业家以及民众信心带来不利影响，PMI 等先导数据创近 10 年新低；随着疫情得到初步控制，全国稳定经济大盘会议后的

政策陆续落地，国内经济政策预期相对平稳，没有大规模疫情等突发因素下，弱复苏的确定性逐步增强；与此同时，临近中期选举的美国的通胀数据连续 2 个季度超预期，欧洲各国国债之间信用利差接近欧债危机时期水平，华尔街资本围猎日本股票债券，俄乌战争继续深化短期几乎没有结束的可能，海外的经济政治形势扑朔迷离，对于衰退的预期显著升温，但衰退的深度、长度市场分歧巨大。一旦发生略长时间的深度衰退，可能会对 A 股市场造成某种程度的输入风险。复盘来看，拥有众多经济学家的美联储年初至今对于通胀、衰退的判断出现了较大错误，可想而知在衰退等核心问题上获得更前瞻的预判非常困难，投资团队将密切跟踪海外衰退情形的进展，一旦深度衰退或者担忧消失，将及时有效的对组合进行调整。

展望下半年，国内经济政策的 3 季度展望预期较为平稳，各个子行业的基本面情况是决定股价表现的核心因素，同时俄乌战争、美国通胀衰退等海外重大事件可能在 3-4 季度持续发酵，其走向值得市场密切关注。综合来说，权益市场可能呈现鲜明的结构性特征，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，为投资人创造经风险调整后的较好收益。

#### （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（2022年6月30日）

单位：人民币元

资产	期末余额	上年年末 余额	负债和所有者 权益	期末余额	上年年末 余额
<b>资 产：</b>			<b>负 债：</b>		
银行存款	1,769,896. 50	3,442,657. 47	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	96,639.31	204,221.31	交易性金融 融负债	0.00	0.00
存出保证金	35,046.21	48,855.39	衍生金融 负债	0.00	0.00
衍生金融资 产	0.00	0.00	卖出回购 金融资产款	0.00	0.00
交易性金融 资产	21,790,804 .72	21,364,885 .20	应付清算 款	1,034,953. 52	0.28
买入返售金 融资产	0.00	0.00	应付赎回 款	0.00	0.00
发放贷款和 垫款			应付管理 人报酬	54,582.65	62,015.71
债权投资	0.00	0.00	应付托管 费	1,091.67	3,100.79
其他债权投 资			应付销售 服务费	0.00	0.00
应收清算款	993,017.81	535,606.59	应付投资 顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	15,480.71	应交税费	17.77	6,899.57
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	70,101.74	107,479.70
			<b>负债合计</b>	1,160,747. 35	179,496.05
			<b>所有者权益</b>		
			<b>实收资金</b>	13,986,010 .93	14,410,257 .06
			<b>其他综合     收益</b>		
			<b>未分配利     润</b>	9,538,646. 27	11,021,953 .56



			所有者权益合 计	23,524,657 .20	25,432,210 .62
资产总计	24,685,404 .55	25,611,706 .67	负债和所有者 权益总计	24,685,404 .55	25,611,706 .67

## 2、集合计划经营业绩表（2022年4月1日至2022年6月30日）

单位：人民币元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	927,360.09	-2,050,496.78
1. 利息收入	8,509.75	10,018.57
2. 投资收益（损失以“-”填列）	90,483.75	-1,046,441.13
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	828,366.59	-1,014,074.22
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他业务收入	0.00	0.00
二、费用	58,169.70	62,213.35
1. 管理人报酬	54,582.65	58,857.93
2. 托管费	1,091.67	1,281.63
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 投资顾问费	0.00	0.00
5. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产利息支出	0.00	0.00
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	1.98	-392.21
8. 其他费用	2,493.40	2,466.00
三、利润总额	869,190.39	-2,112,710.13
减：所得税费用	—	—
四、净利润	869,190.39	-2,112,710.13
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	869,190.39	-2,112,710.13

## (二) 集合计划投资组合报告 (2022 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	1,769,896.50	7.17%
结算备付金	96,639.31	0.39%
存出保证金	35,046.21	0.14%
交易性金融资产	21,790,804.72	88.27%
应收清算款	993,017.81	4.02%
合计	24,685,404.55	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
603056.SH	德邦股份	153,900	2,066,877.00	8.79%
301089.SZ	拓新药业	15,500	1,947,110.00	8.28%
001289.SZ	龙源电力	83,300	1,812,608.00	7.71%
110076.SH	华海转债	11,350	1,292,880.05	5.50%
601985.SH	中国核电	182,400	1,251,264.00	5.32%
110043.SH	无锡转债	10,380	1,223,909.64	5.20%
002385.SZ	大北农	149,700	1,169,157.00	4.97%
000768.SZ	中航西飞	34,200	1,035,918.00	4.40%
603501.SH	韦尔股份	4,900	847,847.00	3.60%
002191.SZ	劲嘉股份	76,500	820,080.00	3.49%

### 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
14,757,618.76	128,392.17	900,000.00	13,986,010.93

## 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，集合计划现有董事、监事、从业人员及其配偶参与份额 291,613.20 份，无涉及控股股东、实际控制人或其他关联方参与份额。

## 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  
2022年7月 日