

华林证券满天星 1 号

集合资产管理计划 2022 年第四季度报告



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 10 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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计划资产，但不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。

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。

托管人负责安全保管委托资产、办理资金收付等事项，并根据管理人的资金划拨指令，及时办理清算、交割等合同约定的相关事宜。托管人已履行了应尽的义务，承诺不存在损害资管份额持有人利益的行为。

托管人保证对本计划管理人的投资运作进行了必要的监督。对本计划资产净值的计算、份额申购赎回价格的计算以及费用、开支等方面进行了复核，未发现本计划管理人存在损害本计划份额持有人利益的行为。

托管人已复核了本报告。本报告未经审计。

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10月1日至2022年12月31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

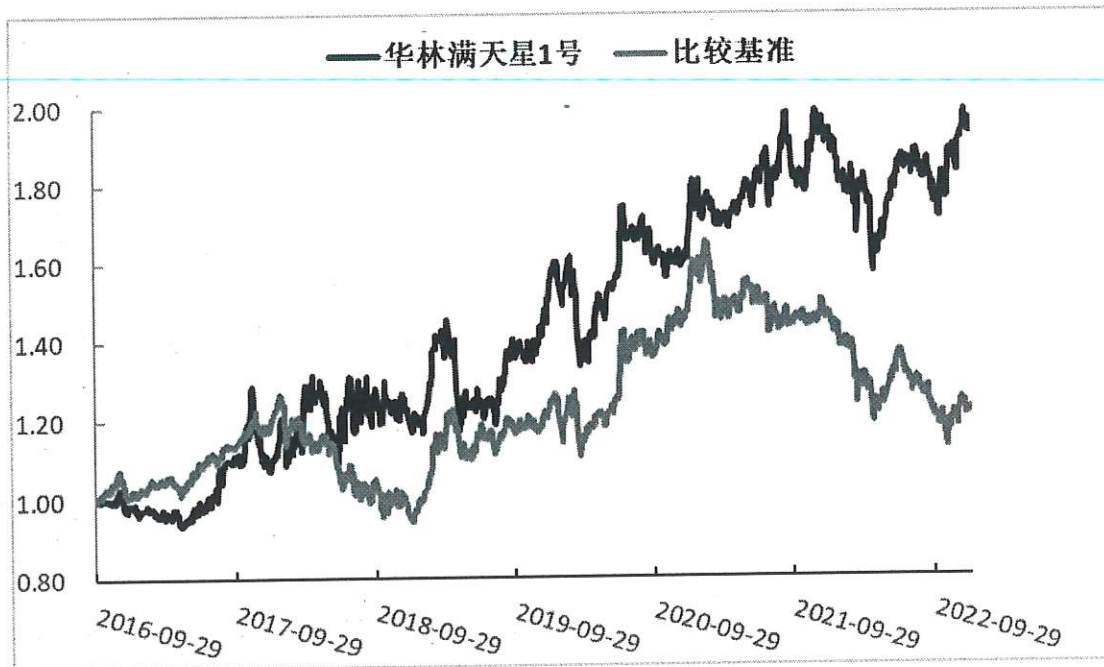
二、主要财务指标

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

项目	主要财务指标	2022年10月1日至2022年12月31日
1	集合计划本期利润	2,445,816.10
2	本期已实现收益	589,799.19
3	期末集合计划资产净值	22,680,996.53
4	期末集合计划单位净值	1.7626
5	期末集合计划累计单位净值	1.9376
6	本期集合计划净值增长率	11.83%
7	集合计划累计净值增长率	103.70%

(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 12 月 31 日，本集合计划单位净值为 1.7626 元，累计单位净值为 1.9376 元，集合计划累计净值增长率为 103.70%。

(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。现任华林证券资管部落投资主办人，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。现任华林证券资管部落投资主办人，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 2022 年的第四季度，市场整体呈现震荡上行的态势。二十大胜利落后，外资流出力度显著加大，大量白马股杀跌；下半季度，随着防疫政策的调整，外资又开始显著流入，整体上国内外投资者根据政策变化对投资组合均进行了调整与再平衡，反应在市场上，则是风险偏好先回落再明显提升，市场波动剧烈，同时分化严重。白酒、地产等均是先大跌后大涨，金融权重股走势稳健，成长类股票小的明显强势；题材股持续活跃。

展望 2023 年，从海外看，美联储边际上大概率转鸽，风险偏好提升，虽然可能的经济衰退会对上市公司业绩有压制，但从整体看是

估值模型分子端与分母端的对抗；从国内看，疫情可能反复，但已无关经济大局，更多的要看新管理层上任后的施政方针，从整体看政策可能是最重要变量；因此不管海外还是国内，整体的宏观环境相对于2022年边际上都有明显改善，各个资产类可能都有机会，投资经理对2023年的市场表现充满期待。投资团队将继续勤勉尽责持续研究、坚持逆向投资大方向，与时俱进不断优化完善投资体系，为持有人创造经风险调整过的较好收益。

（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 12 月 31 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
资产：			负 债：		
货币资金	1,634,524.48	3,442,657.47	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	103,450.22	204,221.31	交易性金融 负债	0.00	0.00
存出保证金	31,104.95	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
应收清算款	0.00	535,606.59	应付管理人 报酬	55,587.49	62,015.71
应收利息	0.00	15,480.71	应付托管费	1,111.69	3,100.79
应收股利	0.00	0.00	应付销售服 务费	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付投资顾 问费	0.00	0.00
买入返售金融 资产	0.00	0.00	应交税费	21,472.32	6,899.57
发放贷款和垫 款			应付清算款	0.01	0.28
交易性金融资 产	21,047,361.51	21,364,885.20	应付赎回款	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
其他债权投资			应付利润	0.00	0.00
其他权益工具 投资			其他负债	57,273.12	107,479.70
长期股权投资	0.00	0.00	负债合计	135,444.63	179,496.05
其他资产	0.00	0.00	净资产：		
			实收资金	12,867,790.05	14,410,257.06
			其他综合收 益		
			未分配利润	9,813,206.48	11,021,953.56
			净资产合计	22,680,996.53	25,432,210.62
资产总计	22,816,441.16	25,611,706.67	负债和净资产总 计	22,816,441.16	25,611,706.67

2、集合计划经营业绩表（2022年10月1日至2022年12月31日）

单位：人民币元

项目	本期金额	上期金额
一、营业总收入	2,540,323.35	-1,417,113.83
利息收入	4,131.77	10,559.87
投资收益（损失以“-”填列）	680,174.67	652,255.35
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
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	1,856,016.91	-2,079,929.05
汇兑损益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
其他业务收入	0.00	0.00
二、营业总支出	94,507.25	62,539.88
管理人报酬	88,571.50	68,835.49
其中：暂估管理人报酬		
托管费	1,111.69	1,176.71
销售服务费	0.00	0.00
投资顾问费	0.00	0.00
利息支出	0.00	0.00
信用减值损失	0.00	0.00
税金及附加	2,304.26	6.88
其他费用	2,519.80	2,520.80
三、利润总额	2,445,816.10	-1,479,653.71
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,445,816.10	-1,479,653.71
五、其他综合收益的税后净额		
六、综合收益总额	2,445,816.10	-1,479,653.71

（二）集合计划投资组合报告（2022年12月31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
货币资金	1,634,524.48	7.16%
结算备付金	103,450.22	0.45%
存出保证金	31,104.95	0.14%
交易性金融资产	21,047,361.51	92.25%
合计	22,816,441.16	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
110079.SH	杭银转债	20,430	2,374,061.15	10.47%
110055.SH	伊力转债	8,330	1,472,085.93	6.49%
601816.SH	京沪高铁	232,400	1,143,408.00	5.04%
600176.SH	中国巨石	79,200	1,085,832.00	4.79%
688981.SH	中芯国际	25,152	1,034,753.28	4.56%
000848.SZ	承德露露	102,800	871,744.00	3.84%
300498.SZ	温氏股份	40,300	791,089.00	3.49%
002092.SZ	中泰化学	105,500	787,030.00	3.47%
603096.SH	海汽集团	29,000	764,440.00	3.37%
300979.SH	华利集团	12,900	736,719.00	3.25%

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
13,986,010.93	0.00	1,118,220.88	12,867,790.05

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、本集合计划于没有发生变化；

3、本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

4、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

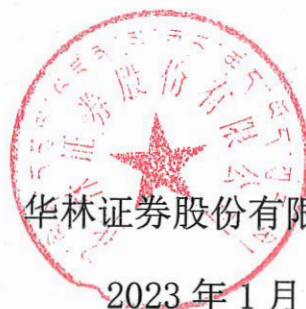
1、本报告期内集合计划未进行收益分配。

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

咨询电话：400 188 3888



华林证券股份有限公司

2023年1月19日