

华创东方嘉石1号集合资产管理计划 2022年第四季度报告

基金管理人：华创期货有限责任公司

基金托管人：兴业证券股份有限公司

送出日期：2023-01-16

# 私募基金信息披露季度报告

## 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	华创东方嘉石1号集合资产管理计划
基金编码	SVK381
基金管理人	华创期货有限责任公司
基金托管人（如有）	兴业证券股份有限公司
投资顾问（如有）	无
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2022-04-14
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	7,582.418874
投资目标	本计划主要投资于债券资产，严格管理投资比例，力争实现计划资产的长期稳健收益。
投资策略	（1）本资产管理计划主要投资于重庆市、四川省内下辖国有企业发行的债券。（2）适当侧重收益率与流动性两个目标：一方面，根据收益率目标，本计划将持有相当数量剩余期限与本计划存续期相近的收益较高、流动性适中的债券，为本计划贡献长期稳健收益；另一方面，根据流动性要求，本计划将配置一定数量的流动性高、收益适中的债券，有效控制债券投资组合的风险。（3）把握市场的主要波动，进行积极投资；积极投资策略主要是指根据利率预期调整集合计划债券投资组合的久期，同时选择低估值的债券进行投资、把握市场的低风险套利机会，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。（4）本计划将根据宏观经济和整体市场估值水平的变化结合管理人的判断进行多类别资产配置。
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本计划风险等级为R3

## 2、基金净值表现

阶段	净值增长率（%）	净值增长率标准差（%）	业绩比较基准收益率（%）	业绩比较基准收益率标准差（%）
当季	0.61	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	4.09	0.00	0.00	0.00

备注：

-
---

注：

净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率=（本季度末累计净值-上季度末累计净值）/上季度末净值

如为分级基金，应按级别分别列示。

表中指标均以不带百分号数值形式填写，请保留至小数点后2位。

## 3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2022-10-01	至	2022-12-31	（元）

本期已实现收益	899,988.68
本期利润	469,498.92
期末基金净资产	76,648,674.53
报告期期末单位净值	1.0109

备注：

-
---

注：

如为分级基金，应按级别分别列示。

#### 4、投资组合情况

##### 4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	95,961.69
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	-
	其中：优先股	-
	其他股权类投资	-
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	-
新三板投资	新三板挂牌企业投资	-
境内证券投资规模	结算备付金	2,253,448.42
	存出保证金	-
	股票投资	-
	债券投资	73,492,148.9
	其中：银行间市场债券	-
	其中：利率债	-
	其中：信用债	73,492,148.9
	资产支持证券	-
	基金投资（公募基金）	-
	其中：货币基金	-
	期货及衍生品交易保证金	-
	买入返售金融资产	1,001,160.2
其他证券类标的	-	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	-
	信托计划投资	-
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	-
	保险资产管理计划投资	-
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	-
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	-
	私募基金产品投资	-
	未在协会备案的合伙企业份额	-
另类投资	另类投资	-
	银行委托贷款规模	-
	信托贷款	-

境内债权类投资	应收账款投资	-
	各类受（收）益权投资	-
	票据（承兑汇票等）投资	-
	其他债权投资	-
境外投资	境外投资	-
其他资产	其他资产	-
基金负债情况	债券回购总额	-
	融资、融券总额	-
	其中：融券总额	-
	银行借款总额	-
	其他融资总额	-

#### 4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	0	0
B	采矿业	0	0
C	制造业	0	0
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0	0
E	建筑业	0	0
F	批发和零售业	0	0
G	交通运输、仓储和邮政业	0	0
H	住宿和餐饮业	0	0
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0	0
J	金融业	0	0
K	房地产业	0	0
L	租赁和商务服务业	0	0
M	科学研究和技术服务业	0	0
N	水利、环境和公共设施管理业	0	0
O	居民服务、修理和其他服务业	0	0
P	教育	0	0
Q	卫生和社会工作	0	0
R	文化、体育和娱乐业	0	0
S	综合	0	0
	合计	0	0

备注：

-
---

#### 4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
港股通	0.00	0.00
合计	-	-

备注:

-

5、基金份额变动情况

单位: 万份/万元

报告期期初基金份额总额	6,055.055635
报告期期间基金总申购份额	1,527.363239
减: 报告期期间基金总赎回份额	0.000000
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	7,582.418874

备注:

-

注: 如为分级基金, 应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初, 则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

6、管理人报告(如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作遵规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等)

-

信息披露报告是否经托管机构复核:

是

