

华创东方嘉石 1 号集合资产管理计划

季度报告（2022 年第四季度）

本报告由资产管理计划管理人编制。管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。本资产管理计划托管人中信建投证券股份有限公司已复核了本报告。

一、管理人履职报告

本集合资产管理计划管理人在报告期间，严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规、规章和自律规则等有关规定，以及本计划资产管理合同的约定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划。

报告期内，本计划管理人坚持规范运作、防范风险，保护投资者利益，严格执行管理人内部控制和 risk 管理制度，加强业务合规性的定期监控和检查，落实各项法律法规和管理制度，严格履行本资产管理计划合同规定。

报告期内，管理人和托管人按照各方约定的统一记账方法和会计处理原则，分别独立设置账套，互相监督，以保证计划资产安全，保护投资者利益。

二、托管人履职报告

本资产管理计划托管人出具了托管人履职报告，详见附件 1《华创东方嘉石 1 号集合资产管理计划托管人报告》。

三、资产管理计划投资表现、投资组合报告、财务会计报告

1. 本报告期末按公允价值占计划资产净值比例排序的债券明细：

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占净值比 (%)
1	21 渝南 03	14,581,253.42	19.0235

2	21 三峡 01	13,551,886.85	17.6805
3	22 任兴 01	13,402,876.30	17.4861
4	22 万盛 D2	11,652,004.79	15.2019
5	21 奉节 01	10,947,486.30	14.2827

2. 其它资产说明详见附件 2《东方嘉石 1 号集合资产管理计划_2022 年第四季度季度报告》。

四、资产管理计划运用杠杆情况（如有）

本报告期内，资产管理计划未运用杠杆投资。

五、费用的计提基准、计提方式和支付方式

本报告期内，资产管理计划计提了 2022 年 10 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日的管理费、托管费及行政服务费。具体计提方式、支付方式详见《华创东方嘉石 1 号集合资产管理计划资产管理合同》“第十九节资产管理计划的费用与税收”章节。

六、资产管理计划投资收益分配情况

本资产管理计划于 2022 年 12 月 21 日进行本集合计划第一次收益分配，向 12 月 20 日登记在册的全体委托人按每 10 份集合计划份额派发红利 0.3 元（不含管理人应计提的业绩报酬）。

七、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；

无。

八、中国证监会规定的其他事项。

无。

附件 1:《华创东方嘉石 1 号集合资产管理计划托管人报告》

附件 2:《SVK381_华创东方嘉石 1 号集合资产管理计划_2022 年第四季度季



度报告》。

