

# 华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合资 产管理计划 2023 年第一季度 资产管理报告



管理人：华金证券股份有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司南京分行

报告送出日期：2023 年 4 月 27 日

## 第一节 重要提示

本报告依据《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。

本报告由资产管理计划管理人编制。管理人保证本报告所载资料真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

资产管理计划托管人兴业银行股份有限公司南京分行于2023年4月13日复核了本报告中的财务指标和投资组合报告等财务资料内容。

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。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读资产管理计划资产管理合同。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期为2023年1月1日起，至2023年3月31日止。

本报告中的内容由管理人负责解释。

## 第二节 资产管理计划概况

名称	华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划
类型	固定收益类
成立日	2021年2月8日
成立份额总额	13,471,426.09份
报告期末份额总额	196,233,662.43份
管理人	华金证券股份有限公司
托管人	兴业银行股份有限公司南京分行

## 第三节 主要财务指标和资产管理计划净值表现

### 一、主要财务指标（单位：人民币元）

项目	报告期（2023年1月1日-2023年3月31日）
本期利润	10,245,089.57
每份额本期利润	0.0522
期末资产净值	209,623,973.36

期末每份额净值	1.0682
期末每份额累计净值	1.2446

注：期末每份额净值为计提业绩报酬前的份额净值。截至 2023 年 3 月 31 日，本资产管理计划暂估业绩报酬为 63.98 元（含所有份额持有人）。其中，暂估业绩报酬为假设本资产管理计划以本报告期最后一个交易日（同本资产管理计划资产管理合同定义）为清算确认日进行清算，根据份额持有人持有的资产管理计划份额（包括未到期份额）至清算申请日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬，与最终计提的业绩报酬可能存在差异。

## 二、报告期内收益分配情况

本报告期内，本资产管理计划未进行收益分配。

## 三、费用计提基准、计提方式和支付方式

序号	费用类型	费率	计提基准	计提及支付方式
1	管理费	1.20%	资产管理计划资产净值	按日计提，按季支付
2	托管费	0.02%	资产管理计划资产净值	按日计提，按季支付
3	业绩报酬	/	业绩报酬计提基准 6%和 8%： 若期间份额年化收益率超过业绩报酬计提基准，超过 6% 小于等于 8% 的部分，业绩报酬提取比例为 25%；若超过 8% 部分业绩报酬提取比例为 40%	业绩报酬计提日为收益分配基准日、份额退出日和终止日

## 第四节 管理人履职报告

### 一、业绩表现

截至 2023 年 3 月 31 日，本资产管理计划单位净值为 1.0682 元，累计单位净值 1.2446 元。报告期内，本资产管理计划的净值增长率为 4.6024%。

### 二、投资经理简介

本资产管理计划投资经理为林碧波、魏源、董立彬先生，简历如下：

林碧波先生：

12 年证券从业经历。历任信达证券资产管理事业部量化分析师、投资经理、投资总监，华金证券资管总部副总经理、联席总经理。林碧波先生聚焦固收+

量化对冲投资领域，对风险套利、条款博弈等事件驱动另类投资策略、特定收益增强策略有丰富经验，对时间价值、波动性有深入的理解，投资风格擅长结合投资标的基本面、波动性进行低风险投资。林碧波先生所管理的产品受到市场和客户的认可，由《证券时报》主办的中国财富管理机构君鼎奖评选中，信达证券睿丰3号集合资产管理计划连续两年分别荣获2019(第十三届)“十大创新资管/基金产品君鼎奖”及2020(第十四届)“绝对收益产品君鼎奖”；由财视中国主办的2022年“第十三届基金与财富管理·介甫奖评选”中，华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划荣获“优秀固收+策略产品”奖项。林碧波先生所在投研团队受到渠道及同业机构认可，在2020(第十四届)中国财富管理机构君鼎奖评选中，获得2020中国量化投资团队君鼎奖的荣誉。

魏源先生：

华金证券资管总部高级投资经理。美国罗格斯大学金融工程硕士，浙江大学应用数学系学士。6年证券从业经验，2年投资管理经验，曾任信达证券资产管理事业部量化研究员、投资助理、投资经理。在固收+、量化投资、衍生品套利、事件套利等方面有较深理解。曾担任信达睿丰系列产品、信达睿诚系列产品、信达睿鸿系列产品投资经理。

董立彬先生：

7年证券投资研究经历。中央财经大学应用统计硕士、数理经济与数理金融学士。2014年起从事日本十年期国债期货投资交易工作，2016年起于信达证券资产管理部协助投资主办进行投资研究与交易工作，包括且不限于减持策略研究、产品波段交易、产品业绩归因。擅长使用数量化工具分析投资机会，对短线市场波动与市场情绪变化敏感。

### 三、报告期内投资策略和运作分析

#### 1. 投资策略回顾

2023年一季度可转债市场自去年低位反弹，主要涨幅来自1月份，2-3月份转债市场震荡整理。行情主线方面，科技板块一季度总体表现较强，TMT行业成交占比逐步攀升，地产产业链总体企稳，生猪养殖板块再度回到历史底部区间。产品在一季度积极关注医药、半导体及生猪养殖等板块，1月反弹修复后，择券重于仓位，积极挖掘行业内优质个券。

## 2. 投资展望

在提振信心、稳增长措施的落实下，经济有望延续复苏趋势，企业和居民信心将逐步回升，经济和消费数据预计将逐季回暖。权益市场仍以结构性行情为主，但市场情绪、资金做多意愿相比去年显著增强，后续仍然看好结构性行情下的投资机会。AI 相关的产业趋势仍然具备长期投资机会，关注受益的新细分领域。医药方面，国产替代和自主可控在各细分领域快速推进，相关公司仍具备较大的成长空间。转债市场则受益于去年估值大幅回落，当前估值水平相对均衡，权益市场弹性可顺畅传导至转债市场，处在较好的投资时点。在经历一季度市场反弹后，转债市场估值修复，产品将继续紧跟市场风格，精选基本面优秀、转债估值合理的标的，坚持转股逻辑投资，积极把握市场机会。

## 四、重大事项披露

### 1. 报告期内投资经理变更情况

本报告期内，本资产管理计划投资经理未发生变更。

### 2. 报告期内关联交易情况

本报告期内，本资产管理计划未发生关联交易。

### 3. 期末计划管理人的从业人员及其配偶、关联方持有资产管理计划的情况

截至 2023 年 3 月 31 日，管理人自有资金持有本资产管理计划份额 23,046,461.56 份；管理人的从业人员及其配偶、关联方持有本资产管理计划份额中，个人投资者 6 名，合计持有份额：3,804,780.24 份；机构投资者 0 名，合计持有份额：0.00 份。

### 4. 其他需披露的重大事项

本报告期内，经管理人及托管人协商一致，并按照本资产管理计划合同的约定履行相应程序，《华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议一》于 2023 年 3 月 29 日正式生效，对本资产管理计划的投资范围、投资比例、业绩报酬、风险揭示、管理人自有资金参与等相关内容进行了调整。具体变更内容详见管理人官网披露的《华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合资产管理计划资产管理合同变更的公告》。

## 五、其他履职情况说明

1. 本报告期内，管理人以诚实信用、审慎尽责的原则管理和运用委托资产，

建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的委托资产与自有资产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。

2. 本报告期内，管理人按照《企业会计准则》以及中国证监会、财政部等监管机构关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定进行会计核算，与托管人定期对账，及时准确办理委托资产的清算交收。

3. 本报告期内，管理人依据合同约定的时间和方式，向投资者提供管理报告等资料，说明报告期内委托资产的配置状况、价值变动、收益分配等情况。

### 第五节 托管人履职报告

具体内容详见《华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划2023年第1季度托管人报告》。

### 第六节 投资组合报告

#### 一、期末资产组合情况

资产类别	市值（元）	占总资产比例（%）
1. 权益类资产	0.00	0.00
其中：股票	0.00	0.00
2. 基金类资产	86,638,668.84	41.20
3. 固定收益类资产	116,354,752.42	55.33
其中：债券	116,354,752.42	55.33
资产支持证券	0.00	0.00
4. 金融衍生品投资	0.00	0.00
5. 买入返售金融资产	0.00	0.00
其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6. 银行存款和结算备付金合计	2,434,688.26	1.16
7. 其他资产	4,868,720.52	2.32
总资产合计	210,296,830.04	100.00

## 二、资产管理计划运用杠杆情况

项目	金额	占资产净值的比例(%)
报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00
其中：买断式回购融资	0.00	0.00

## 三、期末市值占计划资产净值前五名证券明细

序号	证券代码	证券名称	市值（元）	市值/净值(%)
1	511990	华宝添益	27,225,130.01	12.99
2	511660	建信添益	18,274,678.69	8.72
3	110016	易方达货币B	10,009,583.01	4.78
4	015826	广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期	10,000,000.00	4.77
5	015955	万家中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期	10,000,000.00	4.77

## 四、非标准化债权类资产投资情况

本资产管理计划不涉及非标准化债权类资产投资。

## 五、投资组合报告附注

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第七节 报告期内计划份额变动

单位：份

期初份额总额	219,520,289.06
红利再投资份额	0.00
报告期间赎回份额	23,849,151.20
报告期间申购份额	562,524.57
期末份额总额	196,233,662.43

## 第八节 备查文件及查阅方式

### 一、备查文件

1. 华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划资产管理合同及其补充协议；
2. 华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划说明书；
3. 华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划风险揭示书；
4. 报告期内华金证券股份有限公司鸿盈3号集合资产管理计划在指定网站上披露的各项公告；
5. 中国证监会要求的其他文件。

### 二、查询方式

网址：<http://www.huajinsec.cn/>

信息披露电话：956011

