华金7天盈1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

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7天盈1号集合资产管理计划
类型	固定收益类
成立日	2018年12月7日
成立份额总额	10,010,000.00份
报告期末份额总额	123,486,191.80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

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	1,903,589.97
每份额本期利润	0.0154
期末资产净值	144,631,829.45

期末每份额净值	1.1712
期末每份额累计净值	1.1712

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 03 月 31 日，本资产管理计划暂估业绩报酬为 294.56 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	0.30%	前一日的资产净值	逐日计提，自然季支付
2	托管费	0.02%	前一日的资产净值	逐日计提，自然季支付
3	业绩报酬	/	业绩报酬计提基准 3.8%：超过当期业绩报酬计提基准 3.8%的部分的 3%计提为业绩报酬	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 1.1712 元，累计单位净值 1.1712 元。本报告期内，本资产管理计划的净值增长率为 1.2711%。

二、投资经理简介

本资产管理计划投资经理为贾鹏先生，简历如下：

12 年证券从业经历，先后任职于中原证券固定收益投资总部和中原证券资产管理总部，担任投资经理职务。长期从事债券投资相关工作，对宏观经济运行、利率期限结构和

信用评价分析有深刻的理解和认识。

三、报告期内投资策略和运作分析

1.投资策略回顾

一季度，全球需求下滑放缓，美国经济显现一定韧性，美国通胀压力仍在，但硅谷银行破产引发市场避险情绪升温，美联储预计维持缓慢加息，长期美债收益率宽幅震荡。

国内经济预期向好，一季度经济整体修复，地产销售及新开工增速回升，线下消费及可选消费反弹。但经济的复苏仍不稳固，出口受全球景气度下行而持续回落。通胀低于预期，侧面反映需求复苏的强度一般，核心通胀再度下行。政策方面，2023 年政府工作报告对经济增长目标的设定较为稳健，彰显了高质量发展的思路。

投资方面，产品一季度延续了一贯的特点，主要选择中高等级信用债进行投资，维持中性的久期配置思路，根据市场时机增加了短久期高等级债券的投资，同时保持相对积极的杠杆，获取增厚收益。

2.投资展望

展望二季度，从基本面来看，经济持续修复，地产有望逐步企稳，但受出口等多种因素拖累，复苏没有预期中强劲，基本面对债市的利空边际减弱。随着经济修复以及融资需求的改善，资金利率中枢整体可能抬升，债券收益率在上行至新的中枢水平后预计将维持震荡状态。

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，本资产管理计划于 2023 年 3 月 9 日投资了由兴业银行股份有限公司发行的兴业银行股份有限公司 2023 年第 080 期同业存单（简称：23 兴业银行 CD080，代码：112310080.IB），券面金额为 1,000.00 万元。

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 0.00 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 1 名，合计持有份额:256,673.51 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，本资产管理计划无其他需披露的重大事项。

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集合资产管理计划 2023 年 1 季度资产托管报告》。

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	0.00	0.00
3. 固定收益类资产	158,156,276.67	83.87
其中：债券	158,156,276.67	83.87
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	29,505,910.14	15.65

其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6.银行存款及结算备付金合计	849,117.07	0.45
7.其他资产	52,613.86	0.03
总资产合计	188,563,917.74	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	43,507,738.62	30.08
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	102001887	20 青山湖科 MTN001	20,510,005.48	14.18
2	136942	18 青城 Y2	12,413,457.53	8.58
3	1928014	19 华夏银行永续债	10,576,726.03	7.31
4	102101226	21 义乌国资 MTN004	10,564,712.33	7.30
5	102001286	20 西安高新 MTN005	10,479,528.77	7.25

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	119,208,588.01
红利再投资份额	0.00
报告期间赎回份额	55,658,748.92
报告期间申购份额	59,936,352.71
期末份额总额	123,486,191.80

第八节 备查文件及查阅方式

一、备查文件

1. 华金 7 天盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同及其补充协议；

2. 华金 7 天盈 1 号集合资产管理计划说明书；

3. 华金 7 天盈 1 号集合资产管理计划风险揭示书；

4. 报告期内华金 7 天盈 1 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.huajinsc.cn/

信息披露电话：956011

华金证券股份有限公司

2023 年 4 月 25 日