

# 华林证券满天星 1 号集合资产管理计划

## 2023 年第三季度报告

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：2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 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：2023年7月1日至2023年9月30日。

## 一、集合资产管理计划简介

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、集合资产管理计划管理人履职报告

### （一）投资经理简介

贾志先生于 2015 年到 2019 年，担任天相投资顾问有限公司证券投资分析师，投研总监；2020 年到 2022 年，担任平安证券研究所证券投资分析师，基金研究团队负责人，2022 年 4 月加入华林证券资管部落，担任 FOF 投资团队负责人职务，对投资组合管理有深入研究。

### （二）投资经理工作报告

报告期内，国内经济持续弱复苏，9 月 PMI 连续四个月景气回升，重返荣枯线上，考虑到 22 年四季度较低的基数，上市公司业绩在四季度会有明显的改善。海外市场，美债利率和美元指数继续上行，流动性冲击下造成美股下行，黄金震荡偏弱，对港股和国内 A 股也带来压力。同时，国内市场在政策底达成共识后，还在确认市场底，考验投资者耐心。从行业方向看，电力、汽车、机械、交运、石油、传媒等行业前 8 月的利润总额累计同比增速居前，预期季报的数据会有较好表现。报告期内，满天星产品积极防守，优选低估值产品，行业配置有效分散，在保持组合整体稳定的基础上持续优化。

四季度，我们认为市场底随时确立并将迎来全年宝贵的做多窗口。随着三季报陆续披露，经济持续复苏的信心会进一步增强，我们在全年积极防守的基础上，会增加产品的进攻性，积极获取更多投资机会，实现全年的业绩目标。

### （三）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。

3. 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。

### 三、集合资产管理计划投资表现

#### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

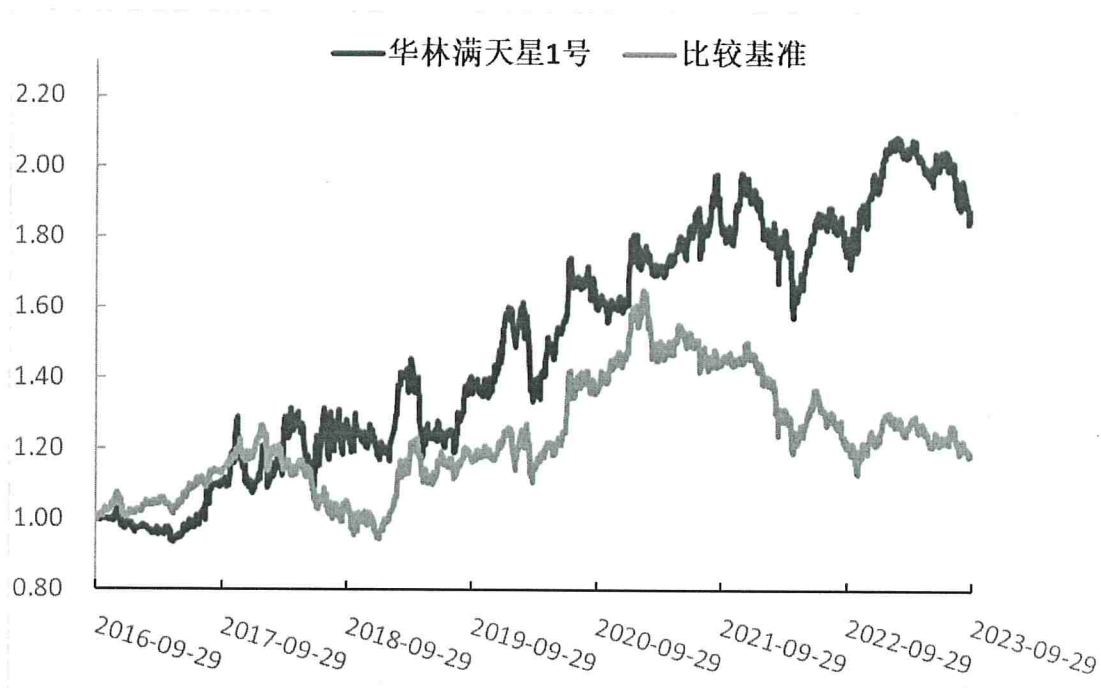
项目	主要财务指标	2023年7月1日至2023年9月30日
1	本期利润	-2,374,097.73
2	本期已实现收益	-739,692.99
3	期末资产净值	25,055,759.26
4	期末单位净值	1.7009
5	期末累计单位净值	1.8759
6	本期净值增长率	-8.69%
7	累计净值增长率	96.57%

#### (二) 业绩表现

截止到2023年9月30日，本集合计划单位净值为1.7009元，累计单位净值为1.8759元，集合计划累计净值增长率为96.57%。



### (三) 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

## 四、集合资产管理计划投资组合报告（2023 年 9 月 30 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	4,141.76	0.02%
结算备付金	51,393.03	0.20%
存出保证金	29,750.86	0.12%
交易性金融资产	25,077,280.19	99.66%
合计	25,162,565.84	100%

2、报告期末按市值占集合计划净值比例大小排序的十大持仓证券明细

单位：人民币元

证券代码	证券名称	数量	期末市值	市值占净值比
113024.SH	核建转债	17,500	2,007,424.04	8.01%
123064.SZ	万孚转债	18,000	1,990,911.38	7.95%
300231.SZ	银信科技	140,600	1,519,886.00	6.07%
300404.SZ	博济医药	148,000	1,383,800.00	5.52%
603015.SH	弘讯科技	140,000	1,227,800.00	4.90%
600468.SH	百利电气	217,000	1,160,950.00	4.63%
113527.SH	维格转债	9,000	1,125,943.77	4.49%
300128.SZ	锦富技术	258,000	1,122,300.00	4.48%
300557.SZ	理工光科	30,000	1,116,000.00	4.45%
002366.SZ	融发核电	200,000	1,112,000.00	4.44%

3、集合资产管理计划份额变动

单位：人民币元

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
14,833,530.48	758,825.30	861,415.29	14,730,940.49



## 五、集合资产管理计划财务会计报告

### (一) 集合计划会计报告书

#### 1、集合计划资产负债表（2023年9月30日）

单位：人民币元

资产	期末余额	上年年末余额	负债和净资产	期末余额	上年年末余额
资产：			负 债：		
货币资金	4,141.76	1,634,524.48	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	51,393.03	103,450.22	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	29,750.86	31,104.95	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	0.00	应付管理人报酬	66,045.26	55,587.49
应收利息	0.00	0.00	应付托管费	1,320.88	1,111.69
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	661.99	21,472.32
发放贷款和垫款			应付清算款	0.00	0.01
交易性金融资产	25,077,280.19	21,047,361.51	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	38,778.45	57,273.12
长期股权投资	0.00	0.00	负债合计	106,806.58	135,444.63
其他资产	0.00	0.00	净资产：		
			实收资金	14,730,940.49	12,867,790.05
			其他综合收益		
			未分配利润	10,324,818.77	9,813,206.48
			净资产合计	25,055,759.26	22,680,996.53
资产总计	25,162,565.84	22,816,441.16	负债和净资产总计	25,162,565.84	22,816,441.16



## 2、集合计划经营业绩表（2023年7月1日至2023年9月30日）

单位：人民币元

项目	本期金额	上期金额
一、营业总收入	-2,283,437.66	18,742.98
利息收入	1,796.36	30,590.19
投资收益（损失以“-”填列）	-650,829.28	539,003.70
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）	-1,634,404.74	-550,850.91
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	90,660.07	173,139.00
管理人报酬	86,327.47	167,439.03
其中：暂估管理人报酬	0.00	0.00
托管费	1,320.88	1,295.71
销售服务费	0.00	0.00
投资顾问费	0.00	0.00
利息支出	21.04	0.00
信用减值损失	0.00	0.00
税金及附加	53.96	1,910.86
其他费用	2,936.72	2,493.40
三、利润总额	-2,374,097.73	-154,396.02
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,374,097.73	-154,396.02
五、其他综合收益的税后净额		
六、综合收益总额	-2,374,097.73	-154,396.02

## 六、集合资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内集合计划未进行分红；本报告期内投资者退出份额861,415.29份，管理人根据资管合同约定，对退出份额核算收益。

## 七、投资经理变更事项

本报告期内投资经理未发生变更。

## 八、重大关联交易事项

本报告期内未发生重大关联交易。

## 九、其他涉及投资者权益的重大事项

### （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、本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。
- 3、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

截止报告期末，集合计划未有董事、监事、从业人员及其配偶参与，无涉及控股股东、实际控制人或其他关联方参与份额。



## 十、信息披露的查阅方式

投资者可登录集合计划管理人网站([www.chinalin.com](http://www.chinalin.com))查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本集合计划管理人,客户服务电话:400 188 3888。



华林证券股份有限公司  
2023年10月31日