

# 首创证券创惠 3 号灵活优选集合资产管理计划 2024 年二季度资产管理报告

## 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》（以下简称《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》（以下简称《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集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合资产管理计划托管人南京银行股份有限公司对本报告中的主要财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

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。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日

## 一、集合计划简介

名称：首创证券创惠 3 号灵活优选集合资产管理计划（以下简称“创惠 3 号灵活优选”或“本集合计划”）

类型：集合资产管理计划

管理人：首创证券股份有限公司

托管人：南京银行股份有限公司

成立日：2020 年 4 月 29 日

成立规模：23,240,268.54 份

存续期：本集合计划固定管理期限 10 年

投资目标：本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

## 二、计划投资表现

### (一) 主要指标

单位：人民币元

序号	主要财务指标	2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日
1	集合计划本期利润	3,384,140.84
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	3,390,079.76
3	期末集合计划资产总值	536,911,632.43
4	期末集合计划资产净值	534,961,075.24
5	单位集合计划资产净值	1.0153
6	期末集合计划杠杆	1.0000

### (二) 主要指标的计算公式

(1) 本期单位集合计划净收益 = 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 ÷ 集合计划份额

(2) 单位集合计划净值 = 集合计划净值 ÷ 集合计划份额

(3) 期末集合计划杠杆 = 卖出回购金融资产款 ÷ 期末集合计划资产净值 + 1

## 三、集合计划管理人报告

### (一) 净值表现

截止到2024年6月30日，本集合计划单位净值为1.0153。

## （二）投资经理简介

投资经理为邵华、胡孝中，简介如下：

邵华，首创证券资产管理事业部固定收益投资部总经理助理，投资经理，南开大学金融硕士。2017年加入首创证券资产管理事业部，历任资产管理部债券交易员、投资经理助理，现任资产管理事业部固定收益投资部总经理助理、投资经理。擅长寻找交易性机会，具有丰富的券商资管产品管理和投资经验。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

胡孝中，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理，中国科学技术大学金融硕士。2019年加入首创证券资产管理事业部，历任资产管理事业部固定收益投资部交易员、投资经理助理，现任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。偏向于通过数据分析调整投资组合来寻找固定收益投资机会，具有丰富的固定收益产品投资交易和管理经验。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

## （三）风险控制报告

### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《管理办法》、《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，管理人通过独立的风险控制部门，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管理人全面自查和合规与风险管理部日常监控、重点检查的结果。

管理人的风险控制工作主要通过资产管理业务部门内控和风险管理部外部监控来进行。为加强资产管理业务的风险管理，资产管理事业部下设研究与风险管理部，将合规与风险管理工作前置化，有效提升业务风险管控效果。主要工作内容包括宏观策略研究、发债主体信用评估，并在此基础上对包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和合规风险在内的主要风险进行严密监控和管理。风险管理部作为公司层面的中台部门，全面负责各类风险的揭示及管理，采用授权管理、绩效评估以及定期与不定期检查等多种方法对资产管理业务条线的运作进行有效控制。定期对业务授权、投资交易及合规性进行了全面细致的审查。

## 四、集合计划投资组合报告

本集合计划为固定收益类集合资产管理计划，固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%。

### (一) 报告期末按市值占净值比例大小排序的前五大债券明细

序号	名称	期末市值（元）	占资产净值的比例（%）
1	23 河南路桥 SCP002	20,561,803.28	3.8436

2	24HTZL 优	10,939,477.38	2.0449
3	23 银创 01	10,857,849.32	2.0297
4	23 渭南 01	10,702,958.90	2.0007
5	23 通泰 MTN001	10,630,830.60	1.9872

注：期末市值包含债券市值及对应债券应计利息。

## (二) 集合计划份额变动情况

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
672,649,448.43	233,455,599.03	379,193,510.26	526,911,537.20

## 五、集合计划费用情况

### 1、管理人管理费计提和支付

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费费率为 0.40%/年。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 2、托管人托管费计提和支付

本集合计划的托管费按前一自然日集合计划的资产净值计提，托管费费率为 0.02%/年，计算方法如下：

$$H=E\times 0.02\%\div 365$$

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

托管费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令将上一季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 3、业绩报酬的计提和支付

### (1) 管理人核算业绩报酬的原则

- ①本集合计划对投资者持有的集合计划份额进行业绩报酬计提；
- ②同一投资者不同时间多次参与集合计划，本集合计划对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；
- ③在符合业绩报酬计提条件时，管理人有权在集合计划收益分配日（以管理人公告为准）、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬；
- ④在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除；

⑤集合计划分红时，业绩报酬按投资者集合计划分红时持有的份额进行核算；

⑥投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或集合计划终止时持有份额进行核算；

⑦管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制；

⑧管理人有权于集合计划份额发行前公告业绩报酬计提基准等规则。

(2) 业绩报酬的计提方法：

在收益分配基准日和计划终止日，对集合计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在委托人退出申请日，仅对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。

每笔参与份额以上一业绩报酬核算日到本次业绩报酬核算日的年化收益率，作为计提业绩报酬的依据。若委托人持有计划份额期间，发生业绩报酬计提基准或业绩报酬计提比例调整，需分别计算调整前后不同核算期内的产品年化收益率，并加总计算管理人业绩报酬。

核算期产品年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 365 \times 100\%$$

$P_1$ ：本次业绩报酬核算日的累计单位净值；

$P_0$ ：上一个业绩报酬核算日的累计单位净值；

$P_0^*$ ：上一个业绩报酬核算日的单位净值；

D：上一个业绩报酬核算日至本次业绩报酬核算日的天数；

R: 年化收益率。

业绩报酬具体计算方法如下:

$$F = \max\{(R-r) \times N \times C \times (D/365), 0\}$$

其中:

F: 针对投资者每笔参与份额核算期内应提取的业绩报酬;

r: 核算期区间对应的业绩报酬计提基准;

C: 投资者每笔参与份额在上一业绩报酬核算日的资产净值总额;

N: 管理人业绩报酬提取比例为 60%;

如上一个业绩报酬核算日不存在, 则为份额注册登记日。

上述管理人业绩报酬计入管理费。

### (3) 业绩报酬的支付

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时, 管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬 (如有), 具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时, 支付日期顺延。业绩报酬的计算和复核由管理人完成, 托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

管理人有权修改业绩报酬计提基准, 管理人应于新的业绩报酬计提基准启用前至少三个工作日在管理人指定网站公告。业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的计算使用, 并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。



## 六、集合计划投资收益分配情况

本集合计划在本季度内以红利再投资的形式进行了 1 次收益分配，红利再投资份额为 10,800,288.79 份。

## 七、重大事项

截至 2024 年 6 月 30 日，我公司共有 2 名从业人员、1 名从业人员配偶参与首创证券创惠 3 号灵活优选集合资产管理计划，总份额为 1,394,896.31 份。同时，我公司以自有资金参与集合计划，参与认购份额为 10,016,389.80 份。

2024 年 5 月 6 日，管理费变更为 0.40%/年；修改业绩报酬相关内容。详见《首创证券创惠 3 号灵活优选集合资产管理计划变更合同条款说明八》。

## 八、备查文件目录

### （一）本集合计划备查文件目录

- 1、首创证券创惠 3 号灵活优选集合资产管理计划资产管理合同、计划说明书
- 2、首创证券创惠 3 号灵活优选集合资产管理计划托管协议
- 3、首创证券创惠 3 号灵活优选集合资产管理计划变更合同条款说明等
- 4、管理人业务资格批件、营业执照
- 5、报告期内披露的各项公告

### （二）信息披露查阅方式

网址：www.sczq.com.cn

信息披露电话：95381

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人首创证券股份有限公司。

