

华宝证券华享添利周周盈 1 号
集合资产管理计划
2023 年第四季度资产管理报告

计划管理人：华宝证券股份有限公司

计划托管人：上海银行股份有限公司

报告期间：2023 年 10 月 1 日— 2023 年 12 月 31 日

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》)《中国人民银行 中国银行保险监督管理委员会 中国证券监督管理委员会 国家外汇管理局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他有关规定制作。

资管计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资管计划资产,但不保证本资管计划本金不受损失,也不保证最低收益。资管计划管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

托管人已对本报告中财务指标、净值表现、投资组合报告财务数据信息进行了复核。托管人履职情况请见托管人出具的报告。

本资管计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本资管计划的资产管理合同。

本报告未经审计,报告内容由管理人负责解释。

一. 资管计划简介

1. 基本资料:

| | |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 计划名称 | 华宝证券华享添利周周盈1号集合资产管理计划 |
| 计划类型 | 固定收益类 |
| 计划成立日 | 2022年6月7日 |
| 计划成立规模 | 10,000,000.00份 |
| 报告期末规模 | 106,072,539.61份 |
| 计划存续期限 | 10年 |
| 计划的分级 | 不分级 |
| 管理费 | 本资管计划的管理费按前一日计划资产净值的0.6%年费率计提。按前一日计划资产净值计算，每日计提，按季度支付。 |
| 托管费 | 本资管计划的托管费按前一日计划资产净值的0.01%年费率计提。按前一日计划资产净值计算，每日计提，按季度支付。 |
| 业绩报酬 | 无 |
| 风险收益特征 | 中低风险 |
| 计划投资范围 | <p>(1) 交易所和银行间市场上市或挂牌交易的标准化债权类资产，包括但不限于国债、地方政府债、中央银行票据、金融债（含次级债、二级资本债、混合资本债、政策性金融债、无固定期限资本债券、保险公司资本补充债券）、公司债、企业债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、标准化票据、非公开定向债务融资工具以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等；资产支持证券（ABS，非次级）、资产支持票据（ABN，非次级）；可转换债券、可交换债券；逆回购、同业存单；银行存款、现金；</p> <p>(2) 商品及金融衍生品类资产：国债期货、利率互换、信用风险缓释凭证（CRMW）、标准债券远期；</p> <p>(3) 本计划不直接从二级市场买入股票、权证，但可持有因可转换债券、可交换债券转（换）所形成的股票、权证；</p> <p>(4) 资产管理产品：公募证券投资基金（包括货币市场基金、公募REITs、同业存单基金、债券型基金），商业银行或其理财子公司发行的理财产品，信托计划，基金公司资产管理计划、基金子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划、证券公司子公司资产管理计划、保险资产管理计划、保险公司子公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、期货公司子公司资产管理计划。</p> <p>本计划可参与债券正回购。</p> |
| 投资顾问 | 无 |

2. 资管计划管理人

法定名称：华宝证券股份有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

电话：021-68777222

3. 资管计划托管人

法定名称：上海银行股份有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号

电 话：021-68476441

二. 主要财务指标和资产管理计划净值表现

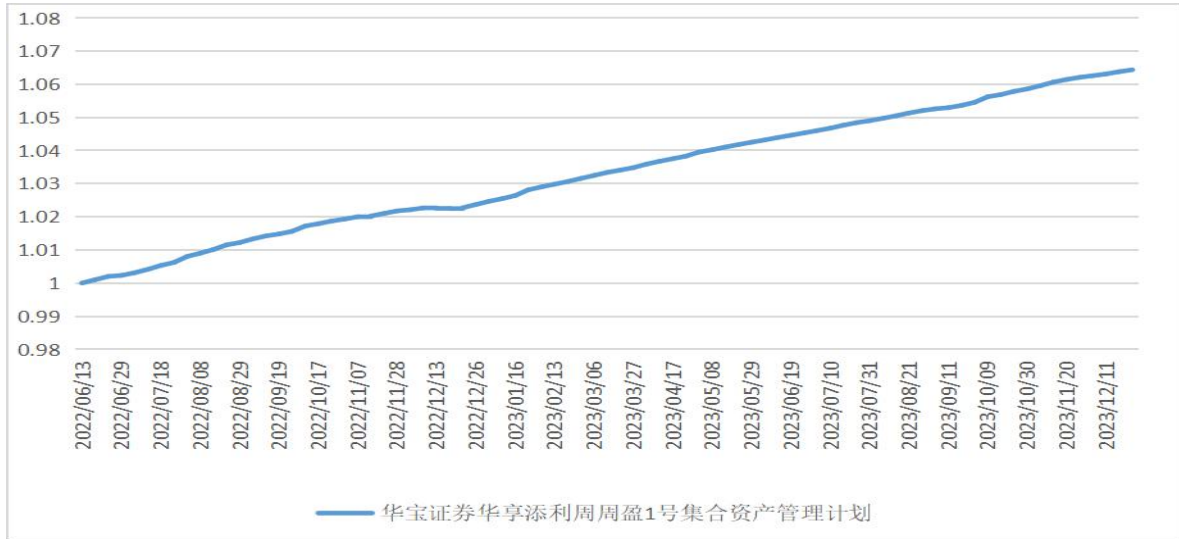
1. 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 本期间 (2023 年 10 月 1 日—2023 年 12 月 31 日) |
|-----------|-------------------------------------------|
| 本期利润 | 1,177,614.62 |
| 本期单位净值增长率 | 0.9719% |
| 期末资产净值 | 113,001,000.98 |
| 期末单位资产净值 | 1.065318 |
| 单位累计净值增长率 | 6.5318% |

2. 资管计划累计净值走势图

日期：2022 年 6 月 7 日—2023 年 12 月 31 日



三. 资管计划管理人履职报告

1. 投资经理简介

任雅姗, 女, 中央财经大学经济学硕士。2015年起从事金融行业, 2015年加入华宝证券, 现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任债券交易员、投资助理、投资经理。擅长信用债、ABS、利率债等品种的投资研究。

王李瑞, 男, 复旦大学风险管理与保险硕士, FRM。2016年起从事金融行业, 2022年加入华宝证券, 现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任建信保险资产管理有限公司研究员、投资助理、投资经理。投资风格稳健、策略多元, 擅长信用债、可转债等投资品种的精选挖掘, 注重自上而下的大类资产配置。

王淑美, 女, 中国人民大学会计硕士, CPA。2011年起从事金融行业, 2011年加入华宝证券, 现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任华宝证券研究所宏观、债券及行业研究员。擅长利率债、可转债交易及信用债分析评价。

2. 投资经理工作报告

2023 年四季度债市整体维持区间震荡但利率中枢略有下移，走势略呈 M 型：季度初担忧再融资债供给冲击上行，至 11 月万亿国债增发落地和资金转松带动利率下行，11 月底稳增长策略超预期及资金偏紧利率上行，最后季末存款利率下调带动降息预期升温债市再度走牛。从基本面角度，市场在经历前三季度后已经对弱修复达成了一定的共识，生产方面，工业增加值环比、同比均在回升，但需求侧消费、民间投资和地产投资大体仍在筑底，物价方面 CPI、PPI 同比同时转弱印证内需偏弱；从政策面看，不论是货币政策还是财政政策，整体保持较强定力，虽然财政和地产相关政策略有加码，但并未达到市场预期，货币政策则边际偏紧，未有预期的总量型降息、降准出台，狭义流动性在四季度内波动加大。

展望 2024 年一季度，预计经济增速在 5%附近不会有很大的压力，但经济整体依然面临较为复杂的地产、地方债务、中小金融机构风险等拖累因素，但随着出口、消费、地产投资持续探底后基数较低的现实，基本面持续向上的概率仍然大于经济继续走弱的可能性，海外进入降息周期也为货币政策打开了一定的操作窗口，主动权再度回到了货币当局手中。整体看，债市的环境仍然处于一个偏友好的环境内，但债市在前期积累了较大的涨幅，收益率水平已达低位，在无超预期政策的前提下继续下行的阻力偏大，债市短期料维持震荡，票息策略、配置策略仍然是较为合适的策略选择，久期上采用哑铃型配置可能更佳。

3. 报告期末的杠杆使用情况

报告期末，本产品杆杆率为 105.45%。

4. 是否涉及关联交易

本报告期内，本计划不涉及关联交易。

| 交易日期 | 交易方向 | 标的证券名称 | 关联方名称 | 关联方类型 | 交易金额（元） |
|------|------|--------|-------|-------|---------|
| - | - | - | - | - | - |

5. 非标投资相关情况

本计划不涉及非标投资。

6. 风险控制报告

华宝证券针对本计划的投资范围及风控要求，通过每日的风险监控工作以及风险预警机制，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，确保计划合法合规、正常运行。公司通过完善的风险指标体系，依托投资交易管理信息系统平台，对资产管理业务进行动态跟踪，及时评估运作过程中面临的各种风险，为投资决策提供风险控制及预警支持，确保计划运作风险水平与其投资目标相一致，以实现本计划追求中长期内资本增值的投资目标。

在本报告期内，本计划运作合法合规，未出现违反相关规定的状况，也未发生损害投资者利益的行为。

四. 资管计划投资组合报告

1. 报告期末资管计划资产组合情况

| 序号 | 资产类别 | 市值（元） | 占总资产的比例(%) |
|----|------|-------|------------|
| 1 | 股票 | | |

| | | | |
|----|----------------------------------------------|----------------|--------|
| 2 | 基金 | | |
| 3 | 债券 | 29,786,476.50 | 25.00 |
| 4 | 其中：央票 | | |
| 5 | 国债 | | |
| 6 | 政策性金融债 | | |
| 7 | 金融债（商业银行次级债、商业银行普通债券、证券公司短期融资券、其他金融债券） | | |
| 8 | 企业债 | 17,208,929.55 | 14.44 |
| 9 | 企业短期融资券 | 4,047,526.67 | 3.40 |
| 10 | 可转债 | | |
| 11 | 银行间中期票据 | | |
| 12 | 同业存单 | | |
| 13 | 私募债 | 8,530,020.28 | 7.16 |
| 14 | 地方政府债 | | |
| 15 | 权证 | | |
| 16 | 资产支持证券 | | |
| 17 | 理财产品投资 | 85,770,570.53 | 71.98 |
| 18 | 货币市场工具（票据、CD） | | |
| 19 | 现金（银行存款及清算备付金） | 69,934.74 | 0.06 |
| 20 | 银行定期存款（定期存款、通知存款、大额存单） | | |
| 21 | 其他资产（交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等） | 3,537,895.04 | 2.97 |
| 22 | 其中：买入返售证券 | 3,525,838.65 | 2.96 |
| 23 | 资产合计 | 119,164,876.81 | 100.00 |

2. 报告期末按市值占资管计划资产净值比例大小排序前十的股票

| 序号 | 证券代码 | 投资标的名称（股票） | 市值占净值比例（%） |
|----|------|------------|------------|
| - | - | - | - |

3. 报告期末按市值占资管计划资产净值比例大小排序前十的债券明细

| 序号 | 投资标的名称（债券） | 市值占净值比例（%） |
|----|----------------|------------|
| 1 | 23 恒廷实业 PPN001 | 7.08 |
| 2 | 23 景旅 03 | 4.51 |
| 3 | 23 新沂城投 PPN004 | 4.44 |
| 4 | 23 兴化交通 PPN001 | 3.54 |
| 5 | 23 怀化高新 SCP002 | 3.53 |
| 6 | 23 商铁 D2 | 1.87 |

| | | |
|---|----------|------|
| 7 | 23 景旅 D3 | 0.89 |
|---|----------|------|

注：表中披露的债券均不包含利息。

4. 报告期末按市值占资管计划资产净值比例大小排序前十的基金明细

| 序号 | 证券代码 | 投资标的名称（基金） | 市值占净值比例（%） |
|----|------|------------|------------|
| - | - | - | - |

5. 报告期末期货投资情况

| 序号 | 投资标的名称（期货） | 合约价值占比（%） |
|----|------------|-----------|
| - | - | - |

6. 报告期末按市值占资管计划资产净值比例大小排序前十的其他理财产品明细

| 序号 | 投资标的名称（其他理财产品） | 市值占净值比例（%） |
|----|--------------------------|------------|
| 1 | 永诚资产永盈安享 2 号资产管理计划 | 20.57 |
| 2 | 西部信托·永宁 10 号债券投资集合资金信托计划 | 16.62 |
| 3 | 华安财保资管安源 5 号集合资产管理计划 | 16.04 |
| 4 | 民生通惠民汇 48 号资产管理计划 | 15.09 |
| 5 | 厦门信托鹭鑫汇银定开 2 号 | 4.58 |
| 6 | 厦门信托鹭鑫汇银定开 3 号 | 3.00 |

五. 资管计划期间份额变动

日期：2023 年 10 月 1 日—2023 年 12 月 31 日

单位：份

| 期初总份额 | 期间参与份额 | 期间退出份额 | 期末总份额 |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 115,708,680.81 | 29,194,429.78 | 38,830,570.98 | 106,072,539.61 |

六. 本集合资管计划管理人自有资金参与情况

日期：2023 年 12 月 31 日

单位：份

| 期末产品总份额 | 自有资金参与总份额 | 自有资金投入比例（%） |
|----------------|-----------|-------------|
| 106,072,539.61 | 0.00 | 0.00 |

七. 投资收益分配情况

本报告期内未进行收益分配。

| 序号 | 收益分配基准日 | 权益登记日 | 分红方式 | 分红方案 |
|----|---------|-------|------|------|
| - | - | - | - | - |

八. 重要事项提示

1. 本报告期内没有发生涉及本资管计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。
2. 本计划管理人办公地址没有发生变更。
3. 本报告期内本资管计划的产品类型及投资组合策略没有发生重大改变。
4. 本报告期内本资管计划的投资经理没有发生变更。
5. 本资管计划在本报告期内未发生对投资者权益产生影响的其他事项。

九. 备查文件目录

1. 本计划备查文件目录

《华宝证券华享添利周周盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同（第二版）》《华宝证券华享添利周周盈 1 号集合资产管理计划计划说明书（第二版）》、管理人业务资格批件、营业执照。

2. 存放地点及查阅方式

查阅地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

管理人指定网址：<http://www.cnhbstock.com>

管理人指定客户服务热线：400-820-9898

华宝证券股份有限公司

2024 年 1 月 22 日