

华金证券鸿盈 8 号集合资产管理计划 2023 年第四季度资产管理报告

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：2024 年 1 月 29 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2024年1月9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10月1日起，至2023年12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	华金证券鸿盈8号集合资产管理计划
类型	固定收益类
成立日	2021年11月10日
成立份额总额	27,961,874.00份
报告期末份额总额	100,041,713.96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10月1日-2023年12月31日）
本期利润	-3,459,833.77
每份额本期利润	-0.0346
期末资产净值	96,696,176.38
期末每份额净值	0.9666
期末每份额累计净值	0.9666

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12月31日，本资产管理计划暂估业绩报酬为0.00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约定）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

项目	当前费率	计提方式	支付方式
管理费	1.20%	资产管理计划资产净值	按日计提，按季支付
托管费	0.02%	资产管理计划资产净值	按日计提，按季支付

项目	当前计提基准	计提比例	计提方式	支付方式
业绩报酬	6%	25%	业绩报酬计提日为收益分配日、份额退出日和计划终止日	在收益分配日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中提取。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
	8%	40%		

第四节 管理人履职报告

一、业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本资产管理计划单位净值为 0.9666 元，累计单位净值 0.9666 元。本报告期内，本资产管理计划的净值增长率为-3.1851%。

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，华金证券资产管理总部副总经理、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：

华金证券资产管理总部高级投资经理。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经理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年四季度制造业 PMI 回踩，连续三个月经济数据放缓，需求不足的问题依然延续，11-12月建筑业 PMI 在增发国债的支撑下连续超季节性回升，经济呈现“波浪式”前进特征显著。10年期国债收益率四季度下行，与制造业 PMI 数据节奏吻合。

2023年四季度权益市场大幅下跌探底，转债市场受正股整体回落影响出现较大回撤，中证转债指数四季度下跌 3.22%，中位数价格多次触及 115 元价格带，较为充分表明了市场的悲观情绪释放。在转债市场快速回落中，考虑到短期流动性的冲击及权益市场的低位，产品维持稳定的仓位，四季度产品净值出现较明显回撤。在市场波动中，产品对持仓结构进行了调整，以期更好地受益权益市场的反弹修复。

2. 投资展望

2023年12月中央经济工作会议强调“稳中求进、以进促稳、先立后破”，对于经济发展的要求进一步明确，更多体现在提升效能，高质量发展的路径之上，后期经济基本面在政策发力下边际将进一步好转。海外市场明年转向降息周期，市场中期风险担忧有望下降。市场节奏上把握市场低位修复的机会，结合市场风格的变化，精选基本面优秀、估值合理的标的，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 12 月 31 日，管理人自有资金持有本资产管理计划份额 16,006,574.19 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 4 名，合计持有份额：1,371,238.45 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，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

具体内容详见托管人提供的托管人履职报告（详见附件）。

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	24,511,386.96	25.27
3. 固定收益类资产	69,831,482.36	71.99
其中：债券	69,831,482.36	71.99
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	398,927.78	0.41
7. 其他资产	2,260,494.23	2.33
总资产合计	97,002,291.33	100.00

二、期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,254,966.93
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	5,527.30
4	应收利息	0.00
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
	合计	2,260,494.23

三、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

四、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	14,827,386.10	15.33
2	511660	建信添益	9,373,543.54	9.69
3	113061	拓普转债	4,000,225.91	4.14
4	127045	牧原转债	3,961,166.19	4.10
5	127050	麒麟转债	3,480,722.06	3.60

五、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。

六、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	106,348,561.00
红利再投资份额	0.00
报告期间赎回份额	6,306,847.04
报告期间申购份额	0.00
期末份额总额	100,041,713.96

第八节 备查文件及查阅方式

一、备查文件

1. 华金证券鸿盈 8 号集合资产管理计划资产管理合同及其补充协议；
2. 华金证券鸿盈 8 号集合资产管理计划说明书；
3. 华金证券鸿盈 8 号集合资产管理计划风险揭示书；
4. 报告期内华金证券鸿盈 8 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

附：托管人履职报告





后入