

华金7天盈1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

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 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	94,221,137.05 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10月1日-2023年12月31日）
本期利润	1,061,133.93
每份额本期利润	0.0113
期末资产净值	113,169,710.57
期末每份额净值	1.2011
期末每份额累计净值	1.2011

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73.95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	0.30%	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	3.8%	3%	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

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 1.2011 元，累计单位净值 1.2011 元。本报告期内，本资产管理计划的净值增长率为 0.8565%。

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：

贾鹏先生，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

2023 年影响利率走势的核心主线是“强预期”和“弱现实”的纠结以及由此带来的政策博弈。全年看，长端利率整体走低。短端利率走势与长端利率基本同步，个别时间段有所分化——即短端利率因资金面收紧而快速上行，但长端利率因基本面偏弱而有所下行——全年看短端利率表现不及长端。

投资方面，产品始终坚持以配置为主要的策略，围绕宏观经济发展和市场变化，选择中高等级信用债进行投资，久期方面根据市场变化进行灵活的调整，同时产品根据资金面对杠杆水平进行调整。

2. 投资展望

展望后市，随着疫情“疤痕效应”的逐步消退，居民商品消费还有较大修复空间，在消费转型升级推动下，以旅游、出行为代表的服务消费有望继续保持较快增长水平。2024 年的房地产可能是影响经济修复的重要变量，随着行业调控政策的变化，加之“三大工程”全面推进，房地产投资下滑幅度将明显缓和；房地产投资和涉房消费对经济增长的拖累效应将得到缓解。产品将保持定力，控制好持仓的整体久期，继续选择确定性较强的品种进行投资，适当参与交易性机会的把握。

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 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 4 名，合计持有份额：1,515,597.07 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	0.00	0.00
3. 固定收益类资产	102,264,310.21	82.91
其中：债券	102,264,310.21	82.91
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	20,283,317.71	16.44
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	451,026.84	0.37
7. 其他资产	351,956.34	0.29
总资产合计	123,350,611.10	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	1,956.34
2	应收证券清算款	50,000.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	0.00
5	应收申购款	300,000.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
	合计	351,956.34

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	10,063,291.50	8.89
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	1928036	19 中信银行永续债	20,310,196.72	17.95
2	102280041	22 济南城建 MTN001	10,380,567.12	9.17
3	1928014	19 华夏银行永续债	10,348,450.82	9.14
4	1928021	19 农业银行永续债 01	10,261,167.12	9.07
5	102002296	20 株洲城建 MTN004	10,155,114.75	8.97

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	97,764,367.21
红利再投资份额	0.00
报告期间赎回份额	43,666,121.76
报告期间申购份额	40,122,891.60
期末份额总额	94,221,137.05

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



附：托管人履职报告