



华宝证券华量安瑞 3 号 FOF 集合资产管理计划 2023 年第三季度资产管理报告

计划管理人：华宝证券股份有限公司

计划托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告期间：2023 年 7 月 1 日— 2023 年 9 月 30 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	华宝证券华量安瑞3号FOF集合资产管理计划
计划类型	混合类
计划成立日	2021年5月13日
计划成立规模	64,023,007.35份
报告期末规模	106,084,900.95份
计划存续期限	10年
计划的分级	不分级
管理费	本集合资管计划的管理费按前一日集合计划资产净值的1%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	本集合资管计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.03%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	管理人于委托人申请退出、收益分配及计划终止/提前终止时取管理人业绩报酬。业绩报酬计提期间的年化收益率小于等于7%，不提取业绩报酬；如业绩报酬计提年化收益率高于7%，提取年收益率大于7%部分的20%作为业绩报酬。
风险收益特征	中等风险
计划投资范围	<p>(1) 沪深证券交易所和银行间市场上市或挂牌交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、债券逆回购（包括质押式回购、质押式协议回购等），现金、银行存款、货币市场基金；</p> <p>(2) 资产管理产品：银行理财产品，公募证券投资基金，资金信托计划，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、期货公司、期货子公司发行的资产管理产品，于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>(3) 中国金融期货交易所上市的股指期货。</p>
投资顾问	无投资顾问

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：国泰君安证券股份有限公司

办公地址：上海市新闻路669号博华广场19楼

电 话：021-38677336

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7月1日—2023年9月30日)
本期利润	885,921.42
本期单位净值增长率	0.7416%
期末资产净值	123,937,343.26
期末单位资产净值	1.1683
单位累计净值增长率	16.8300%

2. 资管计划累计净值走势图

日期：2021年5月13日—2023年9月30日



三. 资管计划管理人履职报告



1. 投资经理简介

高圣豪, 男, 上海财经大学应用统计硕士。2013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组合投资部 FOF 投资经理。历任华宝证券资产管理部投资助理、投资经理。覆盖量化、指增、可转债、套利等私募策略筛选; 投资风格动态多样, 逻辑严谨另类, 决策知行合一。

王翔, 男, 上海交通大学电子工程系硕士, CFA。2010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组合投资部总经理。曾任红塔证券股份有限公司投资管理部投资经理。擅长各类量化策略的筛选、评估与投资。

2. 投资经理工作报告

7月万得全A指数上涨2.47%, 上证50上涨6.47%, 沪深300上涨4.48%, 中证500上涨1.49%, 中证1000下跌-1.31%。从各大宽基指数表现看, 风格极端偏向大票。月底政治局会议再次强调宏观政策需要更积极, 力度也会再加码。会议提及货币政策、财政政策、刺激消费、稳定就业、优化地产、重视民营经济等几点, 对市场提振作用明显, 投资者开始从“弱现实、弱预期”转向了“弱现实、强预期”。之后8月市场再次大幅回落, 上证指数下跌-5.2%, 宽基指数中, 沪深300和中证1000跌幅最大, 分别为-6.21%、-6.32%; 其次是中证500和上证50, 分别下跌-5.73%, -5.39%。市值风格未有明显分化, 整体上呈普跌态势, 本轮下跌很大一部分原因是人民币汇率贬值(单月贬值1.8%)引起的北向资金出逃导致。与其相对的是商品指数延续7月份上涨行情, 单月上涨4.27%, 目前经济在温和复苏阶段, 企



业即将重新进入补库存周期，因此抬升了各大宗商品的价格。另外，8月底监管对于程序化交易的关注度有所提升，我们也与相关的合作私募沟通了一轮，一致认为单产品规模过大或者较依赖算法交易的策略会受一些影响，排查当前所投私募产品，均无以上特征，因此短期内持续关注相关政策的后续变化即可。9月市场小幅下探，上证指数下跌-0.3%，宽基指数结构分化明显，受新能源板块影响，沪深300指数单月跌幅较大-2.01%，中证500和中证1000分别下跌-0.85%、-0.42%，上证50在金融板块支撑下小幅下跌-0.13%。

综合看主要是行业分化影响。月度上北向单边流出374亿，统计今年以来北向情况，除1月份流入1400亿外，2-9月净流出约500亿，考虑本月人民币汇率走势较平稳，9月北向流出主要是外资对A股信心较弱造成。成交量日均7000亿左右，统计2022年1月至今的月级别交易量，目前处于第二低位。

后市看，当前权益市场的“政策底”特征凸显，中长期我们认为权益市场会随着经济复苏而回暖。

3. 报告期末的杠杆使用情况

本计划报告期末未涉及杠杆使用。

4. 是否涉及关联交易

本报告期内，基于正常的资产配置需求，本计划发生以下关联交易：

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）
2023/09/01	参与	国泰君安量化选股混合D	上海国泰君安证券资产管理有限公司	托管人及其关联方发行的证券	4,600,000.00



			司		
--	--	--	---	--	--

相关情况已进行披露。

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	4,556,446.06	3.67
3	债券		
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		
9	企业短期融资券		
10	可转债		
11	银行间中期票据		
12	同业存单		
13	私募债		
14	地方政府债		
15	权证		
16	资产支持证券		
17	理财产品投资	103,111,344.73	82.96
18	货币市场工具（票据、CD）		
19	现金（银行存款及清算备付金）	2,977,202.04	2.40
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）	13,638,980.98	10.97
22	其中：买入返售证券		
23	资产合计	124,283,973.81	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（%）
-	-	-

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（%）
1	018963	国泰君安量化选股混合 D	3.68

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（%）
1	中证 1000 股指期货 2312 合约	-12.69

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	华量九坤 1 号私募基金	12.77
2	华量锐天瑞系列 1 号私募证券投资基金	8.19
3	凯读投资君怡 3 号私募证券投资基金	7.92
4	华量黑翼 CTA 私募证券投资基金	7.15
5	华量黑翼 CTA 私募证券投资基金 B 级	5.66
6	添福利私募证券投资基金磐晟十八期	5.37
7	乾行天合 6 号私募证券投资基金	4.39
8	纽达投资可转债一号私募证券投资基金 A	3.92
9	衍复 300 指增一号私募证券投资基金	3.33
10	天演赛能证券投资基金	2.73

五. 资管计划期间份额变动

日期：2023 年 7 月 1 日—2023 年 9 月 30 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
107,456,216.73	6,188,281.45	7,559,597.23	106,084,900.95

六. 本集合资管计划管理人自有资金参与情况

日期：2023 年 9 月 30 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（%）
106,084,900.95	7,500,675.00	7.07

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

《华宝证券华量安瑞 3 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》《华宝证券华量安瑞 3 号 FOF 集合资产管理计划计划说明书》《华宝证券华量安瑞 3 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》、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

