

# 华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合 资产管理计划 2024 年第二季度 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 7 月 30 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 7 月 5 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 2024 年 4 月 1 日起，至 2024 年 6 月 30 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	华金证券股份有限公司鸿盈 3 号集合资产管理计划
类型	固定收益类
成立日	2021 年 2 月 8 日
成立份额总额	13,471,426.09 份
报告期末份额总额	61,681,188.44 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
本期利润	2,320,683.98
每份额本期利润	0.0376
期末资产净值	63,446,686.98

期末每份额净值	1.0286
期末每份额累计净值	1.2050

注：期末每份额净值为计提业绩报酬前的份额净值。截至 2024 年 6 月 30 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定义）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、资产管理计划收益分配情况

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%	收益分配基准日、份额退出日和终止日计提并支付业绩报酬	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 2024 年 6 月 30 日，本资产管理计划单位净值为 1.0286 元，累计单位净值 1.2050 元。本报告期内，本资产管理计划的净值增长率为 3.7418%。

## 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

2024 年二季度经济基本面仍处在弱复苏态势之中，内需偏弱的问题依旧突出。权益市场二季度先涨后跌，成交总体表现并不活跃，主题性交易机会为主。转债市场跟随权益市场先扬后抑、冲高回落，中证转债指数最终季度上涨 0.75%。由于风险警示、评级下调等引发的信用风险担忧升级叠加权益市场回落，使得转债指数在后半季度大幅下滑。受此影响，转债市场内部走势也较前期呈现较为明显的差异，低价券种估值下移，低价券信用体系重估。绩优个券在此期间反而受冲击相对较少，不少弹性充足在二季度出现了不俗的上涨空间。产品的转债投资中对转债基本面有较高要求，因此这波信用冲击导致的市场回调对产品影响不大，我们进一步提升了对绩优个券的集中度，以规避相关的信用冲击。在行业配置上，基于对景气回升的考量，产品增加了消费电子、芯片等行业的配置。

#### 2. 投资展望

展望 2024 年三季度，当前 A 股市场部分估值和交易指标已经重新回到历史较为极端水平，反映当前资产价格可能已经反应过度悲观预期。我们认为自 2 月份以来，今年预期最为悲观时期可能已经过去，即将召开的“二十届三中全会”及“七月政治局会议”可能出台进一步促进经济发展的政策措施，市场当前位置中期机会仍大于风险。转债市场经历二季度的波动，虽然低价券信用风险担忧短期难言结束，但基本面未有瑕疵的个券受整体市场回落影响估值已然偏低。在后期中，产品择券方面会更加重视正股行业及基本面。在权益市场持续震荡态势下，产品将更关注主题热点个券的交易机会、基本面绩优个券超跌机会，同时伴随中报预披露逐渐释放，关注业绩具备确定性转债，积极轮动，落袋增厚收益。

### 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，本资产管理计划未发生投资经理变更。

#### 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 2024 年 6 月 30 日，管理人自有资金持有本资产管理计划份额

9,868,928.47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：3,029,380.75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受托资产，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，保证所管理的受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，及时准确办理受托资产的清算交收。

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，说明报告期内受托资产的配置状况、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	18,701,389.04	29.39
3. 固定收益类资产	41,201,070.97	64.74
其中：债券	41,201,070.97	64.74
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	720,399.83	1.13
7. 其他资产	3,016,971.58	4.74
总资产合计	63,639,831.42	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	3,012,193.51
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	4,778.07
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	3,016,971.58

## 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	110016	易方达货币B	10,246,526.60	16.15
2	511990	华宝添益	7,939,214.47	12.51
3	123107	温氏转债	2,060,785.60	3.25
4	111007	永和转债	1,999,418.92	3.15
5	127043	川恒转债	1,928,736.39	3.04

#### 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、参与国债期货、股指期货交易的有关情况

本资产管理计划不涉及国债期货、股指期货投资。

#### 七、参与期权交易的有关情况

本资产管理计划不涉及期权投资。

#### 八、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	62,370,309.19
红利再投资份额	0.00
报告期间赎回份额	689,120.75
报告期间申购份额	0.00
期末份额总额	61,681,188.44

### 第八节 备查文件及查阅方式

#### 一、备查文件

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

