

华宝证券华量辉耀 1 号 FOF 集合资产管理计划 2024 年第二季度资产管理报告

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：2024 年 4 月 1 日— 2024 年 6 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	华宝证券华量辉耀1号FOF集合资产管理计划
计划类型	混合类
计划成立日	2020年2月19日
计划成立规模	10,901,156.50份
报告期末规模	24,902,812.44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1.000%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0.030%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	管理人根据每笔参与份额的高水位法原则提取业绩报酬，于委托人申请退出、收益分配及计划终止/提前终止时提取业绩报酬。业绩报酬计提标准为：管理人提取超过每笔参与份额上一发生业绩报酬计提日的计划累计单位净值高水位线部分的5%作为业绩报酬。
风险收益特征	中高风险
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，现金，银行存款，货币市场基金；</p> <p>(2) 银行理财产品，公募证券投资基金，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、期货公司子公司发行的资产管理计划，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交易的股指期货，证券交易所上市的股票期权。</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

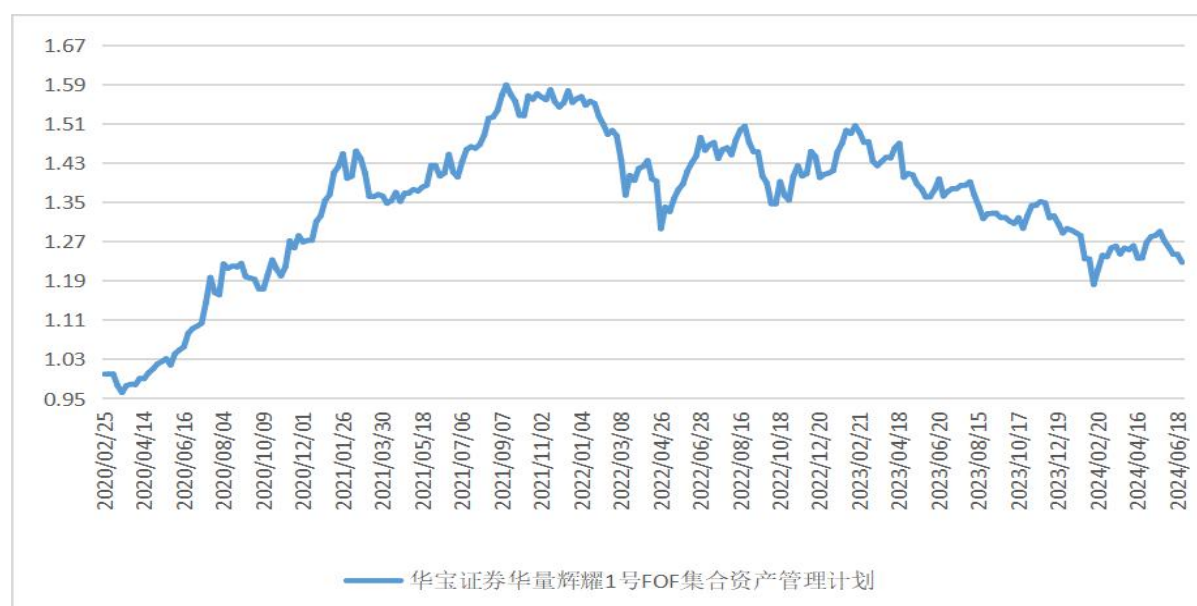
1. 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	本期间 (2024年4月1日—2024年6月30日)
本期利润	-492,480.04
本期单位净值增长率	-1.5907%
期末资产净值	30,504,595.93
期末单位资产净值	1.2249
单位累计净值增长率	22.4900%

2. 资管计划累计净值走势图

日期：2020年2月19日—2024年6月30日



三. 资管计划管理人履职报告

1. 投资经理简介

樊彬彬, 女, 上海财经大学金融学硕士, 中央财经大学金融学本科, CPA。2016 年起从事金融行业, 2020 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。曾任天风证券资管 FOF 投资助理等岗位。擅长国内外宏观经济分析, 大类风格和行业策略配置等。

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

二季度, 整体市场先扬后抑。其中, 上证指数下跌 2.43%, 沪深 300 下跌 2.14%, 中证 500 下跌 6.5%, 中证 1000 下跌 10.02%, 万得全 a 下跌 5.32%, 恒生指数上涨 7.12%。二季度整体港股表现较优, 与港股整体估值较低, 以及南向资金持续流入有关。二季度中, 政策对房地产放松力度非常大, 从之前强调的“三大工程”, 转向需求侧管理。这是政策转向的一个重要信号。

展望三季度, 七月底有新一轮的关于经济的政治局会议。同时, 三中全会召开时间已定, 重点研究进一步全面深化改革、推进中国式现代化问题。中国式现代化的关键是实现科技的自主可控。因此, 三季度重点仍是围绕新质生产力/科技相关的链条寻找机会。此外, 上游资源品的牛市仍未结束, 积极关注回调后的布局机会。关于港股, 南向资金是持续流入的,

这是对港股下有底的坚实支撑。

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）
2024/05/07	退出	华安创业板50ETF	华安基金管理有限公司	托管人及其关联方发行的证券	65,037.40
2024/05/10	退出	华安创业板50ETF	华安基金管理有限公司	托管人及其关联方发行的证券	575,976.96
2024/05/10	参与	长信全球债券人民币	长信基金管理有限责任公司	管理人及其关联方发行的证券	599,520.38

相关情况已进行披露。

5. 报告期末非标投资情况

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	12,812,699.38	41.89
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	14,295,797.95	46.74
18	货币市场工具（票据、CD）		
19	现金（银行存款及清算备付金）	2,069,299.49	6.77
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）	1,410,370.82	4.61
22	其中：买入返售证券		
23	资产合计	30,588,167.64	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	518880	黄金 ETF	8.68
2	517520	黄金股	7.51
3	159920	恒生 ETF	5.68
4	510900	H 股 ETF	4.82
5	159937	黄金 9999	3.87
6	510300	300ETF	3.43
7	513530	港股红利	2.48
8	004998	长信全球债券(QDII)	2.00
9	100050	富国全球债券(QDII)A	1.99
10	004191	招商沪深 300 指数增强 C	1.55

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 500 股指期货 2409 合约	6.39

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	锐天平信 300 指增 1 号	9.09
2	乾行天丰价值发现一号私募证券投资基金	7.78
3	裕恒双龙 8 号私募证券投资基金	6.15
4	千衍六和 2 号私募证券投资基金	6.01
5	绰瑞北岳 34 号私募证券投资基金	5.53
6	千衍六贞 1 号私募证券投资基金	4.90
7	绰瑞北岳 26 号私募证券投资基金	4.26
8	华炎晨轩私募证券投资基金	3.14

五. 资管计划期间份额变动

日期：2024年4月1日—2024年6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
24,902,812.44	0.00	0.00	24,902,812.44

六. 本集合资管计划管理人自有资金参与情况

日期：2024年6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（%）
24,902,812.44	1,500,135.00	6.02

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

《华宝证券华量辉耀 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》《华宝证券华量辉耀 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》《华宝证券华量辉耀 1 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

华宝证券股份有限公司

2024 年 7 月