

华宝证券华享添利周周盈 3 号
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：华泰证券股份有限公司

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	华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划
计划类型	固定收益类
计划成立日	2022年7月13日
计划成立规模	10,000,000.00份
报告期末规模	76,528,610.19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0.600%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0.010%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	无
风险收益特征	中低风险
计划投资范围	<p>(1) 交易所和银行间市场上市或挂牌交易标准化债权类资产，包括但不限于国债、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债、无固定期限资本债券、保险公司资本补充债券）、二级资本工具、永续债、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行、项目收益债券）、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、标准化票据、非公开定向债务融资工具、以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等。债券逆回购（包括质押式回购、质押式协议回购、买断式回购等）、同业存单；银行存款、现金；</p> <p>(2) 资产管理产品：公募证券投资基金（包括货币市场基金、公募REITs、同业存单基金、债券型基金），商业银行或其理财子公司发行的理财产品，信托计划，基金公司资产管理计划、基金子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划、证券公司子公司资产管理计划、保险资产管理计划、保险公司子公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、期货公司子公司资产管理计划；</p> <p>本计划可参与债券正回购（包括质押式回购、协议回购、买断式回购）。</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：华泰证券股份有限公司

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路228号

电 话：025-83389988

二. 主要财务指标和资产管理计划净值表现

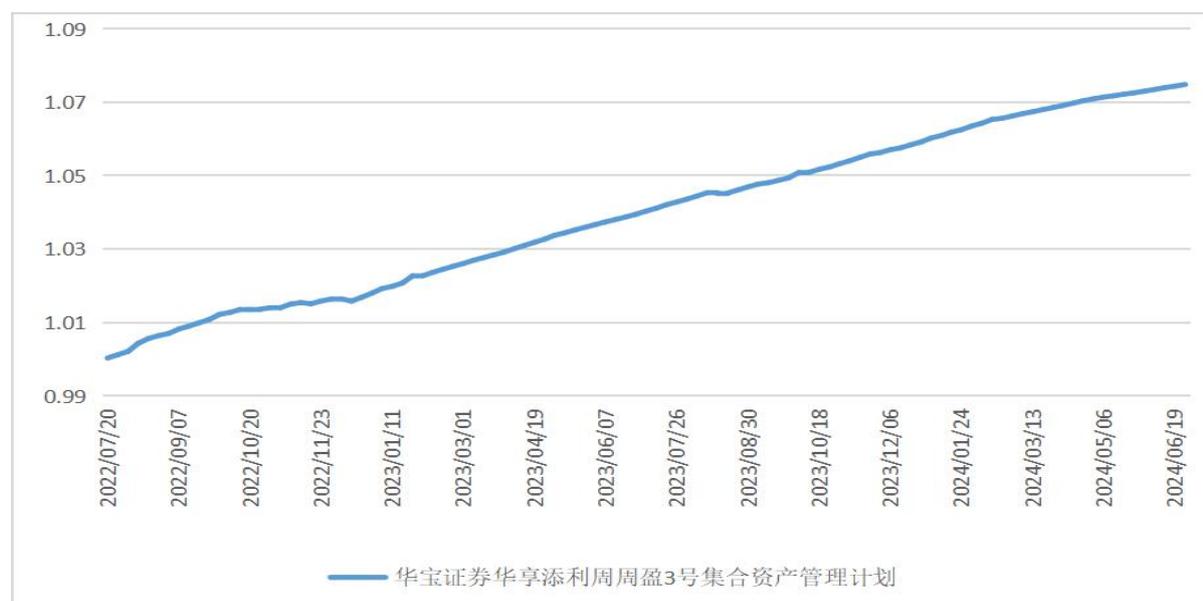
1. 主要财务指标

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	663,943.03
本期单位净值增长率	0.5856%
期末资产净值	82,273,128.12
期末单位资产净值	1.075064
单位累计净值增长率	7.5064%

2. 资管计划累计净值走势图

日期：2022年7月13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

李孟帆, 女, 上海财经大学金融计量硕士。2016年起从事金融行业, 2022年加入华宝证券, 现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任商业银行信用分析经理, 华鑫证券资管信评负责人。拥有丰富的固定收益类资产信用研究经验、深耕各行业信用轮动, 投资风格稳健, 擅长信用债、ABS 等投资品种的精选挖掘。

任雅姗, 女, 中央财经大学经济学硕士。2015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固定收益部投资经理。历任债券交易员、投资助理、投资经理。擅长信用债、ABS、利率债等品种的投资研究。

王李瑞, 男, 复旦大学风险管理与保险硕士, FRM。2016年起从事金融行业, 2022年加入华宝证券, 现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任建信保险资产管理有限公司研究员、投资助理、投资经理。投资风格稳健、策略多元, 擅长信用债、可转债等投资品种的精选挖掘, 注重自上而下的大类资产配置。

2. 投资经理工作报告

2024年二季度债券整体波动下行, 4月快速回调后, 市场再度延续下行趋势。4月在央行喊话关注长端利率风险后, 债市进入调整阶段。随着进入5月, 经济数据不及预期, 资金宽松及资产荒的推动下, 央行喊话效应弱化, 市场做多情绪升温。而政府债供给计划落地也让供给冲击证伪, 市场再度进入单边下行行情, 在6月下旬资金转紧的情况下, 一度与资金

走势背离。

整体来看，目前债券市场牛市未尽，但短期下行难度加大；一方面，央行持续对超长端交易进行敲打（通过债券借贷、正逆回购新建利率走廊等方式），叠加对资金收紧，收益率短期内下行难度较大；另一方面，宏观基本上预计仍将延续修复逻辑，生产强、需求弱的格局推动被动补库存，后续销售价格可能进一步承压。最后，在合意项目供给不足，政府债供给节奏整体偏慢的情况下，资产荒格局短期内难以打破，资产配置压力仍存，利率往上亦存在较大阻力。三季度我们将重点关注政策层面的内容，包括三中全会和政治局会议，能否进一步提升市场预期和风险偏好。综上，当前基本面对长端利率仍有安全边际，债牛行情仍未见明显拐点，但短期央行的操作影响市场走势，可以考虑在波动区间内做交易进行收益增厚。信用方面，关注部分产业债的投资机会，在资质上仍需保持相当谨慎。

3. 报告期末的杠杆使用情况

报告期末，本产品杠杆率为 103.93%。

4. 是否涉及关联交易

本报告期内，本计划不涉及关联交易。

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）
-	-	-	-	-	-

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		
3	债券	21,009,917.99	24.57
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	8,347,814.81	9.76
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	12,662,103.18	14.81
14	地方政府债		

15	权证		
16	资产支持证券		
17	理财产品投资	63,699,913.68	74.50
18	货币市场工具（票据、CD）		
19	现金（银行存款及清算备付金）	784,686.95	0.92
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）	8,274.88	0.01
22	其中：买入返售证券		
23	资产合计	85,502,793.50	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（%）
1	23 安吉城投 PPN002	6.09
2	22 开经 01	4.89
3	23 商建 04	4.87
4	23 牟发 03	4.87
5	16 平供水项目 NPB	3.87

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（%）
-	-	-	-

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（%）
-	-	-

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	永诚资产永盈安享 2 号资产管理计划	24.75
2	华安财保资管安源 5 号集合资产管理计划	18.33
3	国华兴益资管日馨月益 2 号产品	18.28
4	国华兴益资管日馨月益 1 号产品	9.75
5	西部信托·永宁 10 号债券投资集合资金信托计划	6.31

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
110,611,640.02	11,856,282.09	45,939,311.92	76,528,610.19

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 (%)
76,528,610.19	0.00	0.00

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. 自 2024 年 5 月 8 日起，本计划投资经理由王淑美、任雅姗、王李瑞变更为李孟帆、任雅姗、王李瑞担任。
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

《华宝证券华享添利周周盈 3 号集合资产管理计划资产管理合同（第三版）》《华宝证券华享添利周周盈 3 号集合资产管理计划计划说明书（第三版）》、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