

华兴证券科创板和林科技1号战略配售集合资产管理计划

季度报告

(2021年第三季度)

第一节 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人招商银行股份有限公司北京分行于2021年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2021年07月01日至2021年09月30日

第二节 集合资产管理计划概况

名称：	华兴证券科创板和林科技1号战略配售集合资产管理计划
类型：	权益类集合资产管理计划
成立日：	2021年1月18日
报告期末份额总额：	35,858,336.64
投资目标：	本集合计划主要投资于苏州和林微纳科技股份有限公司本次发行战略配售之高管及核心员工战略配售股票，高管及核心员工利益与和林微纳绑定，力争追求和林微纳业绩增长带来的股价上涨收益。
固定管理费：	本集合计划固定管理费按前一日集合计划资产净值的0.28%年费率计提，每日计算，逐日累计，每季度支付一次。

托管费：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.02%年费率计提，每日计算，逐日累计，每季度支付一次。

业绩报酬：本集合计划不提取业绩报酬

管理人：华兴证券有限公司

托管人：招商银行股份有限公司北京分行

注册登记机构：华兴证券有限公司

第三节 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

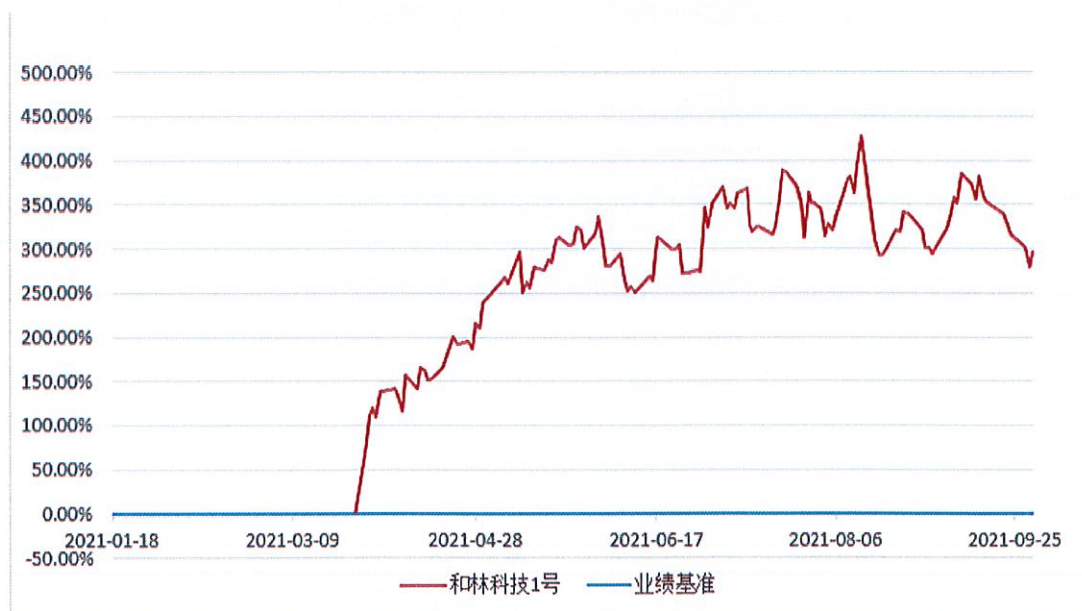
一、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	-18,151,991.72
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-54,904.35
期末资产净值	142,428,908.59
期末每份额净值	3.9720
期末每份额累计净值	3.9730

二、本期每份额净值增长率与业绩报酬计提基准的比较

阶段	净值增长率①	业绩报酬计提基准②	①-②
这3个月	-11.30%	0	-11.30%

三、集合计划累计每份额净值增长率与业绩报酬计提基准的历史走势对比图



第四节 管理人报告

一、业绩表现

截至 2021 年 09 月 30 日，本集合计划单位净值 3.9720 元，累计单位净值 3.9730 元，本期集合计划收益率增长-11.30%。

二、投资经理简介

吴昱斌，华兴证券资产管理事业部权益投资经理，主要负责资管产品投资管理工作。厦门大学双学士，中国科学院硕士，CPA，CFA level 3 passed。任投资经理前，从事电子、计算机和医药行业的研究工作，加入华兴证券前，就职于中信证券资产管理部。

三、投资经理工作报告

1、市场回顾和投资操作

股票市场方面，上证指数三季度下跌 0.64%，深圳成指下跌 5.62%，创业板指下跌 6.69%；结构性行情明显，周期板块大幅上涨，消费、医药等板块持续下跌。

账户操作上，无操作。

2、市场展望和投资策略

（1）市场展望

展望四季度，市场处于宏观经济下行叠加货币边际宽松的一个组合当中，预计大盘以震荡为主。

（2）投资策略

本集合计划在严格做好风险控制的基础上，参与苏州和林微纳科技股份有限公司本次发行战略配售；苏州和林微纳科技股份有限公司发行战略配售对象为高管及核心员工，高管及核心员工利益与和林微纳绑定，力争追求和林微纳业绩增长带来的股价上涨收益。

四、投资风险和风险控制

1、主要投资风险

1.1 科创板股票的投资风险

（1）投资失败风险：本集合计划的投资范围重点为苏州和林微纳科技股份

有限公司本次发行战略配售的标的股票，若和林微纳发行不成功，则集合计划将无法参与本次发行战略配售，集合计划收益将受到影响；或者如果和林微纳发行成功，但在本次发行战略配售过程中，集合计划无法获得预期的配售比例，集合计划收益也将受到影响。

(2) 公司风险：科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，可能存在首次公开发行前未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，以及上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形，从而影响计划的收益而产生风险。

(3) 价格波动风险：科创板企业市场可比公司较少，发行定价难度较大，上市后可能存在股价波动的风险，且科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，存在价格波幅较大而导致亏损的风险。

(4) 差异风险：科创板股票在发行规则、报价要求、交易机制、临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度、特别表决权机制、股权激励制度等方面与上交所主板市场股票交易存在差异；且科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，速度更快；退市情形更多，执行标准更严；可能影响计划的收益而产生风险。

(5) 退出受限风险

根据《上海证券交易所科创板股票发行与承销实施办法》中关于“发行人的高级管理人员与核心员工可以设立专项资产管理计划参与本次发行战略配售。前述专项资产管理计划获配的股票数量不得超过首次公开发行股票数量的 10%，且应当承诺获得本次配售的股票持有期限不少于 12 个月”的政策要求。【苏州和林微纳科技股份有限公司】首次公开发行人民币普通股股票战略配售的锁定期间（自发行人首次公开发行股票并上市之日起 12 个月）本集合计划封闭运作，不设开放日，委托人只能在锁定期后的退出开放期间办理退出。

另外锁定期满后，由于市场缺乏流动性、委托人的退出申请不符合法律法规、监管机构、交易所有关科创板股票减持规则的规定，或不符合委托人作出的有关标的股票持有期限的承诺，则持仓股票无法变现而造成委托人无法退出的风险。

2、风险控制

2021 年第三季度，华兴证券针对本集合计划的运作特点，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，并提醒投资经理采取相应的风险规避措施，确保集合计划合法合规、正常运行。同时，本集合计划通过完善的风险指标体系和定期进行的风险状况分析，及时评估集合计划运作过程中面临的各种风险，为投资决策提供风险分析支持，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致，以实现本集合计划追求中长期内资本增值的投资目标。在本报告期内，本集合计划运作合法合规，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。

第五节 投资组合报告

一、资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例
股 票	145,740,000.00	99.72%
债 券	-	-
基 金	-	-
银行存款及清算备付金合计	408,061.16	0.28%
其他资产	39.7	0.00%
合 计	146,148,100.86	100.00%

二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例
1	688661	和林微纳	2,000,000.	145,740,000.00	102.32%

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

本集合计划报告期末未持有债券。

四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

本集合计划报告期末未持有基金。

五、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

本集合计划报告期末未持有权证。

六、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

第六节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	35,858,336.64
报告期内总参与份额	-
红利再投资份额	-
报告期内总退出份额	-
报告期末份额总额	35,858,336.64

第七节 重要事项提示

一、本集合计划管理人相关事项

- 1、本集合计划管理人在本报告期内没有发生与本集合计划相关的诉讼事项。
- 2、本集合计划管理人办公地址未发生变更。
- 3、本集合计划的管理人高级管理人员没有受到任何处罚。

二、本集合计划中管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方的参与情况

本集合计划报告期末无上述投资者参与。

三、本集合计划运用杠杆情况

资产总值①	资产净值②	杠杆率（①/②）
146,148,100.86	142,428,908.59	1.03

四、本集合计划收益分配情况

本集合计划报告期间未进行收益分配。

五、本集合计划投资经理变更情况

本集合计划报告期间未进行投资经理变更。

六、本集合计划重大关联交易情况

本集合计划报告期间无重大关联交易。

七、本集合计划其他相关事项

无

第八节 信息披露的查阅方式

网址：<https://am.huaxingsec.com/>

热线电话：400-156-8888



附