

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
2021 年报告

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

送出日期：2022 年 4 月 29 日

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2022年04月18日复核了本报告中的财务会计报告、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。

本报告期间：2021年01月18日至2021年12月31日

目录

一、集合资产管理计划概况	3
二、主要财务指标、集合资产管理计划净值表现	5
三、管理人报告	6
四、财务会计报告	8
五、投资组合报告	10
六、集合计划份额变动	11
七、重要事项提示	11
八、备查文件目录	13

一、集合资产管理计划概况

1、基本资料

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

2、管理人

名称:	华兴证券有限公司
注册地址:	上海市虹口区东大名路1089号2301单元

办公地址：上海市虹口区东大名路1089号2301单元
法定代表人：项威
联系地址：上海市虹口区东大名路1089号2301单元
联系电话：021-60156666
传真：021-60156680
网址：www.huaxingsec.com

3、托管人

名称：招商银行股份有限公司北京分行
注册地址：北京市西城区复兴门内大街156号
办公地址：北京市西城区月坛南街一号院3号楼11层
法定代表人：张诚
联系地址：北京市西城区月坛南街一号院3号楼11层
联系电话：010-86493037
传真：010-66428045
网址：www.cmbchina.com

4、注册登记机构

名称：华兴证券有限公司
办公地址：上海市虹口区东大名路1089号2301单元
网址：www.huaxingsec.com

5、会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
地址：中国上海延安东路222号外滩中心30楼
首席合伙人：付建超

项目合伙人： 孙维琦
 联系电话： 021-61418888
 传真： 021-63350177

二、主要财务指标、集合资产管理计划净值表现

1、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	147,091,216.60
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-869,948.45
期末资产净值	183,004,171.43
期末每份额净值	5.1035
期末每份额累计净值	5.1045

2、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
过去三个月	28.49%	0	28.49%
过去一年	410.47%	0	410.47%
合同生效日至今	410.47%	0	410.47%

3、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



三、管理人报告

1、业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 5.1035 元，累计单位净值 5.1045 元，本期集合计划收益率增长 410.47%。

2、投资经理简介

张晨，上海交通大学高级金融学院（SAIF）金融 MBA，FRM。现任华兴证券有限公司资产管理事业部投资经理，曾任日本三井住友银行、韩国国民银行资金交易负责人、苏州银行高级债券投资经理、天风证券资产管理上海分公司高级投资经理、深圳天风天成资产管理有限公司投资总监及上海分公司总经理。拥有 17 年的股票、债券和衍生品投研和团队管理经验。

3、投资经理工作报告

1) 市场回顾和投资操作

2021 年，股票市场不同板块表现存在一定程度的分化，全年上证综指上涨 4.80%，深证成指上涨 2.67%；上证 50 和沪深 300 分别下跌 10.06%和 5.20%，而中证 500 与中证 1000 分别上涨 15.58%和 20.52%。中信 30 个一级行业板块中，全年 22 个板块上涨，其中电力设备及新能源、基础化工、有色金属、煤炭和钢铁等行业板块上涨幅度均超过 40%，机械板块全年涨幅 15.21%，

2) 市场展望和投资策略

2022 年初主要股票指数均出现一定程度下跌，权益资产价格波动性增大，市场走向的不确定性也明显提高；本产品投资的主要资产预计于 2022 年解除限售，管理人将结合估值水平、市场情绪等多方面因素，合理管理产品持仓结构。

4、投资风险和风险控制

1) 主要投资风险

①科创板股票的投资风险

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。

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。

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。

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。

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。

以上风险揭示的内容仅为本集合计划目前投资组合的主要风险，未能详尽列

明投资者参与本集合计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。

2) 风险控制

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。

四、财务会计报告

1. 集合计划期末资产负债表（单位：人民币元）

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
资 产：		负 债：	
银行存款	287,918.65	短期借款	0.00
结算备付金	0.00	交易性金融负债	0.00
存出保证金	0.00	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	187,820,000.00	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	187,820,000.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	0.00	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	123,464.03
权证投资	0.00	应付托管费	8,818.84
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	0.00
买入返售金融资产	0.00	应交税费	4,971,495.15
应收证券清算款	0.00	应付利息	0.00
应收利息	30.80	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	0.00
应收申购款	0.00	负债合计	5,103,778.02
其他资产	0.00		

		所有者权益：	
		实收基金	35,858,336.64
		未分配利润	147,145,834.79
		所有者权益合计	183,004,171.43
资产合计	188,107,949.45	负债和所有者权益总计	188,107,949.45

2. 集合计划本期损益表（单位：人民币元）

项目	本年累计数
一、收入	148,160,309.17
1、利息收入	6,502.54
其中：存款利息收入	3,036.38
债券利息收入	0.00
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售证券收入	3,570.14
其他利息收入	0.00
增值税利息收入抵减	-103.98
2、投资收益	192,641.58
其中：股票投资收益	0.00
债券投资收益	0.00
基金投资收益	0.00
权证投资收益	0.00
资产支持证券投资收益	0.00
衍生工具收益	0.00
股利收益	192,641.58
其他投资收益	0.00
增值税投资收益抵减	0.00
3、公允价值变动收益	147,961,165.05
其中：公允价值变动收益	152,400,000.00
增值税公允价值变动收益抵减	-4,438,834.95
4、其他收入	0.00
二、费用	1,069,092.57
1、管理人报酬	334,127.58
2、托管费	23,866.31
3、销售服务费	0.00
4、交易费用	177,100.00

5、利息支出	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00
6、其他费用	1,326.00
7、税金及附加	532,672.68
三、利润总和	147,091,216.60

五、投资组合报告

1、报告期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例
股 票	187,820,000.00	99.85%
债 券	-	-
基 金	-	-
银行存款及清算备付金合计	287,918.65	0.15%
其他资产	30.80	0.00%
合 计	188,107,949.45	100.00%

2、报告期末按券种分类的债券投资组合

本集合计划报告期末未持有债券。

3、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名债券明细

本集合计划报告期末未持有债券。

4、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例
1	688661	和林微纳	2,000,000.00	187,820,000.00	102.63%

本集合计划报告期末仅持有1只股票。

5、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

本集合计划报告期末未持有资产支持证券。

6、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名基金明细

本集合计划报告期末未持有基金。

7、报告期末按市值占资产净值比例大小排序的前十名权证明细

本集合计划报告期末未持有权证。

8、报告期末股指期货、国债期货交易情况说明

本集合计划报告期末未持有股指期货、国债期货。

9、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。

六、集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	10,000,145.83
报告期内总参与份额	33,420,290.17
红利再投资份额	-
报告期内总退出份额	7,562,099.36
报告期末份额总额	35,858,336.64

七、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发生变更：
变更前的地址为：上海市虹口区吴淞路575号2501室
变更后的地址为：上海市虹口区东大名路1089号2301单元
- 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）
188,107,949.45	183,004,171.43	1.03

四、本集合计划收益分配情况

1、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收益分配公告

<https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1622702446488->

[hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhsyfpgg.pdf](https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1622702446488-hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhsyfpgg.pdf)

五、本集合计划投资经理变更情况

1、关于变更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投资经理的公告

<https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1619161065698->

[gybg hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhtzjldgg.pdf](https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1619161065698-gybg hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhtzjldgg.pdf)

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

1、关于华兴证券有限公司旗下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拟变更合同相关条款的公告

<https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1621589324519->

[gyhxzqyxgsqxhxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhnbghtxgtdgg.pdf](https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1621589324519-gyhxzqyxgsqxhxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhnbghtxgtdgg.pdf)

2、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封闭期公告

<https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1615880511827->

[hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhfbqgg.pdf](https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1615880511827-hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhfbqgg.pdf)

3、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成立公告

<https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1610957002237->

[hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhclgg.pdf](https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1610957002237-hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgjljhclgg.pdf)

4、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销售公告

<https://am.huaxingsec.com/upload/pdf/1610517639490-hxzqkcbhlkj%201hzlpsjhzcgljhxsgg.pdf>

八、备查文件目录

- 1、中国证券投资基金业协会批准设立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的文件
- 2、《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说明书》
- 3、《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资产管理合同》
- 4、管理人业务资格批件、营业执照
- 5、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《验资报告》
- 6、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审计报告
- 7、报告期内披露的各项公告

查阅网址：<https://am.huaxingsec.com/>

热线电话：400-156-8888

