

华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划 2018 年度资产管理报告

报告期：2018 年 9 月 27 日-2018 年 12 月 31 日

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



第一节 重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合资产管理计划托管人兴业银行股份有限公司于2019年4月10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。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，投资者在做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已经审计。

本报告期由2018年9月27日起，至2018年12月31日止。

本报告中的内容由管理人负责解释。

第二节 集合资产管理计划概况

名称： 华金隆盛增利宝1号集合资产管理计划

代码： 份额代码： F0C005

类型： 集合资产管理计划

成立日： 2018年09月27日

成立规模： 36,801,882.00份

报告期末份额总额： 44,653,867.64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

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 291,610.30

每份额本期利润 0.0065

期末资产净值 45,003,492.30

期末每份额净值 1.0078

期末每份额累计净值 1.0078

二、收益分配情况

本报告期内，本集合资产管理计划无收益分配。

第四节 管理人履职报告

一、业绩表现

截止到 2018 年 12 月 31 日，集合计划单位净值为 1.0078 元，累积净值 1.0078 元。报告期内，产品的净值增长率为 0.78%。

二、投资主办人简介

郁维，男，美国约翰霍普金斯大学金融数学硕士，曾任职上海证券交易所基金与衍生品部，担任分级基金和衍生品策略推广、金融工程、系统开发等岗位，负责期权交易制度设计、期权做市策略研究，参与了国内首支场内期权 50ETF 股票期权的设计、研究、监管工作。擅长固定收益量化模型、衍生品套利、期权直接投资等。曾担任长江证券资管投资主办人、模型分析部负责人。

三、投资主办人工作报告

1、投资结果

截止到 2018 年 12 月 31 日，集合计划单位净值为 1.0078 元，累积净值 1.0078 元。

2、投资策略回顾

四季度本产品成立并已经投入债券资产，债券我们严格挑选 AA+以上发达地区国有企业，并控制久期，并已经开始释放收益。

3、投资展望

债券基本面因素仍有利，股市和转债提防上游行业业绩压力：操作层面上，经济下行压力最大的阶段很可能在 2019 年一季度到来，继续享受债牛的同时，逐步调整布局，珍惜票息和息差机会。两会前后叠加中美贸易谈判结果，可能是市场将要面对的一个敏感时点。房地产债可能是政策放松预期的受益者，而过剩产能和部分产业债面临的估值和信用风险在经济下行期仍在加大。

四、重大事项披露

1、报告期内投资主办变更情况

报告期内，投资主办人由茹楠变更为郁维。

2、报告期内关联交易情况

2018年12月31日无关联方持有本集合计划。

3、期末集合计划管理人的从业人员及其配偶、关联方持有本集合计划的情况

截止12月31日，管理人关联方持有本集合计划份额的信息为：华金证券股份有限公司（管理人），持有份额：4,800,096.00份。

4、报告期内本集合计划无涉诉情况。

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委托资产，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，保证所管理的委托资产与自有资产相互独立，不同的委托人的委托资产相互独立，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《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、企业会计准则的相关规则进行会计核算，与托管人定期对账，及时准确办理委托资产的清算交收。

3、本报告期内，管理人依据合同约定的时间和方式，向委托人提供管理报告等资料，说明报告期内委托资产的配置状况、价值变动、交易记录等情况。

第五节 托管人履职报告

具体内容详见《华金隆盛增利宝1号集合资产管理计划托管报告（2018年度）》。

第六节 投资组合报告

一、期末资产组合情况：

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例
固定收益类资产	48,137,110.00	82.82%
基金类资产	619,605.34	1.07%
买入返售类资产	7,000,130.50	12.04%
银行存款及清算备付金合计	2,126,461.36	3.66%
其他资产	237,087.76	0.41%
总资产合计	58,120,394.96	100.00%

注：本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

二、期末市值占集合计划资产净值前五名证券明细

证券代码	证券名称	数量	市值	市值占净值
111819462	18 恒丰银行 CD462	100,000.00	9,633,910.00	21.41%
111889336	18 福建海峡银行 CD035	100,000.00	9,633,910.00	21.41%
111889330	18 广西北部湾银行 CD208	100,000.00	9,629,270.00	21.40%
111889645	18 营口银行 CD102	100,000.00	9,624,640.00	21.39%
111889607	18 龙江银行 CD139	100,000.00	9,615,380.00	21.37%

三、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的理财产品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到受到公开谴责、处罚。

无新增非标投资标的。

第七章 固定收益类产品投资风险披露

一、债券的市场风险

1、交易品种的信用风险

投资于债券等固定收益品种类产品，存在着发行人或者交易对手不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

2、债券回购业务风险

债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行

了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

第八节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	36,801,882.00
红利再投资份额	0.00
报告期间净退出份额	0.00
报告期间申购份额	7,851,985.64
报告期末份额总额	44,653,867.64

第九节 信息披露的查阅方式

一、备查文件

- 1、《华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划说明书》；
- 3、报告期内华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划在指定网站上披露的各项公告；
- 4、证监会要求的其他文件。

二、查询方式

网址：<http://www.huajinsec.com/>

信息披露电话：4008211357

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人华金证券股份有限公司。



华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

资产负债表

2018 年 12 月 31 日

编制单位：华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

资产	行次	注释号	期末余额
资产：			
银行存款	1	1	2,062,828.81
结算备付金	2	2	63,632.55
存出保证金	3	3	3,512.79
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	4	4	48,756,715.34
其中：股票投资	5		
债券投资	6		48,137,110.00
资产支持证券投资	7		
基金投资	8		619,605.34
买入返售金融资产	10	5	7,000,130.50
应收证券清算款	11		
应收利息	12	6	220,379.74
应收股利	13	7	13,195.23
应收申购款	14		
其他资产	15		
	16		
	17		
	18		
	19		
资产总计	20		58,120,394.96

华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

资产负债表

2018 年 12 月 31 日

编制单位：华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

负债与所有者权益	行次	注释号	期末余额
负债：			
短期借款	21		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	22		
衍生金融负债	23		
卖出回购金融资产款	24	8	13,055,780.42
应付证券清算款	25		
应付赎回款	26		
应付管理人报酬	27	9	46,003.57
应付托管费	28	10	2,813.04
应付销售服务费	29		
应付交易费用	30	11	2,897.96
应交税费	31	12	4.55
应付利息	32	13	7,703.78
应付利润	33		
其他负债	34	14	1,699.34
负债合计	35		13,116,902.66
所有者权益：			
实收计划	37	15	44,653,867.64
未分配利润	37	16	349,624.66
所有者权益合计	38		45,003,492.30
负债及所有者权益总计	39		58,120,394.96

华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

利润表

2018 年 9 月 27 日（集合计划设立日）至 2018 年 12 月 31 日止会计期间

编制单位：华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

项目	行次	注释号	本期发生额 (2018 年 9 月 27 日集合计划设立日 至 2018 年 12 月 31 日)
一、收入	1		390,545.29
1、利息收入	2		228,652.92
其中：存款利息收入	3	17	9,017.04
债券利息收入	4	18	215,299.48
资产支持证券利息收入	5		
买入返售金融资产利息收入	6	19	4,336.40
2、投资收益（损失以“-”填列）	7		161,755.61
其中：股票投资收益	8		
债券投资收益	9		
基金投资收益	10	20	124.89
信托产品投资收益	11		
衍生工具收益	12		
基金红利收益	13	21	161,634.36
股利收益	14		
其他	15		-3.64
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	16	22	136.76
4、其他收入（损失以“-”号填列）	17		
二、费用	18		98,934.99
1、管理人报酬	19	23	47,515.96
2、托管费	20	24	2,903.79
3、销售服务费	21		
4、交易费用	22		
5、利息支出	23	25	45,121.80
其中：卖出回购金融资产支出	24		45,121.80
6、税金及附加	25	26	0.85
7、其他费用	26	27	3,392.59
三、利润总额	27		291,610.30



华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

所有者权益变动表

2018 年 9 月 27 日（集合计划设立日）至 2018 年 12 月 31 日止会计期间

编制单位：华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

项目	本期发生额 (2018 年 9 月 27 日集合计划设立日至 2018 年 12 月 31 日)		
	实收计划	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	-	-	-
二、本期经营活动产生的净值变动数（本期净利润）		291,610.30	291,610.30
三、本期基金计划份额交易产生的净值变动数（减少以“-”号填列）	44,653,867.64	58,014.36	44,711,882.00
其中：1、计划认购款	36,801,882.00		36,801,882.00
2、计划申购款	7,851,985.64	58,014.36	7,910,000.00
3、计划赎回款			
四、本期向计划份额持有人分配利润产生的净值变动数			
五、期末所有者权益	44,653,867.64	349,624.66	45,003,492.30