

华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划 2018 年度资产管理报告

报告期：2018 年 8 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 9 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 8 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： 华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

代码： 份额代码： F0C003

类型： 集合资产管理计划

成立日： 2018 年 8 月 27 日

成立规模： 30,503,510.00 份

报告期末份额总额： 2,541,648.17 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 -217,550.50

每份额本期利润 -0.0856

期末资产净值 2,316,841.22

期末每份额净值 0.9116

期末每份额累计净值 0.9116

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 0.9116 元，累积净值 0.9116 元。报告期内，产品的净值增长率为 -8.84%。

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 0.9116 元，累积净值 0.9116 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

2019 年对权益市场充满信心，一是美国受到贸易战伤害也开始显现，急于和中国达成贸易协定。二是国内宏观政策开始走向保增长，市场上资金会逐步增加。三是股市估值已经达到历史最低。股市最黑暗的时刻将远去。

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

2018年12月31日，管理人关联方持有本集合计划份额的信息为：戴卓敏（华金证券股份有限公司员工配偶），持有份额：1,041,558.17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

本托管人依据与华金证券股份有限公司（以下简称“管理人”）签订的集合计划的合同、托管协议以及集合计划说明书，托管了管理人发行的华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划（以下简称“本计划”）的资产。

报告期内，本托管人严格遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》及其他有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本计划委托人利益的行为。

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，对管理人在本计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、计划费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本计划委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告期内该集合资产管理计划资产管理报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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
权益类资产	1,496,542.00	64.42%
基金类资产	616,639.64	26.54%
买入返售类资产	100,000.00	4.30%
银行存款及清算备付金合计	108,851.58	4.69%
其他资产	1,105.98	0.05%
总资产合计	2,323,139.20	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
601318	中国平安	3,200.00	179,520.00	7.75%
600036	招商银行	6,500.00	163,800.00	7.07%
600030	中信证券	8,400.00	134,484.00	5.80%
000651	格力电器	3,600.00	128,484.00	5.55%
600519	贵州茅台	200.00	118,002.00	5.09%

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 权益类产品投资风险披露

一、新股/新债申购风险

新股/新债申购风险是指获配新股/新债上市后其二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。由于网下获配新股有一定的锁定期，锁定期期间股票价格受各种市场因素、宏观政策

因素等的影响，股票价格有可能下跌到申购价以下。

二、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、债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与非平行移动有关的，单一久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

3、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	30,503,510.00
红利再投资份额	0.00
报告期间净退出份额	29,003,420.00
报告期间申购份额	1,041,558.17
报告期末份额总额	2,541,648.17

第九节 信息披露的查阅方式

一、备查文件

- 1、《华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划说明书》；

- 3、 报告期内华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划在指定网站上披露的各项公告；
- 4、 中国证监会要求的其他文件。

二、 查询方式

网址：<http://www.huajinsc.cn/>

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。



华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

资产负债表

2018年12月31日

编制单位：华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

金额单位：人民币元

资产	行次	期末余额
资产：		
银行存款	1	102,063.36
结算备付金	2	6,788.22
存出保证金	3	812.14
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	4	2,113,181.64
其中：股票投资	5	1,496,542.00
债券投资	6	
资产支持证券投资	7	
基金投资	8	616,639.64
买入返售金融资产	10	100,000.00
应收证券清算款	11	
应收利息	12	293.84
应收股利	13	
应收申购款	14	
其他资产	15	
	16	
	17	
	18	
	19	
资产总计	20	2,323,139.20

华金隆盛

华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

资产负债表

2018年12月31日

编制单位：华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

金额单位：人民币元

负债与所有者权益	行次	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	
应付证券清算款	25	
应付赎回款	26	
应付管理人报酬	27	6,106.64
应付托管费	28	183.22
应付销售服务费	29	
应付交易费用	30	
应交税费	31	8.12
应付利息	32	
应付利润	33	
其他负债	34	
负债合计	35	6,297.98
所有者权益：		
实收计划	37	2,541,648.17
未分配利润	37	-224,806.95
所有者权益合计	38	2,316,841.22
负债及所有者权益总计	39	2,323,139.20

华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

利润表

2018年8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：华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

金额单位：人民币元

项目	行次	本期发生额 (2018年8月27日集合计划设立日 至2018年12月31日)
一、收入	1	-202,509.27
1、利息收入	2	4,618.88
其中：存款利息收入	3	2,684.50
债券利息收入	4	
资产支持证券利息收入	5	
买入返售金融资产利息收入	6	1,934.38
2、投资收益（损失以“-”填列）	7	24,481.24
其中：股票投资收益	8	-2,073.00
债券投资收益	9	
基金投资收益	10	-4,541.43
信托产品投资收益	11	
衍生工具收益	12	
基金红利收益	13	30,135.67
股利收益	14	960.00
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	15	-231,609.39
4、其他收入（损失以“-”号填列）	16	
二、费用	17	15,041.23
1、管理人报酬	18	13,813.83
2、托管费	19	414.36
3、销售服务费	20	
4、交易费用	21	206.65
5、利息支出	22	
其中：卖出回购金融资产支出	23	
6、税金及附加	24	6.39
7、其他费用	25	600.00
三、利润总额	26	-217,550.50

华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

所有者权益变动表

2018年8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：华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划

金额单位：人民币元

项目	本期发生额 (2018年8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）		-217,550.50	-217,550.50
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）	2,541,648.17	-7,256.45	2,534,391.72
其中：1、计划认购款	30,503,510.00		30,503,510.00
2、计划申购款	1,041,558.17	-41,558.17	1,000,000.00
3、计划赎回款	-29,003,420.00	34,301.72	-28,969,118.28
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	2,541,648.17	-224,806.95	2,316,841.22