

华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划 2018 年四季度资产管理报告

报告期：2018 年 10 月 1 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《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》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1月17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未经审计。

本报告期由2018年10月1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 293,129.82

每份额本期利润 0.0066

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 19 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，投资主办人未变更。

2、关联交易情况

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。

3、无其他涉及投资者权益的重大事项。

第五节 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受到公开谴责、处罚。

无新增非标投资标的。

第六章 混合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。

第七节 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

第八节 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.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。

华金证券股份有限公司
二〇一九年七月二十三日