

华金隆盛优选指数增强集合资产管理计划 2019年第二季度资产管理报告

报告期：2019年4月1日-2019年6月30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7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未经审计。

本报告期由2019年4月1日起，至2019年6月30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： 5,409,607.39 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 173,956.82

每份额本期利润 0.0322

期末资产净值 6,319,325.56

期末每份额净值 1.1682

期末每份额累计净值 1.1682

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。

三、费率计提基准

1、参与费：0%

2、退出费：

持有期限 (P)	退出费率
P < 3 个月	0.4%
3 个月 ≤ P < 6 个月	0.3%
6 个月 ≤ P < 1 年	0.2%
1 年 ≤ P < 2 年	0.1%
P ≥ 2 年	0

3、管理费：1%/年

4、托管费：0.03%/年

5、业绩报酬：具体见本合同“十三、集合计划的费用、业绩报酬和税收”中的相关约定

6、其他费用

第四节 管理人履职报告

一、业绩表现

截止到 2019 年 6 月 30 日，集合计划单位净值为 1.1682 元，累积净值 1.1682 元。报告期内，产品的净值增长率为 3.80%。

二、投资主办人简介

茹楠，男，伯明翰大学国际银行与金融硕士(MBA)，7 年证券投资管理相关工作经验；历任中国民族证券研究员、投资主办人，联讯证券投资主办人；对市场研判及脉络的把握有独到的见解，在行业、主题的挖掘上经验丰富，坚持中期选股、短期灵活的操作思路，风险控制能力强。

三、投资主办人工作报告

1、投资结果

截止到 2019 年 6 月 30 日，集合计划单位净值为 1.1682 元，累积净值 1.1682 元。

2、投资策略回顾



二季度，受中美贸易摩擦及技术对抗突发升级等外因及包商银行被接管等内因的影响，市场整体出现了一波明显的下行。期间，我们的产品净值受市场影响，也出现了一定的回撤，但由于及时控制了仓位，回撤幅度好于市场整体情况。

3、投资展望

三季度，G20 峰会后，中美关系有了一定的缓和，但从长远来看，彼此之间的分歧与较量仍将长期存在。目前，对于“谈谈打打”的预期市场已经反映的比较充分，预计前期突发性事件带来的低点有望成为年内的低点。但由于大消费及核心资产的估值均已较高，在经济转型期，市场再次出现单边上行大牛市的概率较低，大概率将以结构性行情为主。基于此判断，三季度，我们将以个股深入挖掘为主，择机进行仓位的灵活调整，力争产品净值平稳快速增长。

四、重大事项披露

1、报告期内投资主办变更情况

报告期内原由郁维担任投资主办人，自 2019 年 6 月 26 日起郁维不再担任该产品的投资主办人，改由投资主办人茹楠管理本计划。

2、报告期内关联交易情况

本报告期内 2019 年 6 月 12 日，金葵华（华金证券股份有限公司员工）参与本集合计划，参与金额 1,000,000.00 元，确认份额 870,322.02 份。

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

截止到 2019 年 6 月 30 日，管理人的从业人员及其配偶、关联方持有本集合计划的信息为：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；金葵华（华金证券股份有限公司员工）持有份额 870,322.02 份。

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《华金证券股份有限公司集合资产管理计划2019年2季度资产托管报告》。

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	804,637.50	11.13%
基金类资产	5,431,633.06	75.14%
买入返售类资产	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	274,882.87	3.80%
其他资产	717,775.61	9.93%
总资产合计	7,228,929.04	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（元）	市值占净值
511990	华宝添益	15,054.00	1,505,490.32	23.82%
510300	300ETF	345,000.00	1,331,355.00	21.07%
159919	300ETF	339,068.00	1,305,411.80	20.66%
511650	华夏快线	12,009.00	1,200,815.94	19.00%
601398	XD 工商银	28,000.00	164,920.00	2.61%

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。

本集合资产管理计划报告期末无卖出回购金融资产业务。

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，锁定期内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	2,541,648.17
红利再投资份额	0.00
报告期间退出份额	1,500,090.00
报告期间申购份额	4,368,049.22
报告期末份额总额	5,409,607.39

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.huajinsec.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。



