

广发资管创鑫利 2 号集合资产管理计划

2019 年度资产管理报告

管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

托管人：中信银行股份有限公司广州分行

日期：2020 年 4 月



目录

重要提示	1
一、 资产管理计划简介	1
(一) 基本资料	1
(二) 管理人简介	1
(三) 托管人简介	2
(四) 会计师事务所简介	2
二、 主要财务指标和收益分配	3
(一) 主要财务指标	3
(二) 财务指标计算公式	3
(三) 报告期内收益分配情况	4
(四) 报告期内份额变动情况	4
三、 管理人报告	4
(一) 投资经理简介	4
(二) 投资经理工作报告	4
(三) 管理人对报告期内本资产管理计划运作合规守信情况的说明	5
(四) 托管人履职情况的说明	5
四、 资产管理计划的费用	6
(一) 管理费	6
(二) 托管费	6
(三) 其他费用	6
五、 财务会计报表	7
(一) 资产负债表	7
(二) 利润表	7
六、 投资组合报告	8
(一) 报告期末资产组合情况	8
(二) 报告期末股指期货投资情况	9
七、 重要事项提示	9
八、 备查文件	9
(一) 备查文件目录	9
(二) 存放地点及查阅方式	10

重要提示

本报告依据《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。

管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本资产管理计划资产，但不保证本资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

托管人根据本资产管理计划合同规定，复核了本报告中的主要财务指标、会计报表和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本年度报告的财务资料已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告内容由管理人负责解释。本报告相关数据，因四舍五入原因，可能部分合计数与各项目加总数据在尾数上略有差异。

本报告期起止时间：2019 年 5 月 30 日—2019 年 12 月 31 日。

一、 资产管理计划简介

（一） 基本资料

名称：广发资管创鑫利 2 号集合资产管理计划

成立规模（总份额）：196,052,759.27 份

存续期间：24 个月不展期

报告期末计划总份额：152,938,534.41 份

（二） 管理人简介

名称：广发证券资产管理（广东）有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-285

办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼

电话：（020）66338888

传真：（020）87553363

全国统一客服热线：95575

网址：www.gfam.com.cn

（三） 托管人简介

名称：中信银行股份有限公司广州分行

注册地址：广州市天河区天河北路 233 号中信广场右侧裙楼首层二层及写字楼 48-50 层

办公住所：广州市天河区天河北路 233 号中信广场 48 楼

法定代表人：谢宏儒

电话：（020）38911380

传真：（020）87520668

全国统一客服热线：95558

网址：www.citicbank.com

（四） 会计师事务所简介

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

法人代表：毛鞍宁

电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

经办会计师：赵雅 马婧

二、 主要财务指标和收益分配

(一) 主要财务指标

序号	主要财务指标	2019年5月30日—2019年12月31日
1	资产管理计划本期已实现收益（元）	3,971,887.38
2	单位资产管理计划期末可供分配利润（元）	0.0230
3	期末资产管理计划资产净值（元）	159,200,521.54
4	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.0409
5	期末单位资产管理计划累计资产净值（元）	1.0409
6	本期单位资产管理计划净值增长率	4.09%
7	单位资产管理计划累计净值增长率	4.09%
8	报告期末资产管理计划的杠杆比例	101.90%

(二) 财务指标计算公式

1. 资产管理计划本期已实现收益=资产管理计划本期利润总额-资产管理计划本期公允价值变动损益

2. 单位资产管理计划期末可供分配利润=资产管理计划期末可供分配利润÷期末资产管理计划份额

3. 期末单位资产管理计划资产净值=期末资产管理计划资产净值÷期末资产管理计划份额

4. 期末单位资产管理计划累计资产净值=(期末单位资产管理计划资产净值+拆分后单位资产管理计划分红金额)×资产管理计划拆分比例+拆分前单位资产管理计划累计分红

5. 本期单位资产管理计划净值增长率=(本期资产管理计划分红日上一日单位资产管理计划资产净值/本期期初单位资产管理计划资产净值)×【期末单位资产管理计划资产净值÷(本期资产管理计划分红日上一日单位资产管理计划资产净值-本期单位资产管理计划分红金额)】×资产管理计划拆分比例-1

6. 单位资产管理计划累计净值增长率=(本资产管理计划第一次分红前单位资产管理计划资产净值÷1.0000)×[本资产管理计划第二次分红前单位资产管理计划资产净值÷(本资产管理计划第一次分红前单位资产管理计划资产净值-第一次分红单位金额)]×[本资产管理计划第三次分红前单位资产管理计划资产净值÷(本资产管理计划第二次分红前单位资产管理计划资产净值-第二次分红单位金额)]……×[期末单位资产管理计划资产净值÷(本资产管

理计划最后一次分红前单位资产管理计划资产净值－最后一次分红单位金额)]×资产管理计划拆分比例－1

7. 报告期末资产管理计划的杠杆比例=报告期末计划总资产/报告期末计划净资产*100%。
8. 资产管理计划说明书、资产管理合同有特殊规定的，从其规定。

(三) 报告期内收益分配情况

报告期内未进行收益分配。

(四) 报告期内份额变动情况

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
196,052,759.27	5,817,244.40	48,931,469.26	152,938,534.41

注：“本期参与份额”、“本期退出份额”包括因份额折算导致的份额变动。

三、 管理人报告

(一) 投资经理简介

孙隽勃，男，硕士，基金从业证书编号：F4070000000112。自 2006 年 7 月至 2014 年 1 月任职广发证券股份有限公司财富管理部、资产管理部，自 2014 年 1 月 2019 年 4 月任职广发证券资产管理（广东）有限公司权益产品部。现任职广发证券资产管理（广东）有限公司另类投资部负责人、广发赢家系列集合资产管理计划投资主办人、广发原驰系列集合/单一资产管理计划投资主办人。

(二) 投资经理工作报告

2019 年国内保持了比较好的投资环境，尽管宏观经济数据稳中有降，工业品量价均小幅下行，但国内政策预期、利率环境稳定，资本市场改革和产业结构调整的方向比较明确。

因而权益市场相较于 2018 年出现了较为明显的估值修复，科创板推出、自主可控的产业政策明显推升了市场热度，到四季度时，市场风险偏好已经达到高点，成长股风格非常突出，而此前估值被推到历史新高的核心资产则出现了较为明显的回撤。

我们的产品以追求绝对收益为主要投资目标，为投资人创造了比较稳健的收益。展望 2020 年，当前市场上存在较多的矛盾点，无论是大宗商品价格、利率、乃至上市公司的业绩预期，都与 2019 年的“反弹”主题有较大区别。2020 年有望成为估值重塑的一年，而四季度以来市场首次出现了摒弃确定性资产押注周期上行的情况，风险偏好甚至好于 2019 年初市场大涨时。由于中国在疫情和经济见底方面都早于全球出现，在大类资产估值重塑过程中，国内资产在震荡后有望形成比较良性的状态。

（三） 管理人对报告期内本资产管理计划运作合规守信情况的说明

报告期内，管理人严格遵守《证券法》《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》等有关法律法规及本资产管理计划合同等有关法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本资产管理计划资产，在控制风险的前提下，为资产管理计划持有人谋求最大利益。报告期，本资产管理计划运作合法合规，不存在损害计划持有人利益的行为。

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易管理机制等，并重视交易执行环节的公平交易措施，通过投资交易系统内的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，未发现本资产管理计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

（四） 托管人履职情况的说明

报告期内，托管人履职情况详见与本报告同日披露的托管人出具的本计划托管报告。

报告期内，管理人对托管人的履职情况进行了监督，管理人认为托管人按照本资产管理计划的合同、说明书以及托管协议等约定履行了相应职责和义务。

四、 资产管理计划的费用

（一） 管理费

1、 固定管理费

序号	项目	费用标准与原则
1	年费率	1%
2	计提方式	每日计提
3	支付方式	按季支付

2、 业绩报酬

序号	项目	费用标准与原则
1	计算方式	根据投资者持有份额年化收益率（R），年化收益率 $R \leq 8\%$ 的，计提比例为 0%，年化收益率 $R > 8\%$ 时，对超出 8% 的收益部分提取 20% 作为业绩报酬。
2	计提方式	投资者申请退出或集合计划终止时计提
3	支付方式	投资者申请退出或集合计划终止时计提支付

（二） 托管费

序号	项目	费用标准与原则
1	年费率	0.03%
2	计提方式	每日计提
3	支付方式	按季支付

（三） 其他费用

本资产管理计划运作期间投资所发生的银行结算费、交易手续费、账户开户费、账户管理费、印花税等有关税费，作为交易成本按实际发生金额直接扣除，其费率由管理人根据有关政策法规确定。

本资产管理计划存续期间发生的登记结算费、信息披露费用、会计师费、审计费和律师费以及按照国家有关规定、相应的合同或协议的具体规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，依管理人的指令按费用实际支出金额从资产管理计划资产中支付，列入资产管理计划费用。但管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入本资产管理计划的费用。

有关本资产管理计划费用的详细情况请参阅本计划的资产管理合同及相关公告等法律文件。

五、 财务会计报表

(一) 资产负债表

单位：元

资产	2019/12/31	2018/12/31	负债和所有者权益	2019/12/31	2018/12/31
资产：			负债：		
银行存款	3,335,843.60	-	短期借款	-	-
结算备付金	-	-	交易性金融负债	-	-
存出保证金	14,233,370.34	-	衍生金融负债	2,480,790.00	-
交易性金融资产	144,061,106.04	-	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	65,561,263.09	-	应付证券清算款	-	-
债券投资	-	-	应付赎回款	-	-
基金投资	78,499,842.95	-	应付管理人报酬	474,714.83	-
资产支持证券投资	-	-	应付托管费	14,241.44	-
专项资产管理计划	-	-	应付销售服务费	-	-
银行理财产品	-	-	应付咨询服务费	-	-
信托投资	-	-	应付交易费用	-	-
衍生金融资产	-	-	应交税费	30,965.61	-
买入返售金融资产	-	-	应付利息	-	-
应收证券清算款	-	-	应付利润	-	-
应收利息	610.34	-	其他负债	18,500.00	-
应收股利	588,803.10	-	负债合计	3,019,211.88	-
应收申购款	-	-	所有者权益：		
其他资产	-	-	实收基金	152,938,534.41	-
			未分配利润	6,261,987.13	-
			所有者权益合计	159,200,521.54	-
资产总计	162,219,733.42	-	负债和所有者权益总计	162,219,733.42	-

(二) 利润表

单位：元

项目	2019 年度	2018 年度
一、收入	8,898,516.06	-
1. 利息收入	450,890.07	-

其中：存款利息收入	450,890.07	-
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
利息收入增值税	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	4,420,200.93	-
其中：股票投资收益	7,638,663.51	-
基金投资收益	352,776.08	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
信托投资收益	-	-
银行理财产品投资收益	-	-
专项资产管理计划投资收益	-	-
衍生工具收益	-6,381,875.81	-
股利收益	2,810,637.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,615,538.81	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	411,886.25	-
二、费用	1,311,089.87	-
1、管理人报酬	1,138,768.31	-
2、托管费	34,163.01	-
3、销售服务费	-	-
4、咨询服务费	-	-
5、交易费用	99,852.07	-
6、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
7、税金及附加	13,860.27	-
8、其他费用	24,446.21	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7,587,426.19	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	7,587,426.19	-

六、投资组合报告

（一）报告期末资产组合情况

项 目	期末市值（元）	占总资产比例
银行存款和结算备付金	3,335,843.60	2.06%

股票	65,561,263.09	40.42%
债券	—	—
基金	78,499,842.95	48.39%
资产支持证券	—	—
专项资产管理计划	—	—
银行理财产品	—	—
信托投资	—	—
衍生金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收申购款	—	—
买入返售金融资产	—	—
其它资产	14,822,783.78	9.14%
合 计	162,219,733.42	100.00%

注：“其它资产”包括“存出保证金”、“应收红利”、“应收利息”等项目。

（二）报告期末股指期货投资情况

无

七、 重要事项提示

- （一） 本报告期内未发生任何涉及本资产管理计划管理人、资产管理计划财产、托管人托管业务的重大诉讼或仲裁事项。
- （二） 本报告期内本资产管理计划的投资经理未发生变更。
- （三） 本报告期内本资产管理计划的管理人、托管人托管业务机构及其高级管理人员未受到监管部门任何重大处罚。
- （四） 本报告期内本资产管理计划未发生重大关联交易投资情况。

八、 备查文件

（一） 备查文件目录

1. 《广发资管创鑫利2号集合资产管理计划说明书》

2. 《广发资管创鑫利2号集合资产管理计划资产管理合同》
3. 《广发资管创鑫利2号集合资产管理计划风险揭示书》
4. 管理人业务资格批件、营业执照。

(二) 存放地点及查阅方式

文件存放地点：广发证券资产管理（广东）有限公司

地址：广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦30-32楼

网址：www.gfam.com.cn

电话：（020）66338888

传真：（020）87553363

投资者可通过管理人网站获取本报告，也可以在营业时间在管理人文件存放地点免费查阅本报告，也可按报告工本费购买复印件。投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人广发证券资产管理（广东）有限公司。

广发证券资产管理（广东）有限公司

2020 年 4 月

