

华金鸿腾 2 号集合资产管理计划 2019 年度资产管理报告

报告期：2019 年 1 月 1 日-2019 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2020年3月20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2019年1月1日起，至2019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：华金鸿腾2号集合资产管理计划

代码： 份额代码：F0C012

类型： 集合资产管理计划

成立日：2018年12月26日

成立规模：16,412,072.00份

报告期末份额总额：13,534,904.00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：1,866,171.30

每份额本期利润：0.1379

期末资产净值：14,216,684.75

期末每份额净值：1.0504

期末每份额累计净值：1.0504

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、参与费率：0%；
- 2、退出费率：0%；
- 3、管理费：0.6%/年；
- 4、托管费率：0.02%/年；
- 5、业绩报酬：具体见资管合同“十三、集合计划的费用、业绩报酬和税收”中相关约定；
- 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12月31日，集合计划单位净值为1.0504元，累计单位净值1.0504元。报告期内，产品的净值增长率为5.04%。

二、投资主办人简介

贾鹏先生，投资经理

中国人民大学金融工程硕士，12年证券从业经历，先后任职于中原证券固定收益投资总部和中原证券资产管理总部，担任投资经理职务。对宏观经济运行、利率期限结构和信用评价分析有深刻的理解和认识。

三、投资主办人工作报告

1、投资结果

截止到2019年12月31日，集合计划单位净值为1.0504元，累计单位净值1.0504元。

2、投资策略回顾

2019年的债券市场呈现宽幅震荡走势，年初在降准的宽松货币环境下，市场利率延续下行走势；随着3月PMI数据的企稳和权益市场的上涨，债券利率出现快速的上行；而中美贸易谈判的进展也始终影响着市场的情绪和走势，随着美国对我国出口的商品进一步加征关税，经济数据出现回落，债券市场利率也随之下行，三季度随着猪肉价格的大幅攀升，市场开始担忧CPI的超预期，利率再次快速大幅上行，但10月份美联储降息，11月我国央行

下调 MLF 利率，市场利率又从高位开始回落，回到了年初的位置。

在操作上，产品始终坚持绝对收益策略，控制持仓久期，严选信用投资标的，力求为客户实现稳健的净值增长。

3、投资展望

2020 年是全面建设小康社会的决胜之年，2019 年 12 月份中美之间就贸易问题达成第一阶段协议，中美贸易对经济的负面影响在边际上将会有一定程度的改善。整体来看，2020 年经济增长的向下空间预计要小于 2019 年，大概率会维持在 6%附近波动。

预计债券长端利率维持在低位震荡，因此不会有太多的交易性机会，我们将维持中性偏乐观的投资策略，控制持仓的久期，适时通过杠杆增厚收益，严格控制信用风险，为客户带来稳健的收益回报。

四、重大事项披露

1、报告期内投资主办变更情况

报告期内，本集合计划原由居鹏先生担任投资主办人，自 2019 年 04 月 19 日起居鹏先生不再担任本计划的投资主办人，改由阎炯先生担任本计划的投资主办人。自 2019 年 09 月 30 日起阎炯先生不再担任本计划的投资主办人，改由贾鹏先生担任本计划的投资主办人。

2、报告期内关联交易情况

报告期内无关联交易情况。

3、报告期内集合计划管理人的从业人员及其配偶、关联方参与退出本集合计划的情况

报告期内，未发生管理人的从业人员及其配偶、关联方参与退出本集合计划情况。

4、期末集合计划管理人的从业人员及其配偶、关联方参与退出本集合计划的情况

2019 年 12 月 31 日，管理人的从业人员及其配偶、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：1,600,032.00 份。

5、报告期内集合计划涉诉情况

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《华金证券股份有限公司集合资产管理计划 2019 年度资产托管报告》。

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
固定收益类资产	15,063,581.70	89.63%
基金类资产	0.00	0.00%
买入返售类资产	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	965,604.23	5.75%
其他资产	777,774.56	4.63%
总资产合计	16,806,960.49	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
122393	15 恒大 03	40,000.00	3,999,600.00	28.13%
155406	19 恒大 01	34,300.00	3,323,670.00	23.38%
018007	国开 1801	30,000.00	3,022,500.00	21.26%
122371	14 亨通 01	20,000.00	2,000,000.00	14.07%
011901485	19 潍坊水务 SCP002	10,000.00	1,003,800.00	7.06%

三、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的组合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卖出回购金融资产款市值为 2,499,975.00 元，占净资产比例为 17.58%。

第七节 固定收益类产品投资风险披露

一、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

3、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

5、购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

6、再投资风险

利率下降将对固定收益证券利息收入再投资的收益产生影响，此风险即为由于金融市场利率下降造成的无法通过再投资而实现预期收益的风险。

二、信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成集合计划资产损

失的风险。

1. 交易品种的信用风险

投资于公司债券等固定收益类产品，存在着发行人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，集合资产管理业务所投资的债券可能面临价格下跌风险。

2. 交易对手的信用风险

交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使集合资产管理业务面临交易对手的信用风险。

第八节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	16,412,072.00
红利再投资份额	0.00
报告期间退出份额	60,214,766.68
报告期间申购份额	57,337,598.68
报告期末份额总额	13,534,904.00

第九节 信息披露的查阅方式

一、备查文件

- 1、《华金鸿腾 2 号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《华金鸿腾 2 号集合资产管理计划说明书》；
- 3、报告期内华金鸿腾 2 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。



华金鸿腾 2 号集合资产管理计划

资产负债表

2019 年 12 月 31 日

编制单位：华金鸿腾 2 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

资产	资产期末余额	资产年初余额
资产：		
银行存款	455,824.30	11,328.00
结算备付金	509,779.93	0.00
存出保证金	2,016.66	0.00
交易性金融资产	15,063,581.70	16,401,343.06
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	16,401,343.06
债券投资	15,063,581.70	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	333,359.18	0.00
应收利息	442,398.72	747.06
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	16,806,960.49	16,413,418.12

华金鸿腾 2 号集合资产管理计划

资产负债表

2019 年 12 月 31 日

编制单位：华金鸿腾 2 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

负债与持有人权益	负债期末余额	负债年初余额
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	2,499,975.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	75,542.55	1,348.96
应付托管费	2,518.11	44.95
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	5,239.32	0.00
应交税费	5,518.72	0.00
应付利息	1,482.04	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	2,590,275.74	1,393.91
所有者权益：		
实收基金	13,534,904.00	16,412,072.00
未分配利润	681,780.75	-47.79
所有者权益合计	14,216,684.75	16,412,024.21
负债和所有者权益总计	16,806,960.49	16,413,418.12

华金鸿腾 2 号集合资产管理计划

利润表

2019 年度

编制单位：华金鸿腾 2 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	2,383,979.03	1,346.12
2	1、利息收入	2,399,735.21	3.06
3	其中：存款利息收入	29,261.34	3.06
4	债券利息收入	2,290,368.82	0.00
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	80,105.05	0.00
7	2、投资收益	117,934.10	1,343.06
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	82,934.59	0.00
10	基金投资收益	1,668.00	0.00
11	权证投资收益	0.00	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
13	衍生工具收益	0.00	0.00
14	股利收益	38,584.38	1,343.06
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	增值税(投资收益抵减)	-5,252.87	0.00
17	3、公允价值变动收益	-133,690.28	0.00
18	4、其他收入	0.00	0.00
19	二、费用	517,807.73	1,393.91
20	1、管理人报酬	253,301.92	1,348.96
21	2、托管费	8,443.43	44.95
22	3、销售服务费	0.00	0.00
23	4、交易费用	4,583.13	0.00
24	5、附加税	8,858.06	0.00
25	6、利息支出	223,649.79	0.00
26	其中：卖出回购金融资产支出	223,649.79	0.00
27	7、其他费用	18,971.40	0.00
28	三、利润总和	1,866,171.30	-47.79

华金鸿腾 2 号集合资产管理计划 所有者权益变动表

2019 年度

金额单位：人民币元

编制单位：华金鸿腾 2 号集合资产管理计划

项目	本期金额			上期金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益	实收基金	未分配利润	所有者权益
一、期初所有者权益（基金净值）	16,412,072.00	-47.79	16,412,024.21	16,412,072.00	0.00	16,412,072.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期净利润）	0.00	1,866,171.30	1,866,171.30	0.00	-47.79	-47.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （减少以“-”号填列）	-2,877,168.00	-1,184,342.76	-4,061,510.76	0.00	0.00	0.00
其中：1. 基金申购款	57,337,598.68	1,502,747.20	58,840,345.88	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	-60,214,766.68	-2,687,089.96	-62,901,856.64	0.00	0.00	0.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	13,534,904.00	681,780.75	14,216,684.75	16,412,072.00	-47.79	16,412,024.21