

华金鸿腾年年盈集合资产管理计划 2020 年第四季度资产管理报告

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

报告送出日期：2021 年 1 月 27 日



第一节 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。

本报告由资产管理计划管理人编制。管理人保证本报告所载资料真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

资产管理计划托管人兴业银行股份有限公司于2021年1月15日复核了本报告中的财务指标和投资组合报告等财务资料内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。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资产管理计划资产管理合同。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期为2020年10月1日起，至2020年12月31日止。

本报告中的内容由管理人负责解释。

第二节 资产管理计划概况

名称	华金鸿腾年年盈集合资产管理计划
类型	固定收益类
成立日	2018年10月29日
成立份额总额	20,192,831.40份
报告期末份额总额	21,515,103.00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 主要财务指标和资产管理计划净值表现

一、主要财务指标（单位：人民币元）

项目	报告期（2020年10月1日-2020年12月31日）
本期利润	118,480.72
每份额本期利润	0.0055
期末资产净值	23,689,653.60

期末每份额净值	1.1011
期末每份额累计净值	1.1011

二、报告期内收益分配情况

本报告期内，本资产管理计划未进行收益分配。

三、费用计提基准、计提方式和支付方式

序号	费用类型	费率	计提基准	计提及支付方式
1	管理费	0.60%	资产管理计划资产净值	按日计提，按季支付
2	托管费	0.02%	资产管理计划资产净值	按日计提，按季支付
3	业绩报酬	/	业绩报酬计提基准 6%： 每个结算周期中份额年化 收益超过当期业绩报酬计 提基准部分的 60%	集合计划收益分配 日、份额退出日和计 划终止日计提业绩 报酬

第四节 管理人履职报告

一、业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本资产管理计划单位净值为 1.1011 元，累计单位净值 1.1011 元。报告期内，产品的净值增长率为 0.43%。

二、投资经理简介

本计划投资经理为阎炯（离任日期为 2021 年 1 月 18 日）、贾鹏先生，简历如下：

阎炯先生：

曾任职长江养老保险股份有限公司投资经理；北京诚盛投资管理有限公司金融、宏观研究员，衍生品、套利策略研究员；北京鸿道投资管理有限公司机械、节能环保行业研究员。熟悉全市场套利交易，深入研究个股，结合自上而下择时仓位管理，投资风格稳健，适合绝对收益目标的组合管理，未来更看好股债结合、攻守兼备的品种，将结合可转债、分级 A 等品种做好相对收益。

贾鹏先生：

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、报告期内投资策略和运作分析

1. 投资策略回顾

四季度，随着北半球进入寒冬，海外新冠疫情再次爆发，尤其是英国出现的病毒变异，使全球经济的复苏前景蒙上了一层阴影，值得振奋的是，多种疫苗研发均在稳步推进，而我国在疫情防控方面依然表现出色，在供给替代和海外需求不弱的作用下，我国出口保持强劲，带动经济复苏。

国内信用事件的爆发，对四季度的债券市场形成了明显的冲击，市场风险偏好急剧降低，部分产品遭遇流动性压力，不得不抛售高流动性资产应对赎回，国家金融稳定会议的召开，为市场注入了信心，随着央行超量续作 MLF，市场资金面逐渐好转。

在投资方面，四季度产品依然保持了中性的投资策略，控制债券久期，适当参与一些交易性投资机会。

2. 投资展望

展望 2021 年一季度，随着疫苗的推出，对于疫情的担忧逐步将得到缓解，海外生产也将重启和恢复，货币政策方面，央行将延续之前的货币政策，不会出现快速的转向，债券市场有望出现一定的修复机会。产品方面将维持中性的策略，适时调整久期和杠杆，保持充足的流动性。

四、重大事项披露

1. 报告期内投资经理变更情况

报告期内，本计划自 2020 年 12 月 25 日起改由阎炯和贾鹏先生共同担任投资经理。

2. 报告期内关联交易情况

报告期内，本计划未发生关联交易。

3. 期末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

截至 2020 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中，个人投资者 1 名，合计持有份额：1,198,819.62 份。

4. 其他需披露的重大事项

无其他需披露的重大事项。

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，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《企业会计准则》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定进行会计核算，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，向投资者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、收益分配等情况。

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 2020 年 4 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

资产类别	市值（元）	占总资产比例（%）
1. 权益类资产	0.00	0.00
2. 基金类资产	4,047,166.53	17.05
3. 固定收益类资产	6,652,714.20	28.03
其中：债券	6,652,714.20	28.03
资产支持证券	0.00	0.00
4. 买入返售金融资产	12,000,120.00	50.56
5. 银行存款及清算备付金合计	867,455.04	3.65
6. 其他资产	168,379.13	0.71
总资产合计	23,735,834.90	100.00

二、期末市值占计划资产净值前五名证券明细

序号	证券代码	证券名称	市值（元）	市值/净值（%）
----	------	------	-------	----------

1	511990	华宝添益	4,046,666.45	17.08
2	018006	国开1702	3,050,700.00	12.88
3	010107	21国债(7)	3,035,700.00	12.81
4	010303	03国债(3)	566,314.20	2.39
5	511660	建信添益	500.08	0.00

三、非标准化债权类资产投资情况

本资产管理计划不涉及非标准化债权类资产投资。

四、投资组合报告附注

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第七节 报告期内计划份额变动

单位：份

期初份额总额	28,858,529.00
红利再投资份额	0.00
报告期间赎回份额	7,343,426.00
报告期间申购份额	0.00
期末份额总额	21,515,103.00

第八节 备查文件及查阅方式

一、备查文件

1. 华金鸿腾年年盈集合资产管理计划资产管理合同及其补充协议；
2. 华金鸿腾年年盈集合资产管理计划说明书；
3. 华金鸿腾年年盈集合资产管理计划风险揭示书；
4. 报告期内华金鸿腾年年盈集合资产管理计划在指定网站上披露的各项公告；
5. 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：956011



