

首创证券尊享优选 3 号集合资产管理计划 2020 年度资产管理报告

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》(以下简称《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》(以下简称《管理规定》)及其他有关规定制作。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产,但不保证本集合计划一定盈利,也不保证最低收益。

集合资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司河北省分行于 2021 年 3 月 11 日对本报告中的主要财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

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。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间:2020 年 3 月 4 日—2020 年 12 月 31 日

一、集合计划简介

名称:首创证券尊享优选 3 号集合资产管理计划(以下简称“尊享优选 3 号”或“本计划”)

类型:集合资产管理计划

管理人:首创证券股份有限公司

托管人:中国工商银行股份有限公司河北省分行

成立日:2020 年 03 月 04 日

成立规模:206,080,000.00 份

存续期:本集合计划固定管理期限 5 年

投资目标:本集合计划主要投资于固定收益类、现金类、金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资,在有效控制投资风险的基础上,力争获取稳健的投资回报。

二、计划投资表现

(一) 主要指标

单位:人民币元

	主要财务指标	2020 年 3 月 4 日—2020 年 12 月 31 日
1	集合计划本期利润	9,493,283.35
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	9,770,023.35
3	期末集合计划资产总值	228,374,203.51
4	期末集合计划资产净值	207,946,077.11
5	单位集合计划资产净值	1.0157
6	期末集合计划杠杆	0.0962

(二) 主要指标的计算公式

(1) 本期单位集合计划净收益=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额÷集合计划份额

(2) 单位集合计划净值=集合计划净值÷集合计划份额

(3) 期末集合计划杠杆=卖出回购金融资产款÷期末集合计划资产净值

三、集合计划管理人报告

(一) 净值表现

截止到2020年12月31日，集合计划单位净值为1.0157。

（二）投资经理简介

本资产管理计划投资经理为姚佳，简介如下：

姚佳，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理，精算学学士。偏向挖掘价值洼地与捕捉交易性机会相结合，具有丰富的投资交易经验。2015年加入国融证券股份有限公司，历任债券交易员、投资总监助理、投资顾问授权代表，2019年加入首创证券有限责任公司，担任资产管理事业部固定收益投资部投资经理，负责资管产品的资产配置、流动性管理和投后跟踪工作。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（三）风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《管理办法》、《管理规定》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的风险控制部门，加强对集合资产管理业务风险的事前分析、事中监控和事后评估，并提出风险控制措施。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和合

规与风险管理部日常监控、重点检查的结果。

本集合计划管理人的风险控制工作主要通过资产管理业务部门内控和风险管理部外部监控来进行。为加强资产管理业务的风险管理，资产管理综合运营部作为资产管理业务的一线中台部门，将合规与风险管理工作前置化，有效提升业务风险管控效果。主要工作内容包括集合计划的风险揭示及管理、绩效评估、投资交易的授权执行、交易印章的使用等。风险管理部作为公司层面的中台部门，全面负责各类风险的揭示及管理，采用授权管理、绩效评估以及定期与不定期检查等多种方法对资产管理业务条线的运作进行有效控制。定期对业务授权、投资交易及合规性进行了全面细致的审查。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

四、集合计划会计报告

（一）资产负债表（2020 年 12 月 31 日）

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资 产：		负 债：	
银行存款	24,091,087.92	短期借款	0.00
结算备付金	0.00	交易性金融负债	0.00
存出保证金	2,291.52	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	196,112,000.00	卖出回购金融资产款	20,000,000.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00

债券投资	196,112,000.00	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	299,014.34
权证投资	0.00	应付托管费	52,750.34
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	1,710.00
买入返售金融资产	0.00	应交税费	39,276.30
应收证券清算款	0.00	应付利息	35,375.42
应收利息	8,168,824.07	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	0.00
应收申购款	0.00	负债合计	20,428,126.40
贷款	0.00		
代理业务资产	0.00	所有者权益：	
融资租赁资产	0.00	实收基金	204,730,000.00
可供出售金融资产	0.00	资本公积	0.00
持有至到期投资	0.00	未分配利润	3,216,077.11
长期股权投资	0.00	所有者权益合计	207,946,077.11
长期应收款	0.00		
其他资产	0.00		
资产总计	228,374,203.51	负债和所有者权益总计	228,374,203.51

(二) 损益表 (2020年3月4日至2020年12月31日)

项目	本年累计数
一、收入	12,035,895.54
1、利息收入	11,641,845.13
其中：存款利息收入	14,701.71
债券利息收入	11,153,786.85
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售金融资产收入	473,356.57
贷款利息收入	0.00
代理业务资产利息收入	0.00
租赁收入	0.00
增值税抵减	0
2、投资收益（损失以“-”填列）	670,790.41
其中：股票投资收益	0.00
债券投资收益	488,586.00
基金投资收益	0.00
权证投资收益	0.00

资产支持证券投资收益	0.00
衍生工具收益	0.00
可供出售金融资产投资收益	0.00
持有至到期投资收益	0.00
股权投资收益	0.00
股利收益	196,435.07
个股期权收益	0.00
增值税抵减	-14,230.66
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-276,740.00
4、其他收入（损失以“-”填列）	0.00
5、营业外收入	0.00
二、费用	2,542,612.19
1、管理人报酬	1,357,847.66
2、托管费	86,041.48
3、销售服务费	0.00
4、交易费用	1,815.62
5、利息支出	1,051,497.37
其中：卖出回购金融资产支出	1,051,497.37
6、其他费用	3,600.00
7、营业外支出	0.00
8、营业税金及附加	41,810.06
三、利润总额	9,493,283.35

五、集合计划投资组合报告

本计划为固定收益类集合资产管理计划，固定收益类资产占计划总资产的 100%。

（一）报告期末按市值占净值比例大小排序前五名的债券明细

序号	名称	期末市值（元）	占资产净值的比例（%）
1	19 遵旅 01	20,128,000.00	9.6794
2	19 金堂国资 PPN001	20,126,000.00	9.6785
3	20 永开 01	20,000,000.00	9.6179
4	20 什邡 01	20,000,000.00	9.6179
5	20 德恒 01	20,000,000.00	9.6179

(二) 集合计划份额变动情况

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
206,080,000.00	66,850,000.00	68,200,000.00	204,730,000.00

六、集合计划投资收益分配情况

本计划本年度内于 2020 年 9 月 8 日进行了收益分配，分红金额为 6,277,206.24 元人民币。

七、重大事项

本计划在报告期内进行了管理人名称变更和注册资本变更。管理人于 2020 年 8 月 26 日完成工商变更，公司名称由“首创证券有限责任公司”变更为“首创证券股份有限公司”。公司更名后，业务主体和法律关系不变，原签订的合同继续有效，原有的业务关系和服务承诺保持不变。注册资本增加至 130000 万元，2020 年 9 月 25 日注册资本增加至 246000 万元。

本计划于 2020 年 4 月 30 日进行了投资经理变更，投资经理由谭咏南变更为姚佳。

八、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、首创证券首享优选 3 号集合资产管理计划说明书、资产管理合同、变更合同条款说明
- 2、首创证券首享优选 3 号集合资产管理计划托管协议
- 3、管理人业务资格批件、营业执照

（二）信息披露查阅方式

网址：www.sczq.com.cn

信息披露电话：95381

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人首创证券股份有限公司。

