**海鑫资产稳健收益1号私募证券投资基金2019年年度报告**

# 基金产品概况

1. 基金基本情况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金名称 | 海鑫资产稳健收益1号私募证券投资基金 |
| 基金编号 | SL3715 |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金成立日期 | 2016年7月22日 |
| 基金管理人 | 北京海鑫资产管理有限公司 |
| 基金托管人（如有） | 中信建投证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） | - |
| 报告期末基金份额总额 | 10,000,000 |
| 基金到期日期 | 2021年7月22日 |

1. 基金产品说明

|  |  |
| --- | --- |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的前提下，力争为基金投资者创造稳健的收益和回报。 |
| 投资策略 | 通过构建债券组合，以长期持有获取红利为主，兼顾交易性机会博取利差。 |
| 业绩比较基准（如有） | - |
| 风险收益特征 | 高风险高收益 |

1. 基金管理人和基金托管人

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **项目** | **基金管理人** | **基金托管人** |
| 名称 | 北京海鑫资产管理有限公司 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | - | 纪雅静 |
| 联系电话 | - | 010-86451131 |
| 电子邮箱 | - | tgguzhi@csc.com.cn |
| 传真 | - | 010-85130946 |
| 注册地址 | - | 北京市朝阳区安立路66号4号楼 |
| 办公地址 | - | 北京市东城区朝阳门内大街2号 |
| 邮政编码 | - | 100010 |
| 法定代表人 | - | 王常青 |

1. 信息披露方式

|  |
| --- |
|  |

1. 其他相关资料（如有）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **项目** | **名称** | **办公地址** |
| 会计师事务所 | - | - |
| 注册登记机构 | 中信建投证券股份有限公司 | 北京市东城区朝阳门内大街2号 |
| 外包机构 | 中信建投证券股份有限公司 | 北京市东城区朝阳门内大街2号 |
| - | - | - |
| - | - | - |

# 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

1. 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 期间数据和指标 | 2019年 | 2018年 | 2017年 |
| 本期已实现收益 | 72,693.93 | 122,110.86 | 934,840.74 |
| 本期利润 | 160,884.3 | 405,120.63 | 824,316.74 |
| 期末数据和指标 | 2019年末 | 2018年末 | 2017年末 |
| 期末可供分配利润 | 844,261.91 | 771,567.98 | 784,901.45 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0844 | 0.0772 | 0.0598 |
| 期末基金资产净值 | 11,117,612.55 | 10,956,728.25 | 13,913,622.33 |
| 期末基金份额净值 | 1.112 | 1.096 | 1.06 |
| 累计期末指标 | 2019年末 | 2018年末 | 2017年末 |
| 基金份额累计净值增长率（%） | 11.2 | 9.6 | 6 |

1. 基金净值表现

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **阶段** | **净值增长率（%）** | **净值增长率标准差（%）** | **业绩比较基准收益率（%）** | **业绩比较基准收益率标准差（%）** |
| 当年 | 1.46 | 0 | 0 | 0 |
| 自基金合同生效起至今 | 11.2 | 0 | 0 | 0 |

1. 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **年度** | **每份基金份额分红数** | **现金形式发放总额** | **再投资形式发放总额** | **年度利润分配合计** | **备注** |
| 2019 | 0 | 0 | 0 | 0 | - |
| 2018 | 0 | 0 | 0 | 0 | - |
| 2017 | 0 | 0 | 0 | 0 | - |

# 基金份额变动情况

单位：份

|  |  |
| --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额 | 10,000,000 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 0 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 0 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0 |
| 报告期期末基金份额总额 | 10,000,000 |

# 管理人说明的其他情况

|  |
| --- |
|  |

# 托管人报告（如有）

1. 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

|  |
| --- |
| 在本报告期内，本基金托管人在托管基金过程中，严格遵守了基金合同、托管协议（如有）的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。 |

1. 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

|  |
| --- |
| 在本报告期内，托管人按照基金合同，托管协议（如有）的有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用进行了认真的复核；托管人按照基金合同或托管协议（如有）中约定的托管人应承担的投资监督职责，根据基金管理人向托管人提供的基金投资相关文件及基金托管账户显示的基金投资信息，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有明显损害基金份额持有人利益的行为。 |

1. 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

|  |
| --- |
| 本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现的相关内容，所复核内容真实、准确和完整。免责声明：1、基金托管人仅复核本报告中的基金财务数据，对于本报告中基金财务数据以外的其他数据和信息，基金托管人不承担复核职责。2、基金管理人，基金管理人委托的证券期货经纪商等服务机构应当确保向基金托管人提供的基金财务数据和信息的及时性、真实性、准确性和完整性，对因基金管理人或者服务机构原因导致基金托管人复核后的基金财务数据不准确及基金财产损失，基金托管人不承担任何责任。3、基金托管人不复核本基金财产分配（包括利润分配、收益分配及资产分配等）情况，除非基金合同或托管协议（如有）明确约定由基金托管人对财产分配（包括利润分配、收益分配及资产分配等）情况进行复核。 |

# 年度财务报表

金额单位：元

1. 资产负债表

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **资产** | **本期末2019年12月31日** | **上年度末2018年12月31日** |
| 资产： |  |  |
| 银行存款 | 392,926.74 | 908,634.04 |
| 结算备付金 | 0 | 0 |
| 存出保证金 | 107.05 | 735.46 |
| 交易性金融资产 | 3,311,670 | 5,760,097.5 |
| 其中：股票投资 | 0 | 0 |
| 基金投资 | 0 | 0 |
| 债券投资 | 3,311,670 | 5,760,097.5 |
| 资产支持证券投资 | 0 | 0 |
| 贵金属投资 | 0 | 0 |
| 衍生金融资产 | 0 | 0 |
| 买入返售金融资产 | 4,778,023.89 | 1,263,006.32 |
| 应收证券清算款 | 0 | 0 |
| 应收利息 | 31,295.87 | 153,500.43 |
| 应收股利 | 0 | 0 |
| 应收申购款 | 0 | 0 |
| 递延所得税资产 | 0 | 0 |
| 其他资产 | 3,060,898.06 | 3,138,365.59 |
| 资产总计 | 11,574,921.61 | 11,224,339.34 |
| **负债和所有者权益** | **本期末2019年12月31日** | **上年度末2018年12月31日** |
| 负债： |  |  |
| 短期借款 | 0 | 0 |
| 交易性金融负债 | 0 | 0 |
| 衍生金融负债 | 0 | 0 |
| 卖出回购金融资产款 | 0 | 0 |
| 应付证券清算款 | 0 | 0 |
| 应付赎回款 | 0 | 0 |
| 应付管理人报酬 | 396,043.62 | 212,215.35 |
| 应付托管费 | 30,184.42 | 27,140.62 |
| 应付销售服务费 | 0 | 0 |
| 应付交易费用 | 0 | 0 |
| 应交税费 | 896.6 | 1,114.5 |
| 应付利息 | 0 | 0 |
| 应付利润 | 0 | 0 |
| 递延所得税负债 | 0 | 0 |
| 其他负债 | 30,184.42 | 27,140.62 |
| 负债合计 | 457,309.06 | 267,611.09 |
| **所有者权益：** |  |  |
| 实收基金 | 10,000,000 | 10,000,000 |
| 未分配利润 | 1,117,612.55 | 956,728.25 |
| 所有者权益合计 | 11,117,612.55 | 10,956,728.25 |
| 负债和所有者权益总计 | 11,574,921.61 | 11,224,339.34 |

1. 利润表

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **项目** | **本期** | **上年度可比期间** |
| **2019年1月1日 至 2019年12月31日** | **2018年1月1日 至 2018年12月31日** |
| **一、收入** | 406,311.5 | 874,295.41 |
| 1.利息收入 | 346,239 | 902,712.85 |
| 其中：存款利息收入 | 4,568 | 1,280.27 |
| 债券利息收入 | 276,276.85 | 922,168.46 |
| 资产支持证券利息收入 | 0 | 0 |
| 买入返售金融资产收入 | 75,644.6 | 6,307.56 |
| 其他利息收入 | -10,250.45 | -27,043.44 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -28,117.87 | -311,427.21 |
| 其中：股票投资收益 | 0 | 0 |
| 基金投资收益 | 0 | 0 |
| 债券投资收益 | -28,117.87 | -311,427.21 |
| 资产支持证券投资收益 | 0 | 0 |
| 贵金属投资收益 | 0 | 0 |
| 衍生工具收益 | 0 | 0 |
| 股利收益 | 0 | 0 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”填列） | 88,190.37 | 283,009.77 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”填列） | 0 | 0 |
| 5.其他收入（损失以“-”填列） | 0 | 0 |
| **减：二、费用** | 245,427.2 | 469,174.78 |
| 1．管理人报酬 | 183,828.27 | 212,215.35 |
| 其中：固定管理费 | 165,828.27 | 170,543.64 |
| 业绩报酬 | 18,000 | 41,671.71 |
| 2．托管费 | 30,184.42 | 27,140.62 |
| 3．销售服务费 | 0 | 0 |
| 4. 外包服务费 | 30,184.42 | 27,140.62 |
| 5．交易费用 | 0 | 153.46 |
| 6．利息支出 | 0 | 198,943.5 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 0 | 198,943.5 |
| 7．其他费用 | 1,230.09 | 3,581.23 |
| **三、利润总额****（亏损总额以“-”号填列）** | 160,884.3 | 405,120.63 |
| 减：所得税费用 | 0 | 0 |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 160,884.3 | 405,120.63 |

1. 所有者权益变动表

|  |  |
| --- | --- |
| **项目** | **本期****2019年1月1日 至 2019年12月31日** |
| **实收基金** | **未分配利润** | **所有者权益合计** |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 10,000,000 | 956,728.25 | 10,956,728.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | 0 | 160,884.3 | 160,884.3 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 0 | 0 | 0 |
| 其中：1.基金申购款 | 0 | 0 | 0 |
| 2.基金赎回款 | 0 | 0 | 0 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | 0 | 0 | 0 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 10,000,000 | 1,117,612.55 | 11,117,612.55 |
| **项目** | **上年度可比期间****2018年1月1日 至 2018年12月31日** |
| **实收基金** | **未分配利润** | **所有者权益合计** |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 13,128,720.88 | 784,901.45 | 13,913,622.33 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | 0 | 405,120.63 | 405,120.63 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -3,128,720.88 | -233,293.83 | -3,362,014.71 |
| 其中：1.基金申购款 | 0 | 0 | 0 |
| 2.基金赎回款 | -3,128,720.88 | -233,293.83 | -3,362,014.71 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | 0 | 0 | 0 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 10,000,000 | 956,728.25 | 10,956,728.25 |

# 期末投资组合情况

1. 期末基金资产组合情况

金额单位：元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **项目** | **金额****(人民币)** | **占基金总资产的****比例（%）** |
| 1 | 权益投资 | 0 | 0 |
|  | 其中：普通股 | 0 | 0 |
|  | 存托凭证 | 0 | 0 |
| 2 | 基金投资 | 0 | 0 |
| 3 | 固定收益投资 | 3,311,670 | 28.61 |
|  | 其中：债券 | 3,311,670 | 28.61 |
|  | 资产支持证券 | 0 | 0 |
| 4 | 金融衍生品投资 | 0 | 0 |
|  | 其中：远期 | 0 | 0 |
|  | 期货 | 0 | 0 |
|  | 期权 | 0 | 0 |
|  | 权证 | 0 | 0 |
| 5 | 买入返售金融资产 | 4,778,023.89 | 41.28 |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0 | 0 |
| 6 | 货币市场工具 | 0 | 0 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 393,033.79 | 3.4 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,092,193.93 | 26.71 |
| - | - | - | - |
|  | 合计 | 11,574,921.61 | 100 |

1. 报告期末按行业分类的股票投资组合
2. 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

| **序号** | **行业类别** | **公允价值** | **占基金资产净值比例（%）** |
| --- | --- | --- | --- |
| A | 农、林、牧、渔业 | 0 | 0 |
| B | 采矿业 | 0 | 0 |
| C | 制造业 | 0 | 0 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 0 | 0 |
| E | 建筑业 | 0 | 0 |
| F | 批发和零售业 | 0 | 0 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 0 | 0 |
| H | 住宿和餐饮业 | 0 | 0 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 0 | 0 |
| J | 金融业 | 0 | 0 |
| K | 房地产业 | 0 | 0 |
| L | 租赁和商务服务业 | 0 | 0 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 0 | 0 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 0 | 0 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 0 | 0 |
| P | 教育 | 0 | 0 |
| Q | 卫生和社会工作 | 0 | 0 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 0 | 0 |
| S | 综合 | 0 | 0 |
|  | **合计** | 0 | 0 |

1. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
| 港股通 | 0 | 0 |
| - | - | - |
| 合计 | 0 | 0 |

# 信息披露报告

此处请上传管理人向投资者披露的信息披露报告pdf文件，需加盖管理人公章。

请点击工具栏上“附件列表”按钮上传附件。

信息披露报告是否经托管机构复核：是