

渤海汇金证券资产管理 有限公司

2016 年年度报告 公开披露信息

渤海汇金证券资产管理有限公司

二〇一七年三月

渤海汇金证券资产管理有限公司 2016 年年度报告

目 录

一、重要提示.....	3
二、公司 2015 年年度报告公开信息.....	4

渤海汇金证券资产管理有限公司

2016 年年度报告

重 要 提 示

本公司董事会、监事、高级管理人员保证年度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并就其承担个别和连带的法律责任。

本公司年度财务报告已经普华永道中天会计师事务所审计，并出具了普华永道中天审字（2017）第 22594 号标准无保留意见的审计报告。

公司董事长、公司总经理、财务负责人、合规总监声明并保证年度报告中财务报表的真实、准确、完整。

董事长：

总经理：

财务负责人：

合规总监：

渤海汇金证券资产管理有限公司 2016 年年度报告

一、公司简介

1、公司法定中文名称

渤海汇金证券资产管理有限公司（以下简称公司或本公司）

公司法定英文名称

Bohai Huijin Securities Asset Management CO.,LTD

2、法定代表人、公司董事长：王春峰

总经理：周磊

3、注册资本、净资产和各单项业务资格

(1) 注册资本：

2016 年 12 月 31 日，公司注册资本为 200,000,000 元

(2) 净资产：

2,228,879,844.02 元

(3) 各单项业务资格：

根据中国证监会核发的经营证券期货业务许可证（流水号：000000000166），公司经营范围包括：证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务。

4、公司地址

公司注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

公司办公地址：深圳市南山区海德三道 19 号海岸大厦西座 2901 室（邮政编码：518054）

国际互联网网址：www.bhhjamc.com

电子信箱：bhhjzg@126.com

5、董事会秘书：李唤工

联系地址：天津市南开区宾水西道 8 号

电话：022-28451828

董事会秘书助理：李峥

电话：0755-33017787 18926089783

传真：0755-33017781

电子信箱：lizheng@bhjq.com

二、股东情况：

（一）报告期末股东总数；

报告期末股东总数为 1。

（二）期末持股前 5 名的股东名称、持股比例。

期末持股前 5 名的股东名称：渤海证券股份有限公司

持股比例：100%

三、历史沿革。

渤海汇金证券资产管理有限公司，源自渤海证券股份有限公司资产管理总部，股东为渤海证券股份有限公司，持股比例为 100%。

2015 年 4 月，渤海证券股份有限公司召开第二届董事会第十七次会议，同意渤海证券股份有限公司出资 2 亿元人民币设立全资子公司，从事资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务，并将拟设立公司注册于深圳前海。

2015 年 5 月，渤海证券股份有限公司召开二〇一五年第三次临时股东大会，股东大会同意渤海证券出资 2 亿元人民币设立全资子公司，从事资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务，并将拟设立公司注册于深圳前海。

2016 年 1 月，中国证券监督管理委员会出具《关于核准渤海证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可〔2016〕3 号），核准渤海证券股份有限公司设立渤海汇金证券资产管理有限公司，注册地为深圳市，注册资本为 2 亿元，业务范围为证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务。

2016 年 5 月 18 日，渤海汇金证券资产管理有限公司领取了营业执照；2016 年 8 月 9 日，获得了经营证券期货业务许可证。

四、公司组织机构

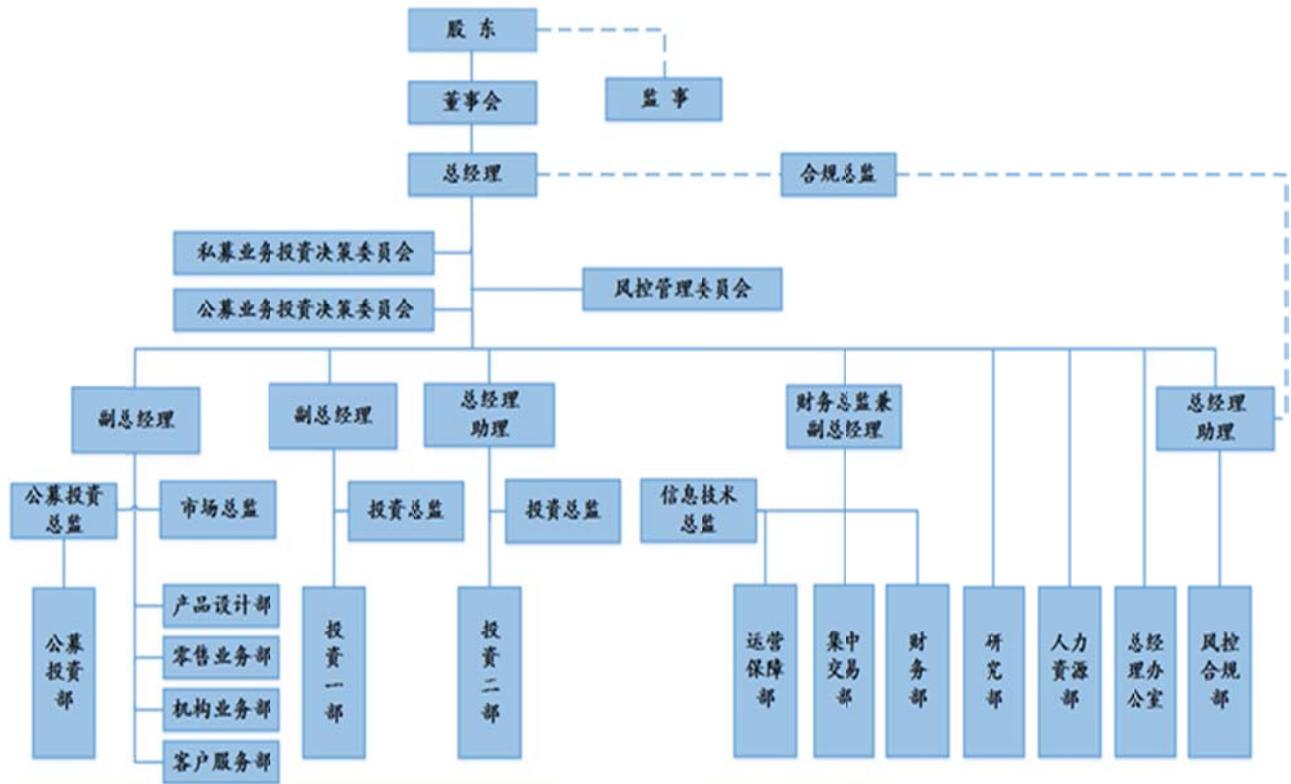
公司遵循《公司法》、《证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司内部控制指引》、《证券公司治理准则》等有关法律、法规及《公司章程》的规定，规范运作，构建了科学有效的法人治理结构。

公司不设股东会，股东依照《公司法》及《公司章程》享有相应权利。公司不设监事会，由监事履行监督机构相应监督职能。董事会为公司决策机构，向股东负责并报告工作。董事会下未设置专业委员会。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，总经理主持公司日常经营管理工作，副总经理协助总经理工作。公司经营管理层负责日常经营。公司总部设在深圳前海，设有公募投资部、

产品设计部、零售业务部、机构业务部、客户服务部、投资一部、投资二部、运营保障部、集中交易部、财务部、研究部、人力资源部、总经理办公室、风控合规部共十四个一级部门。

公司组织结构图：



1、境内外分公司

报告期内未设立，境内外分公司。

2、证券营业部数量和分布情况等

公司目前暂无证券营业部。

五、公司员工情况

序号	类别	细分类别	员工人数（人）	所占比例
1	业务构成	产品设计人员	6	6.38%
		销售业务人员	28	29.80%
		投资研究人员	27	28.72%
		风控合规人员	6	6.38%
		综合管理人员	27	28.72%
2	学历构成	博士研究生	7	7.45%
		硕士研究生	43	45.74%

		本科	44	46.81%
3	专业构成	金融、经济、管理、财会	66	70.21%
		计算机	6	6.38%
		法律	6	6.38%
		其他	16	17.02%

六、公司资产质量、流动性情况、负债情况以及重要的投融资活动

(一) 资产负债情况分析

截至 2016 年 12 月 31 日，公司资产总额 148,256.36 万元，其中金融资产 127,469.32 万元（包含买入返售金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产），占总资产 85.98%，货币资金及结算备付金、存出保证金 15,313.76 万元，占总资产 10.33%，货币资金和金融资产占比较大，资产流动性良好。剩余资产为固定资产、应收款项、应收利息等其他资产。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司负债总额 126,866.59 万元。组成部分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 105,924.50 万元，卖出回购金融资产款 12,769.99 万元，应付款项 6,985.69 万元，以及应付职工薪酬、应交税费、应付利息、递延所得税负债、其他负债等。

报告期内(2016 年 5 月 18 日公司成立日至 2016 年 12 月 31 日)，公司实现营业收入 4,513.80 万元；净利润 1,379.51 万元。截至 2016 年 12 月 31 日，公司资产总额 148,256.36 万元，所有者权益总额 21,389.77 万元，净资本 222,887.98 万元。

1、收入

公司本年度实现营业收入达 4,513.80 万元，其中资产管理业务净收入 3,636.81 万元，利息净收入-86.51 万元，投资收益 2,727.00 万元，公允价值变动收益-1,763.50 万元。

2、成本与费用

2016 年累计费用支出 2,672.68 万元。

3、现金流量

项目	本年累计（元）
一、经营活动产生的现金流量	
经营活动现金流入小计	1,159,025,112.64
经营活动现金流出小计	1,165,221,993.46

经营活动产生的现金流量净额	-6,196,880.82
二、投资活动产生的现金流量	
投资活动现金流出小计	40,870,384.75
投资活动产生的现金流量净额	-40,870,384.75
三、筹资活动产生的现金流量	
筹资活动现金流入小计	200,000,000.00
筹资活动产生的现金流量净额	200,000,000.00

(1) 经营活动产生的现金净流出：619.69 万元。

主要流入项目：回购业务资金净增加额 525.49 万元，收取利息、手续费及佣金的现金 4,841.73 万元，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债净增加额 105,312.55 万元，收到其他与经营活动有关的现金 5,222.74 万元；

主要流出项目：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额 112,514.75 万元，支付利息、手续费及佣金的现金 1,475.86 万元，支付给职工以及为职工支付的现金 1,069.09 万元，支付的各项税费 342.89 万元，支付其他与经营活动有关的现金 1,119.61 万元。

(2) 投资活动产生的现金净流出：4,087.04 万元。

主要流出项目：可供出售投资净减少额 3,583.00 万元，购建固定资产、无形资产及其他长期资产支付的现金净额 504.04 万元。

(3) 筹资活动产生的现金净流入：20,000 万元。

主要流入项目：吸收投资收到的现金 20,000 万元。

(二) 流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

公司的流动性风险主要包括公司以自有资金进行投资活动所产生公司层面的流动性风险和资管产品进行投资活动产生的产品层面的流动性风险。

作为公司层面流动性风险的日常管理部门，财务总部统筹公司资金来源与融资管理，协调安排公司资金需求，开展现金流管理，监控优质流动性资产状况，组织流动性风险应急计划的制定、演练并不断完善应急预案；负责制定流动性风险管理策略、措施和流程；定期向首席风险官报告流动性风险水平、管理状况及其重大变化；负责对公司的流动性风控

指标进行日常管理。公司通过增加注册资本金和向母公司借款补充公司的资金流动性，财务部门随时关注资金的使用情况、安排好还款事宜，确保资金的流动性安全及业务的正常开展。

针对产品层面的流动性风险，公司一方面严格按照资管产品合同约定，合理选择投资品种开展投资业务，一方面关注产品开放期的流动性问题，以确保产品的正常运作。

此外，公司相关负责自有资金投资和产品投资的部门随着固定收益类投资比重的增加和市场变化，及时调整自有投资或产品投资的资产配置、资产规模，随时关注市场上的资金面变化以及投资品种的市场流动性状况，规避在出现市场风险时由于持仓品种难以变现导致的流动性风险，同时，对产品投资尽量做好用国债期货等衍生工具在流动性风险出现时进行有效对冲的准备。

公司在各项业务开展前，均考虑到业务总体规模与公司整体经营状况以及资本实力的匹配关系，充分考虑资金的流动性。在经营层做重大决策前，都要通过压力测试来测算出业务开展对公司净资本等风控指标的影响情况，以给公司经营层决策提供数据支持作用。在具体业务开展过程中，通过各类业务的投资决策委员会来具体审议不同时间阶段的投资策略及资产配置，更加科学、合理地保障公司各项资产配置具有良好的流动性。

2016 年末，公司购置了恒生公司开发的流动性报表模块，预计 2017 年通过试运行后正式上线。通过该模块的使用，能够实现对公司层面流动性监管指标的动态监控，及时了解公司的资产负债结构以及流动性状况，切实提升对流动性风险管理的水平和能力。

七、公司报告期内各项业务的经营概况和公司所处的市场地位

（一）各项业务经营概况

截至 2016 年 12 月 31 日，公司资产管理总规模约 1,908.81 亿，其中集合资产管理规模 23.7 亿，定向资产管理规模 1,881.71 亿，专项资产管理规模 3.4 亿。

定向业务：机构业务部 2016 年以来共开展 6 单股票质押类定向业务，其中落地 2 单，实现了股票质押业务零的突破，规模共计 8.4 亿。主动管理型定向业务，机构部主动向机构客户拓展债券委外、量化打新投资、非标投资等主动管理类定向业务，其中委外业务已签约尚未运作 1 单，正在法审推进 1 单，预计规模 52.5 亿；非标投资业务已签约 1 单，预计规模 1.5 亿；量化打新业务已落地 2 单，合计规模 2.56 亿。

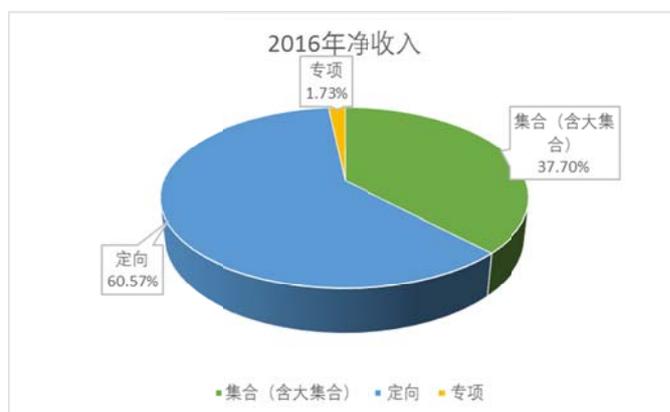
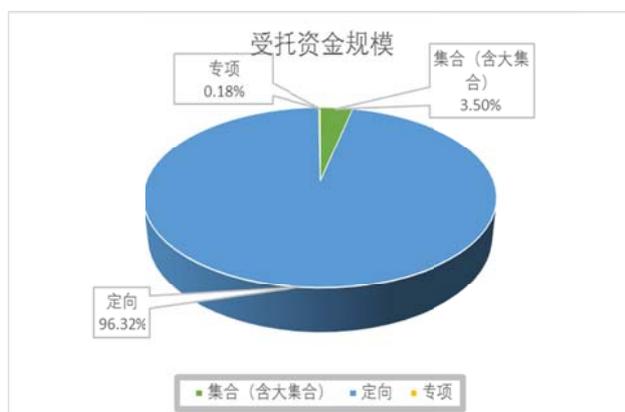
（二）公司所处市场地位（数据来源 cisp 系统）

规模及收入排名:		截至2016年12月底	
指标名称	行业总值	排名	
证券公司客户资产管理总规模(亿元)	173110.74	27.96	
证券公司集合计划管理规模(亿元)	21938.37	49.95	
证券公司集合计划管理数量(只)	3643	22	
证券公司定向资产计划管理规模(亿元)	146857.06	24.96	
证券公司定向资产计划管理数量(只)	20196	26	
证券公司通道类定向资产管理规模(亿元)	123758.03	20	
证券公司通道类定向资产管理数量(只)	16594	22	
证券公司客户资产管理业务本期净收入(万元)	511071.98	61	
证券公司客户资产管理业务本期净收入(万元)	511071.98	91	
证券公司客户资管业务本年累计净收入(万元)	2964629.51	56	
证券公司客户资管业务本年累计净收入(万元)	2964629.51	74	

产品发行排名:		2016年12月	
指标名称	行业总值	排名	
证券公司定向资产计划本期发行数量(只)	1067	44	

2016年,公司资产管理业务实现营业收入4,513.80万元,营业利润1,841.11万元。

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
年末产品数量	29	244	1
年末客户数量	10315	244	5
年末受托资金(万元)	678,759.28	18,661,925.20	34,000
归属于母公司的资产管理业务净收入(万元)	1,643.04	2,639.87	75.34



八、主要业务经营情况及发展趋势

截至 2016 年 12 月 31 日，公司资产管理总规模约 1937.47 亿，其中集合资产管理规模 67.88 亿，定向资产管理规模 1866.19 亿，专项资产管理规模 3.4 亿。

定向业务全年新增产品 59 只，新增对应规模为 660.03 亿；其中，开展 6 单股票质押类定向业务，其中落地 2 单，实现了股票质押业务零的突破，规模共计 8.4 亿。主动管理型定向业务，机构部主动向机构客户拓展债券委外、量化打新投资、非标投资等主动管理类定向业务，其中委外业务已签约尚未运作 1 单，正在法审推进 1 单，预计规模 52.5 亿；非标投资业务已签约 1 单，预计规模 1.5 亿；量化打新业务已落地 2 单，合计规模 2.56 亿。

集合业务全年，新增产品 38 只（含分期），新增产品对应规模为 122.61 亿份；其中管理代销产品 48 只（含分期，含已结束产品 3 只），存续规模为 40.08 亿份。通过 17 次产品持续营销和 2 个产品的首发以及滨海 1 号大集合改造重启工作（自滨海 1 号大集合改造 4 月 11 日首期产品发行，截止 12 月 31 日，8 个月的时间里共发行 31 期产品，累计发行规模达 98.14 亿）。

专项业务新增产品 1 只，新增对应规模为 3.4 亿份。

九、针对财务报表被会计师事务所出具非标准审计意见的，公司就所涉事项作出说明

不适用

十、公司内部控制自我评价报告结论和注册会计师对内部控制的意见

1、公司内部控制自我评价报告结论

公司《董事会 2016 年度内部控制自我评价报告》由公司第一届董事会第十一次会议审议通过。

根据对公司财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷的认定情况，公司于内部控制评价报告基准日不存在财务报告内部控制的重大缺陷及重要缺陷。董事会认为，公司已按照企业内部控制规范体系和相关规定的要求，在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

根据对公司非财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷的认定情况，公司于内部控制评价报告基准日未发现非财务报告内部控制的重大缺陷及重要缺陷。

自内部控制评价报告基准日至内部控制评价报告发出日之间，公司未发生影响内部控制有效性评价结论的情况。

2、报告期内注册会计师对内部控制的评价意见

普华永道中天会计师事务所对公司内部控制方面进行了专项审核，并出具了审核报告（普华永道中天特审字【2017】第 0605 号），报告全文请见附件 2《渤海汇金 2016 年 5 月 18 日至 2016 年 12 月 31 日止期间内部控制专项审核报告》。

十一、董事、监事、高级管理人员薪酬管理信息

(一) 2016 年公司董事、监事、高管薪酬管理情况

1、公司董事、监事、高级管理人员薪酬管理的基本制度

公司外部董事、监事不在公司领取津贴或其他报酬；公司内部董事不领取董事津贴，由于同时兼任公司高管，其报酬根据公司高管人员薪酬管理的相关制度执行。

公司高级管理人员薪酬管理的基本制度为《渤海汇金证券资产管理有限公司高管人员绩效考核与薪酬管理暂行办法》，经公司第一届董事会第八次会议审议通过。

2、董事、监事、高管薪酬决策程序

公司高管薪酬的决策程序是：

①高管人员的基本年薪包括固定工资及半年度绩效工资。其中固定工资由公司根据其职位等级、公司所处人才市场的薪酬情况、公司经营状况和市场竞争力策略定位等确定；半年度绩效工资原则上仅针对总经理及分管业务部门的高管人员发放，以其半年度绩效考核结果为基础，在董事会批准后发放。

②高管人员的绩效年薪以其绩效考核结果为基础，按照公司及其所分管部门的经营管理情况确定。绩效年薪在董事会批准后一次性提取，依照《证券公司治理准则》相关规定制定相应的支付方案。

3、公司高管薪酬延期支付和非现金薪酬情况

《证券公司治理准则》规定，证券公司高级管理人员的绩效年薪 40%以上应当采取延期支付的方式，且延期支付期限不少于 3 年。延期支付薪酬的发放应当遵循等分原则。

公司 2016 年 8 月取得经营许可证，自 2016 年 9 月开始向高管人员发放薪酬。由于 2016 年公司独立运转时间较短，当年无绩效年薪，因此当年无延期支付薪酬。

公司未向高管人员发放非现金薪酬。

十二、报告期公司董事、监事和高级管理人员在公司领取的薪酬总额

董事	人员状态(期末在任或报告期内离任)	期末人员数量(人)	年度计提薪酬(元)	年度实际发放薪酬(元)	期末延期支付薪酬(元)	年度非现金薪酬(元)	期末持有公司股份数	期末持有公司期权数
	期末在任		0	0	0	0	0	0

其中：独立 董事	期末在任		0	0	0	0	0	0
	报告期内离任		0	0	0	0	0	0
监事	期末在任		0	0	0	0	0	0
	报告期内离任		0	0	0	0	0	0
高级管理人 员	期末在任	3	3665936.61	410368	0	0	0	0
	报告期内离任	0	0	0	0	0	0	0

公司 5 名董事,除其中 2 名兼任高管、在公司领酬外,其余 3 名董事由母公司高管兼任、未有在公司领酬;公司无独立董事。公司有监事 1 名,由母公司渤海证券管理人员兼任、未有在公司领酬。

十三、社会责任

我司已积极参与披露履行社会责任的工作,对于客户的信息和利益按监管要求给予了十足保密和保障;对于员工权益包括员工的健康、安全和发展方面给予充分保护(公司每年按时组织员工体检,员工培训费用的报销等),并设立激励约束机制。由于我司于 2016 年 5 月 18 日正式成立,暂未独立在社会公益方面做出动作,随着公司发展与相关制度完善,公司会在社会责任工作上积极响应,2017 年初已启动公益工作方案。

附件 1: 渤海汇金证券资产管理有限公司董事会 2016 年度内部控制自我评价报告

附件 2: 渤海汇金 2016 年 5 月 18 日至 2016 年 12 月 31 日止期间内部控制专项审核报告

附件 3: 渤海汇金 2016 年 5 月 18 日至 2016 年 12 月 31 日止期间财务报表及审计报告