

五矿证券丰泓 1 号集合资产管理计划
2025 年度资产管理报告



计划管理人：五矿证券有限公司

计划托管人：浙商银行股份有限公司

报告期间：2025 年 1 月 1 日—2025 年 12 月 31 日

重要提示

本报告由资产管理计划管理人五矿证券有限公司依据《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。

五矿证券丰泓1号集合资产管理计划（下称“资产管理计划”或“本资产管理计划”）已于2021年3月16日成立，并向中国证券投资基金业协会及中国证监会深圳监管局备案，中国证券投资基金业协会及中国证监会深圳监管局对本资产管理计划做出的任何决定，均不表明中国证监会对本资产管理计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本资产管理计划没有风险。

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

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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告未经审计，由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2025年1月1日—2025年12月31日。

一、 管理人履职报告

1. 资产管理计划概况

(1) 资产管理计划基本资料

资产管理计划名称：五矿证券丰泓1号集合资产管理计划

资产管理计划类型：权益类

资产管理计划运作方式：定期开放

资产管理计划风险等级：R4(中等偏高风险)

资产管理计划成立日：2021年3月16日

资产管理计划报告期末计划受托规模：7,023,716.23元

资产管理计划存续期：十年

(2) 资产管理计划管理人

名称：五矿证券有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区滨海大道3165号五矿金融大厦2401

办公地址：深圳市南山区滨海大道3165号五矿金融大厦22层

法人代表：郑宇

联系人：周蔚

联系电话：0755-23375596

传真电话：0755-83239315

网址：www.wkzq.com.cn

(3) 资产管理计划托管人

名称：浙商银行股份有限公司

联系地址：浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号

法定代表人：陆建强

联系人：卢航

联系电话：0571-87338969

网址：www.czbank.com

2. 投资经理简介

高天昊，对外经济贸易大学经济学硕士，具备基金从业资格。7年金融和资产管理行业经验，曾任职于九州证券股份有限公司资产管理部，现任五矿证券资管投资管理部投资经理，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

3. 内部性声明

(1) 资产管理计划运作合规性声明

本报告期内，资产管理计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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资产管理计划资产，在严格控制风险的基础上，为资产管理计划持有人谋求最大利益。本资产管理计划运作合法合规，无损害资产管理计划持有人利益的行为，本资产管理计划的投资管理符合有关法规的规定。

(2) 风险控制报告

通过监控和检查，可以确认，在本报告期内，本资产管理计划管理人对资产管理计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制

度和本资产管理计划说明书的要求进行。本资产管理计划的投资决策、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。

二、资产管理计划投资表现、投资组合报告及运用杠杆情况（以附件形式提供）

1. 资产管理计划基础资产投资情况

本资产管理计划主要投资于股票、基金，截至本报告期末，股票投资市值占净值比例为80.16%，基金投资市值占净值比例为3.38%。

2. 资产管理计划投资表现

年初单位净值	期末单位净值	成立以来净值增长率(%)	净值年增长率(%)	累计分配收益
0.5252	0.6048	-39.5200	15.1561	0.0000

3. 资产管理计划投资组合

截至本报告期末，本资产管理计划投资于股票的市值合计3,405,260.00元，投资于基金的市值合计143,600.00元。

4. 资产管理计划运用杠杆情况

无。

5. 产品估值表详情（详见附件）

三、资产管理计划财务会计报告（以附件形式提供）

1. 资产负债表（详见附件）

本报告期末，本资产管理计划主要资产为交易性金融资产和存出保证金，主要负债为应付管理费、托管费和应交税费。

2. 损益表（详见附件）

本报告期末，本资产管理计划净利润927,420.66元，因报告期投资收益增加，净利润较上期大幅增加。

3. 所有者权益（净值）变动表（详见附件）

本报告期末，本资产管理计划净资产4,247,913.69元，较上期无变动异常。

四、 资产管理计划费用支付情况

1、 托管人托管费计提和支付:

本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%年费率计提，计算方法如下:

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管费;

E为前一日集合计划资产净值。

集合计划托管费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。由管理人于每季末月21日起五个工作日内向托管人发送托管费划付指令，支付截止到每季末月20日所计提的托管费，托管人复核后于五个工作日内从委托财产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

本报告期间支付托管费2,651.90元。

2、 管理人管理费计提和支付:

本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为1.0%。计算方法如下:

$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

管理人的管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。由管理人于每季末月 21 日起五个工作日内向托管人发送管理费划付指令，支付截止到每季末月 20 日所计提的管理费，托管人复核后于五个工作日内从委托财产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

本报告期间支付管理费 53,039.23 元。

五、资产管理计划投资分配情况

本报告期内赎回份额 3,998,917.23 份，赎回金额 2,468,110.78 元，分配红利 0.00 元。

六、重要事项揭示

1. 法定代表人变更情况

无。

2. 投资经理变更情况

因业务发展需要，管理人于 2025 年 4 月 30 日对本集合资产管理计划投资经理进行变更，并按照规定变更信息已及时备案披露。

3. 重大关联交易情况

无。

4. 重大风险事项

无。

5. 公司从业人员、其他关联方及自有资金参与情况

无。

6. 其他涉及投资者权益的重大事项

无。

七、项目特定风险提示

1. 市场风险：市场风险是指资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、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的风险，包括但不限于：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。

2. 信用风险：信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

3. 流动性风险：如因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金，委托人面临本金及收益损失风险。流动性风险还包括资产管理计划出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

4. 利率风险：证券市场的价格和收益率的变动，委托人将面临收益变动甚至本金亏损。

5. 操作风险：指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程或自然灾害等外部突发偶然事件不可抗力因素的出现等所引致的风险，例如，越权

违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

6. 交收风险：如市场资金紧张、交易对手违约等因素导致资金交收不及时甚至失败，委托人将面临收益及本金亏损。



净资产变动表

恒生电子—五矿证券丰泓1号集合资产管理计划—专用账

日期：2025年01月—2025年12月

单位：元

项目	本期金额				上期金额			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末余额	11,022,633.46		-5,234,029.65	5,788,603.81	11,022,633.46		-7,236,221.00	7,786,412.46
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本期初余额	11,022,633.46		-5,234,029.65	5,788,603.81	11,022,633.46		-7,236,221.00	7,786,412.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,998,917.23		2,458,227.11	-1,540,690.12	-4,000,018.61		2,002,191.35	-1,997,827.26
（一）综合收益总额			927,420.66	927,420.66			-71,035.04	-71,035.04
（二）产品持有入申购和赎回	-3,998,917.23		1,530,806.45	-2,468,110.78	-4,000,018.61		2,073,226.39	-1,926,792.22
其中：产品申购	0.00		0.00	0.00	0.00		0.00	0.00
产品赎回	-3,998,917.23		1,530,806.45	-2,468,110.78	-4,000,018.61		2,073,226.39	-1,926,792.22
（三）利润分配			0.00	0.00			0.00	0.00
（四）其他综合收益结转留存收益								
四、本期末余额	7,023,716.23		-2,775,802.54	4,247,913.69	11,022,633.46		-5,234,029.65	5,788,603.81

制表：金梓彤
打印：金梓彤

打印日期：2026-01-08

利润表

恒生电子_五矿证券丰泓1号集合资产管理计划_专用表

日期: 2025年01月 - 2025年12月

单位: 元

项目	本期金额	上期金额
一、营业总收入	1,012,717.79	20,130.39
利息收入	714.68	1,900.53
投资收益 (损失以“-”填列)	931,239.51	-1,379,319.97
其中: 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
公允价值变动收益 (损失以“-”填列)	80,764.25	1,397,549.83
汇兑损益 (损失以“-”填列)	0.00	0.00
其他业务收入	0.00	0.00
二、营业总支出	85,297.13	91,165.43
管理人报酬	52,531.63	62,062.33
其中: 暂估管理人报酬	0.00	0.00
托管费	2,626.54	3,103.10
销售服务费	0.00	0.00
投资顾问费	0.00	0.00
利息支出	0.00	0.00
信用减值损失	0.00	0.00
税金及附加	7,138.96	0.00
其他费用	23,000.00	26,000.00
三、利润总额	927,420.66	-71,035.04
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	927,420.66	-71,035.04
五、其他综合收益的税后净额		
六、综合收益总额	927,420.66	-71,035.04

制表: 金梓彤

打印: 金梓彤

资产负债表

恒生电子—五矿证券丰泓1号集合资产管理计划—专用表

日期：2025年12月31日

单位：元

资产	期末余额	上年年末余额	负债和净资产	期末余额	上年年末余额
资产：			负		
货币资金	75,340.64	1,485.85	债：		
结算备付金	0.00	0.00	短期借款	0.00	0.00
存出保证金	662,302.75	1,019,975.76	交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应付管理人报酬	1,274.12	1,781.72
应收股利	0.00	0.00	应付托管费	63.72	89.08
应收申购款	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
发放贷款和垫款			应交税费	37,251.86	0.00
交易性金融资产	3,548,860.00	4,769,013.00	应付清算款	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
其他债权投资			应付利息	0.00	0.00
其他权益工具投资			应付利润	0.00	0.00
长期股权投资	0.00	0.00	其他负债	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	负债合计	38,589.70	1,870.80
			净资产：		
			实收资金	7,023,716.23	11,022,633.46
			其他综合收益		
			未分配利润	-2,775,802.54	-5,234,029.65
			净资产合计	4,247,913.69	5,788,603.81
资产总计	4,286,503.39	5,790,474.61	负债和净资产总计	4,286,503.39	5,790,474.61

附注：基金份额净值

0.6048 元,基金份额总额

7,023,716 份。

制表：金梓彤
打印：金梓彤

打印日期：2026-01-08

证券投资基金估值表

恒生电子 EA0113_五矿证券丰泓1号集合资产管理计划_专用表

科目代码	科目名称	数量	单位成本	成本	成本占净值%	市价	市值占净值%	估值增值	停牌信息
1002	银行存款			75,340.64	1.7736	75,340.64	1.7736		
100201	活期存款			75,339.48	1.7736	75,339.48	1.7736		
10020101	托管账户			75,339.48	1.7736	75,339.48	1.7736		
100207	协议活期存款 应计利息			1.16		1.16			
10020701	协议活期存款 应计利息			1.16		1.16			
10020701000001	应计活期存款利息			1.16		1.16			
1031	存出保证金			662,302.75	15.5912	662,302.75	15.5912		
103106	券商保证金账户			662,294.59	15.5911	662,294.59	15.5911		
103173	应计券商保证金利息			8.16	0.0002	8.16	0.0002		
1102	以公允价值计量且其变动计入当期损益的股票投资	70,500		2,306,200.80	54.2902	3,405,260.00	80.1631	1,099,059.20	
110201	上交所A股	14,500		784,081.51	18.4580	1,433,250.00	33.7401	649,168.49	
11020101	上交所A股成本	14,500		784,081.51	18.4580	1,433,250.00	33.7401	649,168.49	
11020199	上交所A股估值增值			649,168.49	15.2821	649,168.49	15.2821		
110231	深交所A股	47,500		1,139,317.86	26.8206	1,537,580.00	36.1961	398,262.14	
11023101	深交所A股成本	47,500		1,139,317.86	26.8206	1,537,580.00	36.1961	398,262.14	
11023199	深交所A股估值增值			398,262.14	9.3755	398,262.14	9.3755		
110241	深交所A股 创业板	8,500		382,801.43	9.0115	434,430.00	10.2269	51,628.57	
11024101	深交所A股成本 创业板	8,500		382,801.43	9.0115	434,430.00	10.2269	51,628.57	
11024199	深交所A股估值增值 创业板			51,628.57	1.2154	51,628.57	1.2154		
1105	以公允价值计量且其变动计入当期损益的基金投资	200,000		126,400.00	2.9756	143,600.00	3.3805	17,200.00	
110503	ETF基金	200,000		126,400.00	2.9756	143,600.00	3.3805	17,200.00	
11050301	ETF基金成本	200,000		126,400.00	2.9756	143,600.00	3.3805	17,200.00	
11050399	ETF基金估值增值			17,200.00	0.4049	17,200.00	0.4049		
2206	应付管理人报酬			1,274.12	0.0300	1,274.12	0.0300		
220601	应付管理人报酬			1,274.12	0.0300	1,274.12	0.0300		
2207	应付托管费			63.72	0.0015	63.72	0.0015		
220701	应付托管费			63.72	0.0015	63.72	0.0015		
2221	应缴税费			37,251.86	0.8769	37,251.86	0.8769		
222106	应交税费-暂估增值税			32,512.40	0.7654	32,512.40	0.7654		
222108	应交税费-增值附加税			3,901.49	0.0918	3,901.49	0.0918		
222122	应交税费-增值附加税-应缴			748.19	0.0176	748.19	0.0176		
222127	应交税费-附加税-应缴			89.78	0.0021	89.78	0.0021		
证券投资基金合计:									
其中股票投资:									
其中债券投资:									
其中权益类投资:									
其中权益类投资:									
今日可用头寸									
实收资本金额									

估值日期: 2025-12-31

单位净值: 0.6048

单位: 元





实收资本		7,023,716.23		7,023,716.23		165.35				
损益平准金-未实现:										
损益平准金-已实现:										
资产类合计:				3,170,244.19		74.63			100.94	1,116,259.20
负债类合计:				38,589.70		0.91			0.91	
基金资产净值:				3,131,654.49		73.72			100.00	1,116,259.20
基金单位净值:	0.6048			0.4459					0.6048	
累计单位净值:	0.6048								0.6048	
年初单位净值:	0.5252									
期初单位净值:	0.5847									
上周单位净值:	0.6056									
昨日单位净值:	0.6075									
成立以来净值增长率(%):	-39.5200									
净值年增长率(%):	15.1561									
净值季度增长率(%):	-8.6819									
净值月增长率(%):	3.4377									
净值周增长率(%):	-0.1321									
净值日增长率(%):	-0.4444									
本年内实现收益:	850,557.90									
本月已实现收益:	20,953.59									
本季度已实现收益:	340,655.37									
从成立日开始的累计已实现收益:	-11,182,667.56									
可分配利润:	-3,315,725.15									
单位可分配利润:	-0.4721									
现金类资产净值比(%):	0.00									
一年内到期的政府债券占净值比:	0.00									
累计派现金额:	0.0000									
新准则暂估业绩报酬-未入账:	0.00									
7个工作日内变现资产:	3,387,769.48									
7日内变现资产占资产净值的比:	79.75%									