

# 华泰紫金鼎造福桑梓子集合资产管理计划 2014年第三季度资产管理报告

## 重要提示

本报告依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《集合细则》)及其他有关规定制作。

中国证监会对“华泰紫金鼎伞型集合资产管理计划造福桑梓子计划”(下称“集合计划”或“本集合计划”)出具批准文件(文号:证监许可[2008]828号),但中国证监会对本集合计划作出的任何决定,均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明参与本集合计划没有风险。

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银行股份有限公司于2014年10月23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。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告期起止时间:2014年7月1日-2014年9月30日

## 一、集合计划简介

名称：华泰紫金鼎造福桑梓子集合资产管理计划

类型：非限定性集合计划

管理人：华泰证券股份有限公司

托管人：中国银行股份有限公司

成立日：2008年10月27日

成立规模：241,288,201.23份

存续期：无固定存续期

## 二、主要财务指标

### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2014年7月1日-2014年9月30日
1	集合计划本期利润	2,611,428.07
2	加权平均计划份额本期利润	0.0370
3	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,497,660.56
4	本期单位集合计划净收益	0.0226
5	期末集合计划资产总值	58,884,478.91
6	期末集合计划资产净值	55,022,899.61
7	单位集合计划资产净值	0.8299
8	本期集合计划净值增长率	4.57%
9	集合计划累计净值增长率	-14.01%

## （二）财务指标的计算公式

（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）本期集合计划净值增长率 = [期末单位净值 / (分红除权前单位净值 - 单位分红金额) \* 分红除权前单位净值 / 期初单位净值 - 1] \* 100%

（4）集合计划累计净值增长率 = (单位集合计划资产累计净值 - 1) \* 100%

## （三）集合计划累计净值历史走势图

单位：人民币元



## （四）集合计划分红情况

2014年三季度集合计划分红情况如下：

本报告期集合计划没有实施分红。

### 三、集合计划管理人报告

#### (一) 净值表现

截止到 2014 年 9 月 30 日，集合计划单位净值为 0.8299 元，本期净值增长率为 4.57%，集合计划单位累计净值为 0.8599 元，集合计划累计净值增长率为-14.01%。

#### (二) 投资主办简介

王旺国，管理学硕士，2001 年进入公司，先后在委托资产管理部、资产管理部、风险管理部和受托资产管理部工作，主要从事产品设计、交易分析、绩效评估和风险管理、策略研究和投资管理等工作，具有丰富的投资管理经验。

#### (三) 投资主办工作报告

##### 1、投资策略回顾

本集合计划在三季度前期操作比较谨慎，股性仓位较低，导致净值增长比较缓慢，之后适当提高了股性仓位，最终三季度获得了 4.57% 的净值增长，落后于大盘。

##### 2、投资管理展望

我们对四季度的市场持相对谨慎的态度，本集合计划将采取灵活操作的投资策略，通过波段操作，努力争取绝对收益，同时密切关注市场调整风险，努力避免净值出现大幅回撤。股票投资方面，重点关注地处长三角地区、前期滞涨的成长股以及今年以来涨幅较小的大盘蓝筹股；固定收益品种投资方面，重点关注剩余期限较短、到期收益率较高的信用债，并通过债券逆回购和货币市场基金，加强现金管理，提高资金使用

用效率。

#### **（四）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》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》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合规与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，资产管理总部作为资产管理业务的一线中台部门，全面负责资产管理业务的内部风险控制管理，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、交易合同的报备等。合规与风险管理部作为公司层面的中台部门，全面负责市场风险的揭示及管理，采用授权管理、逐日监控、绩效评估以及定期与不定期检查等多种方法对集合计划的管理运作进行风险控制。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；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

#### 四、集合计划财务报告

##### (一) 集合计划会计报表

##### 1、集合计划资产负债表 (2014年9月30日)

单位:人民币元

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	6,084,960.78	短期借款	
结算备付金	432,841.19	交易性金融负债	
存出保证金	46,549.93	衍生金融负债	
交易性金融资产	48,789,201.23	卖出回购金融资产款	
其中: 股票投资	27,171,760.00	应付证券清算款	3,740,577.46
债券投资	9,376,080.00	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付赎回费	
基金投资	12,241,361.23	应付管理人报酬	54,753.40
衍生金融资产		应付托管费	11,406.97
买入返售金融资产	3,000,000.00	应付销售服务费	17,338.58
应收证券清算款		应付交易费用	37,502.89
应收利息	522,749.28	应付税费	
应收股利	8,176.50	应付利息	
应收申购款		应付利润	

其他资产		其他负债	
		负债合计	3,861,579.30
		所有者权益:	
		实收基金	66,301,068.79
		未分配利润	-11,278,169.18
		所有者权益合计	55,022,899.61
资产合计:	58,884,478.91	负债与持有人权益总计:	58,884,478.91

## 2、集合计划经营业绩表(2014年7月1日至2014年9月30日)

单位:人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	3,022,684.64	4,673,607.53
1、利息收入	264,061.99	849,582.27
其中:存款利息收入	11,683.10	52,391.35
债券利息收入	186,876.18	420,522.27
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入	65,502.71	376,668.65
2、投资收益(损失以“-”填列)	1,644,855.14	2,490,997.34
其中:股票投资收益	1,004,361.17	1,785,870.96
债券投资收益	-41.67	-41.67
资产支持证券投资收益		
基金投资收益	475,537.72	185,973.63
权证投资收益		
衍生工具收益		
红利收入	144,197.92	341,894.42
股利收益	20,800.00	177,300.00
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	1,113,767.51	1,333,027.92
4、其他收入(损失以“-”填列)		

二、费用	411,256.57	1,332,578.72
1、管理人报酬	172,989.14	552,052.15
2、托管费	36,039.44	115,010.85
3、销售服务费	54,779.91	174,816.55
4、交易费用	144,963.46	467,915.05
5、利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
6、其他费用	2,484.62	22,784.12
三、利润总额	2,611,428.07	3,341,028.81

## (二) 集合计划投资组合报告 (2014年9月30日)

### 1、资产组合情况

单位：人民币元

项目	期末市值	占总资产比例
银行存款、备付金、 保证金及清算款	6,564,351.90	11.15%
股票	27,171,760.00	46.14%
债券	9,376,080.00	15.92%
证券投资基金	12,241,361.23	20.79%
其他资产	3,530,925.78	6.00%
合计	58,884,478.91	100.00%

### 2、按市值占净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票名称	期末市值(元)	占资产净值的比例
1	浦发银行	4,875,000.00	8.86%
2	长盈精密	3,951,000.00	7.18%
3	江海股份	3,688,000.00	6.70%
4	科华生物	3,232,800.00	5.88%



5	海通证券	2,889,600.00	5.25%
6	康缘药业	1,644,600.00	2.99%
7	法拉电子	1,360,800.00	2.47%
8	多氟多	890,000.00	1.62%
9	浙富控股	883,200.00	1.61%
10	中国平安	826,800.00	1.50%

### 3、按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	占资产净值的比例
1	09美好债	4,510,080.00	8.20%
2	09三友债	2,802,800.00	5.09%
3	08新湖债	2,063,200.00	3.75%

本报告期末本集合计划仅持有上述3只债券。

### 4、按市值占净值比例大小排序的前五名基金明细

序号	基金名称	期末市值(元)	占资产净值的比例
1	易方达货币A	5,125,761.23	9.32%
2	50ETF	4,331,600.00	7.87%
3	创业板	1,500,000.00	2.73%
4	180ETF	1,284,000.00	2.33%

本报告期末本集合计划仅持有上述4只基金。

### (三) 集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总额
75,411,464.33	0.00	9,110,395.54	66,301,068.79

## 五、备查文件目录

### (一) 本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会批准华泰紫金鼎伞型集合资产管理计划推广的文件
- 2、华泰紫金鼎伞型集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 3、华泰紫金鼎伞型集合资产管理计划托管协议
- 4、管理人业务资格批件、营业执照

### (二) 存放地点及查阅方式

查阅地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 806 室

网址：www.htsc.com.cn

信息披露电话：025-84579944

联系人：张小辉

EMAIL: zijin@htsc.com.cn

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人华泰证券股份有限公司。

华泰证券股份有限公司

2014年10月27日