

# 华泰紫金现金管家集合资产管理计划 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 2009 年 6 月 23 日对华泰紫金现金管家集合资产管理计划(下称“集合计划”或“本集合计划”)出具了批准文件(文号:证监许可〔2009〕563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。

托管人已于 2014 年 10 月 20 日复核了本报告中的主要财务指标、会计报表和投资组合报告等内容、保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。本报告财务资料未经审计。

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：华泰紫金现金管家集合资产管理计划

类型： 限定性集合计划

管理人：华泰证券股份有限公司

托管人：交通银行股份有限公司

成立日：2009年8月25日

成立规模：5,255,429,228.84份

存续期：8年

## 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	1,134,773.86
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,128,997.86
3	单位集合计划净收益	0.0104
4	期末集合计划资产总值	116,300,965.24
5	期末基金资产净值	116,167,851.83
6	单位集合计划资产净值	1.0651
7	本期集合计划净值增长率	0.97%
8	集合计划累计净值增长率	22.11%

### （二）财务指标的计算公式

(1) 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 ÷ 期末集合计划份额

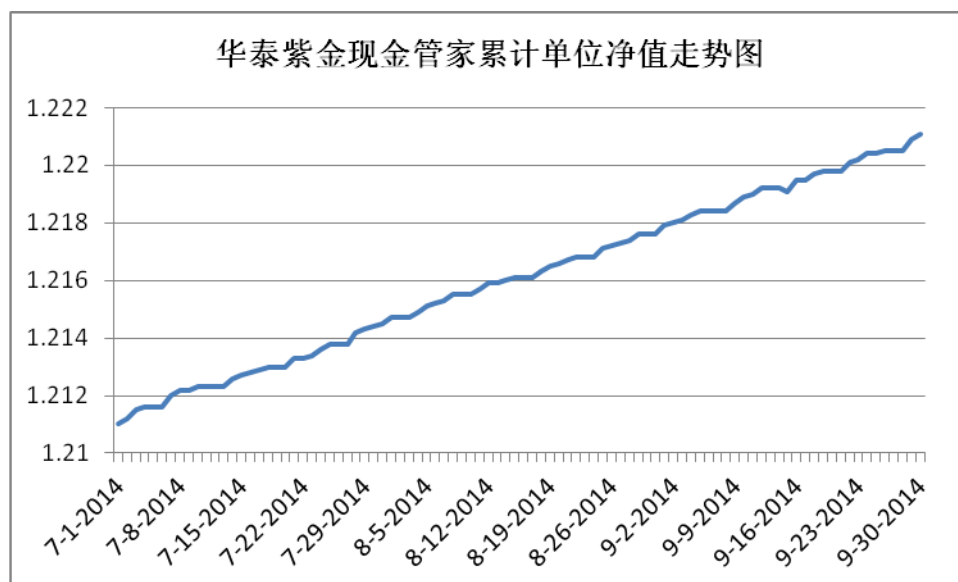
(2) 单位集合计划净值 = 期末集合计划净值 ÷ 期末集合计划份额

(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) 集合计划累计单位净值历史走势图

单位：人民币元



## 三、集合计划管理人报告

### (一) 业绩表现

截止到 2014 年 9 月 30 日，集合计划单位净值为 1.0651 元，本期净值增长率为 0.97%，集合计划单位累计净值为 1.2211 元，集合计划累计净值增长率为 22.11%。

### (二) 投资主办简介

刘娜，现任华泰紫金鼎步步为盈投资主办，6年证券从业经验，华东师范大学经济学硕士。2007年进入华泰证券，先后在固定收益部、资产管理总部从事债券承销和固定收益证券研究、投资工作，具有较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

三季度资金利率总体上较为宽松，期间1天和7天银行间质押式回购利率维持在偏低水平，仅在个别时点，新股申购会对资金利率尤其是交易所资金利率产生一定冲击。操作上，现金管家一方面继续做好流动性管理，保持一定的现金头寸，另一方面对到期资金进行续做，提高组合投资收益。

#### 2、投资管理展望

策略上，一是加强对银行间市场的流动性预判；二是关注新股发行对交易所资金利率的脉冲式影响；三是做好流动性管理；四是做好组合久期管理和仓位管理。在保证资金安全的前提下，为投资人提供较高的净值增长。

## 四、集合计划财务报告

### （一）集合计划会计报告书

#### 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	期 末 余 额	负 债 和 所 有 者 权 益	期 末 余 额
资 产：		负 债：	
银行存款	7,065,470.98	短期借款	
结算备付金	413,575.20	交易性金融负债	
存出保证金	20,266.14	衍生金融负债	
交易性金融资产	73,833,917.75	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	
债券投资	53,662,272.00	应付赎回款	63,911.89
资产支持证券投资		应付赎回费	
基金投资	20,171,645.75	应付管理人报酬	57,427.32
衍生金融资产		应付托管费	9,901.25
买入返售金融资产	26,500,000.00	应付销售服务费	
应收证券清算款		应付交易费用	1,872.95
应收利息	1,654,507.66	应付税费	
应收股利	38,290.02	应付利息	
应收申购款	6,774,937.49	应付利润	
其他资产		其他负债	
		负债合计	133,113.41
		所有者权益：	
		实收基金	109,063,659.25
		未分配利润	7,104,192.58
		所有者权益合计	116,167,851.83
资产合计：	116,300,965.24	负债与持有人权益总计：	116,300,965.24

## 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	1,351,895.40	4,950,519.96
1、利息收入	1,122,268.23	3,844,242.05
其中：存款利息收入	31,677.81	104,054.73
债券利息收入	853,369.31	3,202,283.24
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入	237,221.11	537,904.08
2、投资收益（损失以“-”填列）	223,851.17	1,031,061.91
其中：股票投资收益		
债券投资收益	-51,325.40	713,773.20
资产支持证券投资收益		
基金投资收益	275,176.57	317,288.71
权证投资收益		
衍生工具收益		
红利收入		
股利收益		
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	5,776.00	75,216.00
4、其他收入（损失以“-”填列）		
二、费用	217,121.54	712,968.00
1、管理人报酬	171,565.75	534,855.13
2、托管费	29,580.32	92,216.33
3、销售服务费		
4、交易费用	6,975.47	48,496.54
5、利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
6、其他费用	9,000.00	37,400.00
三、利润总额	1,134,773.86	4,237,551.96

## (二) 集合计划投资组合报告 (2014年9月30日)

### 1、资产组合情况

项目	期末市值（元）	占总资产比例
银行存款、清算备付金、存出保证金、清算款合计	7,499,312.32	6.45%
股票		
债券及资产证券化	53,662,272.00	46.14%
证券投资基金	20,171,645.75	17.34%
其他资产	34,967,735.17	30.07%
资产合计	116,300,965.24	100.00%

### 2、按市值占净值比例大小排序的前五名债券及资产证券化明细

序号	债券名称	期末市值（元）	占资产净值的比例
1	13 粤物资 CP002	10,008,000.00	8.62%
2	13 浙铁投 CP001	10,005,000.00	8.61%
3	14 中海运 SCP001	10,004,000.00	8.61%
4	14 申万 CP007	10,003,000.00	8.61%
5	14 长城证券 CP005	9,999,000.00	8.61%

### 3、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	广发货币 B	10,096,031.53	8.69%
2	海富通货币 B	10,075,614.22	8.67%
3			
4			
5			

### （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	期末总份额
113,141,973.75	60,605,881.36	64,684,195.86	109,063,659.25

### 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现金管家集合资产管理计划推广的文件
- 2、华泰紫金现金管家集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 3、华泰紫金现金管家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](http://www.htsc.com.cn)

信息披露电话：025-84579944

联系人：张小辉

EMAIL：[zijin@htsc.com.cn](mailto: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