

# 华泰紫金鼎造福桑梓子集合资产管理计划 2014年第四季度资产管理报告

## 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2015年1月19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10月1日-2014年12月31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（上海）资产管理有限公司

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10月1日-2014年12月31日
1	集合计划本期利润	5,244,803.39
2	加权平均计划份额本期利润	0.0863
3	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	5,687,301.76
4	本期单位集合计划净收益	0.0979
5	期末集合计划资产总值	67,337,605.12
6	期末集合计划资产净值	53,350,641.77
7	单位集合计划资产净值	0.9182
8	本期集合计划净值增长率	10.64%
9	集合计划累计净值增长率	-5.18%

## （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

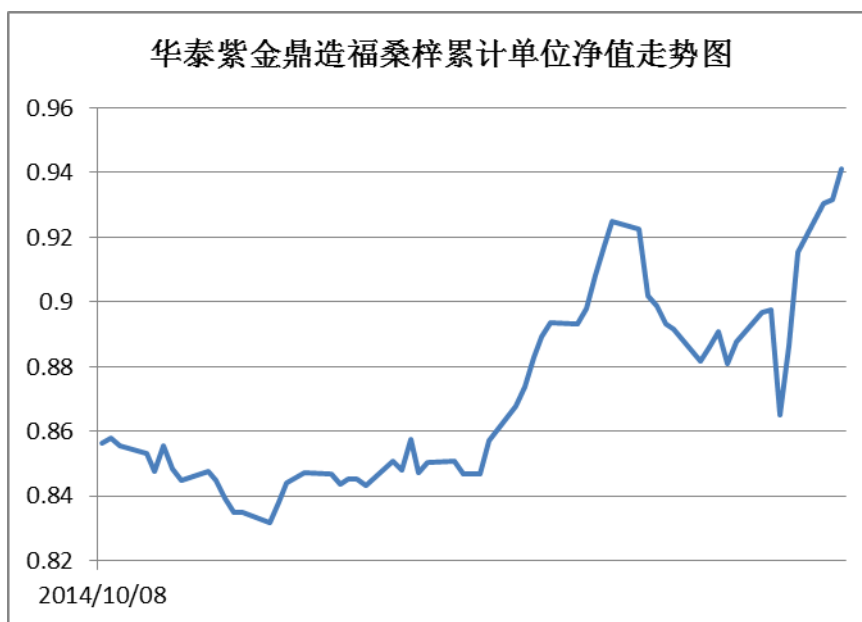
（2）单位集合计划净值 = 集合计划净值 ÷ 集合计划份额

（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年四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 12 月 31 日，集合计划单位净值为 0.9182 元，本期净值增长率为 10.64%，集合计划单位累计净值为 0.9482 元，集合计划累计净值增长率为-5.18%。

#### (二) 投资主办简介

谢江，香港中文大学运筹学博士、南开大学学士及硕士，现为华泰证券资产管理总部金融工程部总监，曾任联合证券首席产品设计师。曾多年从事金融工程研究卖方业务，连续多年获《新财富》最佳金融工程分析师第一名，国内量化选股、量化投资的先行者。2012 年进入华泰证券资产管理总部，拥有较丰富的投资研究经验。

#### (三) 投资主办工作报告

##### 1、投资策略回顾

造福桑梓集合计划 2014 年 4 季度收益率为 10.64%；截止 4 季度末单位净值为 0.9182 元；2014 年度收益率为 16.69%；

由于新股密集发行大量抽血叠加年末资金结算需求增加，资金面紧张局面延续，银行间 14 天回购利率一度大幅上涨至 9%左右，交易所 14 天回购利率更一度跳升至 13%以上。央行两次向银行提供短期流动性调节工具 (SLO)，并对部分到期的中期借贷便利 (MLF)进行了续作。近期下发的央行 387 号文将非银金融机构的同业存款纳入一般存款统计口径，但暂不缴纳存款准备金。在不降准的前提下，央行以创新的货币政策手段减轻银行贷存比压力，向实体经济输送信贷资源，疏导货币“堰

塞湖”。

## 2、投资管理展望

12 月份汇丰制造业 PMI 预览值在半年之后再次跌至 50%以下，制造业出现收缩。从指数构成方法计算来看，新订单指数大幅下滑是主因。而新订单指数与新出口订单指数的分化表明，12 月份出口出现反弹，而国内需求尤其是投资需求明显下降。PMI 产出指数回升 0.1 个百分点，出现边际改善，但原材料库存加速下降，采购意愿也没有出现好转。投入及产出价格指数表明，受原油价格大跌拖累，12 月 PPI 数据可能进一步下滑。我们对大势的判断不变，大类资产配置向股市迁移的脚步仍在进行中，这一点并没有发生变化，因此我们对市场依然持乐观态度。

### （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12月31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	19,022,241.72	短期借款	
结算备付金	657,976.34	交易性金融负债	
存出保证金	42,423.54	衍生金融负债	
交易性金融资产	47,611,907.05	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	25,224,706.16	应付证券清算款	13,627,300.97
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付赎回费	
基金投资	22,387,200.89	应付管理人报酬	52,328.04
衍生金融资产		应付托管费	10,901.68
买入返售金融资产		应付销售服务费	16,570.53
应收证券清算款		应付交易费用	279,862.13
应收利息	3,056.47	应付税费	
应收股利		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	13,986,963.35
		所有者权益：	
		实收基金	58,100,373.78
		未分配利润	-4,749,732.01
		所有者权益合计	53,350,641.77
<b>资产合计：</b>	<b>67,337,605.12</b>	<b>负债与持有人权益总计：</b>	<b>67,337,605.12</b>

## 2、集合计划经营业绩表(2014年10月1日至2014年12月31日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	6,028,853.18	10,702,460.71
1、利息收入	131,586.39	981,168.66
其中：存款利息收入	15,593.12	67,984.47

债券利息收入	97,836.72	518,358.99
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入	18,156.55	394,825.20
2、投资收益（损失以“-”填列）	6,339,765.16	8,830,762.50
其中：股票投资收益	5,221,031.96	7,006,902.92
债券投资收益	-48,025.69	-48,067.36
资产支持证券投资收益		
基金投资收益	1,134,207.44	1,320,181.07
权证投资收益		
衍生工具收益		
红利收入	32,551.45	374,445.87
股利收益		177,300.00
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-442,498.37	890,529.55
4、其他收入（损失以“-”填列）		
二、费用	784,049.79	2,116,628.51
1、管理人报酬	156,538.41	708,590.56
2、托管费	32,612.17	147,623.02
3、销售服务费	49,570.50	224,387.05
4、交易费用	542,181.33	1,010,096.38
5、利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
6、其他费用	3,147.38	25,931.50
三、利润总额	5,244,803.39	8,585,832.20

## （二）集合计划投资组合报告（2014年12月31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	19,722,641.60	29.29%
股票	25,224,706.16	37.46%
债券	0	0.00%
证券投资基金	22,387,200.89	33.25%
其他资产	3,056.47	0.00%
合计	67,337,605.12	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	广发证券	3,633,000.00	6.81%
2	华谊兄弟	3,428,100.00	6.43%
3	光大证券	3,424,800.00	6.42%
4	招商证券	3,392,400.00	6.36%
5	中国平安	2,988,400.00	5.60%
6	宝钢股份	1,794,910.50	3.36%
7	中国国航	1,568,000.00	2.94%
8	河北钢铁	1,532,000.00	2.87%
9	中体产业	1,401,675.66	2.63%
10	古井贡酒	739,000.00	1.39%

## 3、按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

本报告期末本集合计划未持有债券。

## 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	50ETF	4,083,200.00	7.65%
2	申万证券B	3,951,000.00	7.41%
3	券商分级B	3,343,192.50	6.27%
4	房地产B	3,033,000.00	5.69%
5	180ETF	2,891,700.00	5.42%

### (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
66,301,068.79	0.00	8,200,695.01	58,100,373.78

## 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(上海)资产管理有限公司。

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2015年1月22日

