

华泰紫金现金管家集合资产管理计划 2014 年 4 季度报告

产品管理人：华泰证券(上海)资产管理有限公司

产品托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2015 年 1 月 22 日

§ 1 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 2015 年 1 月 15 日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现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 10 月 1 日—2014 年 12 月 31 日

§ 2 产品概况

产品简称	现金管家
交易代码	940008
产品类型	货币型
产品合同生效日	2009 年 8 月 25 日
成立规模	5,255,429,228.84
存续期	8 年
产品管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司
产品托管人	交通银行股份有限公司

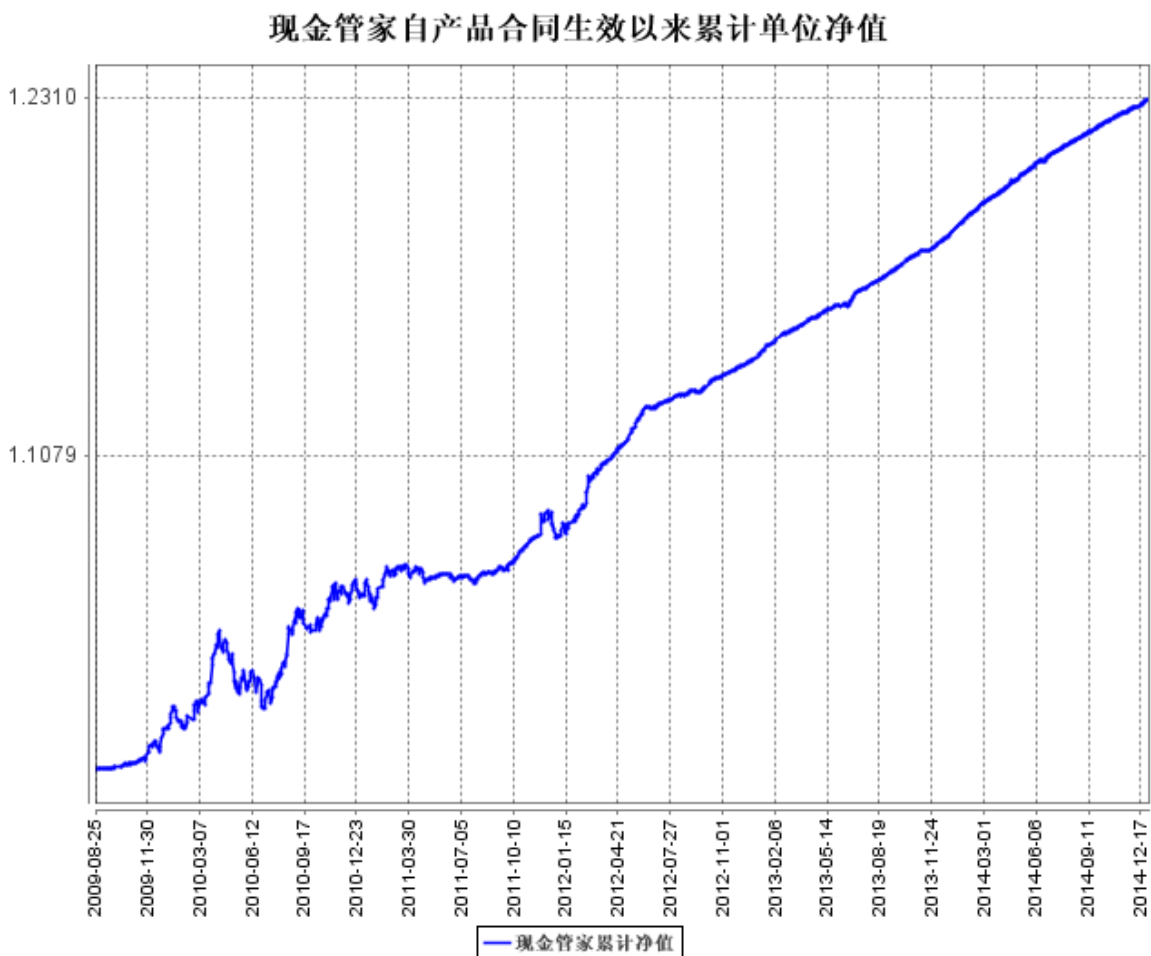
§ 3 主要财务指标和产品净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期
	(2014年10月1日 - 2014年12月31日)
1. 本期已实现收益	1,000,596.97
2. 本期利润	976,850.97
3. 单位资产净值	1.075
4. 期末资产总值	102,679,782.17
5. 期末资产净值	101,116,588.91
6. 本期产品份额净值增长率	0.89%

3.2 自产品合同生效以来累计单位净值历史走势图



§ 4 管理人报告

4.1 产品经理（或产品经理小组）简介

姓名	职务	任本产品的产品经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘娜	-	2013年3月5日	-	7	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、受托资产管理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。
--	--	--	--	--	--

4.2 合规风险控制报告

4.2.1 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。

4.2.2 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。

4.3 报告期内投资策略和运作分析

从资金利率情况来看，四季度前两个月资金继续维持宽松局面，进入12月份，受到新股冲击以及年末影响，资金利率尤其是跨年资金利率大幅上升，银质押1月和2月平均资金利率为6%和6.18%，较11月份资金利率大幅上升。操作上，现金管家主要以管理流动性为主，保持一定比例的现金头寸，其次对到期资金进行续做，提高组合投资收益。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

策略上，现金管家一是加强对银行间市场流动性的预判，动态把握资金利率结构性失衡过程中的投资机会，抓住资金利率上行阶段的配置时点，提高组合的再投资收益；二是做好流动性管理，在保证资金安全的前提下，为投资人提供较高的净值增长；三是做好组合久期管理和仓位管理。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末产品资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占产品总资产的比例（%）
1	银行存款、清算备付金、存出保证金、清算款合计	8,666,638.47	8.44
2	股票	-	-
3	债券及资产支持证券	25,007,500.00	24.35
4	证券投资基金	31,000,000.00	30.19
5	其他资产	38,005,643.70	37.01
6	合计	102,679,782.17	100.00

5.2 报告期末按公允价值占产品资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

5.3 报告期末按债券品种分类的债券及资产证券化投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占产品资产净值比例（%）
1	国家债券投资	-	-
2	可转换债券投资	-	-
3	其他债券	-	-
4	企业债券投资	25,007,500.00	24.73
5	资产证券化	-	-
6	债券及资产证券化投资合计	25,007,500.00	24.73

5.4 报告期末按公允价值占产品资产净值比例大小排序的前十名债券及资产证券化投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占产品资产净值比例（%）
1	011461004	14 五矿股 SCP004	100,000	10,000,000.00	9.89
2	041460068	14 惠天 CP001	100,000	9,995,000.00	9.88
3	122968	09 杭城投	50,000	5,012,500.00	4.96

5.5 报告期末按公允价值占产品资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	数量（张）	公允价值（元）	占产品资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	110006	易方达货币 A	8,000,000	8,000,000.00	7.91
2	482002	工银瑞信货 币	8,000,000	8,000,000.00	7.91
3	270014	广发货币B	8,000,000	8,000,000.00	7.91
4	288201	华夏货币B	7,000,000	7,000,000.00	6.92

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	109,063,659.25
报告期期间产品总申购份额	20,139,366.14
减：报告期期间产品总赎回份额	35,103,063.45
报告期期末产品份额总额	94,099,961.94

§ 7 备查文件目录

7.1 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

7.2 存放地点

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦806室

7.3 查阅方式

网址：www.htsc.com.cn

电话：95597

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

