

恒泰现金添利集合资产管理计划

2019 年 1 季度资产管理报告

重要提示

本报告依据《证券公司客户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》、《证券公司客户资产管理业务规范》及其他有关规定制作。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作集合资产管理计划资产，但不保证本集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。本集合计划面临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、管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险等，同时本集合计划还面临流动性风险、信用风险、销户强行全额退出风险、银行定期存款提前解付风险、估值偏差风险、操作风险、委托人认知风险、合同变更风险、电子合同运行风险等特有风险，请投资者仔细阅读本集合计划管理合同、说明书及风险揭示书等文件，对上述风险进行充分了解和认识。

托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本管理合同规定，于2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、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。

本报告期间：2019年1月1日至2019年3月31日。

本报告中财务资料未经审计。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

一、集合资产管理计划简介

(一) 基本资料

名称：恒泰现金添利集合资产管理计划

存续期：无固定存续期

成立份额总额：168,403,000.00份

管理人：恒泰证券股份有限公司

托管人：中国证券登记结算有限责任公司

成立日：2013年3月26日

(二) 投资目标和主要特点

1、投资目标：

优先考虑资金安全和流动性的基础上谋求适度收益。

2、主要特点：

本集合计划不影响委托人正常证券交易，提高委托人资金使用效率，充分利用闲置资金，获取相对较高收益。委托人一次签约，自动参与、退出计划，无需手工操作。本集合计划是基于客户交易结算账户留存资金及其波动特点，在充分考虑投资者资产安全性、流动性的前提下，为提高投资者资产收益率，实现投资者资产保值、增值的集合资产管理计划。

二、主要财务指标

主要财务指标

单位：元

主要财务指标	2019年1月1日—2019年3月31日
期末资产净值（元）	687,129,500.00
期末基金七日年化收益率	3.357%
期末每万份基金收益	0.8951

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至2019年3月31日，本集合计划七日年化收益率为3.357%。本报告期内本集合计划实施了3次收益分配。

(二) 投资经理简介

本报告期内恒泰现金添利集合资产管理计划自2018年2月1日起投资主办人变更为田野。

田野先生，恒泰证券资产管理部产品经理，金融学学士，2014年加入恒泰证券

资产管理部，具备5年以上资产管理经验。

(三)管理人对报告期内产品运作遵照守信情况的说明

本报告期内，本管理人严格遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》等有关法律法规，中国证监会和本集合计划合同的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，集合计划运作整体合法合规，没有损害集合计划份额持有人利益。集合计划的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及集合计划合同的规定。

(四)公平交易专项说明

本报告期内，本管理人严格遵循公平交易原则，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有产品和投资组合。

(五)投资经理工作报告

市场方面：3月债市波动加大，仍然主要受到股债联动影响，前期对降准降息的预期没有兑现，也是债市调整的一个主要原因。央行连续多日未进行公开市场操作，资金利率在税期快速走高，跨季之后下行至低位。隔夜加权利率维持在至 2.1%-2.3% 的水平

宏观方面：2月金融数据降温，票据规模增幅降低。1-2月经济数据仍然较弱，工业增速5.3%，固投6.1%，其中制造业下滑至5.9%，基建4.3%，地产11.6%。1-2月社零8.2%。3月PMI大幅超预期，3月以来的中高频数据也印证了PMI数据。从高频看，票据贴现有所反弹，居民中长期贷款也有所增加，地方专项债增加带动直接融资增加明显，预计金融数据不弱。外围方面，美联储停止加息，且预测今年停止加息，缩表进程预计提前结束，鸽派态度超出市场预期。

产品方面：本基金主要投资于同业存单以及高等级信用债，并于季末择机进行了同业存单和高等级信用债的投资配置。期限搭配以及杠杆水平合适，组合整体的流动性较好。



四、集合计划投资组合报告

(一) 资产组合情况

项目名称	项目成本(元)	占总资产比例(%)
银行存款	19,744,412.81	2.85%
其中: 活期存款	19,444,763.85	2.81%
协议活期存款	299,648.96	0.04%
存出保证金	69,074.79	0.01%
债券投资	495,249,687.42	71.53%
基金投资	22,696,601.19	3.28%
买入返售金融资产	143,810,846.91	20.77%
应收股利	190,273.37	0.03%
应收利息	10,642,244.82	1.54%
合计	692,403,141.31	100.00%

注: 1、因四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

(二) 按成本占资产比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	证券名称	数量	成本(元)	成本/资产
1	18 兖矿 CP002(总价)	500,000	50,005,385.98	7.22%
2	18 天津银行 CD228(总价)	500,000	49,845,932.28	7.20%
3	18 重庆银行 CD124(总价)	500,000	49,436,636.58	7.14%
4	18 郑州银行 CD104(总价)	500,000	49,423,135.58	7.14%
5	09 中交 G2(总价)	400,000	40,270,479.27	5.82%
6	16 福耀 01(总价)	300,000	29,922,149.02	4.32%
7	19 津城建 CP003(总价)	300,000	29,899,008.93	4.32%
8	10 华润电力 01(总价)	200,000	20,223,419.78	2.92%
9	14 京技投 MTN001(总价)	200,000	20,076,804.15	2.90%
10	14 鄂交投 MTN001(5 年期)(总价)	200,000	20,055,639.33	2.90%

(三)按市值占资产比例大小排序的前五名基金投资明细

序号	证券名称	数量	市值(元)	市值/资产
1	红塔红土人人宝货币B	10,255,127.37	10,255,127.37	1.48%
2	诺德货币B	10,234,873.26	10,234,873.26	1.48%
3	华夏货币A	766,499.17	766,499.17	0.11%
4	华夏收益宝货币A	723,778.62	723,778.62	0.10%
5	万家货币	503,778.21	503,778.21	0.07%

(四)资产组合报告附注:

1、本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

五、 集合计划份额变动

单位:份

期初份额总额	报告期间 总参与份额	报告期间 总退出份额	报告期末 份额总额
494,104,000.00	5,549,380,500.00	5,356,355,000.00	687,129,500.00

六、 信息披露的查阅方式

本集合计划备查文件均在我公司网站披露,投资者可登录查阅。

公司网址 www.cnht.com.cn

信息披露电话:4006609926

投资者对本报告书如有任何疑问,可咨询管理人恒泰证券股份有限公司。

