

央视 50 平衡集合资产管理计划季度报告

(2019 年第一季度)

第一节 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中国光大银行股份有限公司于2019年4月22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。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2019年1月1日至2019年3月31日。

第二节 集合资产管理计划概况

名称	央视50平衡集合资产管理计划
类型	开放式、非限定性、存续期十年
成立日	2012年9月27日
报告期末份额总额	12,332,858.48 份
投资目标	本集合计划主要采取恒定混合战略等资产配置策略,运用指数投资组合管理技术,在有效降低组合波动率的基础上,实现集合计划资产保值增值目标。
投资理念	在工业化和城镇化的推动下,中国经济在今后较长时期仍将保持较快增长态势,为资本市场的繁荣和发展奠定了坚实的基础。秉承被动投资理念,在资产配置和组合管理方面采用透明规则,能够有效克服人性弱点对投资绩效的负面影响。

投资基准	本集合计划的业绩比较基准为：60% × 央视财经 50 指数收益率+40% × 一年期存款基准利率。
管理人	银河金汇证券资产管理有限公司
托管人	中国光大银行股份有限公司
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司

第三节 集合资产管理计划主要财务指标和业绩表现及收益分配情况

一、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	2,382,346.92
净值增长率	15.30%
期末资产净值	17,750,823.11
期末每份额净值	1.439
期末每份额累计净值	1.654

二、业绩表现

截止 2019 年 3 月 31 日，本集合计划单位净值 1.439 元，累计单位净值 1.654 元，本期集合计划净值增长率 15.30%。

三、本期每份额增长率与投资基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① -③	② -④
2019 年 1 季度	15.30%	0.97%	15.75%	0.91%	-0.45%	0.06%

四、收益分配情况

本报告期末进行收益分配。

第四节 管理人报告

一、投资主办人简介

王宝娟，上海财经大学管理学硕士，复旦大学理学学士。曾任职德邦证券量化投资部、资产管理总部，从事量化策略交易、研究。2014年加入银河金汇，历任多只定向计划投资主办人，目前担任银河金星1号、银河木星1号、银河央视50平衡、银河智远1号、银河安心收益1号、银河安心收益2号等集合资产管理计划投资主办人。

二、投资主办人工作报告

本集合计划在报告期内收益率为15.38%，略低于基准。期间，权益仓位保持在60%-70%的水平。

一季度A股市场大幅反弹，主导因素包括：估值水平较低、流动性宽裕、中美贸易战缓和以及风险偏好提升等，但在全球主要经济体经济下滑的背景下，基本面风险仍存。4月份将迎来年报密集披露期，对于一些前期涨幅较大、预期过高、面临业绩考验的行业及个股，我们认为应保持谨慎；而业绩稳健的优质蓝筹，相对吸引力更高。

本集合计划持仓以蓝筹股为主，下一阶段，管理人将密切关注市场形势发展，择机调整仓位配置，以更灵活的应对市场变化。

三、管理人履职报告

在本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券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》等相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划。

报告期内，本集合计划管理人坚持规范运作、防范风险，保护投资者利益，严格执行银河金汇证券资产管理有限公司内部控制和 risk 管理制度，加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，严格履行本集合计划合同规定。

在报告期内，投资主办人按照资产管理投资决策委员会授权的范围进行投资，投资范围和投资比例符合产品说明书规定，无越权交易行为发生。管理人和

托管人按照各方约定的统一记账方法和会计处理原则，分别独立设置账套，每日核对资产净值，互相监督，以保证集合资产安全，保护投资者利益。

第五节 托管人报告

央视 50 平衡集合资产管理计划

(2019 年第 1 季度) 托管报告

本计划托管人—中国光大银行在托管央视 50 平衡集合资产管理计划的过程中，严格遵守各项法律法规，对央视 50 平衡集合资产管理计划管理人—银河金汇证券资产管理有限公司 2019 年 01 月 01 日-2019 年 03 月 31 日计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害计划份额持有人利益的行为。

计划管理人所编制和披露的《央视 50 平衡集合资产管理计划 2019 年第一季度资产管理报告》中的财务数据是真实、准确的。

中国光大银行 投资与托管业务部

2019 年 4 月 22 日

第六节 投资组合报告

一、资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占总资产比例
股票	12,374,380.11	69.38%
银行存款	972,561.81	5.45%
基金	4,483,722.94	25.14%
其他资产	4,729.42	0.03%
合计	17,835,394.28	100.00%

(注： 1. 其他资产包括：结算备付金、存出保证金、应收利息；
2. 因四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。)

二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值
1	601318	中国平安	10,220	787,962.00	4.44%
2	600519	贵州茅台	897	766,029.03	4.32%
3	002415	海康威视	21,495	753,829.65	4.25%
4	600887	伊利股份	25,738	749,233.18	4.22%
5	601166	兴业银行	39,400	715,898.00	4.03%
6	000651	格力电器	12,324	581,816.04	3.28%
7	000333	美的集团	11,852	577,547.96	3.25%
8	002230	科大讯飞	14,413	523,047.77	2.95%
9	600016	民生银行	76,284	483,640.56	2.72%
10	000002	万科A	14,100	433,152.00	2.44%

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

本集合计划报告期末未持有债券。

四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值
1	511990	华宝添益	4,699.00	469,801.32	2.65%
2	169106	东证创优	24,968.00	25,017.94	0.14%
3	000662	银华活钱宝	1,065,307.15	1,065,307.15	6.00%
4	001666	鹏华添利宝	1,022,424.55	1,022,424.55	5.76%
5	003474	南方天天利 B	1,901,171.98	1,901,171.98	10.71%

五、期末市值占集合计划资产净值前十名买入返售金融资产明细

本集合计划报告期末未持有返售金融资产。

六、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

本集合计划报告期末未持有权证。

七、投资组合报告附注

无。

第七节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	12,431,867.48
报告期间总参与份额	0
红利再投资份额	0
报告期间总退出份额	99,009.00
报告期末份额总额	12,332,858.48

第八节 重要事项提示

管理人于2019年2月1日在公司网站公告《关于银河央视50平衡集合资产管理计划投资主办人变更的公告》，因内部工作调整的原因，经我司研究决定，将我司管理的“银河央视50平衡集合资产管理计划”的投资主办人，由王跃文先生、徐杰先生，变更为王跃文先生、王宝娟女士。前述变更自2019年1月25日起实施。

管理人于2019年3月18日在公司网站公告《关于银河央视50平衡集合资产管理计划投资主办人变更的公告》，因内部工作调整的原因，经我司研究决定，将我司管理的“银河央视50平衡集合资产管理计划”的投资主办人，由王跃文先生、王宝娟女士，变更为王宝娟女士。前述变更自2019年3月18日起实施。

第九节 信息披露的查阅方式

网址：<http://yhjh.chinastock.com.cn/>

热线电话：4008-888-888

银河金汇证券资产管理有限公司

二〇一九年四月三十日