

# 央视 50 平衡集合资产管理计划季度报告

(2019 年第三季度)

## 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10月23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7月1日至2019年9月30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 | 12,045,646.09 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      | 307,819.80    |
| 净值增长率     | 1.83%         |
| 期末资产净值    | 17,380,450.70 |
| 期末每份额净值   | 1.443         |
| 期末每份额累计净值 | 1.658         |

#### 二、业绩表现

截止 2019 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值 1.443 元，累计单位净值 1.658 元，本期集合计划净值增长率 1.83%。

#### 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 3 季度 | 1.83%  | 0.48%     | 1.05%      | 0.52%         | 0.78% | -0.04% |

#### 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

三季度A股市场保持震荡走势，在略显疲弱的经济数据和转向宽松的流动性环境之间反复磨底。本集合计划在报告期内股票组合仓位约为52%，继续建仓了部分场内折价基金，包括战略配售基金、鹏华前海以及具备权益属性的分级A等。合计权益仓位略高于60%。本报告期收益率为1.83%，跑赢了业绩基准。

### 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 年第三季度) 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 07 月 01 日- 2019 年 09 月 30 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 年第三季度资产管理报告》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 10 月 23 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      | 9,062,808.28  | 51.88%  |
| 银行存款    | 385,927.97    | 2.21%   |
| 基金      | 5,321,371.91  | 30.46%  |
| 应收证券清算款 | 2,500,608.22  | 14.32%  |
| 其他资产    | 197,608.22    | 1.13%   |
| 合计      | 17,468,324.60 | 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  | 600519 | 贵州茅台 | 697    | 801,550.00 | 4.61% |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 7,420  | 645,836.80 | 3.72% |
| 3  | 600887 | 伊利股份 | 18,738 | 534,407.76 | 3.07% |

|    |        |      |        |            |       |
|----|--------|------|--------|------------|-------|
| 4  | 000651 | 格力电器 | 8,924  | 511,345.20 | 2.94% |
| 5  | 002415 | 海康威视 | 15,495 | 500,488.50 | 2.88% |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 28,400 | 497,852.00 | 2.86% |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 8,652  | 442,117.20 | 2.54% |
| 8  | 002230 | 科大讯飞 | 10,413 | 331,758.18 | 1.91% |
| 9  | 600016 | 民生银行 | 54,984 | 331,003.68 | 1.90% |
| 10 | 300136 | 信维通信 | 8,500  | 304,300.00 | 1.75% |

### 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  | 003474 | 南方天天利 B | 1,419,104    | 1,419,103.56 | 8.16% |
| 2  | 001328 | 鹏华弘华 C  | 1,096,598.24 | 1,114,801.77 | 6.41% |
| 3  | 000662 | 银华活钱宝   | 1,077,599    | 1,077,599.02 | 6.20% |
| 4  | 519951 | 长信利泰    | 856,894      | 1,071,716.86 | 6.17% |
| 5  | 184801 | 鹏华前海    | 2,600        | 250,247.40   | 1.44% |
| 6  | 150022 | 深成指 A   | 130,000      | 105,950.00   | 0.61% |
| 7  | 501189 | 嘉实配售    | 90,000       | 91,440.00    | 0.53% |
| 8  | 161131 | 易基配售    | 40,000       | 41,480.00    | 0.24% |
| 9  | 161728 | 招商配售    | 40,000       | 41,280.00    | 0.24% |
| 10 | 160142 | 南方配售    | 30,000       | 31,350.00    | 0.18% |

### 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买入返售资产。

### 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    | 12,114,914.38 |
| 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 | 69,268.29     |

|          |               |
|----------|---------------|
| 报告期末份额总额 | 12,045,646.09 |
|----------|---------------|

## 第八节 重要事项提示

无。

## 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

二〇一九年十月二十五日