

# 央视 50 平衡集合资产管理计划季度报告

(2019 年第四季度)

## 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2020年1月21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10月1日至2019年12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	11,222,877.49 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	905,395.62
净值增长率	5.47%
期末资产净值	17,075,657.73
期末每份额净值	1.522
期末每份额累计净值	1.737

#### 二、业绩表现

截止 2019 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.522 元，累计单位净值 1.737 元，本期集合计划净值增长率 5.47%。

#### 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 4 季度	5.47%	0.38%	5.45%	0.36%	0.02%	0.02%

#### 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股市场整体震荡上行，部分白马股三季报业绩不达预期，引发剧烈的估值调整，12月份在业绩空窗期、内外环境温和、流动性宽裕、对春季躁动行情的憧憬等因素影响下，风险偏好明显提升，指数大幅上行，结构方面科技和周期表现更好。本集合计划在报告期内股票组合仓位约为67%，此外持有了17%的基金，包括混合型基金、分级A、战略配售基金以及鹏华前海等，作为固收部分的替代。本报告期收益率为5.47%，略高于业绩基准。

### 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年第四季度) 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10月1日—2019年12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年第四季度资产管理报告》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  
2020年1月21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	11,455,907.51	66.48%
银行存款	2,747,838.10	15.95%
基金	2,947,498.27	17.11%
其他资产	79,792.30	0.46%
合计	17,231,036.18	100.00%

(注: 1. 其他资产包括: 结算备付金、存出保证金、应收利息、债券投资;  
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	600036	招商银行	19,900	747,842.00	4.38%
2	600519	贵州茅台	597	706,251.00	4.14%
3	601166	兴业银行	29,900	592,020.00	3.47%
4	000651	格力电器	8,924	585,235.92	3.43%
5	600887	伊利股份	18,038	558,095.72	3.27%

6	601318	中国平安	6,520	557,199.20	3.26%
7	002415	海康威视	16,595	543,320.30	3.18%
8	600016	民生银行	72,584	458,005.04	2.68%
9	300136	信维通信	9,600	435,648.00	2.55%
10	600276	恒瑞医药	4,300	376,336.00	2.20%

### 三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值
1	010107	21 国债(7)	230	23,632.50	0.14%
2	110059	浦发转债	30	3,276.90	0.02%

### 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	001328	鹏华弘华 C	1,096,598.24	1,183,997.12	6.93%
2	519951	长信利泰	856,893.63	1,111,819.48	6.51%
3	184801	鹏华前海	2,600	253,107.40	1.48%
4	150022	深成指 A	130,000	114,140.00	0.67%
5	501189	嘉实配售	90,000	93,330.00	0.55%
6	161131	易基配售	40,000	42,040.00	0.25%
7	161728	招商配售	40,000	41,720.00	0.24%
8	160142	南方配售	30,000	31,800.00	0.19%
9	501186	华夏配售	27,000	28,188.00	0.17%
10	169106	东证创优	24,968	26,316.27	0.15%

### 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	12,045,646.09
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	822,768.60
报告期末份额总额	11,222,877.49

## 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

二〇二零年一月二十三日