

华泰紫金鼎造福桑梓集合资产管理计划 2019 年第 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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2020 年 1 月 21 日



§ 1 重要提示

本报告依据相关法律法规、中国证监会相关规定制定。

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。

托管人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。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。

§ 2 产品概况

2.1 基本信息

产品简称	华泰紫金鼎造福桑梓
产品类型	混合型
资管新规分类	混合类
产品合同生效日	2008年10月27日
成立规模	241,288,201.23
存续期	无固定存续期
产品管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司
产品托管人	中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和产品净值表现

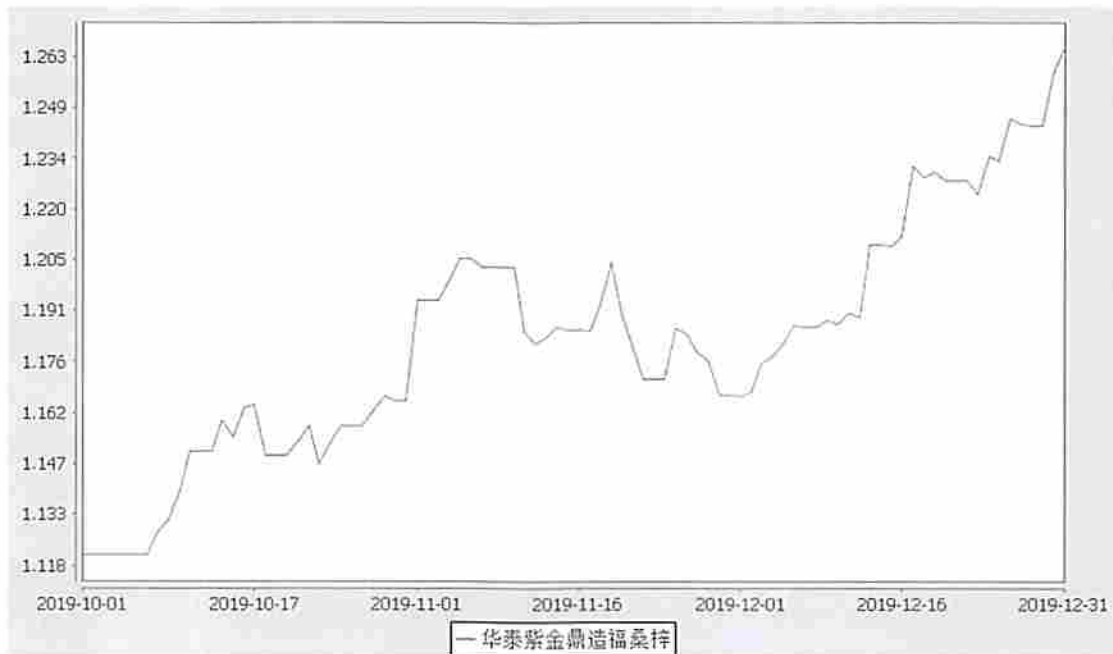
3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2019年10月01日 - 2019年12月31日)
1. 本期已实现收益	636,302.57

2. 本期利润	1,451,471.26
3. 单位资产净值	1.2361
4. 期末资产总值	12,130,739.00
5. 期末资产净值	11,698,880.37
6. 本期产品份额净值增长率	13.27%

3.2 本期累计单位净值走势图



§ 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		
俞天甲	投资经理	2017-04-10	-	9	浙江大学理学学士，悉尼大学经济学硕士。曾担任财通证券、日信证券家电、零售行业研究员，尚雅投资高级研究员，以及Pinpoint基金经理助理职务。现任华泰证券（上海）资

					产管理公司投资 经理。
--	--	--	--	--	----------------

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》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》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风控部日常监控、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相关投资部门内控和合规风控部外部监控来进行。合规风控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；本集合计划管理人通过投资交易制度、评审及交易系统设置进行事前、事中控制，并定期进行事后核查，对可能存在异常的交易进行排查，报告期末未发现存在内幕交易、利益输送、操纵市场的情形；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

2019年第四季度，内部经济环境逐步转暖，外部环境温和。A股指数继续温和上涨。我们保持高仓位操作，继续持有消费、医药、科技、金融行业，并加仓周期成长。精选优秀公司。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2020年一季度，市场已经全面预期经济回暖，外部温和。宏观经济已经企稳。我们认为A股市场将迎来温和上涨的行情。我们继续精选消费、医药、金融、科技领域的优秀公司，长期持有。目前主流公司估值较低，具备长期价值。同时会注重对周期成长股的配置。规避现金流差，资产负债率高的公司。

§ 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	1,260,806.43	10.39
2	股票	10,869,712.06	89.60
3	债券及资产支持证券	-	-
4	证券投资基金	-	-
5	其他资产	220.51	0.01
6	合计	12,130,739.00	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）	占产品资产净值比例（%）
1	600036 SH	招商银行	26,200.00	984,596.00	8.42
2	000333 SZ	美的集团	15,648.00	911,496.00	7.79
3	601398 SH	工商银行	148,300.00	872,004.00	7.45
4	000002 SZ	万科A	25,567.00	822,746.06	7.03
5	603816 SH	顾家家居	16,600.00	759,118.00	6.49
6	000651 SZ	格力电器	11,200.00	734,496.00	6.28
7	000568 SZ	泸州老窖	6,400.00	554,752.00	4.74
8	002831 SZ	裕同科技	20,600.00	546,930.00	4.68
9	601899 SH	紫金矿业	118,000.00	541,620.00	4.63
10	600176 SH	中国巨石	45,300.00	493,770.00	4.22

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

无。

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

无。

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

无。

5.6 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其他资产投资明细

序号	其他名称	公允价值（元）	占产品资产净值比例（%）
1	应收利息	220.51	-

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	11,680,992.67
报告期期间产品总申购份额	-
减：报告期期间产品总赎回份额	2,216,810.91
报告期期末产品份额总额	9,464,181.76

§ 7 风险揭示

本产品主要投资于在中国大陆上市交易的股票，主要面临以下风险：

一、系统风险

系统风险即通常所说的市场风险，指本产品所投资的股票因受经济因素、政治因素、投资心理、交易制度等多种因素影响而引起的价格波动，导致收益水平变化，产生风险。主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响本产品所投资的金融工具挂钩标的价格而产生风险。

2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受其影响，挂钩金融资产收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使本产品所投资金融工具挂钩证券收益水平随之发生变化，从而产生风险。另一方面，利率水平的变化也会影响金融衍生品、商品期货等的估值水平。

4、流动性风险

委托资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险按照其来源可以分为两类：

1) 市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对委托资产造成不利影响。

2) 证券市场中流动性不均匀，存在个股流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个股的流动性可能仍然比较差，从而在进行个股操作时，可能难以买入和卖出预期的数量，或买入卖出行为对个股价格产生比较大的影响，增加个股的建仓成本或变现成本。

5. 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本产品的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险，但是受汇率波动影响，人民币价值会有一定波动，投资者实际收益可能因此受到影响。

二、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受到多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都影响企业盈利水平。若本产品所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使产品投资收益下降或亏损。本产品虽可通过投资多样化来分散这种非系统风险，但无法完全规避。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、华泰紫金鼎造福桑梓集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 2、华泰紫金鼎造福桑梓集合资产管理计划托管协议
- 3、管理人业务资格批复、营业执照

8.2 存放地点与查阅方式

地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场 1 号楼 5 层

网址：<http://htamc.htsc.com.cn>

电话：4008895597

EMAIL: htam_report@htsc.com

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

2020年1月21日

