

华泰紫金货币增强集合资产管理计划 2021 年年度报告

产品管理人:华泰证券(上海)资产管理有限公司

产品托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年3月31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。托管人已复核了本报告。本报告已经审计。

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	华泰紫金货币增强
产品类型	货币型
资管新规分类	固定收益类
产品合同生效日	2013年5月29日
成立规模	173,959,138.08
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	招商银行股份有限公司

2.2 管理人

2.2.1 基本情况

名称	华泰证券（上海）资产管理有限公司
地址	中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室
法定代表人	崔春
成立时间	2014-10-16
注册资本	2,600,000,000.00

2.2.2 发展状况

华泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年10月16日，注册资本26亿元，是华泰证券股份有限公司的全资子公司。公司前身为华泰证券股份有限公司资产管理总部，早

在 1999 年开始从事资产管理业务。截至 2021 年 12 月末，公司资产管理总规模 5,185.72 亿元。2021 年本公司累计实现营业收入 23.57 亿元，营业利润 16.90 亿元，净利润 12.74 亿元，年末公司净资产 95.46 亿元。中国证券投资基金业协会发布的统计数据显示，2021 年 4 季度公司私募资产管理月均规模排名第八；中国证券监督管理委员会 CISP 机构监管综合信息系统发布的统计数据显示，截至 2021 年末，公司客户资管业务本年累计净收入行业排名第三。一年来，公司在监管环境趋严、行业增速放缓、市场竞争加剧的多重挑战下，主动收缩通道业务规模，各业务领域均取得一定突破，市场地位名列前茅，品牌效应持续提升。

2.3 托管人

名称	招商银行股份有限公司
地址	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人	缪建民

2.4 会计师事务所简介

名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
地址	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
合伙人	张楠
电话	01085085000
传真	01085185111

§ 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
	(2021 年 01 月 01 日 - 2021 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	315,745,999.73
2. 本期利润	315,745,999.73
3. 期末资产总值	7,955,375,754.97
4. 期末资产净值	7,800,968,374.63

3.2 本期七天年化收益率走势图



§ 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		
李云增	投资经理	2019-02-13	2021-04-19	12	厦门大学经济学硕士、理学学士，多年证券从业经历。2011年加入华泰证券，2015年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司。具备丰富的产品研发和投研经验。
赵骥	投资经理	2021-04-19	-	5	2007至2010年供职于广发银行金融市场部，2010年至2015年供职于招商银行资产负债管理部负责司库投融资管理，

					2015年至2020年供职于第一创业证券资产管理部。2020年5月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,从事固定收益产品投资管理工作,2021年7月起陆续担任华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金天天货币市场基金等基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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风险管理部日常监控、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风险管理部外部监控来进行。风险管理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。

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,存在被动超标情况,均已按法规和合同的要求调整,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

2021 年经济呈现先高后低，各季度 GDP 同比分别为 18.3%、7.9%、4.9% 和 4.0%。经济上半年在出口高景气度，工业生产较强和强势地产的拉动下经济逐步复苏，但消费表现仍然不佳，疫情仍然在产生持续且深远的影响。下半年受能耗双控、疫情扩散、洪涝台风等影响，供需双弱，仅出口依旧维持较高景气度，同时地产行业信用风险集中爆发，行业融资与销售均表现较差，下半年经济下滑压力加大。流动性方面，全年 DR001 和 DR007 均值分别为 1.95% 和 2.17%，其中 DR007 围绕政策利率 2.2% 附近波动。2021 年 7 月和 12 月两次降准各 0.5 个百分点，合计释放长期资金 2.2 万亿元，2022 年 1 月央行下调 MLF 利率 10 个基点至 2.85%，流动性合理充裕，货币政策偏宽松。组合整体配置品种存单和存款，坚持流动性管理为主要目标，做好各类资产的流动性和收益率比价分析。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，从海外来看，中国与美国经济周期出现明显分化，一是去年中国经济领先于美国复苏，因此货币政策、财政政策均有所前置。二是在价格要素方面，中国更多是治“滞”，美国治“胀”。政府工作报告基本符合预期，22 年稳增长成为明确主线，虽然财政政策更为积极，对债市形成利空压力，但宽松货币政策短期内仍需保驾护航。未来主要关注财政效果、房地产能否企稳、防疫政策变化以及货币政策四点。稳经济宽信用的方向明朗，宽信用前期需要宽货币来配合，货币政策观察期或持续较长时间；财政在基建等方面会发力，以部分对冲房地产投资下滑的影响；金融监管方面，预计前期过紧的房地产监管政策可能会有一定的放松。组合策略方面，将耐心等待机会，择时进行资产配置，平衡产品流动性和收益率。

§ 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	437,057,828.20	5.49
2	股票	-	-
3	债券及资产支持证券	6,911,335,357.78	86.88
4	证券投资基金	-	-
5	衍生金融资产	-	-
6	其他资产	606,982,568.99	7.63
7	合计	7,955,375,754.97	100.00

5.2 报告期末按摊余成本占产品资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

截止本报告期期末，本计划未持有股票资产。

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

序号	债券品种	摊余成本（元）	占产品资产净值比例（%）
1	国家债券投资	648,399,137.65	8.31
2	可转换债券投资	-	-
3	其他债券	6,047,206,612.89	77.52
4	企业债券投资	-	-
5	资产证券化	215,729,607.24	2.77
6	债券及资产证券化投资合计	6,911,335,357.78	88.60

5.4 报告期末按摊余成本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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	摊余成本（元）	占产品资产净值比例（%）
1	112109106 IB	21 浦发银行 CD106	3,000,000.00	298,271,714.06	3.82
2	112198361 IB	21 苏州银行 CD140	3,000,000.00	297,253,890.10	3.81
3	149655 SZ	21 申证 D2	2,500,000.00	250,000,000.00	3.20
4	219958 IB	21 贴现国债 58	2,500,000.00	249,097,397.08	3.19
5	112108052 IB	21 中信银行 CD052	2,500,000.00	248,538,558.13	3.19
6	072110050 IB	21 广发证券 CP008	2,000,000.00	199,996,024.56	2.56
7	012103796 IB	21 南航股 SCP028	2,000,000.00	199,934,355.12	2.56
8	200002 IB	20 付息国债 02	2,000,000.00	199,896,217.11	2.56
9	112112032 IB	21 北京银行 CD032	2,000,000.00	198,956,532.83	2.55
10	112189531 IB	21 宁波银行 CD264	2,000,000.00	198,933,522.01	2.55

5.5 报告期末按摊余成本占产品资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

截止本报告期期末，本计划未持有基金资产。

5.6 报告期末按摊余成本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	摊余成本（元）	占产品资产净值比例（%）
1	204028	350,000,000.00	4.49
2	204007	101,000,000.00	1.29
3	204001	50,000,000.00	0.64
4	204003	50,000,000.00	0.64
5	应收利息	31,982,568.99	0.41
6	204004	24,000,000.00	0.31

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	15,723,278,746.05
报告期期间产品总申购份额	44,218,294,510.26
减：报告期期间产品总赎回份额	52,140,604,881.68
报告期期末产品份额总额	7,800,968,374.63

§ 7 风险揭示

本产品在日常经营活动中面临所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的市场风险，包括利率风险、汇率风险和其他价格变动风险等：

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本产品主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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。

债券价格波动风险是指在二级市场交易的债券价格受利率变动、市场资金面供给变动、投资者预期和风险偏好变动、债券发行主体特定风险等因素影响而发生不利变动的风险。

另外，本产品所持有的债券等金融工具的公允价值或未来现金流量也会因利率和外汇汇率以外的市场价格因素而发生波动，具有一定的风险。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、华泰紫金货币增强集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 2、华泰紫金货币增强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
2022年3月31日