

华泰紫金 2 号集合资产管理计划 2014 年第三季度资产管理报告

重要提示

本报告依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称《集合细则》）及其他有关规定制作。

中国证监会对“华泰紫金 2 号”集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具批准文件（文号：证监机构字〔2006〕121 号）和延长存续期的批复（文号：证监许可〔2011〕1102 号），但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。

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。

托管人已于 2014 年 10 月 20 日复核了本报告。本报告未经审计。

管理人、托管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。

本报告期起止时间：2014 年 7 月 1 日 - 2014 年 9 月 30 日

一、集合计划简介

名称：华泰紫金 2 号集合资产管理计划

类型： FOF 型

管理人：华泰证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

成立日：2006 年 8 月 7 日

成立规模：2,110,279,343.53 份

存续期：无固定存续期

二、主要财务指标

（一）主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2014 年 7 月 1 日 - 2014 年 9 月 30 日
1	集合计划本期利润	32,716,382.11
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	17,192,489.11
3	单位集合计划净收益	0.0585
4	期末集合计划资产总值	289,373,733.78
5	期末基金资产净值	288,530,303.73
6	单位集合计划资产净值	0.9821
7	本期集合计划净值增长率	12.39%
8	集合计划累计净值增长率	111.41%

（二）财务指标的计算公式

(1) 单位集合计划净收益 = 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 ÷ 集合计划份额

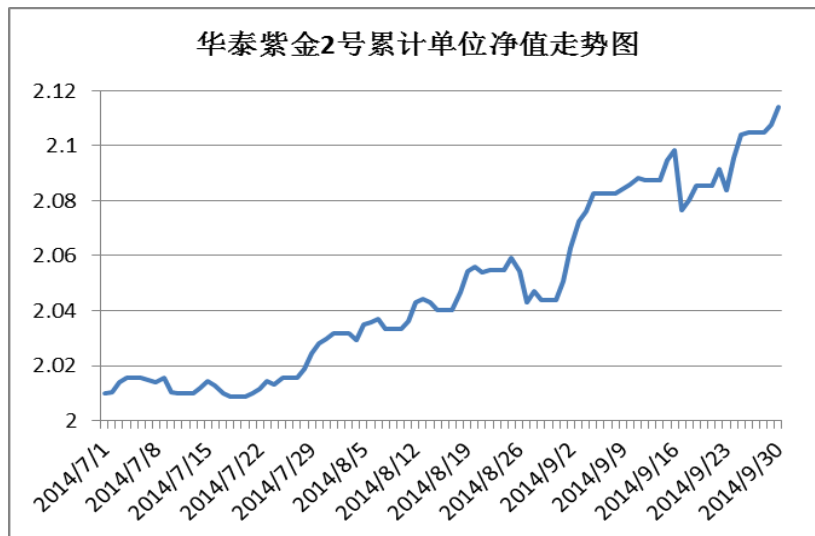
(2) 单位集合计划净值 = 集合计划净值 ÷ 集合计划份额

(3) 本期集合计划净值增长率 = [期末单位净值 / (分红除权前单位净值 - 单位分红金额) * 分红除权前单位净值 / 期初单位净值 - 1] × 100 %

(4) 集合计划累计净值增长率 = (单位集合计划资产累计净值 - 1) × 100 %

(三) 集合计划累计净值历史走势图

单位：人民币元



三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截止到 2014 年 9 月 30 日集合计划单位净值为 0.9821 元，本期

净值增长率为 12.39%，集合计划单位累计净值为 2.1141 元，集合计划累计净值增长率为 111.41%。

(二) 投资主办简介

王婧，澳洲国立大学市场研究学和美国圣约瑟夫大学金融学双硕士。2009 年入职法国安盛集团长岛分部从事基金研究工作，2010 年入职华泰证券，先后从事医药行业研究、定向主办助理、定向账户主办和集合产品主办助理工作，具有较丰富的投资管理经验。

(三) 投资主办工作报告

1、投资策略回顾

在央行定向宽松和经济反复寻底的双重影响下，三季度沪深 300 指数震荡上行，季度涨幅为 13.2%，本集合计划跑输沪深 300 指数 0.81%。考虑到今年新股发行数量低于市场预期，缓解了成长股的流动性压力，本集合计划持仓由二线蓝筹向成长股转换，同时降低了债券类基金的仓位。

2、投资管理展望

短期来看，在定向宽松的大背景下四季度经济数据企稳为大概率事件；长期来看，经济寻底压制了 A 股估值。我们对市场短线乐观，中线保持谨慎。在操作上，做好波段操作，争取绝对收益；股票类基金的配置以成长类为主。

四、集合计划财务报告

(一) 集合计划会计报告书

1、集合计划资产负债表 (2014 年 9 月 30 日)

单位:人民币元

资 产	期 末 余 额	负 债 和 所 有 者 权 益	期 末 余 额
资 产 :		负 债:	
银行存款	29,097,684.46	短期借款	
结算备付金	262,369.42	交易性金融负债	
存出保证金	115,889.06	衍生金融负债	
交易性金融资产	259,883,809.11	卖出回购金融资产款	
其中: 股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	454,751.41
资产支持证券投资		应付赎回费	516.75
基金投资	259,883,809.11	应付管理人报酬	256,047.86
衍生金融资产		应付托管费	46,554.15
买入返售金融资产		应付销售服务费	
应收证券清算款		应付交易费用	85,559.88
应收利息	13,981.73	应付税费	
应收股利		应付利息	
应收申购款		应付利润	
其他资产		其他负债	
		负债合计	843,430.05
		所有者权益:	
		实收基金	293,803,112.97
		未分配利润	-5,272,809.24
		所有者权益合计	288,530,303.73
资产合计:	289,373,733.78	负债与持有人权益总计:	289,373,733.78

2、集合计划经营业绩表 (2014 年 7 月 1 日至 2014 年 9 月 30 日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	35,626,606.42	41,168,114.83
1、利息收入	158,745.04	1,270,435.74
其中：存款利息收入	158,745.04	792,978.60
债券利息收入	0	0
资产支持证券利息收入	0	0
买入返售金融资产收入	0	477,457.14
2、投资收益（损失以“-”填列）	19,943,968.38	22,862,816.31
其中：股票投资收益	0	0
债券投资收益	0	0
资产支持证券投资收益	0	0
基金投资收益	19,943,968.38	22,862,816.31
权证投资收益	0	0
衍生工具收益	0	0
股利收益	0	0
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	15,523,893.00	17,032,352.78
4、其他收入（损失以“-”填列）	0	2,510.00
二、费用	2,910,224.31	6,931,621.60
1、管理人报酬	774,584.59	2,550,216.60
2、托管费	140,833.52	463,675.62
3、销售服务费	0	0
4、交易费用	1,987,771.91	3,886,494.13
5、利息支出	0	0
其中：卖出回购金融资产支出	0	0
6、其他费用	7,034.29	31,235.25
三、利润总额	32,716,382.11	34,236,493.23

(二) 集合计划投资组合报告 (2014年9月30日)

1、资产组合情况

项目	期末市值（元）	占总资产比例
银行存款、清算备付金、存出保证金、清算款合计	29,475,942.94	10.19%
股票	0	0.00%
债券及资产证券化	0	0.00%
证券投资基金	259,883,809.11	89.81%
其他资产	13,981.73	0.00%
资产合计	289,373,733.78	100.00%

2、按市值占净值比例大小排序的前十名证券投资基金明细

序号	名称	期末数量（份）	期末市值(元)	占资产净值的比例
1	宝盈泛沿海区域增长	40,634,944.98	22,714,934.24	7.87%
2	长盛航天海工	11,782,951.74	15,353,186.12	5.32%
3	华商大盘量化	9,328,522.48	14,477,866.89	5.02%
4	华商价值精选	8,835,787.92	13,721,978.64	4.76%
5	泰信中小盘	8,718,524.47	13,191,127.52	4.57%
6	国投瑞银策略精选混合	11,287,864.53	13,172,937.91	4.57%
7	华宝医药生物	9,730,031.10	12,853,371.08	4.45%
8	180ETF	6,000,000.00	12,840,000.00	4.45%
9	长盛电子信息产业	8,817,044.72	12,335,045.56	4.28%
10	浦银价值	8,381,391.45	11,432,217.94	3.96%

（三）集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总额
321,060,243.96	8,175,455.24	35,432,586.23	293,803,112.97

（四）说明

集合计划租用交易单元所支付的佣金严格按照计划说明书及有关文件的规定执行。

五、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会批准华泰紫金 2 号集合资产管理计划推广的文件
- 2、中国证监会核准华泰紫金 2 号集合资产管理计划延长存续期的批复。
- 3、华泰紫金 2 号集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 4、华泰紫金 2 号集合资产管理计划托管协议
- 5、管理人业务资格批件、营业执照

（二）存放地点及查阅方式

查阅地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 806 室

网址：www.htsc.com.cn

信息披露电话：025-84579944

联系人：张小辉

EMAIL: zijin@htsc.com.cn

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人华泰证券股份有限公司。

华泰证券股份有限公司

2014 年 10 月 27 日