华泰紫金 3 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 3 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[2007]36 号）及核准变更资产管理合同重要条款及延长存续期的批复（文号：证监许可[2012]321 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 3 号集合资产管理计划

类型： 偏股型

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：2007 年 3 月 6 日

成立规模：3,479,216,636.16 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	9,113,542.94
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	10,092,340.12
3	单位集合计划净收益	0.0269
4	期末集合计划资产总值	302,256,853.39
5	期末集合计划资产净值	290,722,911.11
6	单位集合计划资产净值	0.7740
7	本期集合计划净值增长率	2.99%
8	集合计划累计净值增长率	7.50%

（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

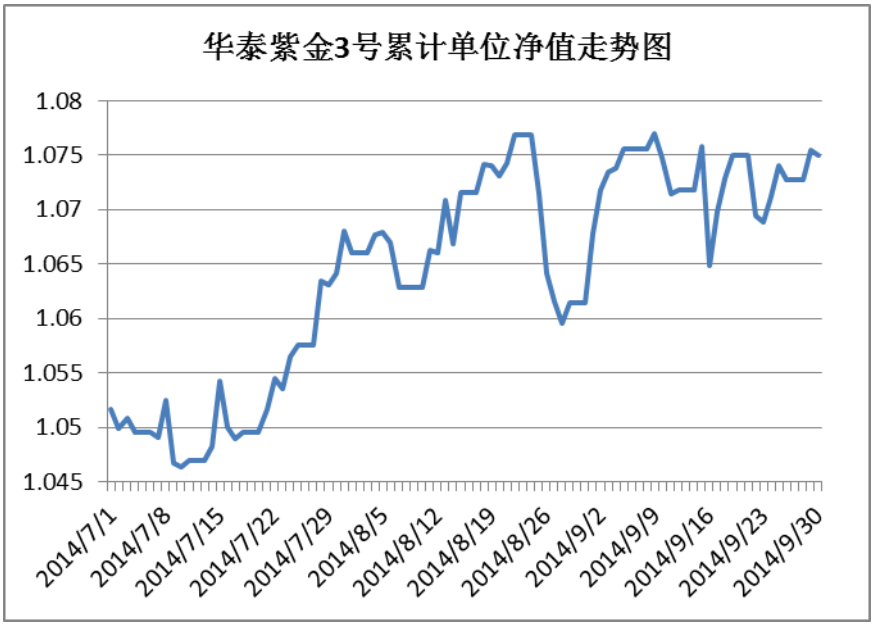
（2）单位集合计划净值＝集合计划净值÷集合计划份额

（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 0.7740 元，本期净值增长率为 2.99％，集合计划单位累计净值为 1.0750 元，集合

计划累计净值增长率为 7.50%。

(二)投资主办简介

张弘，经济学硕士，10 余年证券从业经验，曾在华泰联合证券担任行业与公司研究员、研究所副所长，对宏观经济和证券投资有深入的研究。2011 年进入华泰证券资产管理总部从事投资研究工作。

（三）投资主办工作报告

1、投资策略回顾

在经济整体疲弱的大背景下，我们坚持了防守的策略，重点配置了必须消费品和医药。配置个股业绩增长大致符合预期。

由于我们配置较为集中于必须消费和医药，对于周期性行业出现的阶段性投资机会没有能够把握，净值表现较差，弱于大市。对此，我们将认真反思近期的操作策略，力争此后几个季度能做得更好一些。

2、投资管理展望

整体来看，目前中国经济转型的难度和时间可能都会超出绝大多数人的预期。但转型过程中的机会也不少。我们将认真进行个股的甄选，把业绩增长放到优先的筛选标准中，同时强调估值的安全边际。在第 4 季度将维持适中的仓位，以大蓝筹作为配置重点，聚焦于大消费、医疗领域、物流及新兴行业，同时从国企改革、定增、并购、沪港通等线索发掘主题投资机会，但在个股选择上将会更加苛求。我们相信，通过严苛的选股和稳健的投资，有望为投资者带来净值增长。

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	37,563,464.66	短期借款	0
结算备付金	826,857.14	交易性金融负债	0
存出保证金	35,714.27	衍生金融负债	0
交易性金融资产	198,101,140.32	卖出回购金融资产款	0
其中：股票投资	158,010,292.97	应付证券清算款	10,466,027.19
债券投资	0	应付赎回款	439,320.91
资产支持证券投资	0	应付赎回费	0
基金投资	40,090,847.35	应付管理人报酬	384,348.90
衍生金融资产	0	应付托管费	60,814.72
买入返售金融资产	0	应付销售服务费	0
应收证券清算款	65,712,956.26	应付交易费用	183,430.56
应收利息	16,494.68	应付税费	0
应收股利	226.06	应付利息	0
应收申购款	0	应付利润	0
其他资产	0	其他负债	0
		负债合计	11,533,942.28
		所有者权益:	
		实收基金	375,588,357.49
		未分配利润	-84,865,446.38
		所有者权益合计	290,722,911.11
资产合计:	302,256,853.39	负债与持有人权益总计:	302,256,853.39

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	10,908,811.99	-8,724,758.75
1、利息收入	1,504,516.76	5,140,243.50
其中：存款利息收入	617,644.35	2,362,949.32
债券利息收入	560,383.56	1,716,191.78
资产支持证券利息收入	0	0
买入返售金融资产收入	326,488.85	1,061,102.40
2、投资收益（损失以"-"填列）	10,383,092.41	7,860,703.97
其中：股票投资收益	9,614,996.53	10,106,348.96
债券投资收益	73,430.00	200,320.00
资产支持证券投资收益	0	0
基金投资收益	97,667.98	-5,128,143.41
权证投资收益	0	0
衍生工具收益	0	0
股利收益	596,997.90	2,682,178.42
3、公允价值变动损益（损失以"-"填列）	-978,797.18	-21,725,706.22
4、其他收入（损失以"-"填列）	0	0
二、费用	1,795,269.05	5,124,155.89
1、管理人报酬	1,221,115.80	3,917,946.43
2、托管费	193,214.56	619,928.32
3、销售服务费	0	0
4、交易费用	369,287.74	541,032.93
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	11,650.95	45,248.21
三、 利润总额	9,113,542.94	-13,848,914.64

（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	104,138,992.33	34.45%
股 票	158,010,292.97	52.28%
债 券 及 资 产 证 券 化	0	0.0000%
证券投资基金	40,090,847.35	13.26%
其他资产	16,720.74	0.01%
资产总值	302,256,853.39	100.00%

2、按市值占净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票名称	期末市值（元）	占资产净值的比例
1	焦作万方	18,648,000.00	6.41%
2	苏宁云商	16,956,221.52	5.83%
3	伊利股份	15,151,500.00	5.21%
4	万华化学	13,890,998.04	4.78%
5	深圳惠程	13,153,713.12	4.52%
6	铁龙物流	12,546,865.65	4.32%
7	双汇发展	11,746,000.00	4.04%
8	西南药业	11,017,500.00	3.79%

本集合计划本报告期末仅持有上述 8 只股票。

（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
425,789,467.66	125,478.53	50,326,588.70	375,588,357.49

（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3号集合资产管理计划推广的文件

2、中国证监会批准华泰紫金3号变更资产管理合同重要条款及延长存续期的批复

3、华泰紫金3号集合资产管理计划说明书、资产管理合同

4、华泰紫金3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