

华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理计划

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。

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。

集合资产管理计划托管人工商银行股份有限公司于 2014 年 10 月 14 日对本报告中的主要财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

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。

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: 华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理计划

类型: 数量化产品

管理人：华泰证券股份有限公司

托管人：工商银行股份有限公司

成立日：2013年05月28日

成立规模：103,194,059.11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	1,285,582.50
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	229,516.70
3	本期单位集合计划净收益	0.0291
4	期末集合计划资产总值	8,627,253.75
5	期末集合计划资产净值	8,619,768.17
6	单位集合计划资产净值	1.0937
7	本期集合计划净值增长率	14.76%
8	集合计划累计净值增长率	9.37%

（二）财务指标的计算公式

(1) 本期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

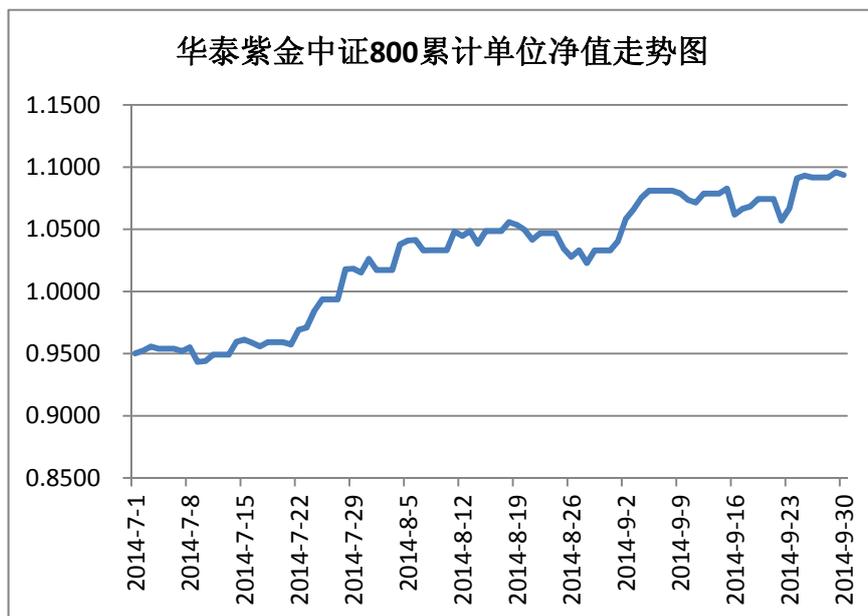
(2) 单位集合计划净值 = 集合计划净值 ÷ 集合计划份额

(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) 净值表现

截止到 2014 年 9 月 30 日，集合计划单位净值为 1.0937 元，本期净值增长率为 14.76%，集合计划单位累计净值为 1.0937 元，集合计划累计净值增长率为 9.37%。

(二) 投资主办简介

谢江，香港中文大学运筹学博士、南开大学学士及硕士，现为华泰证券资产管理总部金融工程部总监，曾任联合证券首席产品设计师。曾多年从事金融工程研究卖方业务，连续多年获《新财富》最佳金融工程分析师第一名，国内量化选股、量化投资的先行者。2012年进入华泰证券资产管理总部，拥有较丰富的投资研究经验。

（三）投资主办工作报告

1、投资策略回顾

中证800指数增强集合计划2014年3季度收益率为14.76%，同期比较基准收益17.40%，本季度市场大幅拉升，本计划业绩略输基准；截止3季度末单位净值为1.0937元；成立以来累计收益9.37%，同期比较基准收益1.17%。

从3季度来看，外部环境方面，地缘政治危机仍在持续。俄罗斯为应对欧美新一轮制裁，采取反制裁措施，并以人道主义援助的方式进入乌东。以色列和巴勒斯坦在加沙地区暂时停火。美国则发动多轮对ISIL的空中打击。经济上，欧盟的数据持续恶化，德国经济景气度下降，意大利步入衰退，欧洲央行计划采取非传统措施刺激经济。国内经济方面，7月份经济数据显示增速放缓，服务类行业景气度下降，地区经济发展不平衡，货币政策在信贷投放方面也发生调整。同时，受前期大幅拉升引起获利盘回吐影响，8月市场整体上持续处于高位震荡的状态。9月PMI保持在50%的荣枯分界线以上，预示未来经济平稳增长的基本态势不会改变。

2、投资管理展望

三季度PMI指数平均水平为51.3%，略高于今年上半年和去年同期，显示三季度经济运行基本平稳，增速仍处在适度、合理区间。从非制造业PMI来看，投资需求将支撑经济稳定增长。建筑业商务活动指数和新订单指数均结束连续两个月的回落走势，双双实现回升。建筑活动的回升，表明投资需求对四季度经济稳定增长的支撑作用将进一步增强。在9月中秋节的消费拉动下，非制造业PMI数据回暖，居民采购活动积极，与居民采购相关的物流活动升温。订单类指数下降，产成品、采购量、购进价格等指数回落，反映去库存活动还在持续，企业信心偏低，经济增长仍存在一定下行压力。为缓解小微企业的经营压力，降低小微企业的融资难、融资贵问题，前期我国出台了一系列包括财税、金融扶持等政策，在多种扶持政策相继推出以后，小企业PMI指数依然低位下行。小微企业对市场需求的敏感度较高，容易受到宏观经济波动的影响，因此后期还要加大对小微企业的政策扶持力度，重在落实前期政策，发挥政策合力效应。随着四中全会的召开以及改革措施的进一步落实，我们认为下半年市场或有较好的投资机会。

（四）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与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资产管理业务部门内控和合规与风险管理部外部监控来进行。为加强资产管理业务的风险管

理，集合计划管理人成立了受托资产管理部，作为资产管理业务的一线中台部门，全面负责资产管理业务的内部风险控制管理，内容包括集合计划的风险揭示及管理、绩效评估、投资交易的授权执行、交易印章的使用、交易合同的报备等。合规与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。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；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；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。

四、集合计划财务报告

(一) 集合计划会计报表

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	1,199,102.95	短期借款	
结算备付金	203,758.23	交易性金融负债	
存出保证金	2,033.84	衍生金融负债	
交易性金融资产	7,222,231.31	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	5,170,373.81	应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付赎回费	

基金投资	2,051,857.50	应付管理人报酬	5,787.41
衍生金融资产		应付托管费	1,085.12
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	613.05
应收利息	127.42	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	7,485.58
		所有者权益:	
		实收基金	7,881,049.22
		未分配利润	738,718.95
		所有者权益合计	8,619,768.17
资产合计:	8,627,253.75	负债与持有人权益总计:	8,627,253.75

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	1,309,825.00	565,972.63
1、利息收入	1,311.22	5,195.59
其中:存款利息收入	1,171.64	4,783.80
债券利息收入		
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入	139.58	411.79
2、投资收益(损失以“-”填列)	252,447.98	-311,680.37
其中:股票投资收益	68,126.67	-594,308.12
债券投资收益		
资产支持证券投资收益		
基金投资收益	118,603.74	118,603.74
权证投资收益		
衍生工具收益		1,740
股利收益	65,717.57	162,284.01
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	1,056,065.80	872,457.41
4、其他收入(损失以“-”填列)		
二、费用	24,242.50	94,561.10
1、管理人报酬	18,659.71	59,554.56
2、托管费	3,498.75	11,166.54
3、销售服务费		

4、交易费用	2,084.04	13,600.00
5、利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
6、其他费用		10,240.00
三、利润总额	1,285,582.50	471,411.53

(二) 集合计划投资组合报告 (2014年9月30日)

1、资产组合情况

单位：人民币元

项目名称	项目市值	占基金资产总值比重
银行存款、清算备付金、存出保证金、清算款合计	1,404,895.02	16.28%
股票	5,170,373.81	59.93%
债券及资产证券化		
证券投资基金	2,051,857.50	23.78%
其他资产	127.42	0.00%
资产总值	8,627,253.75	100.00%

2、按市值占净值比例大小排序的前十名股票明细

单位：人民币元

序号	股票名称	期末市值(元)	占资产净值的比例
1	包钢股份	596,195.10	6.92%
2	中信银行	372,266.38	4.32%
3	中信证券	366,260.04	4.25%
4	招商银行	362,870.75	4.21%
5	大秦铁路	349,874.38	4.06%
6	浦发银行	347,587.50	4.03%
7	格力电器	313,210.35	3.63%
8	平安银行	295,084.14	3.42%
9	广发证券	292,003.65	3.39%

10	航空动力	270,125.08	3.13%
----	------	------------	-------

3、按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

本报告期债券投资期末余额为零。

4、按市值占净值比例大小排序的前五名基金明细

单位：人民币元

序号	股票名称	期末市值（元）	占资产净值的比例
1	信诚 500B	534,310.00	6.20%
2	中 小 板	333,030.00	3.86%
3	300ETF	326,145.00	3.78%
4	180ETF	291,040.00	3.38%
5	华夏金融 ET	284,112.50	3.30%

（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
9,932,810.67	0.00	2,051,761.45	7,881,049.22

五、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理计划说明书、资产管理合同

- 2、华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理计划托管协议
- 3、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受托资产管理部。

