

华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理 计划 2014 年 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期： 2015 年 1 月 22 日

§ 1 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2015年1月16日对本报告中的主要财务指标、净值表现、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10月1日—2014年12月31日

§ 2 产品概况

产品简称	中证 800
交易代码	940039
产品类型	股票型
产品合同生效日	2013 年 5 月 24 日
成立规模	103,194,059.11
存续期	无
产品管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司
产品托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和产品净值表现

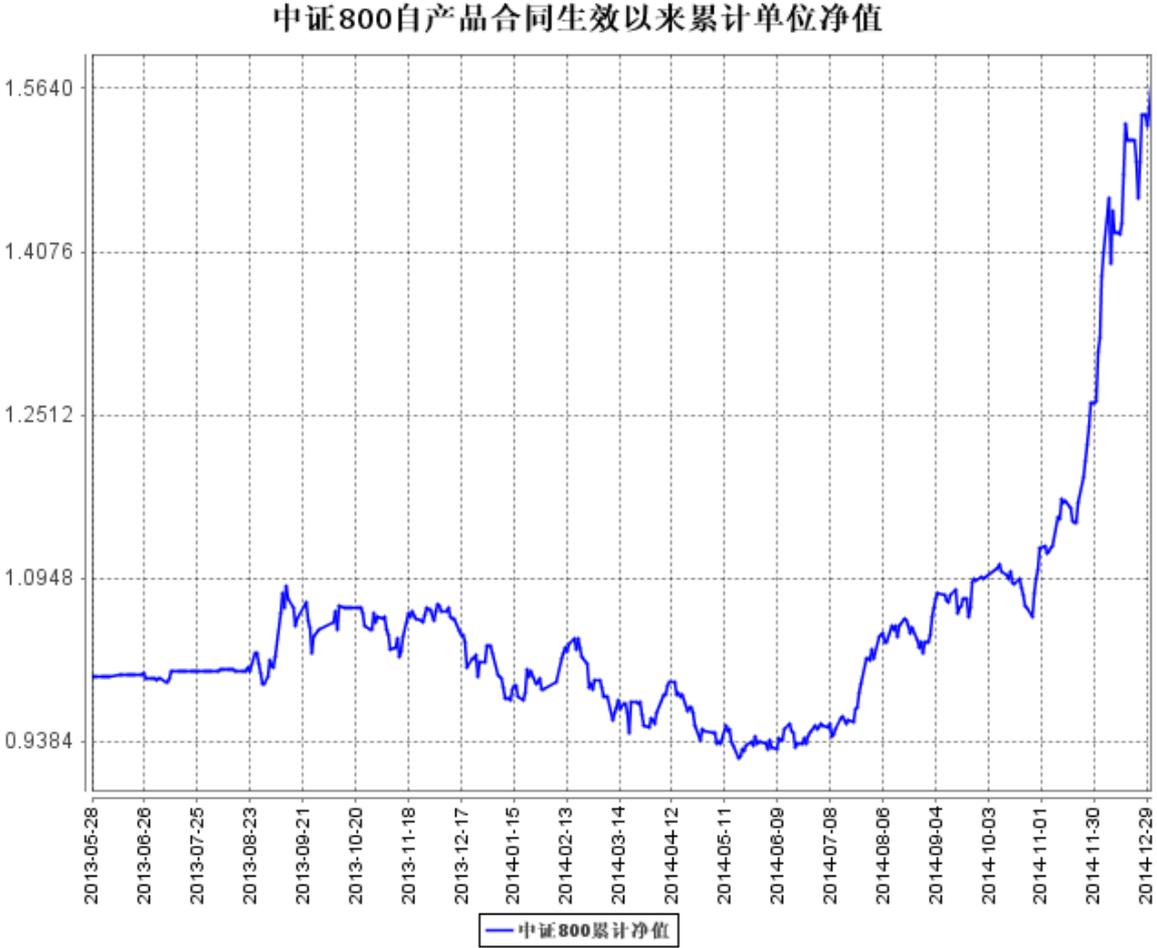
3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期
	(2014 年 10 月 1 日 - 2014 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	909,812.75
2. 本期利润	3,508,686.28
3. 单位资产净值	1.564
4. 期末资产总值	11,393,905.66
5. 期末资产净值	11,231,608.68

6. 本期产品份额净值增长率	43.02%
----------------	--------

3.2 自产品合同生效以来累计单位净值历史走势图



§ 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		
谢江	-	2013年5月28日	-	7	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。
--	--	--	--	--	---

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》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》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，资产管理总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。

4.3 报告期内投资策略和运作分析

中证 800 指数增强集合计划 2014 年 4 季度收益率为 43.02%，同期比较基准收益 33.82%，本季度市场大幅拉升，本计划业绩大幅战胜基准；截止 4 季度末单位净值为 1.5642 元；2014 年度收益率为 52.01%，同期比较基准收益 49.90%；成立以来累计收益 56.42%，同期比较基准收益 34.95%。

由于新股密集发行大量抽血叠加年末资金结算需求增加，资金面紧张局面延续，银行间 14 天回购利率一度大幅上涨至 9%左右，交易所 14 天回购利率更一度跳升至 13%以上。央行两次向银行提供短期流动性调节工具（SLO），并对部分到期的中期借贷便利（MLF）进行了续作。近期下发的央行 387 号文将非银金融机构的同业存款纳入一般存款统计口径，但暂不缴纳存款准备金。在不降准的前提下，央行以创新的货币政策手段减轻银行贷存比压力，向实体经济输送信贷资源，

疏导货币“堰塞湖”。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

12 月份汇丰制造业 PMI 预览值在半年之后再次跌至 50%以下，制造业出现收缩。从指数构成方法计算来看，新订单指数大幅下滑是主因。而新订单指数与新出口订单指数的分化表明，12 月份出口出现反弹，而国内需求尤其是投资需求明显下降。PMI 产出指数回升 0.1 个百分点，出现边际改善，但原材料库存加速下降，采购意愿也没有出现好转。投入及产出价格指数表明，受原油价格大跌拖累，12 月 PPI 数据可能进一步下滑。我们对大势的判断不变，大类资产配置向股市迁移的脚步仍在进行中，这一点并没有发生变化，因此我们对市场依然持乐观态度。

§ 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	2,448,482.78	21.49
2	股票	6,951,038.74	61.01
3	债券及资产支持证券	-	-
4	证券投资基金	1,994,130.50	17.50
5	其他资产	253.64	0.00
6	合计	11,393,905.66	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）	占基金资产净值比例（%）
1	601998	中信银行	81,997	667,455.58	5.94
2	600030	中信证券	19,497	660,948.30	5.88
3	600036	招商银行	34,925	579,405.75	5.16
4	600000	浦发银行	35,650	559,348.50	4.98
5	000001	平安银行	31,101	492,639.84	4.39
6	601006	大秦铁路	44,971	479,390.86	4.27
7	000776	广发证券	16,667	432,508.65	3.85
8	000651	格力电器	11,295	419,270.40	3.73
9	600010	包钢股份	100,000	408,000.00	3.63
10	600027	华电国际	49,152	344,064.00	3.06

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	公允价值（元）	占产品资产净值比例（%）
1	国家债券投资	-	-
2	可转换债券投资	-	-
3	其他债券	-	-
4	企业债券投资	-	-
5	资产证券化	-	-
6	债券及资产证券化投资合计	-	-

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占产品资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

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

序号	基金代码	基金名称	数量（张）	公允价值（元）	占产品资产净值比例（%）
1	510650	华夏金融 ET	297,500	500,097.50	4.45
2	510180	180ETF	136,000	436,968.00	3.89
3	510050	50ETF	170,000	433,840.00	3.86
4	159902	中小板	127,500	324,487.50	2.89
5	159919	300ETF	67,500	248,737.50	2.21
6	150029	信诚 500B	50,000	50,000.00	0.45

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	7,881,049.22
报告期期间产品总申购份额	243,773.01
减：报告期期间产品总赎回份额	944,609.24
报告期期末产品份额总额	7,180,212.99

§ 7 备查文件目录

7.1 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

7.2 存放地点

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 806 室

7.3 查阅方式

网址：www.htsc.com.cn

电话：95597

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(上海)资产管理有限公司。

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2015年1月22日

