

# 华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理计划 2014 年年度资产管理报告

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 3 月 31 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3月17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。

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1月1日—2014年12月31日

## § 2 产品概况

### 2.1 产品基本情况

产品简称	中证800
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	中国工商银行股份有限公司

### 2.2 管理人

名称	华泰证券(上海)资产管理有限公司
地址	中国(上海)自由贸易试验区马吉路88号2幢3层
法定代表人	张海波
成立时间	2014年
注册资本	3亿

### 2.3 托管人

名称	中国工商银行股份有限公司
地址	北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人	姜建清
成立时间	1984年
注册资本	3548亿

## 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号东方广场东2办公楼8层
合伙人	王国蓓
电话	010-85085000
传真	010-85185111

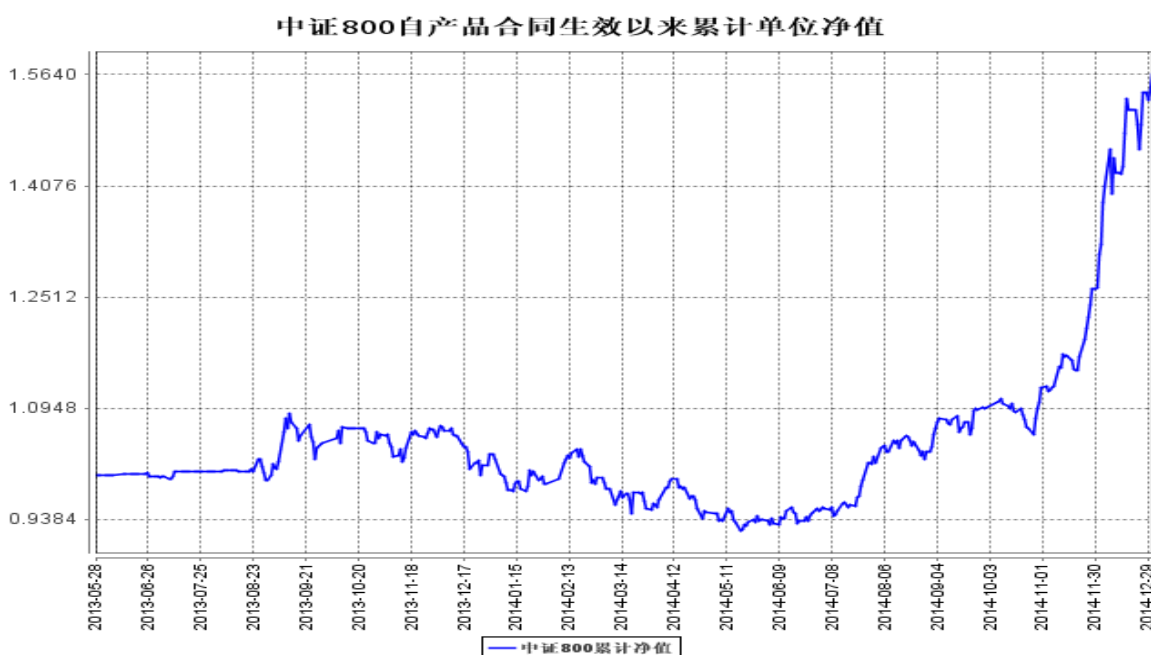
## § 3 主要财务指标和产品净值表现

### 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1月1日 - 2014年12月31日)
1. 本期已实现收益	508,766.87
2. 本期利润	3,980,097.81
3. 单位资产净值	1.5642
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	52.01%

### 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	投资经理	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 年收益率为 52.01%，同期比较基准收益 48.28%，实现超额收益 3.74；截止 2014 年度末单位净值为 1.5642 元；成立以来累计收益 56.42%，同期比较基准收益 34.77%，实现超额收益 21.65%。

回顾 2014 年，市场前低后高。1 季度受 IPO 重启、资金面紧张、经济增速放缓等诸多制约因素，造成的不乐观预期使得资金逃离市场躲避风险，从而造成市场大跌拖累行情。2 季度经济数据尚可、发电量持续回升及较低的 CPI 为货币政策迎来调整契机，逐步向好的经济数据反映出中国经济在往好的方向变化，经济平稳增长的基本态势继续保持，市场反应波澜不惊。我们预计市场或已处于较为底部的区域，故持续进行加仓银行、券商等板块。3 季度外部环境方面地缘政治危机仍在持续，但国内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，市场整体上持续处于高位震荡的状态。4 季度市场风险偏好的持续上行，市场表现快牛模式。

### 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 2015 年市场仍将维持上行趋势，但市场均线结构波动明显，波动率明显放大，或呈持续放大趋势。风格方面，在各板块中寻找有优秀业绩支撑的个股，坚决回避无业绩的题材股，大中小盘均衡配置。行业方面，继续看好大金融、地产行业。目前，医药行业的静态市盈率水平处于历史中值附近，行业龙头目前估值水平低于行业平均水平，具有明显的长线配置价值。未来一段时间家电行业板块有望迎来一段估值修复行情。从收益和风险匹配角度出发，部分中游行业的投资价值也开始值得关注。主题投资方面建议继续关注国企改革、一带一路、生态文明、环保、体育、军工等板块。

## § 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	12,244,655.18
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	5,308,215.20
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：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场 1 号楼 5 层

### 7.3 查阅方式

网址：www.htsc.com.cn

电话：4008895597

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3月31日

