

华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理 计划 2015 年第 4 季度管理报告



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：2016 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2016年1月20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。

§ 2 产品概况

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 28 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

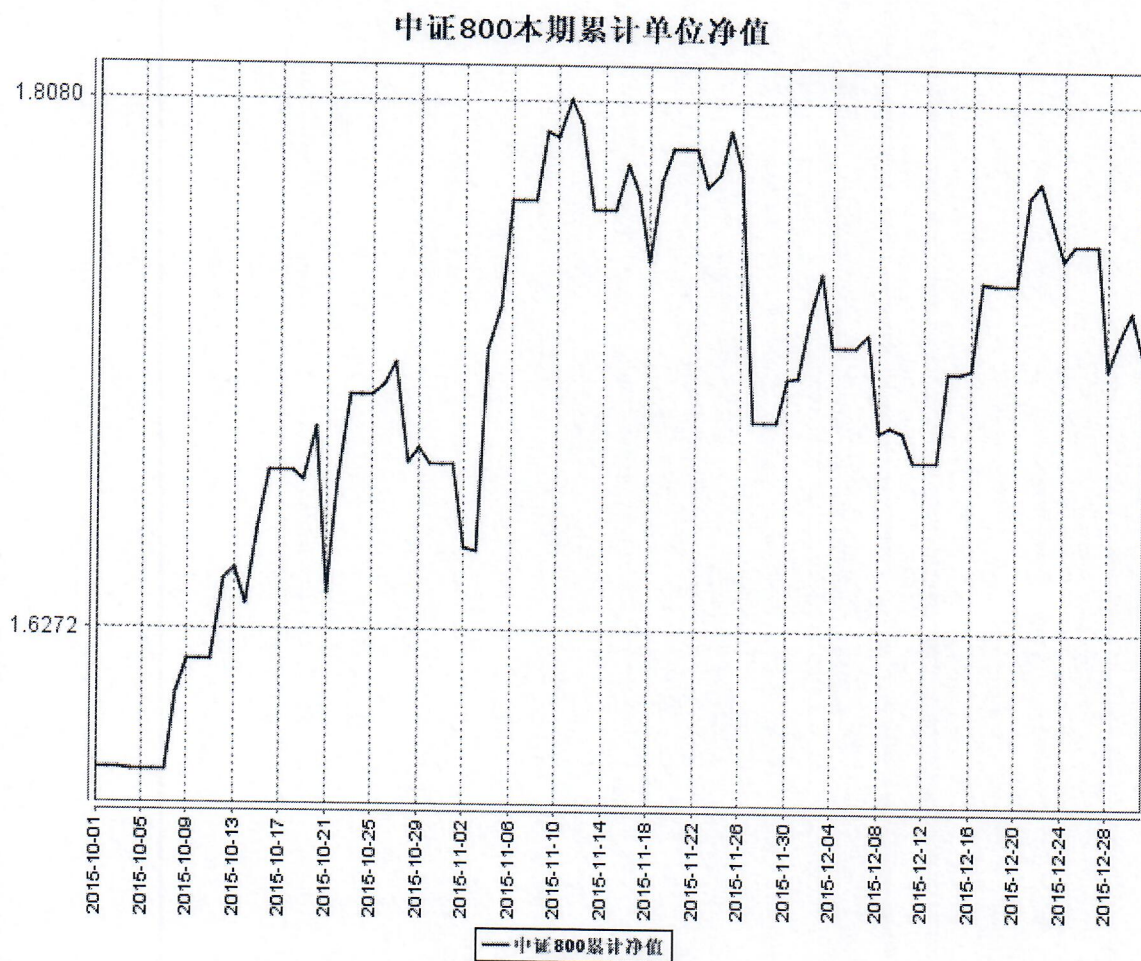
§ 3 主要财务指标和产品净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期
	(2015 年 10 月 1 日 - 2015 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	290,681.21
2. 本期利润	965,276.13
3. 单位资产净值	1.4714
4. 期末资产总值	8,397,231.23
5. 期末资产净值	8,171,956.61
6. 本期产品份额净值增长率	10.68%

3.2 本期累计单位净值走势图



§ 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，现为华泰证券（上海）资产管理有限公司投资主办。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，拥有较丰

					富的投资研究经验。
张弘	投资经理	2013年5月 28日	-	19	经济学硕士，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。

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、日常监控和重点检查的结果。

本集合计划管理人的风险控制工作主要通过合规风控部监控来进行。为加强资产管理业务的风险管理，合规风控部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、并负责交易印章使用、交易合同报备等的检查工作；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。

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

2015年4季度，市场在经历了大幅下跌之后出现了一定反弹。4季度中后期，产品通过构建底仓以跟踪中证800指数，同时基于对未来市场的判断，谨慎挑选了部分个股作为增强仓位。产品在4季度取得收益为约6.25%。

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2016年1季度，市场在经历了2015年下半年的大跌后，投资者信心尚需时日修复。同时，市场外部仍然存在较多的不确定因素，这包括新的监管政策（如熔断机制、限售股减持政策等）、发行政策（如注册制及配套制度）等等，这可能使得市场参与者存在一定的理解分歧，进而影响市场波动。

鉴于此，产品将综合运用量化分析方法以及研究员荐股，把握个股的阶段性的机会，对增强部分仓位进行灵活配置，进一步防范市场风险，以求取得超越标的指数的超额收益。

§ 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	674,987.61	8.04
2	股票	7,722,180.33	91.96
3	债券及资产支持证券	0.00	0.00
4	证券投资基金	2.38	0.00
5	其他资产	60.91	0.00
6	合计	8,397,231.23	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	601318 SH	中国平安	5,600	201,600	2.47
2	600048 SH	保利地产	18,100	192,584	2.36
3	600030 SH	中信证券	8,800	170,280	2.08
4	600036 SH	招商银行	8,878	159,715.22	1.95
5	600016 SH	民生银行	15,300	147,492	1.80
6	000002 SZ	万科A	5,200	127,036	1.55
7	000078 SZ	海王生物	5,300	126,988	1.55
8	002373 SZ	千方科技	2,600	118,950	1.46
9	600000 SH	浦发银行	6,200	113,274	1.39
10	002557 SZ	洽洽食品	6,000	112,320	1.37

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	0.00	0.00
2	可转换债券投资	0.00	0.00
3	其他债券	0.00	0.00
4	企业债券投资	0.00	0.00
5	资产证券化	0.00	0.00
6	债券及资产证券化投资合计	0.00	0.00

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

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(份)	公允价值(元)	占产品资产净值比例(%)
1	165511	信诚500	1	1.43	-
2	160219	国泰医药	1	.95	-

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	6,644,814.89
报告期期间产品总申购份额	19,871.79
减:报告期期间产品总赎回份额	1,110,873.82
报告期期末产品份额总额	5,553,812.86

§ 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 存放地点与查阅方式

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

网址：<http://htamc.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



2016 年 1 月 22 日

