

华泰紫金鼎锦上添花集合资产管理计划 2015 年度管理报告

产品管理人：华泰证券(上海)资产管理有限公司

产品托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期： 2016 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。

托管人已于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的主要财务指标、会计报表和投资组合报告等内容、保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

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

2.1 基本信息

| | |
|---------|------------------|
| 产品简称 | 锦上添花 |
| 产品类型 | FOF 型 |
| 产品合同生效日 | 2009 年 3 月 19 日 |
| 成立规模 | 1,769,267,358.01 |
| 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 | 中国银行股份有限公司 |

2.2 管理人

2.2.1 基本情况

| | |
|-------|----------------------------|
| 名称 | 华泰证券(上海)资产管理有限公司 |
| 地址 | 中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 楼 |
| 法定代表人 | 张海波 |
| 成立时间 | 2014 年 10 月 16 日 |
| 注册资本 | 10.00 亿元 |

2.2.2 发展状况

华泰证券(上海)资产管理有限公司成立于 2014 年 10 月 16 日,注册资本 10 亿元,是华泰

证券股份有限公司的全资子公司。公司前身为华泰证券股份有限公司资产管理总部，早在 1999 年开始从事资产管理业务。截至 2015 年 12 月末，公司资产管理总规模 6244.57 亿元，其中主动管理规模 1707.97 亿元。2015 年本公司累计实现营业收入 12.10 亿元，营业利润 9.36 亿元，净利润 7.02 亿元，年末公司净资产 17.33 亿元；合计口径计算，累计实现营业收入 13.44 亿元，营业利润 9.77 亿元，净利润 7.33 亿元。中国证券投资基金业协会发布的统计数据显示，截至 2015 年 12 月末，公司资产管理业务总规模、资产管理业务净收入行业排名分别为第三、第六。一年来，公司紧紧抓住资产管理行业特点，克服资本市场波动的影响，敏锐捕捉发展机会，通过前瞻性的战略布局、科学的产品决策、有效的风险防控，全面提升公司的整体实力和管理水平，为良好经营业绩的取得及长期可持续发展奠定了坚实基础。

2.3 托管人

| | |
|-------|---------------|
| 名称 | 中国银行股份有限公司 |
| 地址 | 北京市复兴门内大街 1 号 |
| 法定代表人 | 田国立 |

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 号东方广场毕马威大楼 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 |
|----------------|-------------------------------------|
| | (2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 12 月 31 日) |
| 1. 本期已实现收益 | 69,690,024.13 |
| 2. 本期利润 | 10,261,259.52 |
| 3. 单位资产净值 | 0.9524 |
| 4. 期末资产总值 | 36,482,060.22 |
| 5. 期末资产净值 | 36,289,816.03 |
| 6. 本期产品份额净值增长率 | 13.33% |

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 | 2015年1月5日 | 2015年7月20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。 |
| 孙谦 | 投资经理 | 2015 年 7 月 20 日 | - | 10 | 管理科学硕士，美国特许金融分析师。现任华泰资产管理执行董事，曾供职中金公司资产管理部，历任债券投资经理，产品团队负责人和跨境业务团队负责人，执行总经理等职。 |

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

本年国内 A 股市场经历了加杠杆的快速上涨、降杠杆的泡沫破裂、救市、回升、人民币贬值带来的再下跌、自身修复等过程，上证指数全年上涨 9.41%，创业板指数上涨 84.41%。

本产品 2015 年投资主办变化比较大，导致投资策略没有延续性。产品在上半年市场上涨中没有获得足够的收益，在 6 月市场见顶后下跌中损失巨大。9 月以后投资组合主要集中在成长股，

在市场的自我修复阶段表现良好，业绩有所恢复。全年看，本产品的投资管理处于比较被动的状态，全年业绩不理想。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济仍处在 2008 年以来的后危机状态，表现为经济格局重塑、增长乏力、货币极度宽松。期间也经历了一波科技创新与发展，新经济主要集中在美国和中国。在 2015 年开始出现一些变化，美国开始加息、商品开始企稳、科技泡沫破裂、股票市场走软。我国存在经济发展动力不足，原有发展模式无法维系，经济转型刚刚起步，货币持续大幅增长导致资产泡沫。这些问题在 2012 年到 2015 年伴随科技创新催生了一波比较大的牛市，尤其是成长股涨幅惊人。2015 年牛市结束，虽然当年有比较大的下跌调整，但其后续影响还会持续比较长的时间。我们预计国内 A 股市场在 2016 年处于缩量调整态势，企稳后可能保持振荡格局。我们认为，虽然经济环境和市场环境不理想，但国内 A 股市场已经具有相当大的深度和广度，在市场进入缩量调整和振荡格局中，仍有比较丰富的投资机会。我们准备在基本面不断验证的成长股、估值合理的品牌消费股、供需结构改善的多种行业等三个角度积极寻找投资机会。

§ 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 | 4,918,535.15 | 13.48 |
| 2 | 股票 | 12,787,845.00 | 35.05 |
| 3 | 债券及资产支持证券 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 证券投资基金 | 18,774,808.81 | 51.46 |
| 5 | 其他资产 | 871.26 | 0.00 |
| 6 | 合计 | 36,482,060.22 | 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 | 300109 SZ | 新开源 | 20,000 | 2,081,000 | 5.73 |
| 2 | 600593 SH | 大连圣亚 | 30,000 | 1,541,700 | 4.25 |
| 3 | 002551 SZ | 尚荣医疗 | 40,000 | 1,318,800 | 3.63 |
| 4 | 002273 SZ | 水晶光电 | 30,000 | 1,218,000 | 3.36 |
| 5 | 300016 SZ | 北陆药业 | 25,000 | 887,750 | 2.45 |
| 6 | 300009 SZ | 安科生物 | 20,000 | 865,600 | 2.39 |
| 7 | 000926 SZ | 福星股份 | 50,000 | 842,000 | 2.32 |
| 8 | 002446 SZ | 盛路通信 | 20,000 | 742,000 | 2.04 |
| 9 | 300168 SZ | 万达信息 | 20,000 | 662,600 | 1.83 |
| 10 | 600645 SH | 中源协和 | 10,000 | 650,100 | 1.79 |

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 | 159901 | 深圳 100ETF | 600,000 | 2,791,200 | 7.69 |
| 2 | 159919 | 300ETF | 700,000 | 2,733,500 | 7.53 |
| 3 | 510180 | 180ETF | 800,000 | 2,560,000 | 7.05 |
| 4 | 510660 | 上证医药卫生发起式 ETF | 1,500,000 | 2,553,000 | 7.04 |
| 5 | 159902 | 中小板 | 600,000 | 2,355,000 | 6.49 |
| 6 | 159939 | 信息技术 | 1,500,000 | 2,164,500 | 5.96 |
| 7 | 510510 | 广发 500 | 1,000,000 | 2,069,000 | 5.7 |
| 8 | 159915 | 创业板 | 609,927 | 1,548,604.65 | 4.27 |
| 9 | 160628 | 鹏华地产 | 1 | 1.28 | - |
| 10 | 161026 | 富国企改 | 1 | 1.04 | - |

§ 6 产品份额变动

单位：份

| | |
|----------------|---------------|
| 报告期期初产品份额总额 | 84,942,094.07 |
| 报告期期间产品总申购份额 | - |
| 减：报告期期间产品总赎回份额 | 46,837,723.29 |

| | |
|-------------|---------------|
| 报告期期末产品份额总额 | 38,104,370.78 |
|-------------|---------------|

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、华泰紫金锦上添花集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 2、华泰紫金锦上添花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3月31日

