

华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理计划 2016 年第 1 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 4 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4月21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

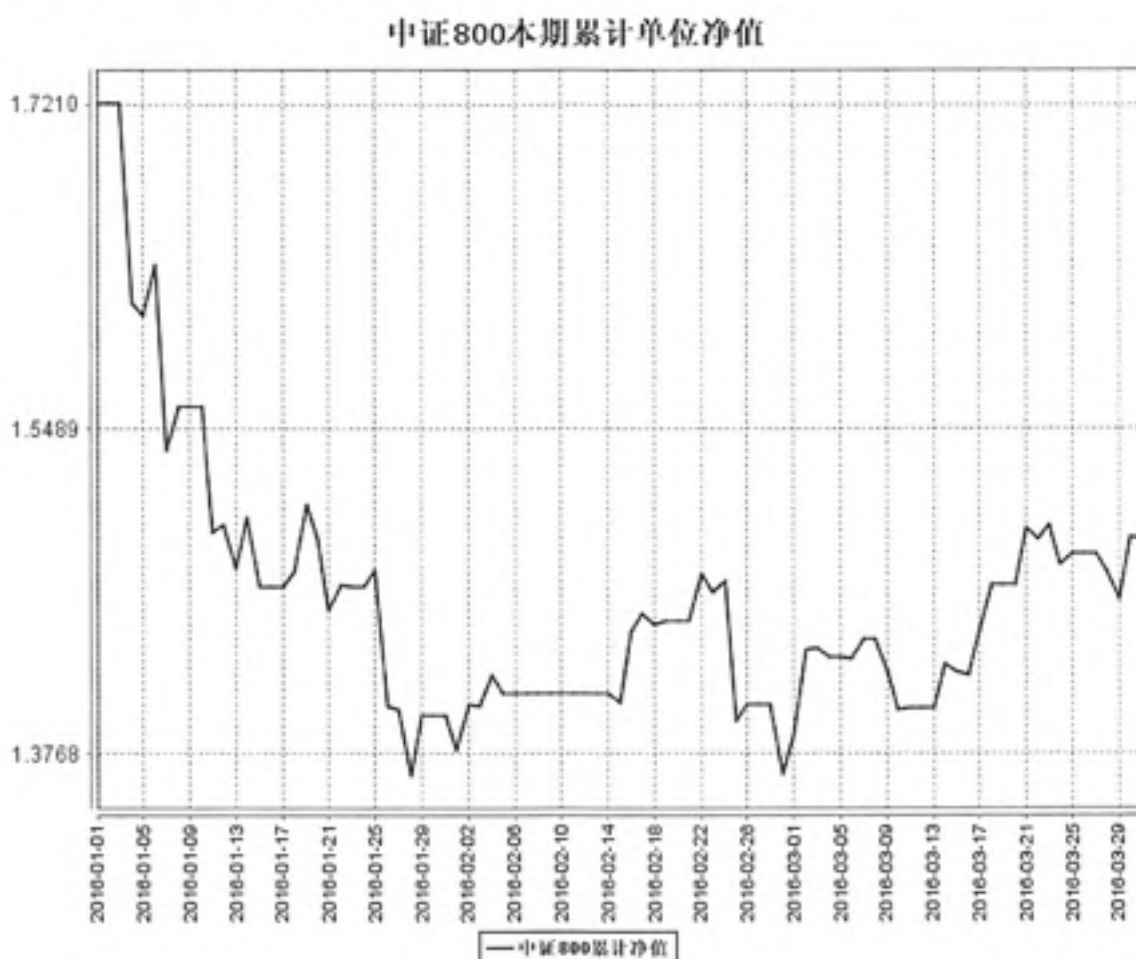
§ 3 主要财务指标和产品净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期
	(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1. 本期已实现收益	-288,769.90
2. 本期利润	-1,277,548.48
3. 单位资产净值	1.2411
4. 期末资产总值	7,009,881.28
5. 期末资产净值	6,924,168.13
6. 本期产品份额净值增长率	-15.65%

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		
张弘	投资经理	2013年5月28日	-	18	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和合规风控部日常监控、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相关投资部门内控和合规风控部外部监控来进行。合规风控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

产品约 80% 的仓位跟踪标的指数——中证 800 指数，同时以不超过 15% 的仓位作为增强仓位，尝试超越标的指数。

回顾 2016 年 1 季度，市场经历了 1 月份的大跌，2 月份的震荡与 3 月份的反弹。整个 2016 年 1 季度中证 800 指数下跌-15.41%，跌幅较大。在增强仓位的配置上我们采取了短中期指数择时、优势板块轮动以及个股事件驱动等策略，配置比较灵活。截至 2016 年 3 月 31 日产品单位净值 1.2411 相比 2015 年 12 月 31 日单位净值 1.4714 回撤-15.65%。产品 2016 年 1 季度略微跑输标的指数。

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 2 季度，市场在经历了连续大跌之后，空间下跌已较为充分，但投资者信心修复时间将会很长。同时，宏观经济是否企稳也尚不明显，外围因素如美国加息预期、大宗商品价格等均不确定，这些因素可能导致市场的波动增大，个股分化也会较为明显，从而增加了操作的难度。2 季度，我们将继续综合运用各项策略，并根据不断变化的市场挖掘出新的逻辑，同时优化调整已有策略，并逐步检验其有效性。我们将坚持综合运用量化分析以及传统基本面相结合的方法，寻找相对确定的机会，对增强部分仓位进行灵活配置，在控制组合风险的前提下，力争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	481,476.95	6.87
2	股票	6,528,379.18	93.13
3	债券及资产支持证券	0.00	0.00
4	证券投资基金	1.92	0.00
5	其他资产	23.23	0.00
6	合计	7,009,881.28	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	5,600.00	178,136.00	2.57
2	600036 SH	招商银行	8,878.00	142,847.02	2.06
3	600016 SH	民生银行	15,300.00	139,383.00	2.01
4	600583 SH	海油工程	19,200.00	137,664.00	1.99
5	000002 SZ	万科A	5,200.00	127,036.00	1.83
6	601628 SH	中国人寿	4,800.00	114,528.00	1.65
7	600000 SH	浦发银行	6,200.00	111,166.00	1.61
8	300291 SZ	华录百纳	4,200.00	109,158.00	1.58
9	000777 SZ	中核科技	4,100.00	107,666.00	1.55
10	000839 SZ	中信国安	6,000.00	106,680.00	1.54

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	1.00	1.15	0.00
2	160219	国泰医药	1.00	0.77	0.00

§ 6 产品份额变动

单位: 份

报告期期初产品份额总额	5,553,812.86
报告期期间产品总申购份额	25,347.07
减:报告期期间产品总赎回份额	-
报告期期末产品份额总额	5,579,159.93

§ 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 4 月 22 日