

华泰紫金货币增强集合资产管理计划 2016 年第 2 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 07 月 21 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。管理人于2016年6月16日对合同条款进行了变更，具体变更内容详见《华泰资金货币增强集合资产管理计划补充协议》，网址如下：

<http://htamc.htsc.com.cn/common/ShowFile.jsp?code=2207441231>。

托管人已于2016年7月14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。本报告财务资料未经审计。

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	华泰紫金货币增强
产品类型	货币型
产品合同生效日	2013年05月29日
成立规模	173,959,138.08
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	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和产品净值表现

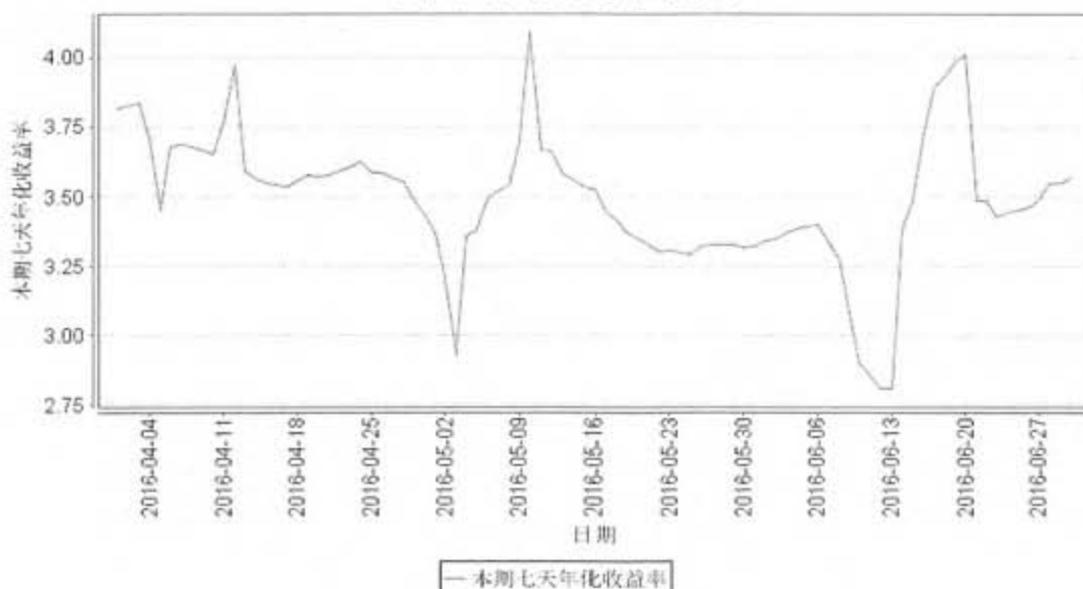
3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2016年04月01日 - 2016年06月30日)
1. 本期已实现收益	60,295,661.50
2. 本期利润	60,295,661.50
3. 期末资产总值	8,603,055,155.49
4. 期末资产净值	7,520,735,749.91

3.2 本期七天年化收益率走势图

本期七天年化收益率走势图



§ 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		
陈韞慧	投资经理	2015-03-18		6	厦门大学管理学硕士，超过4年固定收益从业经验，2011年加入华泰证券，具备丰富的投研和交易经验。

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

回顾 2016 年二季度，如果说一季度需求与库存周期形成共振，同时年初的天量信贷导致市场对于经济产生了过度乐观的预期，那么从二季度的情况来看市场主要对于这种预期进行了一定的修正。

从流动性的角度，由于年初市场对于美联储加息的强烈预期与美国实际的基本面情况形成矛盾，因此随着美联储的信号偏于温和，市场的流动性也存在一定的改善。

在各种因素的共振之下，债券市场尤其是高等级品种在二季度面临了相对比较好的流动性和基本面环境。从 2016 年以来的债券市场回顾来看，高等级品种的价格走势基本呈现“V”字形走势，符合我们年初对于今年市场主要依靠波段操作，趋势性不强的观点。从信用风险来看，市场对于低评级信用债的避险情绪明显，因此低评级信用债的信用利差甚至存在一定的走阔现象。

在操作层面来看，在二季度我们采取了灵活杠杆，精选个券和适当参与市场波段的思路。

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 年三季度，我们认为全球市场流动性宽松的灵丹妙药并不解决经济结构性矛盾和经济的创新动力，导致全球市场存在一定的波动可能。我们认为国内市场流动性仍将保持适度的宽松，但是经济可能仍然在“L”形态中震荡，对于债券资产仍将维持灵活杠杆、精选资产、交易与配置均衡的操作思路。

§ 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	272,367,254.05	3.17
2	股票	-	-
3	债券及资产支持证券	5,598,771,831.69	65.08
4	证券投资基金	2,502,061,936.93	29.08
5	其他资产	229,854,132.82	2.67
6	合计	8,603,055,155.49	100.00

5.2 报告期末按摊余成本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）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

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	摊余成本（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	4,733,133,879.55	62.93
4	企业债券投资	785,637,952.14	10.45
5	资产证券化	80,000,000.00	1.06
6	债券及资产证券化投资合计	5,598,771,831.69	74.44

5.4 报告期末按摊余成本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）	摊余成本（元）	占产品资产净值比例（%）
1	041566016 IB	15 包钢 CP001	2,500,000.00	249,022,164.38	3.31
2	135295 SH	上交所_已上市_私募债券_成本 16 江东 01	2,000,000.00	200,000,000.00	2.66
3	135271 SH	上交所_已上市_私募债券_成本 16 渝隆债	2,000,000.00	200,000,000.00	2.66
4	1605193 IB	16 四川债 09	2,000,000.00	199,904,315.36	2.66
5	011699859 IB	16 津保税 SCP002	2,000,000.00	199,893,808.32	2.66
6	135296 SH	上交所_已上市_私募债券_成本 16 长投 01	1,500,000.00	150,000,000.00	1.99
7	031559039 IB	15 柳州城投 PPN001	1,200,000.00	122,854,863.02	1.63
8	031662005 IB	116 新田投资 PPN001	1,200,000.00	119,942,755.23	1.59
9	031691001 IB	116 高教投资 PPN001	1,100,000.00	110,000,000.00	1.46
10	118385 SZ	15 柯桥 02	1,000,000.00	102,370,486.70	1.36

5.5 报告期末按摊余成本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）	摊余成本（元）	占产品资产净值比例（%）
1	485020	工银瑞信	710,249,851.78	710,249,851.78	9.44

	OTC	14 天理财 B			
2	485018 OTC	工银瑞信 7 天理财 B	690,043,037.26	690,043,037.26	9.18
3	000509 OTC	广发钱袋子	504,455,311.13	504,455,311.13	6.71
4	000905 OTC	鹏华安赢宝	502,567,092.18	502,567,092.18	6.68
5	000725 OTC	大成添利宝 货币 B	90,000,000.00	90,000,000.00	1.20
6	002183 OTC	广发天天红 B	4,733,592.60	4,733,592.60	0.06
7	000343 OTC	华夏财富宝	13,051.17	13,051.17	-
8	000645 OTC	华夏薪金宝 货币	0.48	0.48	-
9	519878 SH	国保 A	33.00	0.33	-

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	4,968,160,632.60
报告期期间产品总申购份额	21,149,841,937.48
减：报告期期间产品总赎回份额	18,597,266,820.26
报告期期末产品份额总额	7,520,735,749.91

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、华泰紫金货币增强集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 2、华泰紫金货币增强集合资产管理计划补充协议
- 2、华泰紫金货币增强集合资产管理计划托管协议
- 3、管理人业务资格批复、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07月21日