

# 华泰紫金鼎造福桑梓集合资产管理计划 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：中国银行股份有限公司

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。

中国证监会对“华泰紫金鼎伞型集合资产管理计划造福桑梓计划”（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具批准文件（文号：证监许可〔2008〕828号），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

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。

托管人中国银行股份有限公司于2016年7月15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	华泰紫金鼎造福桑梓
产品类型	混合型
产品合同生效日	2008年10月27日
成立规模	241,288,201.23
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

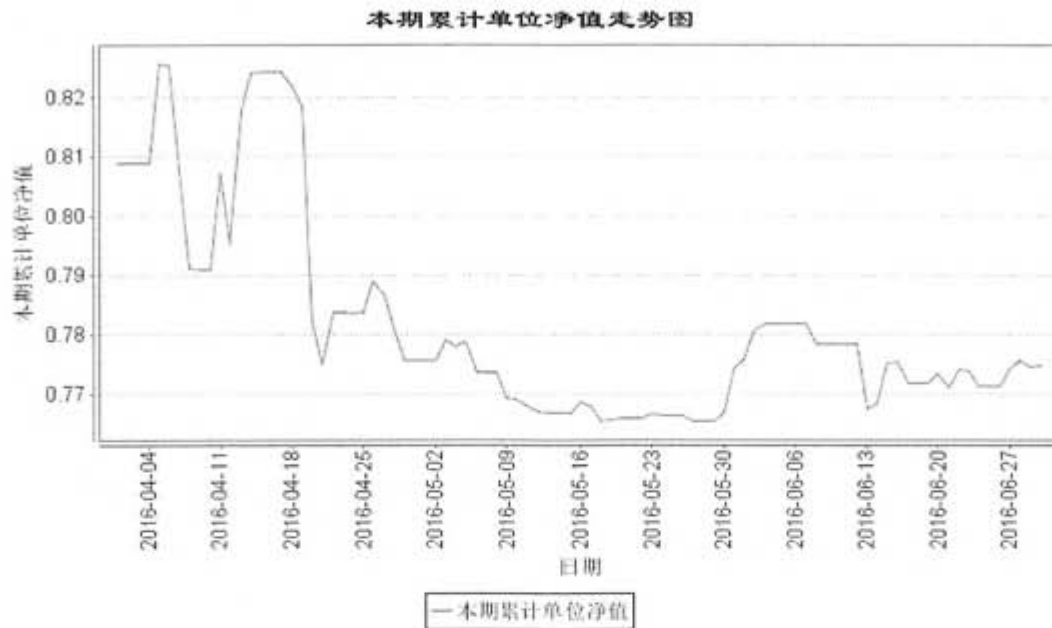
## § 3 主要财务指标和产品净值表现

### 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	705,647.20
2. 本期利润	-1,097,406.77
3. 单位资产净值	0.7448
4. 期末资产总值	17,568,647.05
5. 期末资产净值	17,174,846.93
6. 本期产品份额净值增长率	-5.88%

### 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		
孙谦	投资经理	2015-07-20	2016-04-26	14	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。
俞天甲	投资经理	2016-04-27		6	浙江大学理学学士，悉尼大学经济学硕士。曾担任财通证券、日信证券家电、零售行业研究员，尚雅投资高级研究员，以及Pinpoint基金副基金经理职务。现任华泰证券（上海）资产管理公司投资经理。

### 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

2016年第二季度，A股主要指数在底部横盘震荡，呈现整理的态势。投资者信心逐步开始恢复。我们坚持以价值投资为主线，自下而上发掘个股，以成长股为主，维持中低仓位水平操作。

#### 4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2016年三季度，市场外部利空因素逐步减少，国外市场也趋于稳定，预计指数会有一个阶段性的反弹。但是目前市场整体估值约40倍，高于以往熊市底部20倍的水平，且宏观环境的差异不足以支撑目前的估值水平。从中期来看，市场还处于熊市下行过程中，估值收敛的趋势还未走完。综合考虑，未来出现结构性行情的可能性较大。配置的行业会集中在高成长的行业上，仓位水平提升至中高仓位进行操作。

### § 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	934,756.68	5.32
2	股票	5,227,171.00	29.75
3	债券及资产支持证券	-	-
4	证券投资基金	5,267,389.78	29.98
5	其他资产	6,139,329.59	34.94
6	合计	17,568,647.05	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	600373 SH	中文传媒	40,700.00	844,525.00	4.92
2	600028 SH	中国石化	158,100.00	746,232.00	4.34
3	601939 SH	XD 建设银	145,200.00	689,700.00	4.02
4	601588 SH	北辰实业	151,900.00	648,613.00	3.78
5	002589 SZ	瑞康医药	17,700.00	543,567.00	3.16
6	300351 SZ	永贵电器	15,800.00	536,094.00	3.12
7	300219 SZ	鸿利光电	34,000.00	529,720.00	3.08
8	000718 SZ	苏宁环球	30,000.00	392,700.00	2.29
9	300299 SZ	富春通信	10,000.00	275,100.00	1.60
10	601611 SH	中国核建	1,000.00	20,920.00	0.12

### 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（份）	公允价值（元）	占产品资产净值比例（%）
1	270004 OTC	广发货币 A	1,363,014.10	1,363,014.10	7.94

2	110006 OTC	易基货币 A 级	1,302,253.80	1,302,253.80	7.58
3	482002 OTC	工银瑞信货 币	1,302,121.88	1,302,121.88	7.58
4	288101 OTC	华夏货币 A	1,300,000.00	1,300,000.00	7.57

## § 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	23,676,869.21
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	618,428.52
报告期期末产品份额总额	23,058,440.69

## § 7 备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华泰紫金鼎伞型集合资产管理计划推广的文件
- 2、华泰紫金鼎伞型集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 3、华泰紫金鼎伞型集合资产管理计划托管协议
- 4、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](mailto: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

