华泰紫金3号集合资产管理计划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。

中国证监会对“华泰紫金3号”集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具批准文件（文号：证监机构字[2007]36号）及核准变更资产管理合同重要条款及延长存续期的批复（文号：证监许可[2012]321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。

托管人已于2016年7月19日复核了本报告。本报告未经审计。

管理人、托管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3号
产品类型	混合型
产品合同生效日	2007年03月06日
成立规模	3,479,216,636.16
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

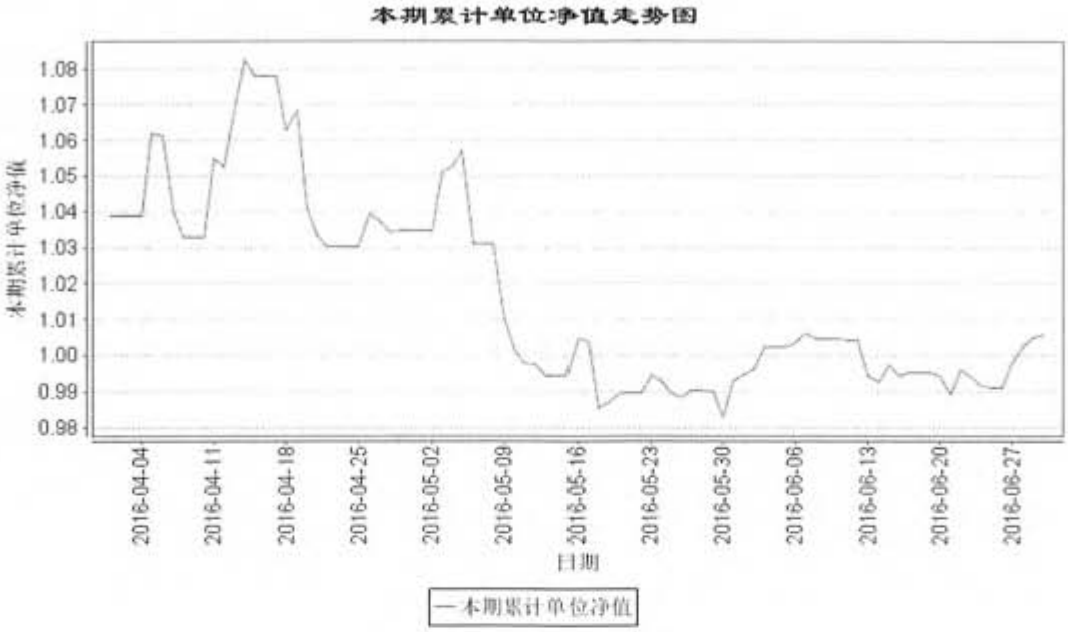
§3 主要财务指标和产品净值表现

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	-5,911,690.86
2.本期利润	-4,133,063.21
3.单位资产净值	0.7045
4.期末资产总值	94,849,734.35
5.期末资产净值	92,240,698.81
6.本期产品份额净值增长率	-4.27%

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	2014-09-22		15	经济学硕士，曾在华泰联合证券担任行业与公司研究员，从事行业与公司研究，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

2016 年 2 季度，经历熔断机制等多重打击之后，加之经济复苏认定为 L 型，市场信心不足，沪深股指进入窄幅震荡，其中上证指数、中小板指数、创业板指数分别较上季末上涨-2.47%、0.41%与-0.47%。2016 年第 2 季度投资操作中，坚持以价值投资为主线，由下而上深度发掘个股，但对主题、概念、次新股的参与不足，加之脱欧、加息、人民币贬值等因素扰动，产品的净值波动较大，更为严重的是，波动过程中减仓不及时，本季产品净值下跌 4.27%，跌幅高于上证指数。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2016 年 3 季度，证券市场外部大的不确定性因素在消退，市场走稳的预期在增加，投资者参与的热情在恢复，市场存在走出阶段性行情的基础，不过我们对其涨幅仅持谨慎乐观的态度。对此，在未来 1 个季度，将坚持价值投资的理念，采取中等仓位操作，对中报业绩增长明显增长的公司、具备真正高成长潜质的公司进行深度挖掘，对周期性、新能源、教育等行业进行深入研究，对国企改革、员工增持、定向增发等相关主题投资板块予以关注，同时要做好热点板块的跟踪，建立均衡配置格局。

§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	11,890,866.14	12.54
2	股票	70,958,595.41	74.81
3	债券及资产支持证券	-	-
4	证券投资基金	11,993,287.54	12.64
5	其他资产	6,985.26	0.01
6	合计	94,849,734.35	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	000881 SZ	大连国际	248,000.00	5,473,360.00	5.93
2	300230	永利股份	160,000.00	4,652,800.00	5.04

	SZ				
3	000078 SZ	海王生物	570,000.00	4,235,100.00	4.59
4	600728 SH	佳都科技	408,500.00	3,970,620.00	4.30
5	300345 SZ	红宇新材	350,000.00	3,661,000.00	3.97
6	002541 SZ	鸿路钢构	190,900.00	3,289,207.00	3.57
7	300359 SZ	全通教育	100,000.00	2,966,000.00	3.22
8	600010 SH	包钢股份	1,000,000.00	2,860,000.00	3.10
9	300213 SZ	佳讯飞鸿	98,163.00	2,772,123.12	3.01
10	600315 SH	上海家化	96,100.00	2,771,524.00	3.00

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	150194 SZ	互联网 A	7,000,000.00	6,993,000.00	7.58
2	150205 SZ	国防 A	2,994,800.00	3,000,789.60	3.25
3	001605 OTC	国富成长股票	1,904,283.11	1,999,497.27	2.17
4	150240 SZ	150240 SZ	1.00	0.67	-

§6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	133,907,315.00
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	2,967,793.24
报告期期末产品份额总额	130,939,521.76

§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3号集合资产管理计划推广的文件

2、中国证监会批准华泰紫金3号变更资产管理合同重要条款及延长存续期的批复

3、华泰紫金3号集合资产管理计划说明书、资产管理合同

4、华泰紫金3号集合资产管理计划托管协议

5、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