

华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理 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：中国工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。

托管人已于 2016 年 7 月 8 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	华泰紫金中证 800 指数增强
产品类型	股票型
产品合同生效日	2013 年 05 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

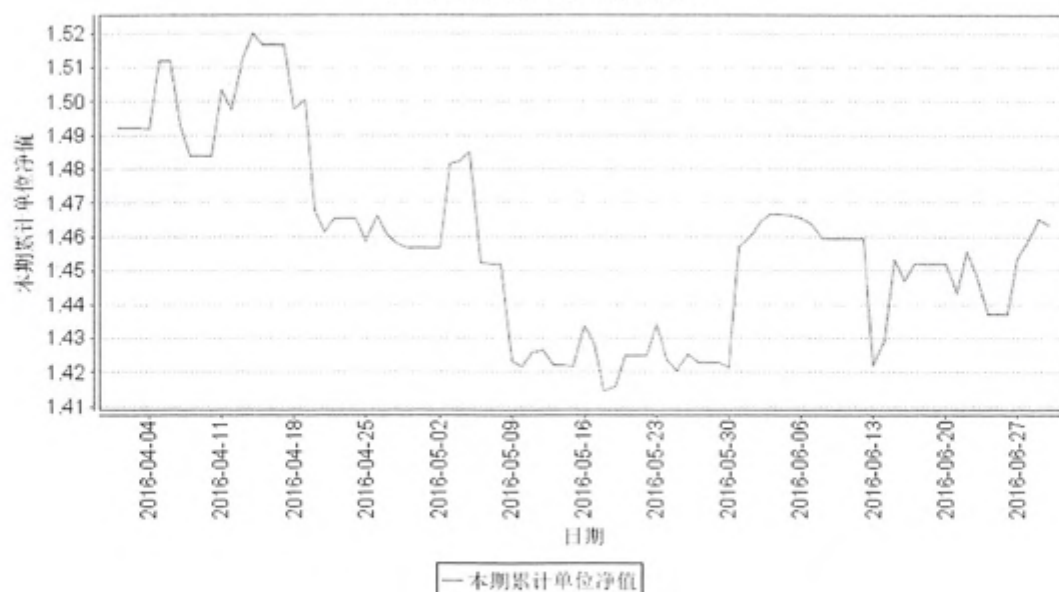
3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2016 年 04 月 01 日 - 2016 年 06 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-127,984.59
2. 本期利润	-151,791.45
3. 单位资产净值	1.1271
4. 期末资产总值	6,209,601.22
5. 期末资产净值	6,203,455.62
6. 本期产品份额净值增长率	-1.95%

3.2 本期累计单位净值走势图

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	2013-05-28	2016-05-23	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。
高缔杰	投资经理	2016-05-24		5	工学硕士，研究方向为金融工程。2012年加入华泰证券，先后担任资产管理部金融工程研究员、量化投资岗等职。2015年进入华泰证券（上海）资产管理有限公司权益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 2 季度，A 股指数在美联储加息预期、是否纳入 MSCI、英国“脱欧”等大事件中徘徊，整体 A 股市场环境弱势。2016 年 2 季度中证 800 指数下跌-1.55%，相对于 1 季度跌幅明显趋缓。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 6 月 30 日产品单位净值为 1.1271，累计单位净值为 1.4635（期间进行了分红），2 季度产品净值回撤约-1.95%，落后于标的指数。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场 2 季度下跌趋势趋缓，以横盘形式展开震荡，题材股包括新能源汽车产业链、稀土永磁、半导体等出现了明显赚钱效应，说明存量资金博弈氛围下，大部分资金青睐于少量股票，场内投资者愿意为真正具有确定性成长的优质公司买单。但因国内经济形势以及外围市场动荡的因素，投资者的信心修复时间仍然会较长，包括对国内外宏观经济基本面的担忧，以及对中小创高估值的担忧，这些因素综合之下存在着对中长期市场看法上的分歧，而短期形成了一个相对均衡的博弈，操作难度上有所加大。

3 季度市场可能延续当前震荡格局，个股机会比指数机会更多，优质公司的估值有望进一步提升，而落后公司或将面临长期的低迷。3 季度，我们将坚持综合运用量化分析及传统基本面相结合的方法，寻找相对确定机会，好中择优，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	350,236.44	5.64
2	股票	5,859,345.90	94.36
3	债券及资产支持证券	-	-
4	证券投资基金	1.95	-
5	其他资产	16.93	-
6	合计	6,209,601.22	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	601318 SH	中国平安	5,000.00	160,200.00	2.58
2	002366 SZ	台海核电	2,500.00	133,275.00	2.15
3	002048 SZ	宁波华翔	5,700.00	130,359.00	2.10
4	000002 SZ	万科A	5,200.00	127,036.00	2.05
5	600016 SH	民生银行	13,400.00	119,662.00	1.93
6	002601 SZ	佰利联	8,000.00	111,600.00	1.80
7	600705 SH	中航资本	18,000.00	105,840.00	1.71
8	603118 SH	共进股份	2,500.00	101,725.00	1.64
9	601166 SH	兴业银行	6,200.00	94,488.00	1.52
10	600058 SH	五矿发展	5,000.00	93,850.00	1.51

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	165511 SZ	信诚 500	1.00	1.18	-
2	160219 SZ	国泰医药	1.00	0.77	-

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	5,579,159.93
报告期期间产品总申购份额	3,857.22
减：报告期期间产品总赎回份额	79,250.32
报告期期末产品份额总额	5,503,766.83

§ 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

