

华泰紫金 2 号集合资产管理计划 2016 年年 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：2017 年 03 月 30 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 2 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（2006）121 号）和延长存续期的批复（文号：证监许可（2011）1102 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 2017 年 3 月 20 日复核了本报告。

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

2.1 基本信息

产品简称	华泰紫金 2 号
产品类型	FOF 型
产品合同生效日	2006 年 08 月 07 日
成立规模	2,110,279,343.53
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

2.2 管理人

2.2.1 基本情况

名称	华泰证券(上海)资产管理有限公司
地址	中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 楼
法定代表人	张海波
成立时间	2014-10-16
注册资本	2,600,000,000.00

2.2.2 发展状况

华泰证券(上海)资产管理有限公司成立于 2014 年 10 月 16 日，注册资本 26 亿元，是华泰证券股份有限公司的全资子公司。公司前身为华泰证券股份有限公司资产管理总部，早在 1999 年开始从事资产管理业务。截至 2016 年 12 月末，公司资产管理总规模 8,833.20 亿元。2016 年本公司累计实现营业收入 19.41 亿元，营业利润 12.53 亿元，净利润 10.16 亿元，年末公司净资产 43.66 亿元；合计口径计算，累计实现营业收入 20.09 亿元，营业利润 12.75 亿元，净利润 10.32 亿元。中国证券投资基金业协会发布的统计数据显示，截至 2016 年 12 月末，公司资产管理业务总规模、资产管理业务净收入行业排名分别为第二、

第五。一年来，公司紧紧抓住资产管理行业特点，克服资本市场波动的影响，敏锐捕捉发展机会，通过前瞻性的战略布局、科学的产品决策、有效的风险防控，全面提升公司的整体实力和管理水平，为良好经营业绩的取得及长期可持续发展奠定了坚实基础。

2.3 托管人

名称	招商银行股份有限公司
地址	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人	李建红

2.4 会计师事务所简介

名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
地址	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼层
合伙人	王国蓓
电话	01085085000
传真	01085185111

§ 3 主要财务指标和产品净值表现

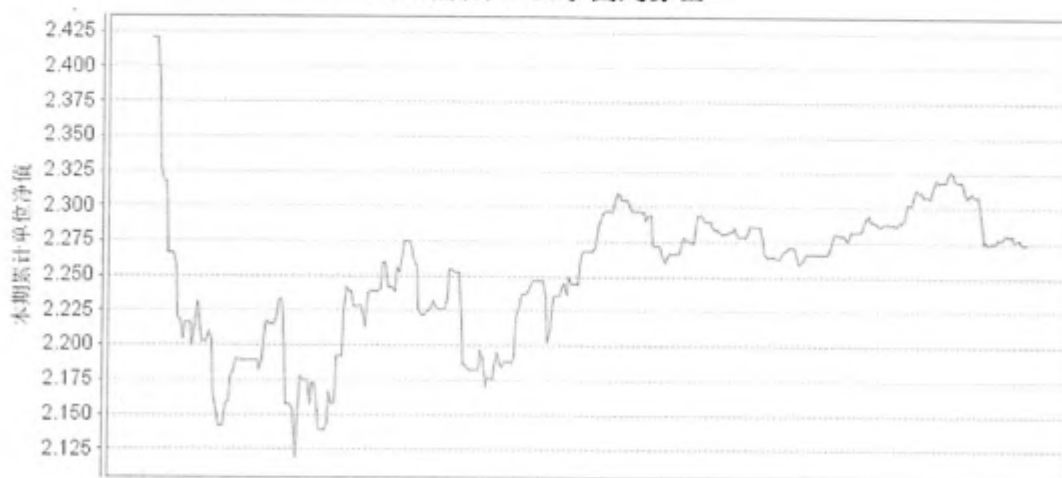
3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2016 年 01 月 01 日 - 2016 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	-7,310,159.49
2. 本期利润	-19,165,927.18
3. 单位资产净值	1.0724
4. 期末资产总值	145,326,038.29
5. 期末资产净值	145,099,622.60
6. 本期产品份额净值增长率	-11.92%

3.2 本期累计单位净值走势图

本期累计单位净值走势图



— 本期累计单位净值

§ 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		
王婧	投资经理	2013-10-23		6	澳洲国立大学市场研究学和美国圣约瑟夫大学金融学双硕士。2009年入职法国安盛集团长岛分部从事基金研究工作，2010年入职华泰证券，先后从事医药行业研究、定向主办助理、定向账户主办和集合产品主办助理工作，具有较丰富的投资管理经验。

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，期间因集合计划规模变动等因外部因素导致比例被动超限的，均已按规定调整；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年市场从“熔断”开始，随后全年窄幅震荡，全年沪深300跌幅-11.28%，紫金2号跌幅为-11.92%。市场从2015年股灾下来，开年又遭遇熔断，极大影响了市场人气，降低了投资者风险偏好程度及投资信心。同时从基本面上来看，美元步入加息周期，汇率承压，国内流动性难以进一步宽松。不过国家财政政策积极，政府对供给侧改革决心坚定，

因此全年周期股及部分蓝筹股走出较好的结构化行情。紫金 2 号全年谨慎投资，多以均衡配置为主，力求取得风险可控的稳健收益。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，美元加息周期带来的汇率压力、国内去杠杆压力犹存，同时通胀压力抬头，判断货币环境将偏紧。投资方面，受到地产下行拖累，经济增速仍有小幅下行的风险。但一方面资产荒及负债端收益率压力会继续延续到 2017 年，以保险为首的机构有资产配置的需求，另一方面国家将继续保持积极的财政政策，改革决心坚决。因此我们对市场走势短线偏谨慎，中线相对较乐观。在基金配置上，仍将采取周期和成长均衡配置的方式来分散市场风险。同时紫金 2 号也将根据市场情况积极把握市场的波动节奏，力求在控制风险的前提下博取超额收益。

§ 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	61,777,735.41	42.51
2	股票	-	-
3	债券及资产支持证券	-	-
4	证券投资基金	83,527,432.25	57.48
5	其他资产	20,870.63	0.01
6	合计	145,326,038.29	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（%）
-	-	-	-	-	-

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	519704 OTC	交银先进制造	3,739,336.65	8,020,877.11	5.53
2	150205 SZ	国防 A	8,000,000.00	7,888,000.00	5.44
3	150209 SZ	国企改 A	7,000,000.00	6,930,000.00	4.78
4	150182 SZ	富国军工	5,001,718.00	5,486,884.65	3.78
5	040035 OTC	华安逆向混合	2,001,008.94	5,268,656.54	3.63
6	000523 OTC	国投瑞银医疗保健	3,000,000.00	5,130,000.00	3.54
7	200012 OTC	长城中小盘成长	4,328,138.53	5,029,296.97	3.47
8	001397 OTC	建信精工制造指数增强	4,716,101.86	5,028,779.41	3.47
9	160512 OTC	博时卓越品牌	2,081,314.46	5,003,479.96	3.45
10	000408 OTC	民生加银城镇化混合	3,854,279.11	4,999,000.01	3.45

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	142,976,685.63
报告期期间产品总申购份额	75,428,284.16
减：报告期期间产品总赎回份额	83,098,208.47
报告期期末产品份额总额	135,306,761.32

§ 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 2 号集合资产管理计划推广的文件
- 2、中国证监会核准华泰紫金 2 号集合资产管理计划延长存续期的批复
- 3、“华泰紫金 2 号”集合资产管理计划说明书、资产管理合同
- 4、“华泰紫金 2 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
2017-03-30

