

华泰紫金中证 800 指数增强集合资产管理 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：中国工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。

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

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	中国工商银行股份有限公司
地址	北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人	易会满

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

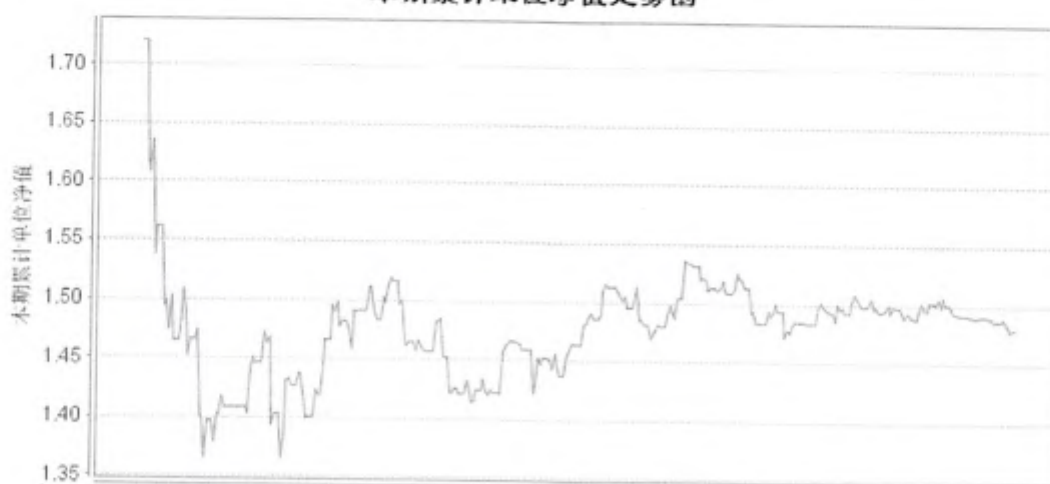
3.1 主要财务指标

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	-509,275.84
2. 本期利润	-1,284,252.18
3. 单位资产净值	1.1432
4. 期末资产总值	857,771.80
5. 期末资产净值	853,566.22
6. 本期产品份额净值增长率	-16.11%

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		
高缔杰	投资经理	2016-05-24		6	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。
张弘	投资经理	2013-05-28	2016-05-24	16	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

回顾 2016 年，宏观经济存在下行压力，GDP 增速从高速增长阶段步入到相对稳定的

中高速增长阶段。房地产政策的收紧，也要求寻找到新的经济增长点。“稳增长”成为经济增长的重要标准。

回顾 A 股市场，2016 年的市场主要跌幅产生于 1 季度，2 季度市场恐慌性情绪好转，在 3 季度和 4 季度沪深 300 指数出现一定回升，但期间仍出现过单日大跌的系统性风险。2016 年全年主要指数均出现下跌，其中上证指数（-12.31%），深证成指（-19.64%），创业板指（-27.71%），沪深 300 指数（-11.28%），中证 500 指数（-17.78%），中证 800 指数（-13.27%）。产品在 2016 年收益率为（-16.11%）。

投资策略上，因产品规模较小，在防范产品流动性风险的同时，管理人积极调整了策略，通过采取量化选股和传统选股相结合的方法，使得产品的单位净值在 2 季度-3 季度出现了震荡回升，4 季度后降低了产品的单位净值波动水平。

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 2017 年，国内宏观经济环境预计变化不大，美元进入加息周期后，黄金价格难现中级别的机会，货币环境相对之前更宽松的可能性也不大，债市在经过显著调整后可能步入到修整期，从估值角度出发，股市已具备相对配置价值。结构上看，“供给侧改革”、“混合所有制改革”、“债转股”等符合国家政策导向的板块或个股具备一定的投资机会。部分优质的中小创成长股在估值达到合理水平后，也可能具备投资机会。

投资方法上我们将继续坚持运用量化分析与传统投资相结合的方法，通过寻找确定机会，好中择优，在控制组合风险的前提下，力争促使产品净值稳健增长。

§ 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	481,486.74	56.13
2	股票	376,203.50	43.86
3	债券及资产支持证券	-	-
4	证券投资基金	2.01	-
5	其他资产	79.55	0.01
6	合计	857,771.80	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	002707 SZ	众信旅游	4,200.00	65,310.00	7.65
2	300207 SZ	欣旺达	2,985.00	41,491.50	4.86
3	000977 SZ	浪潮信息	1,800.00	38,160.00	4.47

4	600525 SH	长园集团	1,480.00	20,646.00	2.42
5	600282 SH	南钢股份	6,500.00	20,150.00	2.36
6	601555 SH	东吴证券	1,500.00	19,905.00	2.33
7	300008 SZ	天海防务	800.00	19,512.00	2.29
8	601088 SH	中国神华	1,200.00	19,416.00	2.27
9	600126 SH	杭钢股份	2,300.00	19,320.00	2.26
10	601186 SH	中国铁建	1,600.00	19,136.00	2.24

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	1.23	-
2	160219 SZ	国泰医药	1.00	0.78	-

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	5,553,812.86
报告期期间产品总申购份额	286,814.65
减：报告期期间产品总赎回份额	5,093,997.23
报告期期末产品份额总额	746,630.28

§ 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

2017-03-30

