

华泰紫金鼎锦上添花集合资产管理计划 2017年第3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：2017年10月27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《实施细则》）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锦上添花子计划”（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2017年10月25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	华泰紫金鼎锦上添花
产品类型	FOF型
产品合同生效日	2009年03月19日
成立规模	1,769,267,358.01
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

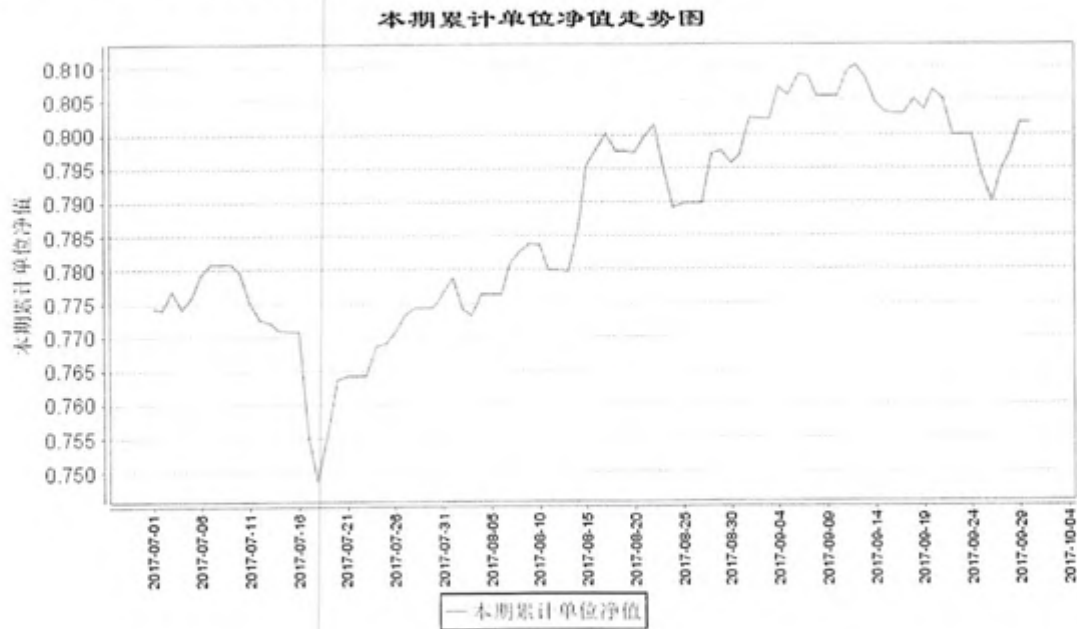
§ 3 主要财务指标和产品净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期	
	(2017年07月01日 - 2017年09月30日)	
1. 本期已实现收益		-121,047.43
2. 本期利润		935,868.65
3. 单位资产净值		0.7717
4. 期末资产总值		26,824,554.56
5. 期末资产净值		25,867,262.00
6. 本期产品份额净值增长率		3.68%

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		
王婧	投资经理	2016-04-27		7	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

资金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

2017年三季度市场震荡上行，其中以有色金属、钢铁为代表的周期股涨幅超前，以计算机、电子为代表的成长股也止跌反弹。截至季度末，沪深300涨幅4.63%，锦上添花涨幅为3.69%。虽然三季度市场总体较为活跃，投资者情绪略有回温，但鉴于经济增速见顶回落的概率较大，同时市场依然处在存量博弈的格局，所以锦上添花依旧采取分散化投资策略，以防御型配置为主，并没有积极进攻。

鉴于有色金属、钢铁为代表的周期股疯狂上涨，短期涨幅过大，故锦上添花并没有追涨参与。四成股票仓位延续分散化投资策略，从组合的角度出发，以均衡配置为主，精选个股进行投资，行业上覆盖汽车、医药、电子、化工等多行业，并没有显著侧重，均衡配置能够避免产品风险过于集中暴露于单一行业。锦上添花基金仓位主要集中于价值型基金，同时配置了部分量化基金。价值股在今年以来一直表现优异，配置的基金为产品贡献了较大收益。产品投资策略在三季度表现良好，产品净值回升。

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，从经济上来看，7-8月经济数据已经有所回落，预计本轮库存周期已接近尾声，未来经济见顶回落的概率较大。同时货币政策稳健中性的总基调难有调整，但边际存在改善的可能。四季度，十九大临近召开，深化改革预期升温，届时市场风险偏好有望回暖。因此我们对市场走势短线偏乐观，中线保持谨慎。锦上添花在股票配置上，仍将延续以往策略，均衡配置，分散化投资，将关注白马蓝筹股行情的延续，以及优质成长股的投资机会，主题上将重点关注国企改革和军工改革。同时锦上添花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	4,526,363.39	16.87
2	股票	8,558,968.68	31.91
3	债券及资产支持证券	-	-
4	证券投资基金	13,738,484.88	51.22
5	其他资产	737.61	-
6	合计	26,824,554.56	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	300408 SZ	三环集团	31,800.00	781,962.00	3.02
2	300373 SZ	扬杰科技	33,400.00	758,848.00	2.93
3	300104 SZ	乐视网	42,000.00	643,860.00	2.49
4	600176 SH	中国巨石	45,000.00	515,700.00	1.99
5	002356 SZ	赫美集团	20,000.00	506,200.00	1.96
6	002027 SZ	分众传媒	50,000.00	502,500.00	1.94
7	002101 SZ	广东鸿图	20,000.00	470,800.00	1.82
8	300129 SZ	泰胜风能	60,000.00	460,800.00	1.78
9	002583 SZ	海能达	25,000.00	414,750.00	1.60
10	300231 SZ	银信科技	30,000.00	384,900.00	1.49

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	001637 OTC	嘉实腾讯自选股大数据策略股票	1,861,660.76	2,140,909.87	8.28
2	160918 OTC	大成小盘	1,079,300.53	2,084,129.32	8.06
3	000866 OTC	华宝兴业制造股票	1,516,806.21	1,953,646.40	7.55
4	159915 SZ	创业板	811,800.00	1,445,004.00	5.59
5	512680 SH	军工基金	1,301,300.00	1,177,676.50	4.55
6	165523 OTC	信诚中证信息安全指数分级	1,193,548.39	1,032,419.36	3.99
7	165522 OTC	信诚中证TMT产业主题指数分级	1,250,312.89	1,025,256.57	3.96
8	165315 OTC	建信网金融分级	1,284,558.07	976,906.41	3.78
9	150206 SZ	国防B	588,278.00	620,633.29	2.40
10	150182 SZ	富国军工	563,200.00	512,512.00	1.98

§ 6 产品份额变动

单位：份

报告期期初产品份额总额	34,573,763.15
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	1,054,621.37
报告期期末产品份额总额	33,519,141.78

§ 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：htam_report@htsc.com

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年10月27日

