

海通赢家系列-月月赢集合资产管理计划季度资产管理报告

(2013年1月1日-2013年3月31日)

一、重要提示

本报告依据《证券公司客户资产管理业务试行办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》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海通赢家系列-月月赢集合资产管理计划（以下为“本集合计划”或“本计划”）资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。托管人上海银行根据本集合计划合同规定于2013年4月19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。

本报告财务数据未经审计。

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。

二、集合计划概况

计划名称：海通赢家系列-月月赢集合资产管理计划

计划类型：限定性集合资产管理计划

成立日期：2012年12月24日

成立规模：221,722,472.36份

报告期末计划总份额：2,244,047,322.36份

存续期：本计划不约定固定存续期限，未设计展期安排。

开放日：本集合计划不设封闭期，自产品成立日起进入开放期。

产品分级结构：本集合计划分级份额包括优先级和风险级份额。本集合计划优先级采用周期概念，按照投资期限，分为1个月周期，3个月周期和6个月周期，优先级份额享受约定收益，约定收益率由管理人确定，并提前在管理人指定网站公告，风险级份额以其份额资产为限承担风险，享有全部剩余收益。

业绩比较基准：无。

风险收益特征：本集合计划为债券型证券投资产品，其中优先级份额为低风险收益品种，风险级份额为中高风险收益品种。

管理人：上海海通证券资产管理有限公司

托管人：上海银行股份有限公司

三、集合计划主要财务指标

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

| | 主要财务指标 | 2013年1月1日—2013年3月31日 |
|----|-----------------------|----------------------|
| 1 | 集合计划本期利润 | 22,781,726.03 |
| 2 | 集合计划本期利润扣减公允价值变动损益后净额 | 14,290,084.25 |
| 3 | 期末集合计划未分配利润 | 28,473,039.35 |
| 4 | 期末集合计划资产总值 | 2,465,398,362.22 |
| 5 | 期末集合计划优先级 851911 资产净值 | 477,588,096.80 |
| 6 | 期末集合计划优先级 851912 资产净值 | 496,771,015.79 |
| 7 | 期末集合计划优先级 851913 资产净值 | 190,997,583.99 |
| 8 | 期末集合计划优先级 851914 资产净值 | 477,773,289.88 |
| 9 | 期末集合计划优先级 851931 资产净值 | 233,963,343.11 |
| 10 | 期末集合计划优先级 851961 资产净值 | 194,524,772.37 |
| 11 | 期末集合计划风险级 851919 资产净值 | 200,902,259.77 |

四、集合计划管理人报告

(一) 投资经理简介

杨贵宾先生，西安交通大学经济学博士，7年金融工作经验，4年债券型基金管理经验。现任海通资产管理固定收益部总监。曾任职于富国基金，所管理的富国天利债券基金曾多次获金牛债券基金奖项。在宏观经济、信用债和可转债投资方面具有丰富经验。现担任海通赢家系列一月月赢集合资产管理计划、海通月月财集合资产管理计划、海通海蓝宝润集合资产管理计划和海通现金赢家集合资产管理计划投资经理。

(二) 投资经理工作报告

一季度，资金面较为宽松，国外QE政策叠加热钱流入。经济基本面总体弱势复苏，物价在2月冲高后3月迅速回落。在这种背景下，债市出现了一轮明显的上涨行情，中途仅在2月CPI高启时出现一次小幅调整，之后在银监会8号文推动下再次上涨。

一季度，月月赢在规模快速膨胀、持有债券资产被迅速摊薄的不利环境下，通过前期快速提高仓位、增配债券杠杆基金等手段，构建了进攻性较强的组合，为持有人带来了较好收益。

展望二季度，我们认为经济仍将持续弱复苏、物价也将维持低位，流动性整体依然中性偏宽松，债市仍有一定投资价值。但经过一季度持续上涨后，债市二季度的上涨幅度不宜高估，且应开始逐渐担忧下半年物价的反弹和股市可能出现的反弹，因此我们在月月赢产品的

策略上将逐渐调整为偏防守的组合，即小幅降低久期，并降低杠杆债券基金的配置比例。

五、集合计划财务会计报告

(一) 集合计划会计报表

日期：2013年3月31日

单位：人民币元

| 资产 | 期末数 | 年初数 | 负债和所有者权益 | 期末数 | 年初数 |
|----------|------------------|----------------|-------------|------------------|---------|
| 资产： | | | 负债： | | |
| 银行存款 | 7,613,045.81 | 6,009,962.25 | 短期借款 | | |
| 结算备付金 | 8,421,309.68 | | 交易性金融负债 | | |
| 存出保证金 | 371,819.26 | | 衍生金融负债 | | |
| 交易性金融资产 | 2,315,470,268.04 | 86,934,359.41 | 卖出回购金融资产款 | 171,814,329.39 | 24,699 |
| 其中：股票投资 | | | 应付证券清算款 | 20,010,936.99 | 5,059 |
| 债券投资 | 1,950,175,248.21 | 53,627,668.31 | 应付赎回款 | | |
| 资产支持证券投资 | | | 应付赎回费 | | |
| 基金投资 | 365,295,019.83 | 33,306,691.10 | 应付管理人报酬 | 860,647.87 | 30 |
| 衍生金融资产 | | | 应付托管费 | 86,064.79 | 3 |
| 买入返售金融资产 | | 280,000,700.00 | 应付销售服务费 | | |
| 应收证券清算款 | 86,987,533.16 | | 应付交易费用 | 32,011.22 | 6 |
| 应收利息 | 46,534,113.30 | 1,908,632.86 | 应付税费 | | |
| 应收股利 | 272.97 | 7,491.20 | 应付利息 | 66,613.15 | |
| 应收申购款 | | | 应付利润 | | |
| 其他资产 | | | 其他负债 | 7,397.10 | |
| | | | 负债合计 | 192,878,000.51 | 29,799 |
| | | | 所有者权益： | | |
| | | | 实收基金 | 2,244,047,322.36 | 344,695 |
| | | | 未分配利润 | 28,473,039.35 | 365 |
| | | | 所有者权益合计 | 2,272,520,361.71 | 345,061 |
| 资产合计： | 2,465,398,362.22 | 374,861,145.72 | 负债与持有人权益总计： | 2,465,398,362.22 | 374,861 |

2、经营业绩表

日期：2013年1月1日至2013年3月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期金额 | 本年累计数 |
|------------------|---------------|---------------|
| 一、收入 | 24,903,019.26 | 24,903,019.26 |
| 1、利息收入 | 14,265,060.31 | 14,265,060.31 |
| 其中：存款利息收入 | 332,654.87 | 332,654.87 |
| 债券利息收入 | 13,263,629.82 | 13,263,629.82 |
| 资产支持证券利息收入 | | |
| 买入返售金融资产收入 | 668,775.62 | 668,775.62 |
| 2、投资收益（损失以“-”填列） | 2,146,317.17 | 2,146,317.17 |
| 其中：股票投资收益 | | |

| | | |
|----------------------|---------------|---------------|
| 债券投资收益 | 255,523.68 | 255,523.68 |
| 资产支持证券投资收益 | | |
| 基金投资收益 | 483,567.22 | 483,567.22 |
| 权证投资收益 | | |
| 衍生工具收益 | | |
| 股利收益 | 1,407,226.27 | 1,407,226.27 |
| 3、公允价值变动损益（损失以“-”填列） | 8,491,641.78 | 8,491,641.78 |
| 4、其他收入（损失以“-”填列） | | |
| 二、费用 | 2,121,293.23 | 2,121,293.23 |
| 1、管理人报酬 | 1,535,929.83 | 1,535,929.83 |
| 2、托管费 | 153,592.95 | 153,592.95 |
| 3、销售服务费 | | |
| 4、交易费用 | 151,642.58 | 151,642.58 |
| 5、利息支出 | 271,373.83 | 271,373.83 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 271,373.83 | 271,373.83 |
| 6、其他费用 | 8,754.04 | 8,754.04 |
| 三、利润总额 | 22,781,726.03 | 22,781,726.03 |

（二）集合计划投资组合报告

1、资产组合情况

单位：人民币元

| 科目 | 期末市值 | 占期末总资产比例(%) |
|------------|------------------|-------------|
| 银行存款和清算备付金 | 16,034,355.49 | 0.65% |
| 交易保证金 | 371,819.26 | 0.01% |
| 股票投资 | - | 0.00% |
| 债券投资 | 1,950,175,248.21 | 79.10% |
| 基金投资 | 365,295,019.83 | 14.82% |
| 买入返售证券 | - | 0.00% |
| 应收证券清算款 | 86,987,533.16 | 3.53% |
| 其他资产 | 46,534,386.27 | 1.89% |
| 资产合计： | 2,465,398,362.22 | 100.00% |

2、按市值占集合计划资产净值比例前十名企业债券投资明细

单位：人民币元

| 序号 | 科目代码 | 科目名称 | 数量 | 市值 | 市值占净值比 |
|----|--------|---------|--------------|----------------|--------|
| 1 | 122805 | 11 大同债 | 1,009,940.00 | 104,013,720.60 | 4.58% |
| 2 | 122840 | 11 临汾债 | 656,750.00 | 69,214,882.50 | 3.05% |
| 3 | 124050 | 12 榆城投债 | 500,000.00 | 50,960,000.00 | 2.24% |
| 4 | 122579 | 09 远洋债 | 500,000.00 | 50,425,000.00 | 2.22% |
| 5 | 111047 | 08 长兴债 | 449,628.00 | 48,703,704.96 | 2.14% |
| 6 | 122593 | 12 衡城投 | 461,790.00 | 47,790,647.10 | 2.10% |
| 7 | 122802 | 11 辽阳债 | 410,350.00 | 42,278,360.50 | 1.86% |

| | | | | | |
|----|--------|----------|------------|---------------|-------|
| 8 | 122932 | 09 宣城债 | 337,180.00 | 35,424,130.80 | 1.56% |
| 9 | 122937 | 10 辽源债 | 332,150.00 | 35,317,509.50 | 1.55% |
| 10 | 112126 | 12 科伦 01 | 342,029.00 | 34,647,537.70 | 1.52% |

3、按市值占集合计划资产净值比例前五名银行间短期融资债券投资明细

| 序号 | 科目代码 | 科目名称 | 数量 | 市值 | 市值占净值比 |
|----|-----------|---------------|------------|---------------|--------|
| 1 | 041371001 | 13 华邦 CP001 | 400,000.00 | 40,064,000.00 | 1.76% |
| 2 | 041364011 | 13 众品 CP001 | 300,000.00 | 30,015,000.00 | 1.32% |
| 3 | 041260059 | 12 欧菲光 CP001 | 200,000.00 | 20,056,000.00 | 0.88% |
| 4 | 041358028 | 13 现代牧业 CP001 | 200,000.00 | 20,036,000.00 | 0.88% |
| 5 | 041359018 | 13 常熟风范 CP001 | 200,000.00 | 20,020,000.00 | 0.88% |

4、按市值占集合计划资产净值比例前五名银行间企业债券投资明细

| 序号 | 科目代码 | 科目名称 | 数量 | 市值 | 市值占净值比 |
|----|---------|---------------|--------------|----------------|--------|
| 1 | 1080090 | 10 蚌埠城投债 | 1,500,000.00 | 147,735,000.00 | 6.50% |
| 2 | 1380097 | 13 天保投控小微债 01 | 800,000.00 | 79,952,000.00 | 3.52% |
| 3 | 1380030 | 13 绍兴城改债 | 500,000.00 | 50,650,000.00 | 2.23% |
| 4 | 1280036 | 12 临安城建债 | 400,000.00 | 42,168,000.00 | 1.86% |
| 5 | 1280074 | 12 济城建债 | 300,000.00 | 31,686,000.00 | 1.39% |

5、按市值占集合计划资产净值比例前五名银行间中期票据投资明细

| 序号 | 科目代码 | 科目名称 | 数量 | 市值 | 市值占净值比 |
|----|---------|-------------|------------|---------------|--------|
| 1 | 1282108 | 12 豫投资 MTN1 | 700,000.00 | 70,602,000.00 | 3.11% |
| 2 | 1382069 | 13 曲文投 MTN1 | 600,000.00 | 59,934,000.00 | 2.64% |
| 3 | 1282404 | 12 玖龙 MTN1 | 500,000.00 | 50,310,000.00 | 2.21% |
| 4 | 1382101 | 13 沁和集 MTN1 | 400,000.00 | 40,092,000.00 | 1.76% |
| 5 | 1282048 | 12 魏桥 MTN1 | 300,000.00 | 30,732,000.00 | 1.35% |

6、按市值占集合计划资产净值比例前五名指数型基金投资明细

单位：人民币元

| 序号 | 科目代码 | 科目名称 | 数量 | 市值 | 市值占净值比 |
|----|--------|---------------|---------------|---------------|--------|
| 1 | 150022 | 申万收益 | 14,000,000.00 | 11,284,000.00 | 0.50% |
| 2 | 511010 | 国泰上证 5 年期 ETF | 100,000.00 | 9,983,300.00 | 0.44% |

7、按市值占集合计划资产净值比例前五名债券型基金投资明细

单位：人民币元

| 序号 | 科目代码 | 科目名称 | 数量 | 市值 | 市值占净值比 |
|----|--------|------|---------------|---------------|--------|
| 1 | 150021 | 汇利 B | 42,920,165.00 | 58,800,626.05 | 2.59% |

| | | | | | |
|---|--------|------|---------------|---------------|-------|
| 2 | 161010 | 富国天丰 | 38,436,769.72 | 40,243,297.90 | 1.77% |
| 3 | 161115 | 易基岁丰 | 34,664,327 | 35,426,942.19 | 1.56% |
| 4 | 150043 | 裕祥 B | 26,256,971 | 32,978,755.58 | 1.45% |
| 5 | 150026 | 景丰 B | 25,893,535 | 24,857,793.60 | 1.09% |

8、按市值占集合计划资产净值比例前五名开放式货币型基金投资明细

单位：人民币元

| 序号 | 科目代码 | 科目名称 | 数量 | 市值 | 市值占净值比 |
|----|--------|--------|------------|------------|---------|
| 1 | 110006 | 易基货币 A | 197,720.94 | 197,720.94 | 0.0087% |

9、其他投资明细

单位：人民币元

| 序号 | 科目代码 | 科目名称 | 市值 | 市值占净值比 | 备注 |
|----|--------|-------|---------------|--------|-----|
| 1 | 131801 | R-007 | 56,081,857.91 | 2.47% | 正回购 |
| 2 | 204014 | GC014 | 39,999,800.00 | 1.76% | 正回购 |
| 3 | 204004 | GC004 | 29,999,940.00 | 1.32% | 正回购 |
| 4 | 204007 | GC007 | 14,999,962.50 | 0.66% | 正回购 |
| 5 | 131802 | R-014 | 14,571,926.73 | 0.64% | 正回购 |

(三) 集合计划份额变动

| 序号 | 名称 | 期初总份额 | 本期参与份额 | 本期退出份额 | 期末总份额 |
|----|--------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 1 | 851961 | 191,722,472.36 | - | - | 191,722,472.36 |
| 2 | 851911 | 107,973,176.00 | 570,602,904.00 | 201,735,250.00 | 476,840,830.00 |
| 3 | 851912 | - | 616,948,183.00 | 121,788,807.00 | 495,159,376.00 |
| 4 | 851913 | - | 345,624,283.00 | 155,086,079.00 | 190,538,204.00 |
| 5 | 851914 | - | 702,383,395.00 | 224,955,424.00 | 477,427,971.00 |
| 6 | 851931 | - | 233,336,850.00 | - | 233,336,850.00 |
| 7 | 851919 (风险级) | 45,000,000.00 | 134,021,619.00 | - | 179,021,619.00 |

六、重要事项揭示

- (一) 在本报告期内本集合计划管理人和托管人没有发生变更；
- (二) 在本报告期内本集合计划管理人或托管人没有受到重大处罚；
- (三) 在本报告期内本集合计划没有发生重大诉讼、仲裁事项；

七、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、《海通赢家系列-月月赢集合资产管理计划说明书》
- 2、《海通赢家系列-月月赢集合资产管理计划合同》
- 3、《海通赢家系列-月月赢集合资产管理计划托管协议》
- 4、 管理人业务资格批件、营业执照

(二) 查阅方式

网址：www.htsec.com

信息披露电话：4008-888-001

文件存放地点：上海市广东路689号海通证券大厦32层

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人上海海通证券资产管理有限公司。

上海海通证券资产管理有限公司

2013年4月18日



