
华安理财五号日日赢集合资产管理计划
2013年第三季度资产管理报告



二〇一三年十月

目 录

重要提示.....	1
一、集合资产管理计划简介.....	1
二、主要财务指标.....	2
(一) 主要财务指标.....	2
(二) 收益分配情况.....	2
三、集合计划管理人报告.....	2
(一) 投资主办简介.....	2
(二) 投资主办工作报告.....	2
(三) 风险控制报告.....	4
四、集合计划财务报告.....	5
(一) 集合计划会计报表.....	5
(二) 集合计划投资组合报告.....	7
(三) 集合计划份额变动.....	7
五、重要事项提示.....	7
六、备查文件目录.....	7
(一) 本集合计划备查文件目录.....	7
(二) 存放地点及查阅方式.....	8

华安理财五号日日赢集合资产管理计划

2013 年第三季度资产管理报告

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》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及其他有关规定制作。

华安证券股份有限公司已按照报送中国证券监督管理委员会的《华安理财五号集合资产管理计划合同》、《华安理财五号集合资产管理计划说明书》及其相关协议向委托人进行推广。

集合计划托管人于 2013 年 10 月 16 日复核了本报告中的财务指标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。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

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。

本报告期起止时间：2013 年 5 月 28 日—2013 年 9 月 30 日

一、集合资产管理计划简介

产品名称：华安理财5号日日赢集合资产管理计划

产品类型：限定性集合资产管理计划

集合计划管理人：华安证券股份有限公司

集合计划托管人：兴业银行股份有限公司

成立日期：2013年5月28日

成立规模：118,023,602.33

报告期末规模：115,363,526.46

二、主要财务指标

(一) 主要财务指标 (单位: 元)

集合计划本期净收益	2,090,424.14
期末集合计划资产净值	115,363,526.46
期末年化收益率	5.31%



(二) 收益分配情况

报告期内, 集合计划向持有人分配收益 1,760,614.25 元。

三、集合计划管理人报告

(一) 投资主办简介

唐泳, 男, 法学硕士, 证券从业经验 11 年, 偏重于固定收益品种的投资, 对现金管理产品投资运行和风险控制有着较为深刻的理解。

樊艳, 女, 工商管理硕士, 证券从业 14 年, 擅长大类资产配置, 择时择股能力较强, 注重投资风险管控。

(二) 投资主办工作报告

1、市场和投资工作回顾

6 月底市场流动性极度紧张、资金价格飙升, 三季度货币市场资金价格明显回落, 但整体水平高于上半年。

7 月债券市场在资金价格抬升、信用风险释放等因素综合影响下, 延续 6 月跌势, 特别是交易所债券市场中大量低评级债券遭遇评级下调后, 该类债券整体

出现幅度较大的下跌。8 月后随着经济数据在短期内企稳，资金价格相对前期也有所回落，交易所债券市场总体表现平稳，部分超跌券种出现了一定程度的反弹。同期银行间市场受国家审计署启动对地方政府债务开展全面审计事件的影响，投资者对城投债系统性风险的担忧开始加剧，收益率出现较为陡峭的上升，随着季末资金价格的抬升，银行间市场债券一直处于调整状态，市况较为疲弱。

三季度里，本集合计划保持持仓结构基本稳定，按货币市场和债券市场波动节奏，适度调整产品配置：资金价格较高时增加回购交易，债券市场跌幅较大时适量增配债券。产品收益较稳定。

2、市场展望和投资计划

近期公布的宏观经济数据显示经济趋稳，但中期来看经济内生恢复的动力和外部刺激的效果仍显不足。CPI 受翘尾因素影响，四季度温和回升，但大幅回升的可能性较低。

利率市场化进程加快，会拉动资金成本逐步提高。美国 QE 退出从预期向现实切换，对国内流动性的影响也将逐渐体现。本届政府的政策重点已从稳增长转换为深化改革，通过释放流动性刺激经济的粗放式手段已经被摒弃，目前央行正通过多种货币工具，谨慎严密的控制和调节资金量，四季度市场资金面仍将维持紧平衡状态，在一些关键时点上，资金价格仍有可能大幅上升，现金类资产配置价值提升。

债券市场在三季度经历了长端利率债收益率快速上行，十年期国债破四的过程，无风险利率的快速升高，也带动了信用产品收益率的抬升，但信用利差并未显著扩大。四季度，利率产品可能会因为短期内的超调，而进入震荡整理阶段，但因为无风险利率的中枢被抬高，信用产品的收益率很难大幅回落，如果四季度供给加大，则可能会主动拉大信用利差。在券种选择方面，经济复苏初期，政府支持企业，龙头企业，优质城投主体都可能受益于市场超调后的震荡行情；同时，也要警惕信用事件和评级下调的风险。可转债将受益于经济复苏和股市回暖的拉动，存在交易性机会。但整体上债市出现趋势性转向的动力仍显不足。

基于以上对于货币市场和债券市场的判断，本集合计划在投资方面将采取相对谨慎策略，兼顾流动性和收益率，结合集合计划的规模变动和资金价格走势，及时调整各大类品种持仓比重。

（三）风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

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。

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和业务部门内设的风险控制岗位，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与风险管理部日常监控、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资产管理业务部门内控和风险管理部外部监控来进行。为加强资产管理业务的风险管理，集合计划管理人资产管理部作为资产管理业务的执行部门，全面负责资产管理业务的内部风险控制管理。风险管理部作为公司层面的风险控制部门，严格按照中国证监会资产管理业务风险监管标准，以及公司相关制度和《华安理财五号日日赢集合资产管理计划资产管理合同》的规定，对华安理财五号日日赢产品开展风险管理工作，采用逐日监控、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。

四、集合计划财务报告

(一) 集合计划会计报表

1、集合计划资产负债表

日期：2013-09-30

单位：元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
资 产：		负 债：	
银行存款	4,372,245.64	短期借款	0.00
结算备付金	936,909.09	交易性金融负债	0.00
存出保证金	111,719.54	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	92,340,162.67	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	2,000,000.00
债券投资	86,249,580.23	应付赎回款	833,137.15
基金投资	6,090,582.44	应付管理人报酬	77,788.99
权证投资	0.00	应付托管费	7,695.30
资产支持证券 投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	1,277.90
买入返售金融资产	11,600,830.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	0.00	应付利息	0.00
应收利息	3,440,304.01	应付利润	19,100.02
应收股利	0.00	其他负债	0.00
应收申购款	5,500,354.87	负债合计	2,938,999.36
其他资产	0.00		
		所有者权益：	
		实收基金	115,363,526.46
		未分配利润	0.00
		所有者权益合计	115,363,526.46
资产合计	118,302,525.82	负债和所有者权益总计	118,302,525.82

2、集合计划经营业绩表

日期：2013 年 05 月 — 2013 年 09 月

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	2,156,895.70	2,156,895.70
2	1、利息收入	1,989,314.93	1,989,314.93
3	其中：存款利息收入	172,515.46	172,515.46
4	债券利息收入	1,760,634.90	1,760,634.90
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	56,164.57	56,164.57
7	2、投资收益	167,580.77	167,580.77
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	-59,530.94	-59,530.94
10	基金投资收益	0.00	0.00
11	权证投资收益	0.00	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
13	衍生工具收益	0.00	0.00
14	股利收益	227,111.71	227,111.71
15	3、公允价值变动收益	0.00	0.00
16	4、其他收入	0.00	0.00
17	二、费用	66,471.56	66,471.56
18	1、管理人报酬	0.00	0.00
19	2、托管费	31,327.42	31,327.42
20	3、销售服务费	0.00	0.00
21	4、交易费用	0.00	0.00
22	5、利息支出	33,242.64	33,242.64
23	其中：卖出回购金融资产支出	33,242.64	33,242.64
24	6、其他费用	1,901.50	1,901.50
25	三、利润总和	2,090,424.14	2,090,424.14

(二) 集合计划投资组合报告 (2013 年 9 月 30 日)

序号	资产类别	市 值 (元)	占总资产的比例 (%)
1	股票		
2	基金	6,090,582.44	5.15%
3	债券	86,249,580.23	72.91%
4	权证		
5	资产支持证券		
6	货币市场工具 (票据、CD)		
7	现金 (银行存款及清算备付金)	5,309,154.73	4.49%
8	银行定期存款 (定期存款、通知存款、大额存单)		
9	其他资产 (交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等)	20,653,208.42	17.46%
10	资产合计	118,302,525.82	100.00%

(三) 集合计划份额变动 (单位: 份)

期初集合计划份额总额	118,023,602.33
报告期内集合计划参与份额	251,271,203.62
报告期内集合计划退出份额	253,931,279.49
报告期末集合计划份额总额	115,363,526.46

五、重要事项提示

- (一) 报告期内, 集合计划管理人、托管人没有发生变更;
- (二) 报告期内, 集合计划管理人、托管人没有受到重大处罚;
- (三) 报告期内, 集合计划管理人、托管人没有发生任何涉及本集合计划的诉讼、仲裁事项。

六、备查文件目录

(一) 备查文件目录

- 1、《华安理财五号日日赢集合资产管理计划合同》
- 2、《华安理财五号日日赢集合资产管理计划说明书》
- 3、《华安理财五号日日赢集合资产管理计划托管协议》

4、《华安理财五号日日赢集合资产管理计划验资报告》

5、管理人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点及查阅方式

查阅地址：安徽省合肥市政务区南二环路959号财智中心B座601室

网址：<http://www.hazq.com>

信息披露电话：0551-65161852

联系人：于玲玲

投资者对本报告如有疑问，可咨询管理人华安证券股份有限公司资产管理部。

华安证券股份有限公司

二〇一三年十月十六日