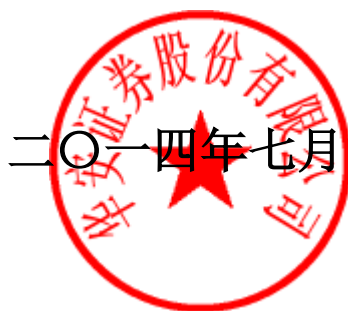


华安理财安赢套利 1 号限额特定集合资产管理计划 2014 年第二季度资产管理报告



目 录

重要提示.....	1
一、集合资产管理计划简介.....	1
二、主要财务指标和集合计划净值表现.....	2
(一) 主要财务指标.....	2
(二) 自集合计划合同生效以来集合计划份额净值的变动情况, 并与同期业绩比较基准的变动的比较.....	3
三、集合计划管理人报告.....	3
(一) 业绩表现.....	3
(二) 投资主办简介.....	3
(三) 投资主办工作报告.....	4
(四) 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(2014 年 6 月 30 日).....	7
(三) 集合计划份额变动.....	8
五、备查文件目录.....	8
(一) 本集合计划备查文件目录.....	8
(二) 存放地点及查阅方式.....	8

华安理财安赢套利 1 号限额特定集合资产管理计划

2014 年第二季度资产管理报告

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。

中国证券业协会对本集合计划出具了备案文件（《关于华安证券股份有限公司发起设立华安理财安赢套利1号限额特定集合资产管理计划的备案确认函》中证协函【2013】651号），但中国证监会和中国证券业协会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会和中国证券业协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：2014 年 4 月 1 日—2014 年 6 月 30 日

一、集合资产管理计划简介

产品名称：华安理财安赢套利 1 号限额特定集合资产管理计划

产品类型：限额特定集合资产管理计划

集合计划管理人：华安证券股份有限公司

集合计划托管人：交通银行股份有限公司

成立日期：2013 年 5 月 16 日

成立规模：70,915,669份

存续期：3 年

二、主要财务指标和集合计划净值表现

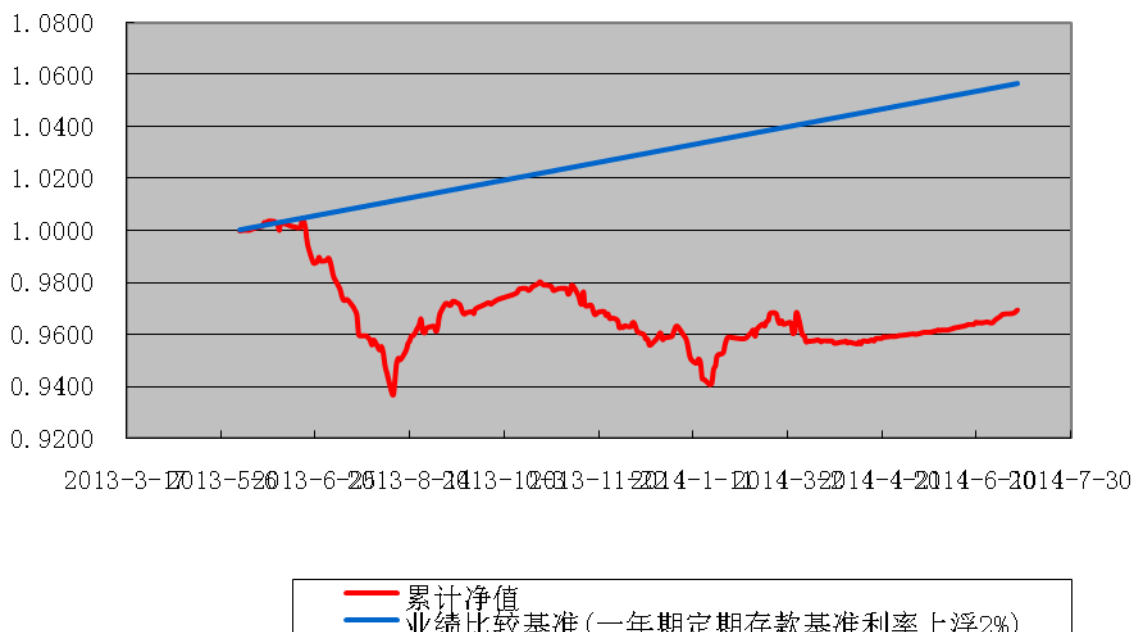
(一) 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2014 年 4 月 1 日—2014 年 6 月 30 日
本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	278,381.88
本期利润	466,784.39
其中：本期公允价值变动损益	188,402.51
加权平均份额本期利润	0.009
加权平均净值利润率	0.96%
本期单位净值增长率	1.16%
期末可分配利润	-930,758.30
期末可供分配份额利润	-0.0345
期末资产净值	26,106,594.39
期末单位资产净值	0.9682
单位累计净值增长率	-3.18%

注：所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 自集合计划合同生效以来集合计划份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较



集合计划累计份额净值增长率与业绩基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 5 月 16 日 至 2014 年 6 月 30 日)

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，集合计划单位净值为 0.9682 元，本期净值增长率为 1.16%，累计净值增长率为-3.18%。

(二) 投资主办简介

张雷，男，经济学博士，证券从业经验 10 年，擅长于低风险类产品的投资，对套利对冲、固定收益投资有较为丰富的经验。

李庆科，男，数量经济学硕士，相关研究投资工作经验 5 年，专注于量化对冲投资，投资风格稳健。

（三）投资主办工作报告

1、投资回顾

整个二季度，成分股大量分红，存在着一定的套利机会，我们抓住了这些机会，并配合以现金管理、分级基金、新股申购等投资手段，在极低的风险下取得了 1.16% 的收益，并且实现了周净值无回撤，同期沪深 300 指数上涨 0.8%。

2、投资管理展望

二季度国内货币政策明确转向定向宽松，逐步发挥托底作用，各项经济指标已显示企稳信号，加之人民币贬值及外需恢复拉动因素，三季度宏观经济应无大碍。但在现有的微刺激框架下，宏观经济的远虑仍然难以消除。由于货币政策的转向以及货币需求的回落，去年以来资金市场的紧张状况已显著缓解。分级基金 A 端存在着一定的投资机会。

量化投资群雄逐鹿，不同类型模型各显神通。我们将始终坚持低风险的投资理念，不断优化组合配置，实时监控套利模型表现，并根据市场变化及时调整相关模型和参数，以期取得低风险条件下的预期收益。

（四）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管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》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《华安理财安赢套利 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的规定，对华安理财安赢套利 1 号开展风险管理工作，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（2014 年 6 月 30 日） 单位：人民币元

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	109,684.76	短期借款	0.00
结算备付金	2,457,941.54	交易性金融负债	0.00
存出保证金	312,933.77	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	11,148,772.55	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	1,951,702.90	应付证券清算款	108,010.53
债券投资	0.00	应付赎回款	0.00
基金投资	9,197,069.65	应付管理人报酬	0.00
权证投资	0.00	应付托管费	5,346.11
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	11,734.00
买入返售金融资产	12,100,121.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	102,890.84	应付利息	0.00
应收利息	839.72	应付利润	0.00

应收股利	2,083.45	其他负债	3,582.60
应收申购款	0.00	负债合计	128,673.24
其他资产	0.00		
		所有者权益:	
		实收基金	26,963,012.60
		未分配利润	-856,418.21
		所有者权益合计	26,106,594.39
资产合计	26,235,267.63	负债和所有者权益总计	26,235,267.63

集合计划资产负债表（附注）

单位：人民币元

股指期货投资			2014年6月30日	
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF1407	IF1407	-3	-1,938,420	-7,404.00
总额合计				-7,404.00

2、集合计划经营业绩表（2014年4月1日至2014年6月30日）

单位：人民币元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	690,504.66	699,063.84
1、利息收入	168,704.17	920,308.17
其中：存款利息收入	7,512.12	15,939.66
债券利息收入	122,260.27	788,007.15
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	38,931.78	116,361.36
2、投资收益	333,397.98	-3,335,872.49
其中：股票投资收益	87,122.04	-156,758.78
债券投资收益	2,050.00	-4,088,756.10
基金投资收益	-145,818.33	-125,284.53
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	51,025.79	499,771.50
股利收益	339,018.48	535,155.42
3、公允价值变动收益	188,402.51	3,114,628.16
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	223,720.27	386,504.37
1、管理人报酬	0.00	0.00
2、托管费	30,453.44	72,336.93

3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	175,148.42	294,269.82
5、利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
6、其他费用	18,118.41	19,897.62
三、利润总和	466,784.39	312,559.47

(二) 集合计划投资组合报告 (2014 年 6 月 30 日)

1、资产组合情况

序号	资产类别	市值 (元)	占总资产的比例 (%)
1	股票	1,951,702.90	7.44%
2	基金	9,197,069.65	35.06%
3	债券		
4	其中：央票		
5	国债		
6	政策性金融债		
7	金融债（商业银行次级债、商业银行普通债券、证券公司短期融资券、其他金融债券）		
8	企业债		
9	企业短期融资券		
10	可转债		
11	权证		
12	资产支持证券		
13	货币市场工具（票据、CD）		
14	现金（银行存款及清算备付金）	2,567,626.30	9.79%
15	银行定期存款（定期存款、通知存款、大额存单）		
16	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）	12,518,868.78	47.72%
17	其中：买入返售证券	12,100,121.00	46.12%
18	资产合计	26,235,267.63	100.00%

2、按市值占净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	股票市值（元）	占期末净值比例
201	601318	中国平安	2,000.00	78,680.00	0.30%
202	600016	民生银行	11,280.00	70,048.80	0.27%
203	600036	招商银行	6,800.00	69,632.00	0.27%
204	601166	兴业银行	4,700.00	47,141.00	0.18%
205	600000	浦发银行	4,600.00	41,630.00	0.16%
206	600030	中信证券	2,900.00	33,234.00	0.13%
207	000002	万科A	4,000.00	33,080.00	0.13%
208	600519	贵州茅台	220.00	31,235.60	0.12%
209	600837	海通证券	3,400.00	31,110.00	0.12%
210	000651	格力电器	1,000.00	29,450.00	0.11%
合计			40,900.00	465,241.40	1.78%

（三）集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
70,915,669	0	43,952,656.4	26,963,012.6

五、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

1. 华安理财安赢套利 1 号限额特定集合资产管理计划说明书
2. 华安理财安赢套利 1 号限额特定集合资产管理计划资产管理合同
3. 华安理财安赢套利 1 号限额特定集合资产管理计划风险揭示书
4. 华安理财安赢套利 1 号限额特定集合资产管理计划托管协议
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 B1 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
二〇一四年七月十日





客服电话：96518（安徽） 4008096518（全国）

资产管理部客服电话：0551-5161852

公司网址：<http://www.hazq.com>