

财通证券股份有限公司  
财通证券财丰1号集合资产管理计划  
季度管理报告  
(2014 年三季度)

计划管理人：财通证券股份有限公司

计划托管人：招商银行股份有限公司

报告期间：2014 年 7 月 1 日—2014 年 9 月 30 日

## 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人财通证券股份有限公司依据《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。

财通证券财丰1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”或“本计划”）于2013年5月20日成立，并向中国证券业协会及中国证监会浙江监管局备案，但中国证券业协会及中国证监会浙江监管局对本集合计划做出的任何决定，均不表明其对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明客户参与本集合计划没有风险。

托管人已于2014年10月21日对本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告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。

本报告涉及《财通证券财丰1号集合资产管理计划管理合同》（以下简称《管理合同》）及《财通证券财丰1号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）的相关内容若与《管理合同》及《说明

书》中的相关内容不一致，以最新的《管理合同》及《说明书》为准。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2014年7月1日—2014年9月30日

## 一、集合计划简介

### （一）基本资料

名称：财通证券财丰1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2013年5月20日

成立规模：47,105,058.00份

存续期：无固定管理期限

管理人：财通证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

### （二）管理人

名称：财通证券股份有限公司

设立日期：2003年6月

办公地址：浙江省杭州市杭大路15号

法定代表人：沈继宁

公司网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

### （三）托管人

名称：招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：黄晓霞

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

公司网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

## 二、 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	本季度
1	集合计划本期利润（元）	3,763,370.49
2	集合计划本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	3,310,823
3	期末集合计划资产净值（元）	16,879,508.12
4	期初单位集合计划资产净值（元）	1.021
5	期末单位集合计划资产净值（元）	1.334
6	期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.334
7	本期集合计划单位净值增长率	23.46%
8	集合计划累计净值增长率	33.40%

注：本集合计划本期内未分红

### (二) 财务指标计算公式

1. 期末单位集合计划资产净值 = 期末集合计划资产净值 ÷ 集合计划期末份额
2. 期末单位集合计划累计资产净值 = 期末单位集合计划资产净值 + 单位集合计划累计分红值
3. 本期集合计划单位净值增长率 = (本期分红前一天产品单位资产

净值 ÷ 期初产品单位资产净值) × {期末产品单位资产净值 ÷ (本期分红前一天产品单位资产净值 - 分红金额)} - 1

4. 集合计划累计净值增长率 = (第一次分红前一天产品单位资产净值 ÷ 期初产品单位资产净值) × {第二次分红前一天产品单位资产净值 ÷ (第一次分红前一天产品单位资产净值 - 第一次分红金额)} × {第三次分红前一天产品单位资产净值 ÷ (第二次分红前一天产品单位资产净值 - 第二次分红金额)} × …… × {期末产品单位资产净值 ÷ (第N次分红前一天产品单位资产净值 - 第N次分红金额)} - 1

### (三) 收益分配情况

集合计划成立以来，收益分配情况：

分配红利日期	每10份集合计划分红	备注
-	-	本期未分配收益

### (四) 开放期

开放期为集合计划封闭期满后每月前3个工作日。

### (五) 管理人提取业绩报酬情况

本期管理人提取业绩报酬0.00元。

### 三、 集合计划管理人报告

#### （一） 业绩表现

本集合计划于2013年5月20日成立，截至2014年9月30日，集合计划单位净值为1.334元，累计净值为1.334元。

#### （二） 投资经理简介

蔡立辉先生，北京交通大学工学学士，武汉大学工商管理硕士。先后在国元证券股份有限公司资产管理部（2002.2-2004.3）、万家基金基金管理部（2004.3-2007.2）、汇丰晋信基金投资部（2007.2-2011.2）、中信证券股份有限公司交易与衍生产品部（2011.3-2012.2）从事证券研究、投资管理等工作。2012年4月加入财通证券股份有限公司资产管理部，任财通证券资产管理部副总经理、投资总监，11年证券从业经验。

#### （三） 投资经理工作报告

2014年第三季度，宏观经济波澜不惊，整体呈现底部震荡回升的态势，尽管7月份部分经济数据出现波折，但宏观政策整体偏松，为股票市场提供了较好的外部环境。与此同时，在沪港通和十八届四中全会改革政策良好预期的推动下，股市出现了较大的反弹，沪深300指数上涨13.2%，代表中小市值股票的中证500指数上涨了25.3%，均



取得了较大的涨幅，尤其是中小市值个股涨幅普遍较大。

财丰1号在三季度整体保持了比较积极的策略，股票仓位处于较高的水平。在操作上，基于经济数据企稳反弹和沪港通预期的考虑，三季度前半部分我们以低估指的大盘蓝筹股为主要持仓，行业主要集中在金融、地产、军工和部分分级基金。三季度后半部分，我们观察到经济数据出现反复，将持仓风格转向中小盘成长股，尤其是具有转型预期的中小盘成长股，行业主要集中在计算机、机械和化工等行业。在这种策略的指导下，财丰1号三季度产品净值增长35.4%，取得了较好的收益。

四季度，随着宏观政策的逐渐放松，股市系统性风险不大，整体可以保持比较积极的策略。但是，也需要注意沪港通和四中全会改革政策的预期已经在相关行业和个股得到了比较充分的反映，并重视预期差可能对市场产生的冲击。在持仓机构上，继续保持转型成长股的配置，并逐渐加大2014年整体业绩有可能超出市场预期的个股的挖掘，为年报行情做好准备。

#### （四）内部性声明

##### 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》、《管理办法》、《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设立独立的风险控制部门，对集合理财业务进行事前审核、事中监控，日常对集合资产管理业务的重大事项进行风险评估，并提出风险控制措施。风险管理部还对业务授权、投资交易的执行情况进行监控，控制业务运作过程中存在的风险。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

我们认为，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《管理合同》及《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) 资产负债表 (2014年9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
<b>资 产：</b>		<b>负 债：</b>	
银行存款	5,932,794.13	短期借款	0.00
结算备付金	266,010.70	交易性金融负债	0.00
存出保证金	21,533.56	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	10,720,049.73	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	10,720,049.73	应付证券清算款	0.00
债券投资	0.00	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	6,758.43
权证投资	0.00	应付托管费	3,379.24
资产支持证券投资	0.00	应付投资咨询费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	24,169.74
买入返售金融资产	0.00	应付税收	0.00
应收证券清算款	0.00	应付利息	0.00
应收利息	1,216.77	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	27,789.36
应收申购款	0.00	<b>负债合计</b>	<b>62,096.77</b>
其他资产	0.00		
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	12,655,597.94
		未分配利润	4,223,910.18
		<b>持有人权益合计</b>	<b>16,879,508.12</b>
<b>资产合计</b>	<b>16,941,604.89</b>	<b>负债及持有人权益总计</b>	<b>16,941,604.89</b>

## (二) 利润表 (2014年7月1日-2014年9月30日)

单位: 人民币元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	3,946,816.44	4,270,055.01
2	1、利息收入	14,870.45	103,146.11
3	其中: 存款利息收入	7,020.64	34,129.34
4	债券利息收入	0.00	0.00
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	7,849.81	69,016.77
7	2、投资收益	3,479,398.50	3,802,482.92
8	其中: 股票投资收益	3,401,734.00	3,759,914.86
9	债券投资收益	0.00	0.00
10	基金投资收益	77,664.50	32,568.06
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	0.00	10,000.00
15	3、公允价值变动收益	452,547.49	364,425.98
16	4、其他收入	0.00	0.00
17	二、费用	183,445.95	407,661.25
18	1、管理人报酬	17,297.60	55,104.79
19	2、托管费	8,648.78	27,552.33
20	3、销售服务费	0.00	0.00
21	4、交易费用	160,121.99	321,316.50
22	5、利息支出	0.00	0.00
23	其中: 卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
24	6、其他费用	-2,622.42	3,687.63
25	三、利润总和	3,763,370.49	3,862,393.76

## (三) 净值变动表 (2014年7月1日 - 2014年9月30日)

单位: 人民币元

项目	本期数			上期数		
	实收基金	未分配利润	所有者权益	实收基金	未分配利润	所有者权益
一、期初所有者权益 (基金净值)	10,002,350.00	213,787.63	10,216,137.63	11,001,755.00	-296,538.02	10,705,216.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	0.00	3,763,370.49	3,763,370.49	0.00	488,338.74	488,338.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,653,247.94	246,752.06	2,900,000.00	-999,405.00	21,986.91	-977,418.09
其中: 1. 基金申购款	2,653,247.94	246,752.06	2,900,000.00	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00	-999,405.00	21,986.91	-977,418.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益 (基金净值)	12,655,597.94	4,223,910.18	16,879,508.12	10,002,350.00	213,787.63	10,216,137.63

## 五、集合计划投资组合报告（2014年9月30日）

### （一）资产组合情况

	期末市值（元）	占总资产比（%）
银行存款、清算备付金和证券清算款	6,198,804.83	36.73
存出保证金	21,533.56	0.13
股票投资	10,720,049.73	63.51
债券投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00
权证投资	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收利息	1,216.77	0.01
合计	16,941,604.89	100.00

### （二）股票投资明细（按市值占净值比例大小排序的前十名）

序号	证券代码	证券名称	期末数量 （股）	期末市值（元）	占期末计划 净值的比例（%）
1	002306	中科云网	299,951	3,368,449.73	19.96
2	300098	高新兴	70,000	1,964,900.00	11.64
3	600728	佳都科技	70,000	1,115,800.00	6.61
4	300293	蓝英装备	60,000	975,600.00	5.78

5	002136	安纳达	70,000	805,700.00	4.77
6	300252	金信诺	20,000	706,400.00	4.19
7	000553	沙隆达A	50,000	690,000.00	4.09
8	000630	铜陵有色	50,000	570,000.00	3.38
9	002520	日发精机	20,000	523,200.00	3.10
10	/	/	/	/	/
	合计			10,720,049.73	63.51

(三) 债券投资明细 (按市值占净值比例大小排序的前十名)

序号	证券代码	证券名称	期末数量 (张)	期末市值 (元)	占期末计划 净值的比例 (%)
1	/	/	/	/	/
	合计			0.00	0.00

(四) 基金投资明细 (按市值占净值比例大小排序的前十名)

序号	证券代码	证券名称	期末数量 (份)	期末市值 (元)	占期末计划 净值的比例 (%)
1	/	/	/	/	/
	合计			0.00	0.00

(五) 配股权证投资明细 (按市值占净值比例大小排序的前十名)

本报告期末投资权证, 配股权证期末余额为零。

## 六、集合计划份额变动情况

单位：份

报告期初份额总额	10,002,350.00
报告期内总参与份额	2,653,247.94
报告期内红利再投资份额	0
报告期内总退出份额	0
报告期末份额总额	12,655,597.94



## 七、重要事项提示

- (一) 本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理、财产、托管业务的诉讼事项。
- (二) 本集合计划聘请的会计师事务所没有发生变更。
- (三) 本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。
- (四) 本报告期内集合计划的投资组合策略没有重大改变。
- (五) 本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

## 八、 备查文件目录

### （一）本集合计划备查文件目录

1. 《财通证券财丰1号集合资产管理计划说明书》
2. 《财通证券财丰1号集合资产管理计划管理合同》
3. 《财通证券财丰1号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

财通证券网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

客服电话：96336（浙江）

021-962336（上海）

40086-96336（全国）

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询管理人财通证券股份有限公司。

财通证券股份有限公司

二〇一四年十月二十日