

华安理财五号日日赢集合资产管理计划
2014年第三季度资产管理报告



二〇一四年十月

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
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.....	3
四、集合计划财务报告.....	4
(一) 集合计划会计报表.....	4
(二) 集合计划投资组合报告.....	5
(三) 集合计划份额变动.....	6
五、重要事项提示.....	6
六、备查文件目录.....	6
(一) 本集合计划备查文件目录.....	6
(二) 存放地点及查阅方式.....	7

华安理财五号日日赢集合资产管理计划

2014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:2014年7月1日—2014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

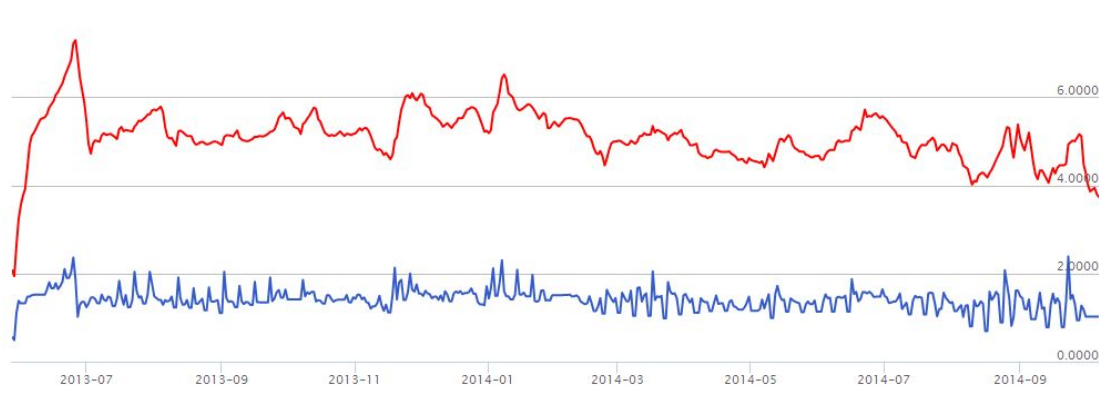
成立规模: 118,023,602.33

报告期末规模: 117,637,439.27

二、主要财务指标

单位：元

集合计划本期净收益	1,523,048.30
期末集合计划资产净值	117,637,439.27
期间年化收益率	4.70%



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

三季度管理层出台了一系列政策引导利率低位运行，资金面延续了相对宽松的格局，7 天期回购多处于 3.5% 左右。宽松的资金面为债券市场提供了良好的环境，债市经历了 7 月的调整以后，8 月开始步入慢牛行情，信用债走势好于利率债。受 IPO 影响，资金价格呈现较明显的阶段性波动特征，债市也随之小幅波动。

本产品秉持高流动性和短久期策略，抓住资金面宽松，债市慢牛的市场机会，在加强流动性管理的基础上，努力随资金和债券市价的反向波动节奏适时调整持

仓结构，提高投资收益，取得了较好的投资效果。

2、市场展望和投资计划

鉴于经济增速下行压力较大，预计未来央行货币政策延续定向宽松方向是大概率事件，IPO 等因素对于资金面仍会产生时点性冲击，债券市场和货币市场均有一定投资机会；但三季报公布期间以及临近年底时段，受信用风险影响，债市可能会产生波动。

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，及时调整持仓结构。

（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：2014 年 9 月 30 日

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	11,631,675.86	短期借款	0.00
结算备付金	642,924.72	交易性金融负债	0.00
存出保证金	23,198.98	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	118,798,280.98	卖出回购金融资产款	12,999,050.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	10,944,762.05
债券投资	76,697,310.14	应付赎回款	256,411.43
基金投资	42,100,970.84	应付管理人报酬	386,561.53
权证投资	0.00	其中：应付风险准备金	342,123.93
资产支持证券投资	0.00	应付托管费	9,700.02
衍生金融工具	0.00	应付销售服务费	0.00
买入返售金融资产	0.00	应付交易费用	5,071.84
应收证券清算款	0.00	应交税费	0.00
应收利息	3,026,762.27	应付利息	870.18
应收股利	130,046.48	应付利润	14,775.84
应收申购款	8,011,340.53	其他负债	9,587.66
其他资产	0.00	负债合计	24,626,790.55
		所有者权益：	
		实收基金	117,637,439.27
		未分配利润	0.00
		所有者权益合计	117,637,439.27
资产合计	142,264,229.82	负债和所有者权益总计	142,264,229.82

2、集合计划经营业绩表

日期：2014 年 7 月 1 日-9 月 30 日

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	1,637,284.79	4,500,076.92
2	1、利息收入	1,300,151.06	3,834,739.30
3	其中：存款利息收入	34,143.37	67,276.88
4	债券利息收入	1,174,666.61	3,670,122.30
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	91,341.08	97,340.12
7	2、投资收益	337,133.73	665,337.62
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	-125,053.45	-416,690.05
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	462,187.18	1,082,027.67
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	114,236.49	412,177.44
18	1、管理人报酬	0.00	0.00
19	2、托管费	26,253.44	66,624.92
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	79,415.61	331,226.86
23	其中：卖出回购金融资产支出	79,415.61	331,226.86
24	6、其他费用	8,567.44	14,325.66
25	三、利润总和	1,523,048.30	4,087,899.48

(二) 集合计划投资组合报告 (2014 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	42,100,970.84	29.59%
3	债券	76,697,310.14	53.91%
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	76,697,310.14	53.91%
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）	12,274,600.58	8.63%
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）	11,191,348.26	7.87%
17	其中：买入返售证券		
18	资产合计	142,264,229.82	100.00%

（三）集合计划份额变动（单位：份）

期初集合计划份额总额	83,220,606.48
报告期内集合计划参与份额	261,814,104.21
报告期内集合计划退出份额	227,397,271.42
报告期末集合计划份额总额	117,637,439.27

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

二〇一四年十月十日