

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 9 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。

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 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

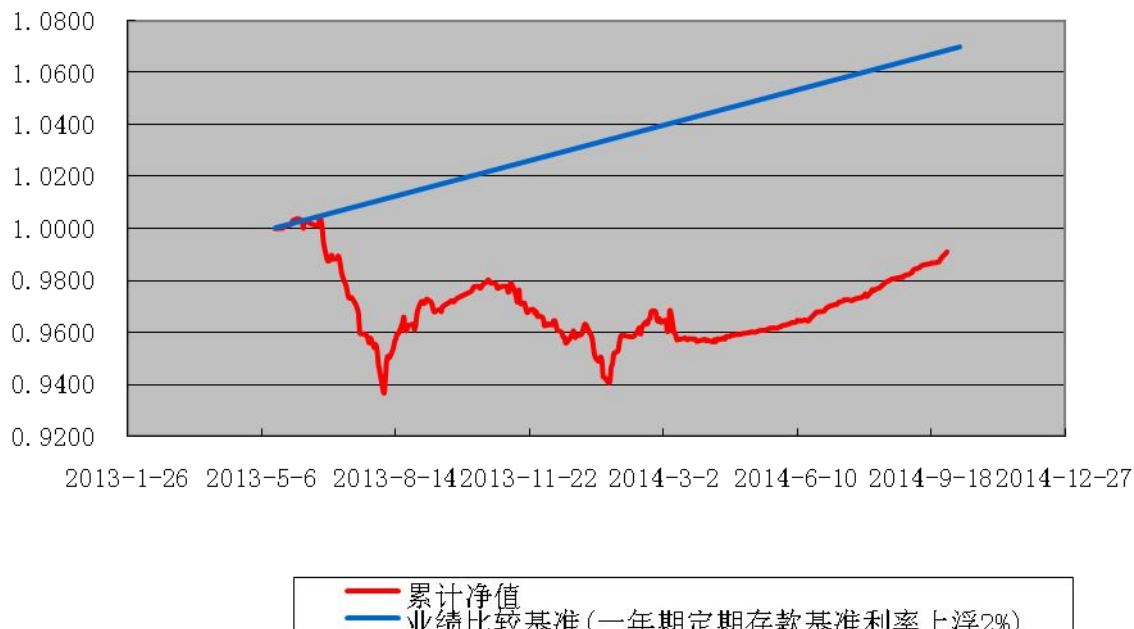
### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2014年7月1日—2014年9月30日
本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	563,256.41
本期利润	613,162.80
其中：本期公允价值变动损益	49,906.39
加权平均份额本期利润	0.0228
加权平均净值利润率	2.33%
本期单位净值增长率	2.37%
期末可分配利润	-361,948.42
期末可供分配份额利润	-0.0135
期末资产净值	26,477,088.34
期末单位资产净值	0.9911

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9月30日）

## 三、集合计划管理人报告

### （一）业绩表现

截至2014年9月30日，集合计划单位净值为0.9911元，本期净值增长率为2.37%。

### （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

第三季度，本产品坚持稳健低风险投资原则，主要以股指期货套利、分级基金 A 端、新股申购等为投资对象，净值增长率为 2.37%，年化收益率 9.48%，继续做到了周净值无回撤。

#### 2、投资管理展望

2014 年四季度，安赢套利 1 号继续坚持低风险投资策略，以股指期货套利和分级基金 A 端为主，同时在承受能力基础上适度提升一些风险度，以增强收益。

股指期货套利方面，积极把握有利行情下的基差套利机会，优化现货组合，适度增加一些阿尔法组合。阿尔法组合主要是在构建全复制组合基础上，在组合内部利用配对交易模型，进行组合内调仓，调仓比例控制在组合市值的 20% 以内。另外，灵活把握股指期货跨期套利机会，适当加大分级基金的配置比例。

### （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 9 月 30 日） 单位：人民币元

资 产：		负 债：	
银行存款	360,150.50	短期借款	0.00
结算备付金	2,172,679.90	交易性金融负债	0.00
存出保证金	826,446.54	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	21,690,625.66	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	74,686.00	应付证券清算款	387,208.70
债券投资	4,996,450.00	应付赎回款	0.00
基金投资	16,619,489.66	应付管理人报酬	0.00
权证投资	0.00	应付托管费	5,411.76
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	16,630.45
买入返售金融资产	0.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	1,610,204.49	应付利息	0.00
应收利息	230,595.28	应付利润	0.00
应收股利	3,928.04	其他负债	8,291.16

应收申购款	0.00	<b>负债合计</b>	417,542.07
其他资产	0.00		
		<b>所有者权益:</b>	
		实收基金	26,715,618.52
		未分配利润	-238,530.18
		<b>所有者权益合计</b>	26,477,088.34
<b>资产合计</b>	26,894,630.41	<b>负债和所有者权益总计</b>	26,894,630.41
<b>资 产:</b>		<b>负 债:</b>	

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9月30日	
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF1410	IF1410	-9	-6,626,340	21,781.22
IF1412	IF1412	1	740,160	-2,460
总额合计				19,321.22

## 2、集合计划经营业绩表（2014年7月1日至2014年9月30日）

单位：人民币元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	765,503.96	1,464,567.80
1、利息收入	160,123.91	1,080,432.08
其中：存款利息收入	3,804.25	19,743.91
债券利息收入	120,821.92	908,829.07
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	35,497.74	151,859.10
2、投资收益	555,473.66	-2,780,398.83
其中：股票投资收益	412,518.16	255,759.38
债券投资收益	0.00	-4,088,756.10
基金投资收益	36,693.14	-88,591.39
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	-47,485.22	452,286.28
股利收益	153,747.58	688,903.00
3、公允价值变动收益	49,906.39	3,164,534.55
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	152,341.16	538,845.53
1、管理人报酬	0.00	0.00



2、托管费	16,567.61	88,904.54
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	130,197.64	424,467.46
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	5,575.91	25,473.53
三、利润总和	613,162.80	925,722.27

## (二) 集合计划投资组合报告 (2014年9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	74,686.00	0.28%
2	基金	16,619,489.66	61.79%
3	债券	4,996,450.00	18.58%
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)	2,532,830.40	9.42%
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)	2,671,174.35	9.93%
17	其中：买入返售证券		
18	资产合计	26,894,630.41	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
1	600018	上港集团	3,800.00	20,140.00	0.08%
2	600547	山东黄金	900.00	14,895.00	0.06%
3	600705	中航投资	600.00	11,298.00	0.04%
4	600010	包钢股份	3,400.00	9,486.00	0.04%
5	600369	西南证券	800.00	8,432.00	0.03%
6	600068	葛洲坝	1,000.00	4,770.00	0.02%
7	601016	节能风电	1,000.00	3,430.00	0.01%
8	300402	宝色股份	500.00	2,235.00	0.01%
合计			12,000.00	74,686.00	0.28%

### 3、按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

序号 5	债券名称	债券市值 (元)	占期末净值比例
1	13 鲁润峰债	4,996,450.00	18.87%
合计		4,996,450.00	18.87%

### (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
26,963,012.6	0	247,394.08	26,715,618.52

## 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

二〇一四年十月十日



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>