

# 长城季季红 1 号集合资产管理计划 2014 年第四季度资产管理报告

管理人：长城证券有限责任公司

托管人：华夏银行股份有限公司

报告期：2014 年 10 月 1 日-2014 年 12 月 31 日



## 第一节 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。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合资产管理计划托管人华夏银行股份有限公司复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期由2014年10月1日起，至2014年12月31日止。

本报告中的内容由管理人负责解释。

## 第二节 集合资产管理计划概况

|           |                                                                                        |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 名称:       | 长城季季红1号集合资产管理计划                                                                        |
| 代码:       | C81001                                                                                 |
| 类型(运作方式): | 限定性                                                                                    |
| 投资目标      | 本计划以投资安全性高、流动性好的固定收益类资产为主，力争在风险可控的前提下，实现资产的长期稳健增值。                                     |
| 投资策略      | 本计划坚持稳健的投资理念，通过深入研究和积极运作，根据组合避险策略做好资产配置，积极发掘低风险投资机会，通过有效的风险管理，获取稳健的绝对收益，力争实现投资人收益的最大化。 |
| 风险收益特征    | 低风险                                                                                    |
| 成立日:      | 2013年4月12日                                                                             |
| 成立规模:     | 131,603,694.96份                                                                        |
| 报告期末份额总额: | 449,685,717.31份                                                                        |
| 管理人:      | 长城证券有限责任公司<br>地址: 深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦14、16、17层                                        |

|      |                                                                                                                         |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | 邮编: 518034<br>电话: (0755) 83516066<br>传真: (0755) 83516229<br>网址: www.cgws.com                                            |
| 托管人: | 华夏银行股份有限公司<br>地址: 北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦<br>邮编: 100005<br>电话: (010) 85238667<br>传真: (010) 85238680<br>网址: www.hxb.com.cn |

### 第三节 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

#### 一、主要财务指标 (单位: 人民币元)

|            |                |
|------------|----------------|
| 期初单位资产净值   | 1.0204         |
| 期末单位资产净值   | 1.0249         |
| 期末单位累计资产净值 | 1.1323         |
| 本期已实现收益    | 8,393,653.60   |
| 期末资产净值     | 460,862,662.48 |

#### 二、收益分配情况

本报告期内, 本集合计划对每10份集合计划份额分红0.186元。

### 第四节 管理人报告

#### 一、业绩表现

截止到 2014 年 12 月 31 日, 集合计划单位净值为 1.0249 元。

#### 二、投资主办人简介

李正红, 工学博士, 10 年固定收益投资管理经验。现任长城证券资产管理部董事总经理, 负责固定收益的资产管理业务。曾任长城人寿保险股份有限公司资产管理中心副总经理兼固定收益部总经理, 民生人寿保险股份有限公司资产管理中心固定收益部总经理。

#### 三、投资策略回顾

2014 年 4 季度经济增速仍继续下行, CPI 低位徘徊, 市场资金面较为宽松, 基本面继续推动债市上涨, 市场收益率水平整体小幅下行。2014 年 4 季度中信

标普全债指数上涨了 3.62%，分品种看，4 季度中信标普国债指数上涨 1.93%，中信标普企业债指数上涨 2.70%，企业债品种涨幅较大。

针对债券市场的上涨机会，长城季季红 1 号积极增加债券资产及债券型基金的投资比例，在投资结构方面，主要以精选信用资质较好收益率较高的信用债及组合收益率偏高且权益仓位较低的债券型基金为主。2014 年 4 季度长城季季红 1 号累计涨幅为 2.08%。

#### 四、投资展望

对于 2015 年 1 季度债券市场总体上保持谨慎乐观的态度。考虑到 2015 年 1 季度国内经济仍然疲弱，CPI 将继续低位徘徊，降息降准的预期增强，基本面仍有利于债市，市场收益率水平仍将继续回落。

2015 年 1 季度我们将继续坚持稳健的投资思路，在关注债券信用风险的前提下，适时调整债券仓位，力争本计划净值实现稳定增长。

我们必将珍惜投资者的每一份信任，本产品将继续奉行规范运作，审慎投资，勤勉尽责的原则，为投资者谋求长期、稳定的回报。

#### 五、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。

#### 六、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，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、风险控制部门日常监控、重点检查的结果。

公司设立独立的风险管理部，通过系统监控和现场检查，对集合资产管理计划的投资风险、契约风险、操作风险、道德风险等进行全面的监督和检查。同时在交易系统中将设置各类风控指标进行限制，实现交易事前控制，确保集合资产

管理计划的合法合规。对日常集合资产管理计划出现的各类问题，风险管理部及时进行风险提示，提出管理建议，并督促相关部门及时整改。

风险管理部对公司各类重要规章制度进行风险评审并参与其业务流程梳理，提出建议，保证业务制度及业务流程的科学、合理，进而规范有序的开展业务。

公司在实行严格的内部风险控制的同时，也接受托管银行、上级监管机构、中介审计机构以及委托人的监督。

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、公司相关制度和本集合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；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

## 第五节 集合计划财务报告

### 一、集合计划资产负债表

金额单位：元

| 资产       | 期末余额           | 负债和所有者权益  | 期末余额           |
|----------|----------------|-----------|----------------|
| 资产：      |                | 负债：       |                |
| 银行存款     | 10,884,827.21  | 短期借款      |                |
| 结算备付金    |                | 交易性金融负债   |                |
| 存出保证金    | 153,596.15     | 衍生金融负债    |                |
| 交易性金融资产  | 438,920,986.74 | 卖出回购金融资产款 |                |
| 其中：股票投资  |                | 应付证券清算款   |                |
| 债券投资     | 392,755,215.78 | 应付赎回款     |                |
| 资产支持证券投资 |                | 应付管理人报酬   | 5,284,347.63   |
| 基金投资     | 46,165,770.96  | 应付托管费     | 39,078.89      |
| 衍生金融资产   |                | 应付销售服务费   |                |
| 买入返售金融资产 |                | 应付交易费用    |                |
| 应收证券清算款  |                | 应付税费      |                |
| 应收利息     | 16,215,409.50  | 应付利息      |                |
| 应收股利     | 11,269.40      | 应付利润      |                |
| 应收申购款    |                | 其他负债      |                |
| 其他资产     |                | 负债合计      | 5,323,426.52   |
|          |                | 所有者权益：    |                |
|          |                | 实收基金      | 449,685,717.31 |
|          |                | 未分配利润     | 11,176,945.17  |
|          |                | 所有者权益合计   | 460,862,662.48 |
|          |                |           |                |

长城季季红 1 号集合资产管理计划 2014 年第四季度资产管理报告

|       |                |             |                |
|-------|----------------|-------------|----------------|
| 资产合计: | 466,186,089.00 | 负债与持有人权益总计: | 466,186,089.00 |
|-------|----------------|-------------|----------------|

二、集合计划利润表

金额单位: 元

| 项目                    | 本期金额          | 本年累计数         |
|-----------------------|---------------|---------------|
| 一、收入                  | 10,792,538.32 | 34,299,905.35 |
| 1、利息收入                | 7,607,043.98  | 28,106,495.80 |
| 其中: 存款利息收入            | 110,622.64    | 301,686.71    |
| 债券利息收入                | 7,496,421.34  | 27,628,759.21 |
| 资产支持证券利息收入            |               |               |
| 买入返售金融资产收入            |               | 176,049.88    |
| 2、投资收益 (损失以“-”填列)     | 1,248,996.99  | 963,544.58    |
| 其中: 股票投资收益            |               |               |
| 债券投资收益                | 1,090,790.00  | 243,262.11    |
| 资产支持证券投资收益            |               |               |
| 基金投资收益                | 1,099.73      | 1,099.73      |
| 权证投资收益                |               |               |
| 衍生工具收益                |               |               |
| 基金红利收益                | 157,107.26    | 719,182.74    |
| 股利收益                  |               |               |
| 3、公允价值变动损益 (损失以“-”填列) | 1,936,497.35  | 5,229,864.97  |
| 4、其他收入 (损失以“-”填列)     |               |               |
| 二、费用                  | 462,387.37    | 1,813,598.99  |
| 1、管理人报酬               |               |               |
| 2、托管费                 | 115,486.45    | 404,955.06    |
| 3、销售服务费               | 346,459.37    | 1,214,865.20  |
| 4、交易费用                | 441.55        | 1,700.51      |
| 5、利息支出                |               | 161,431.02    |
| 其中: 卖出回购金融资产支出        |               | 161,431.02    |
| 6、其他费用                |               | 30,647.20     |
| 三、利润总额                | 10,330,150.95 | 32,486,306.36 |

三、资产组合情况

| 项目名称         | 项目公允价值 (元)     | 占总资产比例  |
|--------------|----------------|---------|
| 债券           | 392,755,215.78 | 84.25%  |
| 基金           | 46,165,770.96  | 9.90%   |
| 银行存款及结算备付金合计 | 10,884,827.21  | 2.33%   |
| 存出保证金        | 153,596.15     | 0.03%   |
| 应收利息         | 16,215,409.50  | 3.48%   |
| 应收股利         | 11,269.40      | 0.00%   |
| 合计           | 466,186,089.00 | 100.00% |

注：因四舍五入原因，资产组合情况表中项目公允价值占总资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

#### 四、期末公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

| 序号 | 代码     | 名称       | 公允价值（元）       | 占净值比例 |
|----|--------|----------|---------------|-------|
| 1  | 124719 | 13 鞍新 02 | 30,000,000.00 | 6.51% |
| 2  | 530002 | 建信货币     | 25,004,192.41 | 5.43% |
| 3  | 122551 | 12 如东投   | 21,168,000.00 | 4.59% |
| 4  | 530008 | 建信稳定增利   | 21,161,578.55 | 4.59% |
| 5  | 124389 | 13 资水务   | 20,720,000.00 | 4.50% |
| 6  | 124572 | 14 遂川中   | 20,700,000.00 | 4.49% |
| 7  | 122614 | 12 渝缙债   | 20,674,000.00 | 4.49% |
| 8  | 125119 | 13 镇旅游   | 20,000,000.00 | 4.34% |
| 9  | 125121 | 13 淮物流   | 20,000,000.00 | 4.34% |
| 10 | 124516 | 14 泉高新   | 20,000,000.00 | 4.34% |

#### 五、集合计划份额变动

单位：份

|           |                |
|-----------|----------------|
| 期初份额总额    | 470,483,443.44 |
| 红利再投资份额   | -              |
| 报告期间总参与份额 | 93,830,552.15  |
| 报告期间总退出份额 | 114,628,278.28 |
| 报告期末份额总额  | 449,685,717.31 |

## 第六节 重要事项揭示

- 1、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人、财产、托管业务的诉讼事项。
- 2、本报告期内本集合计划投资主办人没有发生变更。
- 3、本报告期内本集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券的投资比例没有超过集合计划资产净值的 7%。
- 4、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。

## 第七节 信息披露的查阅方式

### 一、备查文件

- 1、《长城季季红1号集合资产管理计划说明书》;
- 2、《长城季季红1号集合资产管理计划合同》;
- 3、《长城季季红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;
- 5、《长城季季红1号集合资产管理计划验资报告》，天职深QJ【2013】346号;

### 二、存放地点及查询方式

网址: <http://www.cgws.com>

客户服务电话: 400-6666-888

投资者对本报告书如有任何疑问, 可咨询管理人长城证券有限责任公司。

长城证券有限责任公司

二〇一五年一月二十日

