



海通新兴成长集合资产管理计划  
(2014 年年度)  
资产管理报告

计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司

计划托管人：交通银行股份有限公司

报告期间：2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 12 月 31 日

## 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人交通银行股份有限公司于 2015 年 3 月 27 日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，也不保证最低收益。

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，投资者在作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已经审计。

## 一、集合计划简介

### (一) 计划基本资料

1、计划名称：	海通新兴成长集合资产管理计划
2、计划简称：	新兴成长
3、计划合同生效日：	2010 年 5 月 26 日
4、成立规模：	852,070,451.52 元
5、报告期末计划份额总额：	83,898,479.53 份

### (二) 计划产品说明

1、投资目标：	把握中国经济增长方式转型中的成长机会，重点投资于基本面良好、具有高成长性的中小市值公司股票，谋求计划资产的长期增值。
2、投资策略：	<p>资产配置策略</p> <p>管理人基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，进行大类资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，追求更高收益，控制组合风险。</p> <p>股票类资产投资策略</p> <p>本产品主要是采取自下而上选择成长股的策略，重点关注国家重点支持发展的领域的投资机会。集合资产管理人在公司价值评估方面遵循了定性指标与定量指标相结合、静态指标与动态指标相结合的原则，有效地对企业价值进行分析判断。企业价值考察方面侧重四个重点：行业背景、竞争力优势、财务健康状况、经营管理状况。</p>
3、业绩比较基准：	中证 500 指数×70%+中证全债指数×30%
4、风险收益特征：	本计划属于混合型产品，风险和收益水平低于股票型产品，高于债券型产品，属于较高风险收益特征的产品。

## (三) 计划管理人

1、名称：	上海海通证券资产管理有限公司
2、注册地址：	上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼
3、办公地址：	上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼
4、邮政编码：	200001
5、国际互联网址：	www.htsamc.com
6、法定代表人：	裴长江
7、信息披露负责人：	赵高华
8、信息披露电话：	021-23212156
9、联系电话：	95553、4008888001
10、传真：	021-63410460
11、电子邮箱：	htam@htsec.com

## (四) 计划托管人

1、名称：	交通银行股份有限公司
2、注册地址：	上海市浦东新区银城中路 188 号
3、办公地址：	上海市仙霞路 18 号
4、邮政编码：	200120
5、国际互联网址：	www.bankcomm.com
6、法定代表人：	牛锡明
7、信息披露负责人：	裴学敏
8、联系电话：	95559
9、传真：	021-62701262
10、电子邮箱：	zh_jjb@bankcomm.com

## (五) 其他有关资料

1、聘请的会计师事务所	
名称：	众华会计师事务所（特殊普通合伙）
办公地址：	上海市中山南路 100 号金外滩广场 6 楼
2、计划注册登记机构	
名称：	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址：	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 二、主要财务指标和集合计划净值表现

## (一) 主要财务指标

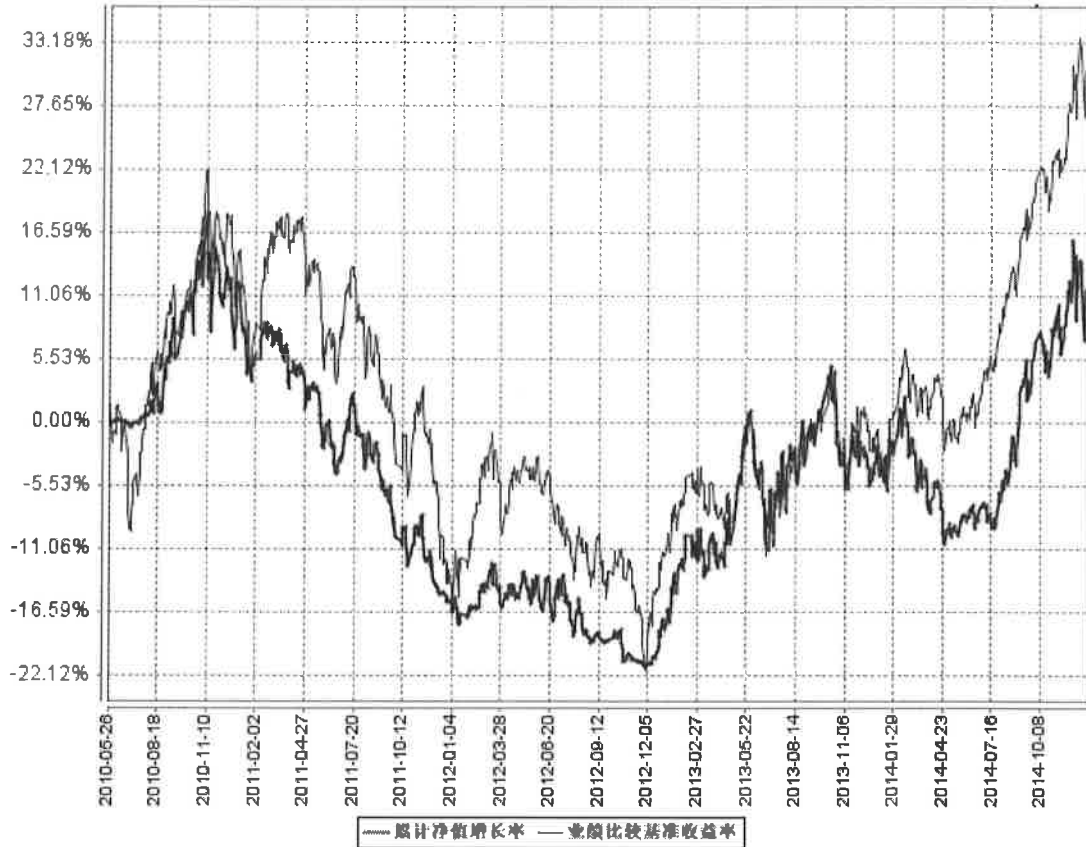
(单位：人民币元)

主要财务指标	2014 年 1 月 1 日-2014 年 12 月 31 日
--------	---------------------------------

1.	本期利润	15,696,911.22
2.	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	17,150,529.27
3.	期末集合计划资产净值	91,604,998.15
4.	期末单位集合计划资产净值	1.0919

## (二) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## (三) 本计划合同生效以来每年的计划收益分配情况

年度	每 10 份计划份额分红数 (元)	备注
2011	0.3000	-
合计	0.3000	-

## 三、集合计划管理人报告

## (一) 投资经理简介

王爱景，上海交通大学金融学硕士，现任海通新兴成长集合资产管理计划、海通汇智 1 号集合资产管理计划以及海通信通 1 号集合资产管理计划投资经理，曾任国海富兰克林基金交易员、联合证券研究员和信诚基金研究员，2007 年获新财富最佳分析师食品饮料行业第三名。

## 投资助理

—

## （二）投资经理工作报告

### 市场回顾

2014 年是 A 股市场在沉寂了几年后的一波牛市，从下半年开始，在国企改革、并购重组的带动下，市场逐步活跃，更是在 11 月 22 日降息的带动下，A 股市场走出了一个个轰轰烈烈的牛市行情，上证指数从 11 月 24 日的 2500 点涨至年底 3234 点的全年最高点收盘，几乎没有回调，股市连续的赚钱效应吸引社会资金大量入市，新开户数量屡创新高，全民炒股的时期时隔 7 年重新来到。

### 市场展望

进入 2015 年以来，市场呈现高位震荡的格局，金融行业和一带一路暂时休息，而以互联网金融、行业转型、软件国产化、互联网医疗等新兴热点板块则一路高歌猛进，并带领创业板创出新高。

我们认为，今年将继续延续这种格局，由于经济总体比较疲弱，而目前市场表现显然已经隐含了至少 2 次降息和数次降准的预期，因此短期的宽松不会引发整体的上涨，而只能是存量资金在市场的博弈，这就是目前大盘整体稳定，而成长股和新兴行业表现出彩的原因。具体到板块和行业，我们看好：

一、互联网板块：互联网金融、物联网、O2O、国产信息化和国家安全、智慧城市等一系列信息技术在新一轮经济变革中起到关键作用，行业中长期看好，目前仍处于行业发展初期。

二、环保：两会期间环保将成为重要议题，环保政策持续发酵。去年相继出台了一系列环保政策，如 PPP 管理办法和指南、第三方治理指导意见、污水处理收费管理办法、环境检测服务意见等。未来还将有一系列政策出台，“水十条”、“大气污染防治法”等都将在今年出台。

三、军工：中国 2014 年度国防预算较 2013 年提升 12.2%，总额为 8082 亿元人民币（约等于 1320 亿美元）。我们预测未来几年我国国防开支仍将保持 10% 以上的稳定增速，到十二五期末，国防预算有望接近 1 万亿元。考虑到国防开支的稳步增加，未来每年在军备采购和训练方面的开支将达到 6000 亿左右人民币。

四、国企改革：通过混合所有制、股权激励、引入战略投资者等一系列方式重新激活国企活力，是目前国企改革的主要目的，看好在国企改革方面走在前面的一些央企和地方国企。

总体看来，2015 年中国股市在流动性的全面推动下将震荡上行，相比银行理财、房地产等其他资产，股市的吸引力逐渐增加，居民的大类资产配置向股市转移，将推动股市全面的牛市行情，我们强烈看好市场。

### 操作策略：

虽然我们看好 2015 年股市的表现，但在市场在一个月经历了近 50% 的上涨后，我们认为短期操作难度加大，必须慎重对待。

首先，经历了去年四季度和一季度的上涨后，大盘蓝筹和创业板股票都创出新高，尤其是创业板，突破了 2000 点，目前看多数股票估值偏高，选股难度加大。

其次，2015 年股市必将是不平凡的一年，市场仍将创新不断，一批新制度的推出对市场产品巨大影响，如 T+0 制度、注册制、指数期权等，将加大市场波动。

最后，尽管难度加大，我们仍看好股市在居民大类资产配置中的价值，更看好经济转型和创新，我们将秉持谨慎原则，为客户创造稳定增长的收益。

## 四、合规管理与风险控制报告

### 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》、《证券公司监督管理条例》、《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、合规管理报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的合规风控部门，加强对集合资产管理业务的合规管理，并为其提供人力、物力、财力和技术支持，确保合规管理有效开展。通过事前审核和定期检查，可以确认，在本报告期内，未发生违反法律法规及其他监管规定的情况。

### 3、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的合规风控部门，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。

公司设立合规与风控部，通过系统监控和定期检查，对集合资产管理计划的投资风险、操作风险、契约风险、道德风险等进行全面的监督和检查。同时在交易系统中设置各类合规性指标，实现事前控制，确保集合资产管理计划运作的合法合规。对日常集合资产管理计划出现的各类问题，合规与风控部及时进行风险提示，并督促相关部门及时整改。

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

通过监控和检查，可以确认，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。

## 五、集合计划审计报告

# 审计报告

众会字(2015)第1254号

海通新兴成长集合资产管理计划全体持有人：：

我们审计了后附的海通新兴成长集合资产管理计划(以下简称“海通新兴成长计划”)财务报表,包括2014年12月31日的海通新兴成长计划资产负债表,2014年度的海通新兴成长计划经营业绩表、海通新兴成长计划净值变动表以及财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是海通新兴成长计划管理人上海海通证券资产管理有限公司的责任,这种责任包括:(1)按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《海通新兴成长集合资产管理计划资产管理合同》及中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的参照基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

### 三、审计意见

我们认为,海通新兴成长计划财务报表在所有重大方面按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《海通新兴成长集合资产管理计划合同》及中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的参照基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了海通新兴成长集合资产管理计划2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和收益分配情况。

众华会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

吴焕明

中国注册会计师

朱靓旻

中国，上海

二〇一五年三月二五日

## 六、集合计划财务报表

### 6.1 资产负债表

资产	年末余额	年初余额	负债与 持有人 权益	年末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	128,407.42	86,499.90	短期借 款	-	-
清算备付 金	12,386,233.67	560,556.19	交易性 金融负 债	-	-
存出保证 金	119,735.58	100,544.96	衍生金 融负债	-	-
交易性金 融资产	79,539,661.10	102,431,750.94	卖出回 购金融 资产款	-	-
其中：股 票投资	68,711,029.11	85,945,422.49	应付证 券清算 款	-	-
债券投资	-	4,105,391.50	应付赎 回款	352,560.78	165,364.09
基金投资	10,828,631.99	12,380,936.95	应付管 理人报 酬	99,629.29	131,746.38
资产支持证 券投资	-	-	应付托 管费	19,095.64	25,251.39
衍生金融 资产	-	-	应付销 售服务 费	-	-
买入返售	-	20,000,002.00	应付交	62,090.33	17,213.75



金融资产			易费用		
应收证券清算款	-	7,061,685.76	应交税费	-	-
应收利息	6,563.07	45,148.98	应付利息	-	-
应收股利	-	-	应付利润	-	-
应收申购款	-	-	其他负债	42,226.65	62,226.65
其他资产	-	-	负债合计	575,602.69	401,802.26
			所有者权益：		
			实收计划	83,898,479.53	136,849,782.38
			未分配利润	7,706,518.62	-6,965,395.91
			所有者权益合计	91,604,998.15	129,884,386.47
资产总计	92,180,600.84	130,286,188.73	负债及所有者权益总计	92,180,600.84	130,286,188.73

## 6.2 利润表

项 目	本年数	上年数
一、收入	18,328,676.66	27,652,268.12
1、利息收入	572,298.59	809,236.27
其中：存款利息收入	218,816.87	230,882.07
债券利息收入	220,889.34	381,487.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	132,592.38	196,866.94
2、投资收益（损失以“-”填列）	19,209,996.12	27,693,870.65
其中：股票投资收益	14,492,436.02	25,373,543.34
债券投资收益	852,756.46	322,732.26

基金投资收益	2,877,533.96	775,322.42
权证投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	601,469.68	1,222,272.63
基金红利收益	385,800.00	-
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,453,618.05	-850,838.80
4、其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
二、费用	2,631,765.44	3,168,407.76
1、管理人报酬	1,379,279.28	1,716,562.05
2、托管费	264,361.81	329,007.74
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	949,321.85	1,064,098.47
5、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6、其他费用	38,802.50	58,739.50
三、利润总额	15,696,911.22	24,483,860.36

## 6.3 集合计划所有者权益（净值）变动表

项 目	本金额			上年金额		
	实收计划	未分配利润	所有者权益合计	实收计划	未分配利润	所有者权益合计
一、年初所有者权益（计划净值）	136,849,782.38	-6,965,395.91	129,884,386.47	171,344,433.26	-33,603,218.09	137,741,215.17
二、本年经营活动产生的计划净值变动数（本年净利润）	-	15,696,911.22	15,696,911.22	-	24,483,860.36	24,483,860.36

三、本年计划份额交易产生的计划净值变动数(减少以“-”号填列)	-52,951,302.85	-1,024,996.69	-53,976,299.54	-34,494,650.88	2,153,961.82	-32,340,689.06
其中：1、计划申购款	91,935.78	6,564.22	98,500.00	113,348.68	-14,848.68	98,500.00
2、计划赎回款	53,043,238.63	1,031,560.91	54,074,799.54	34,607,999.56	-2,168,810.50	32,439,189.06
四、本年向计划份额持有人分配利润产生的计划净值变动数	-	-	-	-	-	-
五、年末所有者权益(计划净值)	83,898,479.53	7,706,518.62	91,604,998.15	136,849,782.38	-6,965,395.91	129,884,386.47

## 6.4 财务报表附注

### 6.4.1 计划基本情况

海通新兴成长集合资产管理计划(以下简称本计划或集合计划)由海通证券股份有限公司依照《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》及其他有关规定,经中国证券监督管理委员会(证监许可[2010]180号)《关于核准海通证券股份有限公司设立海通新兴成长集合资产管理计划的批复》核准推广设立。

本计划为非限定性集合资产管理计划,不约定固定存续期限,集合计划的推广期为2010年4月6日至5月21日,成立日为2010年5月26日,集合计划成立后满一个月后的第一个工作日为首个开放日(2010年6月28日),之后每个沪深交易所交易日开放。本计划原管理人为海通证券股份有限公司,2012年8月3日,海通证券股份有限公司、上海海通证券资产管理有限公司联合发布公告,自2012年7月25日起,集合计划的管理人变更为上海海通证券资产管理有限公司,集合计划托管人为交通银行股份有限公司;有关集合计划设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;报告期末的集合计划份额总额为83,898,479.53份计划单位。

### 6.4.2 财务报表编制基础

本计划的财务报表和财务报表附注系按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》以及其他中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的参照基金行业实务操作的有关规定而编制。

### 6.4.3 主要会计政策

#### 1、会计年度

本计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 2、记账本位币

本计划以人民币为记账本位币。

## 3、记账基础和计价原则

本计划的会计核算以权责发生制为记账基础，除金融资产投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

## 4、集合计划资产的估值方法

### 4.1 股票估值方法

(1)上市流通股票按估值其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的基金净值的影响在 0.25%以上的，采用指数收益法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### (2)未上市股票的估值：

①首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

②首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第(1)条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第(1)条确定的估值价格进行估值。

#### ④非公开发行且在发行时明确一定锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(DI-Dr)/DI$$

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；DI 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天

数，不含估值日当天。

#### 4.2 债券估值方法

(1)在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近至易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2)在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价）确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

(3)首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4)在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

#### 4.3 权证估值方法

(1)上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2)首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3)停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4)因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

#### 4.4 资产支持证券的估值方法

(1)交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2)全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

#### 4.5 基金估值

(1)任何在证券交易所上市流通的封闭式基金、ETF 基金、场内登记的 LOF 基金，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2)未上市的封闭式基金按估值日的净值估值，若估值日未公布净值，按最近公布的净值估值。

(3)开放式基金（含场外登记的 LOF 基金）按前一开放日基金份额净值估值；如果估值日分红，则按前一开放日基金份额净值减单位分红额后的差额估值。前一开放日基金份额净值未公布的，以最近公布日的基金份额净值估值；若前一开放日之前未公布基金份额净值的按估值日的账面成本估值。

(4)处于募集期内的开放式基金按成本估值。

(5)货币市场基金以每万份收益逐日提取收益

### 5、收入的确认

(1)股票、权证和基金差价收入于卖出股票、权证和基金成交日确认，并按卖出股票、权证和基金成交总额与其成本的差额入账；

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额入账；

(3)债券差价收入于卖出债券成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

(4)货币型开放式基金红利按实际持有期内逐日计提，并按货币型开放式基金持有份额与根据每天公布的每万份基金单位收益率计提的金额入账；

(5)存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

(6)红利收入于除息日确认，并按宣告的分红派息比例计算的金额入账；

(7)其他收入于实际收到时确认收入。

### 6、费用的确认和计量

#### (1)管理人管理费

根据《海通新兴成长集合资产管理计划资产管理合同》的规定，管理人管理费按前一日计划资产净值 1.2%的年费率逐日计提。

#### (2)托管人托管费

根据《海通新兴成长集合资产管理计划资产管理合同》的规定，托管人托管费按前一日计划资产净值 0.23% 的年费率逐日计提。

- (3) 证券交易费用
- (4) 计划信息披露费用
- (5) 与计划相关的会计师费、律师费
- (6) 按照国家有关规定可以列入其他费用

上述 3 至 6 项费用由本计划托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期计划费用。根据《海通新兴成长集合资产管理计划资产管理合同》的约定，集合计划推广期间的费用、管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本计划资产的损失，以及处理与本计划运作无关的事项发生的费用等不列入集合计划费用。

## 7、收益分配原则

- (1) 每一份集合计划单位享有同等分配权（含管理人业绩报酬），受托人最终收到的为扣除管理人业绩报酬后的净额；
- (2) 当单位资产净值超过面值时，方可进行收益分配；
- (3) 分配收益不少于已实现收益的 90%，收益分配以现金形式进行，也可转做份额处理；
- (4) 收益分配后单位资产净值不得低于面值；
- (5) 在符合上述分配原则的条件下，每年至少应分配收益一次；
- (6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 6.4.4 税项

根据及参照财政部、国家税务总局财税字 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

#### 1、印花税

本计划根据《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》的规定，证券(股票)交易印花税税率按 1‰ 单边缴纳。

#### 2、营业税

本计划参照《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，集合计划

管理人运用集合计划资金买卖股票、债券的价差收入暂免缴营业税。

### 3、企业所得税

本计划参照《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，集合计划自证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的价差收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

## 七、投资组合报告

### 1、本报告期末计划资产组合情况

项目名称	金额（元）	占计划资产总值比例
股票	68,711,029.11	74.54%
基金	10,828,631.99	11.75%
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	12,514,641.09	13.58%
应收证券清算款	-	-
其他资产	126,298.65	0.14%
总计	92,180,600.84	100.00%

注：因四舍五入原因，分项占比之和与合计数可能存在尾差。

### 2、本报告期末按市值占计划资产净值比例大小排序的前 10 名证券明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	市值（元）	市值占净值%
1	511990	华宝添益	51,720.00	5,174,327.40	5.65
2	600208	新潮中宝	658,240.00	4,818,316.80	5.26
3	002063	远光软件	221,783.00	4,446,749.15	4.85
4	150027	添利 B	2,637,319.00	3,225,441.14	3.52
5	300005	探路者	171,261.00	3,178,604.16	3.47
6	002366	丹甫股份	101,300.00	3,064,325.00	3.35
7	600114	东睦股份	224,397.00	2,991,212.01	3.27
8	601218	吉鑫科技	423,800.00	2,890,316.00	3.16
9	600249	两面针	336,500.00	2,480,005.00	2.71
10	150118	房地产 B	1,175,875.00	2,377,619.25	2.60



## 八、集合计划份额变动情况

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
136,849,782.38	91,935.78	53,043,238.63	83,898,479.53

## 九、重要事项提示

（一）本集合计划管理人相关事项

- 1、本集合计划管理人在本报告期内没有发生与本集合计划相关的诉讼事项。
- 2、本集合计划管理人办公地址未发生变更。
- 3、本集合计划的管理人高级管理人员没有受到任何处罚。
- 4、本报告期内上海海通证券资产管理有限公司的法定代表人变更为裴长江先生，公司于 2014 年 11 月 20 日刊登了公告。

（二）本集合计划相关事项

无

## 十、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、《海通新兴成长集合资产管理计划合同》
- 2、《海通新兴成长集合资产管理计划说明书》
- 3、《海通新兴成长集合资产管理计划风险揭示书》

（二）查阅方式

网址：[www.htsamc.com](http://www.htsamc.com)

热线电话：95553

