

华安理财五号日日赢集合资产管理计划
2015 年第二季度资产管理报告



二〇一五年七月

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.....		6

(三) 集合计划份额变动.....
.....6

五、重要事项提示.....7

六、备查文件目录.....
.....7

(一) 本集合计划备查文件目录.....
.....7

(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

2015 年第二季度资产管理报告

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: 2015 年 4 月 1 日—2015 年 6 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

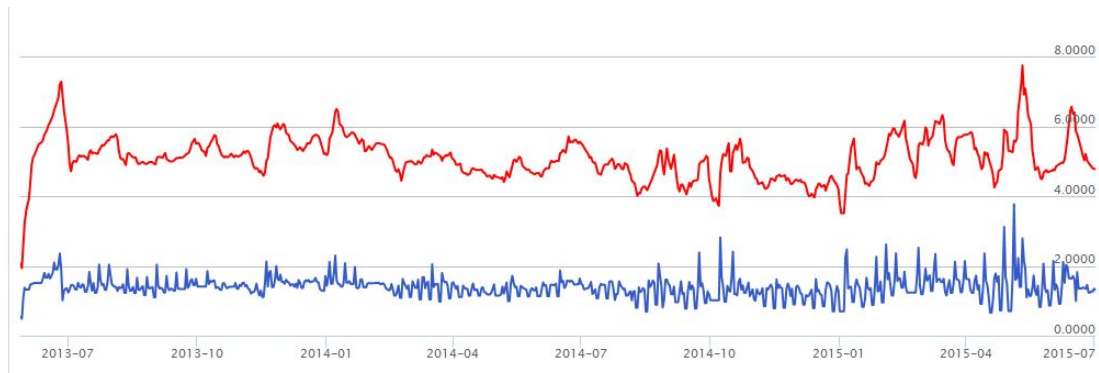
成立规模: 118, 023, 602. 33

报告期末规模: 93, 617, 215. 98

二、主要财务指标

单位：元

集合计划本期净收益	1,702,779.79
期末集合计划资产净值	93,617,215.98
期间年化收益率	5.32%



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

上半年宏观经济整体仍然呈下行态势，GDP 增速降至 7% 左右，消费、出口、固定资产投资增速仍呈下滑态势，“三驾马车”引擎作用明显减弱。周期性行业、产能过剩行业经营状况持续恶化。

央行采取了较为宽松的货币政策，通过释放流动性和降低融资成本缓解企业融资压力，进而缓解经济下行的压力。受降准降息影响，上半年银行间市场流动性较为充裕，货币市场资金利率持续下行，目前货币市场利率已降至历史较低水平。债券市场整体振荡上行，信用债违约风险不断，对市场信心打击较大。

本产品适当降低债券仓位，加大波段操作力度、增加差价收入，不断调整持仓结构，增加组合流动性。针对 IPO 和节日因素等时点性资金压力，提前做好流动性准备。从收益率来看，二季度实现万份基金单位期间累计收益 132.6697 元，期间年化收益率 5.32%，位于同类产品前列。

2、市场展望和投资计划

近期房地产市场分化，一线城市量价回升，将带动固定资产投资增速企稳，但力度有限。美元保持强势，以美元计价的大宗商品价格持续低迷，输入型通胀压力较小，受制于制造企业需求不足，国内重要生产资料价格难以反弹，内生性通胀压力不大。外汇占款下行趋势持续。上述背景下，预计下半年央行货币政策维持宽松，但不会大幅放水，基础货币供应不会显著增加。财政政策支持力度也将继续加大。宽货币、经济下行、信用风险等因素共同作用下，预计债券收益率将以震荡为主，在宽松政策以及地方债置换等因素的影响下，下半年市场发生系统性信用风险的概率较小，信用风险事件更多体现为个券风险。

操作上仍旧秉持高流动性、短久期策略，兼顾产品流动性与收益率。根据资金价格波动做好债券、回购、现金等各类资产配置比例调整工作。保持债券基本仓位，利用债券波动有限度进行差价交易，提升收益率。预计资金面时点压力仍然会对产品产生较大冲击，需要提前做好流动性准备。

（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：2015 年 6 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	30,147,651.15	短期借款	0.00
结算备付金	277,863.22	交易性金融负债	0.00
存出保证金	19,199.81	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	47,609,572.95	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	47,609,572.95	应付赎回款	1,163,534.19
基金投资	0.00	应付管理人报酬	692,919.92
权证投资	0.00	应付托管费	6,364.83
资产支持证 券投资	0.00	其中：应付风险准备金	659,378.46
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	10,000,100.00	应付交易费用	4,105.28

应收证券清算款	3,837,521.09	应交税费	0.00
应收利息	1,799,767.16	应付利息	0.00
应收股利	0.00	应付利润	13,069.68
应收申购款	1,810,000.00	其他负债	4,465.50
其他资产	0.00	负债合计	1,884,459.40
		所有者权益:	
		实收基金	93,617,215.98
		未分配利润	0.00
		所有者权益合计	93,617,215.98
资产合计	95,501,675.38	负债和所有者权益总计	95,501,675.38

2、集合计划经营业绩表

日期：2015 年 4 月-6 月

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	1,771,820.10	3,157,210.92
2	1、利息收入	1,210,706.17	2,292,586.26
3	其中：存款利息收入	69,836.02	139,702.18
4	债券利息收入	1,138,280.42	2,149,218.13
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	2,589.73	3,665.95
7	2、投资收益	546,815.40	850,326.13
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	38,906.31	33,817.69
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	507,909.09	816,508.44
15	3、公允价值变动收益	0.00	0.00
16	4、其他收入	14,298.53	14,298.53
17	二、费用	69,040.31	126,263.99
18	1、管理人报酬	0.00	0.00
19	2、托管费	25,964.88	46,011.03
20	3、销售服务费	0.00	0.00
21	4、交易费用	4.78	4.78

22	5、利息支出	36,060.15	72,082.68
23	其中：卖出回购金融资产支出	36,060.15	72,082.68
24	6、其他费用	7,010.50	8,165.50
25	三、利润总和	1,702,779.79	3,030,946.93

(二) 集合计划投资组合报告 (2015 年 6 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		
3	债券	47,609,572.95	49.85%
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	47,609,572.95	49.85%
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)	2,425,514.37	2.54%
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)	45,466,588.06	47.61%
17	其中：买入返售证券	10,000,100.00	10.47%
18	资产合计	95,501,675.38	100.00%

(三) 集合计划份额变动 (单位：份)

期初集合计划份额总额	110,283,505.67
报告期间集合计划参与份额	301,713,300.95
报告期间集合计划退出份额	318,379,590.64
报告期末集合计划份额总额	93,617,215.98

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

二〇一五年七月三日