

广发金管家多添利集合资产管理计划

2016 年第三季度资产管理报告



管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

托管人：广发银行股份有限公司

日期：2016 年 10 月

目录

重要提示.....	1
一、 集合计划简介.....	1
(一) 基本资料.....	1
(二) 管理人简介.....	2
(三) 托管人简介.....	2
(四) 会计师事务所简介.....	2
二、 主要财务指标和收益分配.....	3
(一) 主要财务指标.....	3
(二) 报告期内收益分配情况.....	3
三、 集合计划管理人报告.....	3
(一) 投资主办人简介.....	3
(二) 报告期内业绩表现.....	4
(三) 投资主办人工作报告.....	4
四、 集合计划会计报表.....	4
(一) 资产负债表.....	4
(二) 份额变动表.....	5
五、 集合计划投资组合报告.....	5
(一) 资产组合情况.....	5
(二) 报告期关联交易投资情况.....	6
六、 重要事项提示.....	6
七、 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

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。

管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

托管人根据本集合计划合同规定，复核了本报告中的主要财务指标、会计报表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。

本报告未经审计。

本报告内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2016年7月1日—2016年9月30日

一、 集合计划简介

（一） 基本资料

名称：广发金管家多添利集合资产管理计划

成立规模（总份额）：1,130,442.23份

存续期间：无固定期限

报告期末计划总份额：1,220,539,411.32份

管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

托管人：广发银行股份有限公司

注：每份额面值100元

(二) 管理人简介

名称：广发证券资产管理（广东）有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-285

办公地址：广东省广州市天河北路183-187号大都会广场36楼

法定代表人：张威

电话：（020）87555888

传真：（020）87553569

全国统一客服热线：95575

网址：www.gf.com.cn

(三) 托管人简介

名称：广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

办公住所：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

电话：（020）87310779

传真：（020）87310779

全国统一客服热线：95508

网址：www.cgbchina.com.cn

(四) 会计师事务所简介

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市黄浦区延安东路222号30楼

办公地址：上海市黄浦区延安东路222号30楼

法人代表：卢伯卿

电话：（020）83969228

传真：（020）38880119

经办会计师：王明静 洪锐明

二、 主要财务指标和收益分配

(一) 主要财务指标

序号	主要财务指标	2016年7月1日—2016年9月30日
1	集合计划本期已实现收益(元)	1,316,267,720.15
2	本期利润(元)	1,316,267,720.15
3	期末集合计划资产净值(元)	122,053,941,132.00

(二) 报告期内收益分配情况

本报告期累积分配利润 808,118,929.00 元

三、 集合计划管理人报告

(一) 投资主办人简介

陈晓荣女士，硕士，曾就职于广发银行金融市场部，主管广发银行本币货币市场团队，主要投资范围为货币市场工具，熟悉同业存款、票据、债券一二级交易等资产运作，善于捕捉市场转向及跨市场交易机会，应对过 08-09 年罕见的流动性泛滥以及 2011 年罕见的流动性危机。因业绩表现突出，连续多年被评定为银行间市场优秀交易员。2012 年 6 月入职广发证券资产管理部。现任广发金管家多添利集合资产管理计划投资主办人。

袁克非先生，曾任广发银行固定收益业务主管，从事专业债券投资业务超过 10 年，具备全面的货币市场、债券一、二级市场投资交易经验。经历过债券市场三轮以上完整的牛熊周期，擅长控制风险，把握市场转折。曾连续荣获 2003 年及 2004 年全国银行间市场优秀交易员称号及 2015 年“英华奖”三年期最佳固定收益投资主办称号。现担任广发金管家弘利债券集合资产管理计划、广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划、广发金管家现金增利集合资产管理计划、广发金管家多添利集合资产管理计划、广发资产配置策略集合资产管理计划、广发金管家睿利债券分级 1 号集合资产管理计划、广发银享利 1 号集合资产管理计划、广发资管 CTA 大宗商品 1 号集合资产管理计划、广发多添富系列、广发多添益系列和广发证券稳利系列投资主办，广发控股（香港）有限公司 RQFII 人民币固定收益基金投资顾问。

(二) 报告期内业绩表现

2016 年三季度末各期限报价：7 天品种(879002)业绩比较标准：3.00%；14 天品种(879003)业绩比较标准：3.10%；28 天品种（879004）业绩比较标准：3.30%；56 天品种（879005）业绩比较标准：3.50%；91 天品种（879006）业绩比较标准：3.70%；182 天品种（879007）业绩比较标准：3.90%；364 天品种（879008）业绩比较标准：4.00%。

(三) 投资主办人工作报告

2016 年三季度，人民币汇率保持相对稳定，由于通胀压力回落和信贷数据不佳，债券市场收益率延续下行趋势，期限利差、信用利差持续压缩，收益率曲线继续平坦化。货币市场方面，央行通过重启 28 天逆回购稳定资金面，保持季末前后流动性充裕，货币市场回购利率中枢略有抬升，银行间隔夜回购利率从 2.0%上升到 2.2%左右。本产品投资方面仍坚持以流动性为主，投资活期类存款资产依旧保持合理比例；同时为了兼顾收益性，适时择优配置定期存款和同业存单，并择时增配收益率相对较高的利率债和高等级信用债。

在经济复苏前景不明，货币政策仍保持稳健基调的背景下，债券资产仍是资金配置的主要标的。展望 2016 年四季度，政策面上不明朗，经济基本面亦难有实质性改善，信用风险未消，随着收益率继续降低和信用利差继续缩窄，债券市场面临机遇与风险并存。2016 年四季度，我们将继续保持稳健运作的策略，在保持流动性并严控信用风险的基础上，提高产品收益，以良好的业绩回馈广大投资者。

四、 集合计划会计报表

(一) 资产负债表

单位：元

资产	2016/9/30	2016/6/30	负债与所有者权益	2016/9/30	2016/6/30
资产：			负债：		
银行存款	21,281,422,531.66	4,660,750,534.65	短期借款	-	-
结算备付金	1,226,549,935.76	1,217,757,415.44	交易性金融负债	-	-
存出保证金	20,971,844.36	30,250,413.68	衍生金融负债	-	-

交易性金融资产	126,053,717,471.65	104,341,977,664.24	卖出回购金融资产款	16,721,585,307.10	23,998,676,418.90
其中:股票投资	9,999,994.23	-	应付证券清算款	11,252,454,197.90	-
债券投资	93,963,517,320.36	68,632,801,736.65	应付赎回款	-	751,257,747.00
基金投资	30,805,517,152.06	34,628,130,887.59	应付管理人报酬	85,755,539.93	50,251,316.02
资产支持证券投资	1,274,683,005.00	1,081,045,040.00	应付风险准备金	287,075,295.40	315,878,957.61
专项资产管理计划	-	-	应付托管费	14,292,589.98	11,746,109.10
银行理财产品	-	-	应付销售服务费	-	-
信托投资	-	-	应付交易费用	2,694,000.60	1,928,844.22
衍生金融资产	-	-	应交税费	-	-
权证投资	-	-	应付利息	4,071,334.24	2,468,025.74
买入返售金融资产	1,654,972,517.50	206,720,052.90	应付利润	1,445,084,540.32	936,935,749.17
应收证券清算款	-	11,577,704,593.45	其他负债	13,475.32	8,950.76
应收利息	1,611,880,603.21	1,468,080,413.83	负债合计	29,813,026,280.79	26,069,152,118.52
应收股利	17,452,508.65	34,896,636.33	所有者权益:		
应收申购款	-	-	实收基金	122,053,941,132.00	97,468,985,606.00
其他资产	-	-	未分配利润	-	-
			所有者权益合计	122,053,941,132.00	97,468,985,606.00
资产总计	151,866,967,412.79	123,538,137,724.52	负债和所有者权益总计	151,866,967,412.79	123,538,137,724.52

(二) 份额变动表

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
974,689,856.06	729,476,060.95	483,626,505.69	1,220,539,411.32

五、 集合计划投资组合报告

(一) 资产组合情况

项目	期末市值(元)	占总资产比例
银行存款和结算备付金	22,507,972,467.42	14.82%
股票	9,999,994.23	0.01%
债券	93,963,517,320.36	61.87%
基金	30,805,517,152.06	20.28%
资产支持证券	1,274,683,005.00	0.84%
专项资产管理计划	-	-
银行理财产品	-	-
信托投资	-	-
应收证券清算款	-	-

应收申购款	-	-
买入返售金融资产	1,654,972,517.50	1.09%
其他资产	1,650,304,956.22	1.09%
合计	151,866,967,412.79	100.00%

注：“其他资产”包括“存出保证金”、“应收红利”、“应收利息”等项目。

（二） 报告期关联交易投资情况

本集合计划于2016年8月11日认购管理人全资控股股东—广发证券股份有限公司联合承销的国家电力投资集团公司公开发行的2016年公司债券（第四期）26000万元，详见《广发证券资产管理（广东）有限公司关于旗下集合资产管理计划认购关联公司承销债券的公告》。

六、 重要事项提示

- （一） 本报告期内本集合计划管理人及托管人未发生任何涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。
- （二） 本报告期内本集合计划聘请的会计师事务所未发生变更。
- （三） 本报告期内集合计划的投资组合策略、投资决策程序未发生改变。
- （四） 本报告期内集合计划的投资主办人未发生变更。
- （五） 本报告期内本集合计划的管理人、托管人托管业务机构及其高级管理人员未受到监管部门任何处罚。

七、 备查文件目录

（一） 本集合计划备查文件目录

1. 《广发金管家多添利集合资产管理计划说明书》
2. 《广发金管家多添利集合资产管理计划资产管理合同》
3. 《广发金管家多添利集合资产管理计划资产托管协议》
4. 《广发金管家多添利集合资产管理计划风险揭示书》
5. 管理人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点及查阅方式

文件存放地点：广发证券资产管理（广东）有限公司

地址：广州市天河北路183号大都会广场36楼

网址：www.gf.com.cn

电话：（020）87555888

传真：（020）87553569

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人广发证券资产管理（广东）有限公司。


广发证券资产管理（广东）有限公司
2016年10月

（广东）有限公司