

日信证券长安 2 号集合资产管理计划

2016 年第三季度报告



一、重要提示

本报告由日信证券长安 2 号集合资产管理计划（“本集合计划”）管理人国融证券股份有限公司（“国融证券”）编制。本集合计划托管人渤海银行股份有限公司于 2016 年 10 月 21 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本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合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合同、说明书及风险揭示书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2016 年 7 月 1 日至 2016 年 9 月 30 日。

本报告内容由管理人负责解释。

二、集合计划概况

产品名称：	日信证券长安 2 号集合资产管理计划
产品类型：	集合资产管理计划
成立日期：	2015 年 11 月 3 日
成立规模：	人民币 583,340,000.00 元
存续期限：	无固定存续期间，若出现集合资产管理合同约定的终止情形时，终止本集合计划，并实施清算。
投资范围及资产组合比例：	本集合计划主要投资于债券类资产和现金类资产。 债券类资产包括国债、央行票据、金融债、信用评级不低于 AA- 的公司债、企业债、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具（PPN）、资产支持证券、资产支持票据，债券型基金（含开放式债券型基金、LOF 债券型基金、普通封闭式债券型基金）、债券逆

	<p>回购、债券正回购、股票质押式回购业务、集合资金信托计划等监管部门批准或备案发行的金融产品。</p> <p>现金类资产包括剩余期限在 1 年以内（含 1 年）的国债和央行票据、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、货币市场基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）和现金。</p>
管理人：	国融证券股份有限公司（原日信证券有限责任公司）
托管人：	渤海银行股份有限公司
注册登记机构：	中国证券登记结算有限责任公司

三、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

1、本集合计划业绩表现

截止 2016 年 9 月 30 日，集合资产管理计划单位净值为 1.0657 元，累计单位净值为 1.0824 元，报告期内集合资产管理计划单位净值增长率为：2.44%。

2、主要财务指标（2016.7.1-2016.9.30）

本期已实现收益	13,335,383.71
本期利润	19,232,043.71
期末资产净值	808,161,433.75
期末单位份额净值	1.0657
本期单位净值增长率	2.44%
期末单位份额累计净值	1.0824

资产负债表

国融证券____日信长安2号集合理财资产管理计划____专用表

日期：2016-09-30

单位：元

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资产：			负 债：		
银行存款	9,110,052.85	509,204.79	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	765,350.75	779,871.10	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	13,934.15	14,214.44	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	465,058,000.00	213,589,150.26	卖出回购金融资产款	65,998,125.00	37,998,100.00
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算款	0.00	0.00
债券投资	465,058,000.00	209,344,000.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	4,245,150.26	应付管理人报酬	124,658.70	188,586.42
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	24,931.80	37,717.52
资产支持证券投资	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00	应付交易费用	24,987.62	7,890.00
买入返售金融资产	385,110,070.06	408,500,015.00	应交税费	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	125.21	应付利息	9,478.97	2,906.98
应收利息	14,286,208.03	5,935,587.51	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	166,130.14	其他负债	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	负债合计	66,182,182.09	38,235,200.92
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	758,340,000.00	583,340,000.00
			未分配利润	49,821,433.75	7,919,097.53
			所有者权益合计	808,161,433.75	591,259,097.53
资产合计	874,343,615.84	629,494,298.45	负债和所有者权益总计	874,343,615.84	629,494,298.45

损益表

国融证券__日信长安2号集合理财资产管理计划__专用表

日期：2016年07月 - 2016年09月

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	19,854,451.55	46,294,796.93
2	1、利息收入	13,836,672.67	39,940,306.45
3	其中：存款利息收入	21,648.56	74,242.38
4	债券利息收入	3,004,589.52	8,653,199.79
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	10,810,434.59	31,212,864.28
7	2、投资收益	121,118.88	1,748,797.48
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	-5,230.00	1,125,270.02
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	126,348.88	623,527.46
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	3、公允价值变动收益	5,896,660.00	4,605,660.00
17	4、其他收入	0.00	33.00
18	二、费用	622,407.84	1,894,816.87
19	1、管理人报酬	382,286.68	1,115,124.63
20	2、托管费	76,457.52	223,025.50
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	2,200.00	8,674.25
23	5、利息支出	141,763.64	527,052.49
24	其中：卖出回购金融资产支出	141,763.64	527,052.49
25	6、其他费用	19,700.00	20,940.00
26	三、利润总和	19,232,043.71	44,399,980.06

四、集合计划管理人报告

1、集合计划投资主办人简介：

鲁华星：计算机专业背景，工学学士，精于数理分析测算。自 2011 年 8 月进入日信证券以来，一直从事资产管理产品的运营管理工作，有丰富的产品管理经验，在日鑫多利改造期间全程参与产品改造工作，负责产品设计、合同制定等。现负责日鑫添利、日鑫多利等大集合产品的整体管理工作。

2、风险控制报告

在报告期内，本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办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》等其他相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，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。

报告期内，本集合计划管理人坚持规范运作、防范风险，保护投资者利益，严格执行日信证券有限责任公司内部控制和风险管理制，加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，严格履行本集合计划合同规定。

在报告期内，投资主办人按照资产管理事业部执委会授权的范围进行投资，投资范围和投资比例符合产品说明书规定，无越权交易行为发生。管理人和托管人按照各方约定的统一记账方法和会计处理原则，分别独立设置账套，每日核对资产净值，互相监督，以保证集合资产安全，保护投资者利益。

五、投资组合报告（2016 年 9 月 30 日）

1、集合资产管理组合

资产品种	金额（元）	金额占总资产比例
银行存款	9,110,052.85	1.04%

结算备付金	765,350.75	0.09%
存出保证金	13,934.15	0.00%
债券投资	465,058,000.00	53.19%
基金投资	0.00	0.00%
其他投资	0.00	0.00%
买入返售金额资产	385,110,070.06	44.05%
其他资产	14,286,208.03	1.63%
合计	874,343,615.84	100%

注：①、其他资产包括：应收股利、应收利息、应收证券清算款。

②、因四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

六、集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额总额	758,340,000.00
报告期间总参与份额	0.00
红利再投资份额	0.00
报告期间总退出份额	0.00
报告期末份额总额	758,340,000.00

七、重要事项提示

1、本集合计划管理人及托管人相关事项：

1) 本集合计划管理人及托管人报告期内没有发生任何涉及本集合计划管理、财产以及托管业务的诉讼事项。

2) 本集合计划管理人、托管人、涉及托管业务机构及其高级管理人员报告期内没有受到任何处罚。

2、本集合计划相关事项:

报告期内本集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

八、信息披露的查阅方式

网址: <http://www.grzq.com/soa/views/index.html>

热线电话: 010-83991858



四、托管人报告

日信证券长安 2 号集合资产管理计划 托管人报告（2016.07.01 -2016.09.30）

本托管人依据《日信证券长安 2 号集合资产管理计划合同》，自 2013 年 11 月 03 日起托管日信证券长安 2 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）资产。

本报告期间，渤海银行股份有限公司及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

本报告期间，渤海银行股份有限公司对管理人的投资运作行为按合同约定进行了监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

本报告期间，渤海银行股份有限公司对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

渤海银行股份有限公司复核了本计划资产管理报告（2016 年 3 季度报告）中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。

渤海银行股份有限公司托管业务部

2016 年 10 月 24 日



