

华安理财五号日日赢集合资产管理计划
2016年第三季度资产管理报告



二〇一六年十月

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.....	4
四、集合计划财务报告.....	5
(一)集合计划会计报表.....	5
(二)集合计划投资组合报告.....	6
(三)集合计划份额变动.....	7
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.....	8

华安理财五号日日赢集合资产管理计划

2016年第三季度资产管理报告

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：2016年7月1日—2016年9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

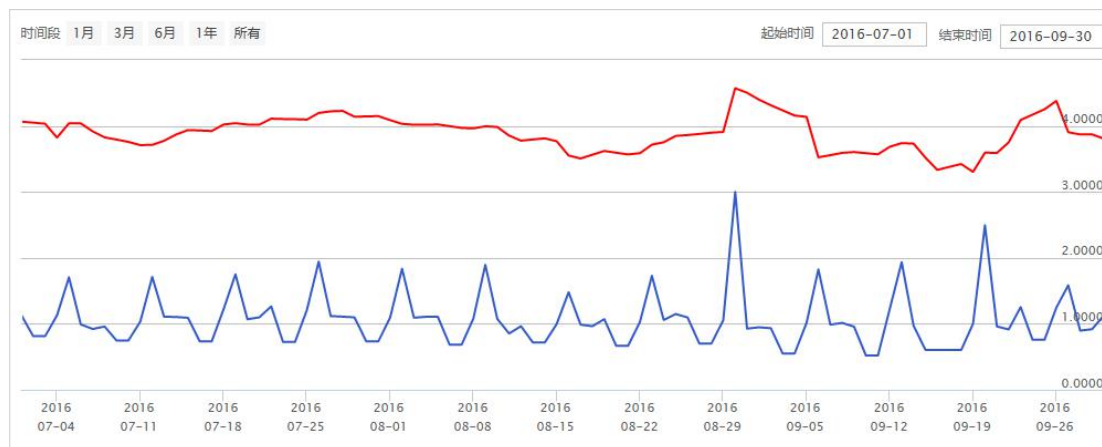
报告期末规模：625,557,258.07

二、主要财务指标

单位：元

集合计划本期净收益	4,992,899.52
期末集合计划资产净值	625,557,258.07
期间年化收益率	3.89%

-7 日年化收益率--每万份收益-



三、集合计划管理人报告

(一) 投资主办简介

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

上半年房地产、基建等领域较快增长，带动了投资大幅增加，三季度投资增速下行，主要原因一是多地实行房地产调控政策，新开工、拿地速度放慢，二是受去产能影响，20 多个省市发布去产能规划，关停减产政策逐步落实，企业投资受限，三是地方政府收入状况不佳。

表现较好的是进出口数据，不断上行且高顺差延续。外贸的超预期表现反映了外需有所改善，国内工业、制造业的回暖，内需也出现一定程度的好转。工业增速小幅下滑，国企经营状况普遍好于民营企业，工业企业利润反弹。

CPI 单边下行，8 月同比仅上涨 1.3%，创出近一年来的新低点，猪肉价格持续回落，食品对 CPI 的拉动明显减弱，通胀回落给四季度保持中性偏宽松的货币政策预留了空间。PPI 同比降幅收窄，除了去年低基数的影响外，黑色、有色以及煤炭价格表现突出，供给侧改革效果显现，经济 L 型走势底部徘徊的大格局不变。

三季度美国非农就业数据不及预期，9 月加息化为泡影，但 12 月仍有加息预期，人民币承受一定压力，预计四季度汇率波动可能加剧。

货币政策宽松偏中性基调不变，由于频繁降低准备金将加大本币贬值压力，所以今年央行采取了谨慎态度，较多采用公开市场操作。

三季度债市延续牛市格局，7 月大幅上涨，8 月央行公开市场操作趋于谨慎，重启了 14 天逆回购，导致市场对货币政策预期降低，债市开始小幅回调，其中短债回调，长债延续上涨态势。

当期产品规模增长较快，投资工作主要是秉持短久期、高流动性策略，以保证流动性为主要目标，兼顾投资收益率，随产品规模变动及时调整债券和现金类产品的持仓比例，主要配置对象是高评级、短久期品种。从投资业绩看，三季度实现年化收益率 3.89%，实现万份收益总值 97.9291 元，位于同类产品前列。

2、市场展望和投资计划

四季度内外环境与三季度大致相同，人民日报发文指出钢铁、煤炭去产能进度不及预期，预计四季度去产能进度将加快，房地产调控政策加码后大概率将结束之前的快速上涨势头，相关领域投资将延续三季度下行趋势。进出口有望延续三季度良好势头。今年以来外汇占款一直流出，人民币贬值压力大，预计四季度会延续，汇率有下行空间，制约了货币政策宽松空间，但世界范围内看，负利率时代到来，美联储加息不断延后，给国内货币政策宽松留有余地。债券市场本身资金充裕，机构配置力量强大，一级市场认购热情不减。各种因素综合作用，预计四季度市场将保持盘整格局，有阶段性交易机会。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，根据产品规模变动进一步做好债券仓位调整及结构调整，随市场波动进行波段交易增加差价收入。

（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总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：2016 年 9 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	7,921,945.32	短期借款	0.00
结算备付金	326,176.82	交易性金融负债	0.00
存出保证金	62,538.81	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	548,807,377.57	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	573,450.19
债券投资	250,635,810.03	应付赎回款	360,924.16
基金投资	298,171,567.54	应付管理人报酬	2,192,893.19
权证投资	0.00	其中：应付风险准备金	2,054,518.23
资产支持证券投资	0.00	应付托管费	40,366.11
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	46,000,389.00	应付交易费用	8,882.26
应收证券清算款	10,934,529.18	应交税费	0.00
应收利息	7,821,798.94	应付利息	0.00
应收股利	39,039.37	应付利润	71,980.91
应收申购款	6,986,349.78	其他负债	94,389.90
其他资产	0.00	负债合计	3,342,886.72
		所有者权益：	
		实收基金	625,557,258.07
		未分配利润	0.00
		所有者权益合计	625,557,258.07
资产合计	628,900,144.79	负债和所有者权益总计	628,900,144.79

2、集合计划经营业绩表

日期：2016 年 7 月-9 月

单位：元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	5,130,238.72	13,974,635.09
1、利息收入	3,239,455.43	8,838,095.12
其中：存款利息收入	48,153.81	155,201.78
债券利息收入	3,050,723.16	8,448,163.32

资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	140,578.46	234,730.02
2、投资收益	1,807,621.73	4,950,330.39
其中：股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	159,823.08	179,005.58
基金投资收益	-797.13	-670.68
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	1,648,595.78	4,771,995.49
个股期权收益	0.00	0.00
3、公允价值变动收益	0.00	0.00
4、其他收入	83,161.56	186,209.58
二、费用	137,339.20	378,708.76
1、管理人报酬	0.00	0.00
2、托管费	102,651.88	269,477.63
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	0.00	9.70
5、利息支出	24,247.16	45,255.83
其中：卖出回购金融资产支出	24,247.16	45,255.83
6、其他费用	10,440.16	63,965.60
三、利润总和	4,992,899.52	13,595,926.33

(二) 集合计划投资组合报告 (2016 年 9 月 30 日)

资产类别	市值 (元)	占总资产的比例 (%)
股票		
基金	298,171,567.54	47.41%
债券	250,635,810.03	39.85%
其中：央票		
国债		
政策性金融债		
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)		
企业债	120,626,771.48	19.18%
企业短期融资券	105,009,038.55	16.70%
可转债		
权证		

资产支持证券		
理财产品投资		
货币市场工具（票据、CD）		
现金（银行存款及清算备付金）	8,248,122.14	1.31%
银行定期存款（定期存款、通知存款、大额存单）		
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）	71,844,645.08	11.42%
其中：买入返售证券	46,000,389.00	7.31%
资产合计	628,900,144.79	100.00%

（三）集合计划份额变动（单位：份）

期初集合计划份额总额	338,273,704.70
报告期内集合计划参与份额	791,097,858.95
报告期内集合计划退出份额	503,814,305.58
报告期末集合计划份额总额	625,557,258.07

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：0551-65161552

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总部。

华安证券股份有限公司

二〇一六年十月十一日