

## 广发资管鑫添利 2 号集合资产管理计划

### 2016 年第四季度资产管理报告

管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

日期：2017 年 1 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.....       | 1 |
| (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) 财务指标计算公式.....    | 3 |
| (三) 报告期内收益分配情况.....  | 4 |
| 三、 集合计划管理人报告.....    | 4 |
| (一) 投资主办人简介.....     | 4 |
| (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.....     | 5 |
| (一) 资产负债表.....       | 5 |
| (二) 份额变动表.....       | 5 |
| 五、 集合计划投资组合报告.....   | 6 |
| (一) 资产组合情况.....      | 6 |
| (二) 报告期末衍生品投资情况..... | 6 |
| (三) 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.....       | 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 |

## 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8月23日—2016年12月31日

## 一、 集合计划简介

### （一） 基本资料

名称：广发资管鑫添利2号集合资产管理计划

成立规模（总份额）：82,115,797.40份

存续期间：24个月，可展期

报告期末计划总份额：53,043,189.49份

管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

### （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：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

住所：广州市大沙头路 29 号工银大厦

负责人：沈晓东

电话：（020）83786666-2115

传真：（020）83786666

全国统一客服热线：95588

网址：www.icbc.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8月23日—2016年12月31日 |
|----|--------------------|------------------------|
| 1  | 集合计划本期净收益（元）       | 771,633.86             |
| 2  | 单位集合计划期末可供分配净收益（元） | 0.0117                 |
| 3  | 期末集合计划资产净值（元）      | 53,325,926.30          |
| 4  | 期末单位集合计划资产净值（元）    | 1.0053                 |
| 5  | 期末单位集合计划累计资产净值（元）  | 1.0118                 |
| 6  | 本期单位集合计划净值增长率      | 1.18%                  |
| 7  | 单位集合计划累计净值增长率      | 1.18%                  |

注：集合计划本期净收益为本期利润总额扣除本期公允价值变动。

### (二) 财务指标计算公式

1. 单位集合计划期末可供分配净收益 = 集合计划期末可供分配净收益 ÷ 期末集合计划份额
2. 期末单位集合计划资产净值 = 期末集合计划资产净值 ÷ 期末集合计划份额
3. 期末单位集合计划累计资产净值 = (期末单位集合计划资产净值 + 拆分后单位集合计划分红金额) × 集合计划拆分比例 + 拆分前单位集合计划累计分红
4. 本期单位集合计划净值增长率 = (本期集合计划分红日上一日单位集合计划资产净值 / 本期期初单位集合计划资产净值) × 【期末单位集合计划资产净值 ÷ (本期集合计划分红日上一日单位集合计划资产净值 - 本期单位集合计划分红金额)】 × 集合计划拆分比例 - 1
5. 单位集合计划累计净值增长率 = (本集合计划第一次分红前单位集合计划资产净值 ÷ 1.0000) × [本集合计划第二次分红前单位集合计划资产净值 ÷ (本集合计划第一次分红前单位集合计划资产净值 - 第一次分红单位金额)] × [本集合计划第三次分红前单位集合计划资产净值 ÷ (本集合计划第二次分红前单位集合计划资产净值 - 第二次分红单位金额)] …… × [期末单位集合计划资产净值 ÷ (本集合计划最后一次分红前单位集合计划资产净值 - 最后一次分红单位金额)] × 集合计划拆分比例 - 1
6. 集合资产管理计划说明书、资产管理合同有特殊规定的，从其规定。

### (三) 报告期内收益分配情况

无

## 三、 集合计划管理人报告

### (一) 投资主办人简介

陈博，男，纽约大学硕士，6年从业经验，曾任职于巴克莱资本及摩根大通投资银行，2014年入职广发证券资产管理（广东）有限公司固定收益部，从事 FICC 业务投资研究。现担任广发资管 CTA 大宗商品 1 号、2 号集合资产管理计划，广发资管鑫添利 2 号、3 号集合资产管理计划投资主办。

陈翔，男，上海交通大学硕士，6年从业经验。曾任职于鹏华基金管理有限公司，2013年7月加入广发证券，历任广发证券资产管理部投资助理，广发证券资产管理（广东）有限公司固定收益部投资助理，主要负责广发资产配置策略集合资产管理计划、多添富和多添益系列的投资助理工作。现任广发资管 CTA 大宗商品 1 号、2 号集合资产管理计划，广发资管鑫添利 2 号、3 号集合资产管理计划和广发资产配置策略集合资产管理计划投资主办。

### (二) 报告期内业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.0053 元，累计单位资产净值为 1.0118 元；本期单位资产净值增长率 1.18%，累计增长率 1.18%。

### (三) 投资主办人工作报告

本报告期内通过投资于固定收益类资产及收益互换取得了符合预期业绩基准的收益。报告期内固定收益市场承受较大回调压力，但管理人通过积极应对，提前布局，良好的把控住固定收益部分的投资风险，同时在收益互换投资上对操作风险及信用风险进行了严格的把关，产品总体上运行平稳。

## 四、 集合计划会计报表

### (一) 资产负债表

单位：元

| 资产       | 2016/12/31    | 2016/9/30     | 负债与所有者权益   | 2016/12/31    | 2016/9/30     |
|----------|---------------|---------------|------------|---------------|---------------|
| 资产：      |               |               | 负债：        |               |               |
| 银行存款     | 52,521.12     | 179,953.01    | 短期借款       | -             | -             |
| 结算备付金    | -             | 426,112.52    | 交易性金融负债    | -             | -             |
| 存出保证金    | 33,605.68     | 33,527.66     | 衍生金融负债     | -             | -             |
| 交易性金融资产  | 51,962,356.69 | 81,461,468.55 | 卖出回购金融资产款  | -             | -             |
| 其中：股票投资  | -             | -             | 应付证券清算款    | -             | -             |
| 债券投资     | 51,308,967.26 | 78,999,995.89 | 应付赎回款      | -             | -             |
| 基金投资     | 653,389.43    | 2,461,472.66  | 应付管理人报酬    | 54,201.70     | 81,210.45     |
| 资产支持证券投资 | -             | -             | 应付风险准备金    | -             | -             |
| 专项资产管理计划 | -             | -             | 应付托管费      | 2,258.43      | 3,383.76      |
| 银行理财产品   | -             | -             | 应付销售服务费    | -             | -             |
| 信托投资     | -             | -             | 应付咨询服务费    | -             | -             |
| 私募基金投资   | -             | -             | 应付交易费用     | 475.14        | 402.39        |
| 衍生金融资产   | -             | -             | 应交税费       | -             | -             |
| 权证投资     | -             | -             | 应付利息       | -             | -             |
| 买入返售金融资产 | -             | -             | 应付利润       | -             | -             |
| 应收证券清算款  | -             | -             | 其他负债       | 18,000.00     | 5,358.60      |
| 应收利息     | 1,352,378.08  | 547,571.47    | 负债合计       | 74,935.27     | 90,355.20     |
| 应收股利     | -             | -             | 所有者权益：     |               |               |
| 应收申购款    | -             | -             | 实收基金       | 52,703,234.16 | 82,115,797.40 |
| 其他资产     | -             | -             | 未分配利润      | 622,692.14    | 442,480.61    |
|          | -             | -             | 所有者权益合计    | 53,325,926.30 | 82,558,278.01 |
| 资产总计     | 53,400,861.57 | 82,648,633.21 | 负债和所有者权益总计 | 53,400,861.57 | 82,648,633.21 |

### (二) 份额变动表

| 期初总份额         | 本期参与份额       | 本期参与份额<br>(强增) | 本期退出份额        | 期末总份额         |
|---------------|--------------|----------------|---------------|---------------|
| 82,115,797.40 | 26,049,910.2 | 301,308.89     | 55,423,827.00 | 53,043,189.49 |

## 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 | 52,521.12     | 0.10%   |
| 股票         | -             | -       |
| 债券         | 51,308,967.26 | 96.08%  |
| 基金         | 653,389.43    | 1.22%   |
| 资产支持证券     | -             | -       |
| 专项资产管理计划   | -             | -       |
| 银行理财产品     | -             | -       |
| 信托投资       | -             | -       |
| 私募基金投资     | -             | -       |
| 应收证券清算款    | -             | -       |
| 应收申购款      | -             | -       |
| 买入返售金融资产   | -             | -       |
| 其他资产       | 1,385,983.76  | 2.60%   |
| 合计         | 53,400,861.57 | 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) 报告期末衍生品投资情况

| 序号 | 名称                       | 持仓量 (买/卖) | 合约市值 (元)      |
|----|--------------------------|-----------|---------------|
| 1  | 广发证券-广发资管-权益互换【2016004】号 | 1         | 26,521,594.75 |
| 2  | 广发证券-广发资管-权益互换【2016003】号 | 1         | 26,521,594.74 |

### (三) 报告期关联交易投资情况

无

## 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. 《广发资管鑫添利2号集合资产管理计划说明书》
2. 《广发资管鑫添利2号集合资产管理计划资产管理合同》
3. 《广发资管鑫添利2号集合资产管理计划资产托管协议》
4. 《广发资管鑫添利2号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

2017年1月