

广发金管家多添利集合资产管理计划
2017 年第二季度资产管理报告



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：2017 年 7 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) 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.....	3
(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：2017年4月1日—2017年6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：938,389,689.20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

（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：杨明生

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	2017年4月1日—2017年6月30日
1	集合计划本期已实现收益(元)	1,146,583,900.84
2	本期利润(元)	1,146,583,900.84
3	期末集合计划资产净值(元)	93,838,968,920.00

(二) 报告期内收益分配情况

季度	收益分配情况	备注
2017年二季度	1,451,510,171.00	金额(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。

冯国生，南开大学概率论与数理统计硕士，6年证券从业经验，熟悉数理金融分析技术，擅长把握大类资产轮动机会。2011年6月加入广发证券，历任广发证券风险管理部业务助理，广发证券资产管理(广东)有限公司固定收益部宏观利率研究员，广发多添富系列集合资产管理计划投资助理，广发金管家多添利集合资产管理计划投资助理。现任广发金管家多添利集合资产管理计划投资主办人。

(二) 报告期内业绩表现

2017年二季度末各期限报价：7天品种(879002)业绩比较标准：4.80%；14天品种(879003)业绩比较标准：4.50%；28天品种(879004)业绩比较标准：4.50%；56天品种(879005)业

绩比较标准：4.50%；91天品种（879006）业绩比较标准：4.50%；182天品种（879007）业绩比较标准：4.60%；364天品种（879008）业绩比较标准：4.75%。

（三） 投资主办人工作报告

2017年二季度，监管政策在持续加强后有所缓和，经济数据逐步回落，债券收益率在本季度先上后下呈现倒V型走势，10年期国债总体在3.4%-3.7%的区间内波动。货币市场方面，在央行通过公开市场操作平稳过渡半年末的背景下，资金面波动幅度显著减小，银行间7天回购加权利率逐步回落至3.3%附近。本产品在规模上继续保持稳定，在投资方面坚持以流动性为主，投资活期类存款资产始终在合理比例，保持产品充足的流动性；同时为了兼顾收益性，适时择优配置可提前支取的定期存款，并择时配置收益率较高的短久期信用债。

展望三季度，一方面在全球央行都面临退出宽松的大背景下，国内货币政策难以存在实质性的放松空间，债券市场的担忧持续存在；另一方面目前CPI和M2双低的局面，加上经济基本面开始出现回落，超调的利率存在一定的修复下行空间。2017年三季度，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	2017/6/30	2017/3/31	负债与所有者权益	2017/6/30	2017/3/31
资产：			负债：		
银行存款	15,675,818,266.71	38,453,947,936.96	短期借款	-	-
结算备付金	1,156,721,207.75	775,866,584.23	交易性金融负债	-	-
存出保证金	1,082,393.84	7,323,803.00	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	104,907,033,865.22	117,216,286,360.66	卖出回购金融资产款	30,171,770,346.44	41,266,835,274.55
其中：股票投资	9,999,994.23	9,999,994.23	应付证券清算款	791,974,512.16	34,836,189.39
债券投资	99,235,569,470.64	107,732,529,414.89	应付赎回款	-	-
基金投资	3,506,386,900.35	7,563,305,951.54	应付管理人报酬	23,980,840.27	32,131,640.11
资产支持证券投资	2,155,077,500.00	1,910,451,000.00	应付托管费	258,560.48	5,355,273.39
专项资产管理计划	-	-	应付销售服务费	-	-
银行理财产品	-	-	应付咨询服务费	-	-

信托投资	-	-	应付交易费用	944,594.26	1,408,535.03
私募基金投资	-	-	应交税费	-	-
衍生金融资产	-	-	应付利息	-879,219.04	29,748,713.47
权证投资	-	-	应付利润	1,261,151,318.55	1,566,077,588.71
买入返售金融资产	1,475,099,893.00	3,593,617,698.67	其他负债	152,663,565.04	111,227,014.87
应收证券清算款	379,844,123.11	55,552,210.00	负债合计	32,401,864,518.16	43,047,620,229.52
应收利息	2,517,978,688.53	2,434,256,148.40	所有者权益:		
应收股利	-	568,395.60	实收集合计划	93,838,968,920.00	119,524,715,908.00
应收申购款	127,255,000.00	34,917,000.00	未分配利润	-	-
其他资产	-	-	所有者权益合计	93,838,968,920.00	119,524,715,908.00
资产总计	126,240,833,438.16	162,572,336,137.52	负债和所有者权益总计	126,240,833,438.16	162,572,336,137.52

(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
1,195,247,159.08	499,233,191.83	756,090,661.71	938,389,689.20

注：上表“本期参与份额”、“本期退出份额”包括因份额折算导致的份额变动。

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	16,832,539,474.46	13.33%
股票	9,999,994.23	0.01%
债券	99,235,569,470.64	78.61%
基金	3,506,386,900.35	2.78%
资产支持证券	2,155,077,500.00	1.71%
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	379,844,123.11	0.30%
应收申购款	127,255,000.00	0.10%
买入返售金融资产	1,475,099,893.00	1.17%
其它资产	2,519,061,082.37	2.00%

合计	126,240,833,438.16	100.00%
----	--------------------	---------

注1：“其它资产”包括“存出保证金”、“应收红利”、“应收利息”等项目；

2：上表中因四舍五入原因，各项目占总资产比例之和与合计可能存在尾差。

（二） 报告期关联交易投资情况

本集合计划于2017年5月22日认购管理人全资控股股东—广发证券股份有限公司承销的长隆集团有限公司非公开发行2017年公司债券（第一期）3000万元，详见《广发金管家多添利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

