

# 华安理财5号日日赢集合资产管理计划 2019年年度报告

计划管理人：华安证券股份有限公司

计划托管人：兴业银行股份有限公司

报告期间：2019年1月1日至2019年12月31日

## 目 录

|                        |   |
|------------------------|---|
| 一、集合资产管理计划简介.....      | 1 |
| (一) 基本资料.....          | 1 |
| (二) 管理人.....           | 1 |
| (三) 托管人.....           | 1 |
| (四) 会计师事务所简介.....      | 2 |
| 二、主要财务指标.....          | 2 |
| (一) 主要财务指标.....        | 2 |
| (二) 财务指标计算公式.....      | 2 |
| (三) 集合计划累计净值历史走势图..... | 3 |
| 三、集合计划管理人报告.....       | 3 |
| (一) 业绩表现.....          | 3 |
| (二) 投资主办简介.....        | 3 |
| (三) 投资主办工作报告.....      | 3 |
| (四) 风险控制报告.....        | 4 |
| 四、集合计划财务报告.....        | 5 |
| 五、集合计划投资组合报告.....      | 8 |
| (一) 资产组合情况.....        | 8 |
| (二) 集合计划份额变动.....      | 8 |
| 六、重要事项提示.....          | 9 |
| 七、备查文件目录.....          | 9 |
| (一) 本集合计划备查文件目录.....   | 9 |
| (二) 存放地点及查阅方式.....     | 9 |

## 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 5 号集合资产管理计划合同》、《华安理财 5 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。

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。

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。本报告已经审计。

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：2019 年 1 月 1 日—2019 年 12 月 31 日

## 一、集合资产管理计划简介

### (一) 基本资料

**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：**715693497.19

### (二) 管理人

**名称：**华安证券股份有限公司

**注册地址：**安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

**法定代表人：**章宏韬

**成立时间：**2001 年 1 月 8 日

**注册资本：**人民币 36.21 亿元

**经营期限：**持续经营

**电话：**(0551) 65161666

**传真：**(0551) 65161600

### (三) 托管人

**机构名称：**兴业银行股份有限公司

**法定代表人：**高建平

**通信地址：**福建省福州市湖东路 154 号

**邮政编码：**350003

**联系电话：**021-52629999

#### （四）会计师事务所简介

单位名称：容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

地址：中国北京市西城区阜成门外大街 22 号外经贸大厦 920-926

法定代表人：肖厚发

经办注册会计师：褚诗炜、鲍灵姬、洪雁南

联系电话：0551-63475800

传真：0551-62652879

## 二、主要财务指标

### （一）主要财务指标（2019 年 1 月 1 日-2019 年 12 月 31 日）

| 主要财务指标               | 本期间            |
|----------------------|----------------|
| 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 | 28,841,016.99  |
| 本期利润                 | 28,841,016.99  |
| 其中：本期公允价值变动损益        | 0.00           |
| 本期净值收益率              | 4.1651%        |
| 期末可分配利润              | 0.00           |
| 期末可供分配份额利润           | 0.0000         |
| 期末资产净值               | 715,693,497.19 |
| 期末单位资产净值             | 1.0000         |
| 本期累计净值收益率            | 29.4497%       |
| 万份实现收益               | 416.5056       |
| 年化收益率                | 4.1651%        |

### （二）财务指标计算公式

1、本期单位集合计划净收益 = 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 ÷ 集合计划份额

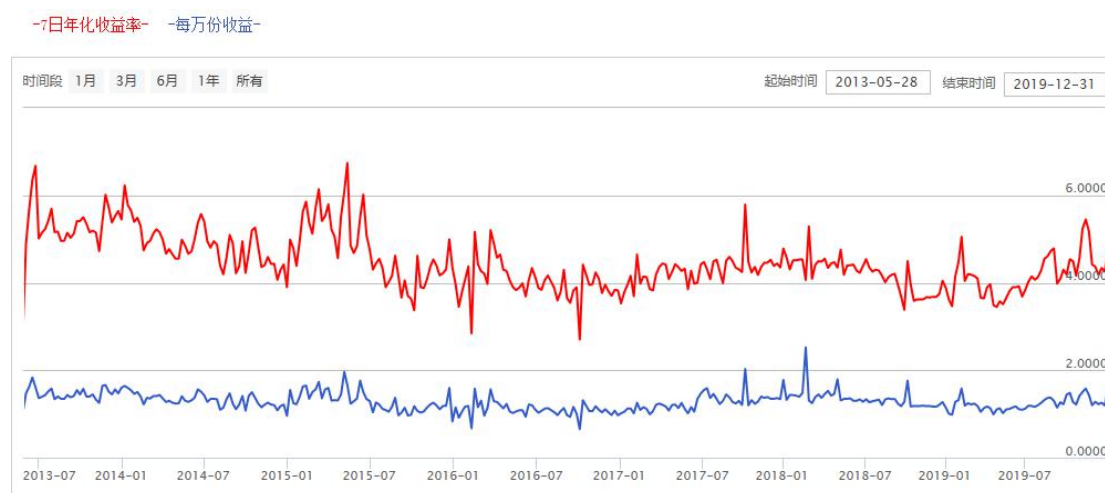
2、单位集合计划净值 = 集合计划净值 ÷ 集合计划份额

3、本期集合计划净值增长率 = [期末单位净值 / (分红除权前单位净值 - 单位分

红金额) \* 分红除权前单位净值/期初单位净值-1]\*100%

4、集合计划累计净值增长率 = (单位集合计划资产累计净值 - 1) \* 100%

### (三) 集合计划累计净值历史走势图



## 三、集合计划管理人报告

### (一) 业绩表现

从 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日, 本集合计划为持有人每万份投资实现收益 416.5056 元, 折合年化收益率为 4.1651%。

### (二) 投资主办简介

樊艳, 女, 工商管理硕士, 证券从业 21 年, 对于权益类市场、固收类市场有较长期投资经历, 注重择时择股及投资风险管控。

### (三) 投资主办工作报告

2019 年国内经济增速下行压力较大, 内外需同步回落。制造业投资和消费拖累内需, 贸易摩擦对出口有一定影响。中美贸易冲突先持续升级后缓和, 谈判达成第一阶段协议, 美国小幅取消已有关税, 出口面临的不确定下降。CPI 受猪肉价格拉动而回升, 呈现结构性通胀。货币政策偏宽松, 社会融资存量增速企稳

略上行。12 月中央经济工作会议确定了明年的重点工作，其中提到“健全财政、货币、就业等政策协同和传导落实机制，确保经济运行在合理区间”，“要保持宏观杠杆率基本稳定”，财政政策要“继续实施积极财政政策”并“要大力提质增效”，货币政策则要“灵活适度，保持流动性合理充裕，货币信贷、社会融资规模增长同经济发展相适应，降低社会融资成本，深化金融供给侧结构性改革，疏通货币政策传导机制，增加制造业中长期融资，更好缓解民营和中小微企业融资难融资贵问题”，政策继续强调“坚持房子是用来住的、不是用来炒的定位”，房地产严控总基调不变。预计 2020 年经济仍面临一定下行压力，货币政策维持偏宽松基调，全年将数次降准和下调公开市场操作利率，流动性总体仍保持较充裕状态。从目前情况看，疫情对 2020 年全球经济将有较大冲击，内需消费方面，国内居民收入、就业均面临一定压力，居民收入增长预期下降，对疫情结束后的消费回补力度保持谨慎乐观；政策面仍旧对经济和资本市场偏暖，货币政策持续宽松，财政政策积极，预计疫情防控取得阶段性成果后，全社会逐步复工复产，经济将逐步复苏，财政和货币政策效果将逐步显现，对冲外围的不利影响。受多种因素影响，2020 年内外环境均面临较大考验，但国内股市债市仍有一定投资机会。

全年产品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，实现万份收益 416.4869 元，折合年化收益率为 4.1649%。2020 年仍秉持短久期、高流动性策略，把握阶段性投资机会，做好不同类别资产之间的配置工作，债券以高评级短久期品种为主要配置对象适度进行波段交易增加差价收入。

#### （四）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（试行）》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5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5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

### 1、集合计划资产负债表（2019 年 12 月 31 日）

单位：人民币元

| 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 |
|-------------|---------------|---------------|-------------|------|------|
| <b>资 产：</b> |               |               | <b>负 债：</b> |      |      |
| 银行存款        | 48,004,485.15 | 17,681,162.59 | 短期借款        | 0.00 | 0.00 |
| 结算备付金       | 2,803,001.92  | 36,363.64     | 交易性金融负债     | 0.00 | 0.00 |



|             |                       |                       |                   |                       |                       |
|-------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 存出保证金       | 59,747.39             | 23,128.33             | 衍生金融负债            | 0.00                  | 0.00                  |
| 交易性金融资产     | 440,668,190.96        | 350,586,560.98        | 卖出回购金融资产款         | 44,997,750.00         | 0.00                  |
| 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        | 440,668,190.96        | 317,428,594.61        | 应付赎回款             | 23,610,587.31         | 436,200.76            |
| 基金投资        | 0.00                  | 33,157,966.37         | 应付管理人报酬           | 0.00                  | 0.00                  |
| 权证投资        | 0.00                  | 0.00                  | 应付托管费             | 43,583.26             | 42,564.08             |
| 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            | 18,838.48             | 11,486.55             |
| 买入返售金融资产    | 244,622,000.00        | 9,900,134.85          | 应交税费              | 100,661.29            | 44,669.26             |
| 应收证券清算款     | 14,256,452.25         | 0.00                  | 应付利息              | 10,028.78             | 0.00                  |
| 应收利息        | 15,260,486.96         | 6,390,886.57          | 应付利润              | 145,919.53            | 161,284.70            |
| 应收股利        | 0.00                  | 1,247.48              | 其他负债              | 9,740,275.96          | 9,364,700.53          |
| 应收申购款       | 0.00                  | 1,687,000.00          | <b>负债合计</b>       | <b>78,667,644.61</b>  | <b>10,060,905.88</b>  |
| 其他资产        | 28,686,777.17         | 32,877,139.75         |                   |                       |                       |
|             |                       |                       | <b>所有者权益：</b>     |                       |                       |
|             |                       |                       | 实收基金              | 715,693,497.19        | 409,122,718.31        |
|             |                       |                       | 未分配利润             | 0.00                  | 0.00                  |
|             |                       |                       | <b>所有者权益合计</b>    | <b>715,693,497.19</b> | <b>409,122,718.31</b> |
| <b>资产合计</b> | <b>794,361,141.80</b> | <b>419,183,624.19</b> | <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>794,361,141.80</b> | <b>419,183,624.19</b> |

## 2、集合计划经营业绩表（2019年1月1日至2019年12月31日）

单位：人民币元

| 项目         | 本期数           | 上年同期数         |
|------------|---------------|---------------|
| 一、收入       | 41,572,895.10 | 33,722,534.89 |
| 1、利息收入     | 41,318,522.82 | 21,936,555.99 |
| 其中：存款利息收入  | 913,618.70    | 226,319.60    |
| 债券利息收入     | 31,917,832.18 | 17,831,784.63 |
| 资产支持证券利息收入 | 0.00          | 0.00          |
| 买入返售证券收入   | 8,487,071.94  | 3,878,451.76  |
| 2、投资收益     | 246,308.28    | 11,781,606.90 |
| 其中：股票投资收益  | 0.00          | 0.00          |
| 债券投资收益     | -141,900.71   | 1,973.21      |
| 基金投资收益     | 0.00          | 0.00          |
| 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          | 388,208.99    | 11,779,633.69 |
| 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        | 8,064.00      | 4,372.00      |
| 二、费用          | 12,731,878.11 | 845,600.50    |
| 1、管理人报酬       | 0.00          | 0.00          |
| 2、托管费         | 552,731.78    | 629,945.00    |
| 3、销售服务费       | 0.00          | 0.00          |
| 4、交易费用        | 545.27        | 19.23         |
| 5、利息支出        | 1,064,306.48  | 74,259.73     |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 1,064,306.48  | 74,259.73     |
| 6、其他费用        | 11,114,294.58 | 141,376.54    |
| 三、利润总和        | 28,841,016.99 | 32,876,934.39 |

### 3、集合计划净值变动表

| 项目                                  | 本期金额              |                |                   |
|-------------------------------------|-------------------|----------------|-------------------|
|                                     | 实收基金              | 未分配利润          | 所有者权益             |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                     | 409,122,718.31    | 0.00           | 409,122,718.31    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数<br>（本期净利润）       | 0.00              | 28,841,016.99  | 28,841,016.99     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（减少以“-”号填列） | 306,570,778.88    | 0.00           | 306,570,778.88    |
| 其中：1. 基金申购款                         | 1,711,186,138.95  | 0.00           | 1,711,186,138.95  |
| 2. 基金赎回款                            | -1,404,615,360.07 | 0.00           | -1,404,615,360.07 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数          | 0.00              | -28,841,016.99 | -28,841,016.99    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                     | 715,693,497.19    | 0.00           | 715,693,497.19    |

## 五、集合计划投资组合报告

### (一) 资产组合情况 (2019 年 12 月 31 日)

| 序号 | 资产类别   | 市值 (元)         | 占总资产的比例 (%) |
|----|--|----------------|-------------|
| 1  | 股票   |                |             |
| 2  | 基金   |                |             |
| 3  | 债券   | 440,668,190.96 | 55.47%      |
| 4  | 其中：央票  |                |             |
| 5  | 国债   |                |             |
| 6  | 政策性金融债                                       |                |             |
| 7  | 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）       |                |             |
| 8  | 企业债  | 440,668,190.96 | 55.47%      |
| 9  | 企业短期融资券                                      |                |             |
| 10 | 可转债  |                |             |
| 11 | 银行间中期票据                                      |                |             |
| 12 | 同业存单   |                |             |
| 13 | 私募债  |                |             |
| 14 | 权证   |                |             |
| 15 | 资产支持证券                                       |                |             |
| 16 | 理财产品投资                                       |                |             |
| 17 | 货币市场工具（票据、CD）                                |                |             |
| 18 | 现金（银行存款及清算备付金）                               | 50,807,487.07  | 6.40%       |
| 19 | 银行定期存款（定期存款、通知存款、大额存单）                       |                |             |
| 20 | 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） | 302,885,463.77 | 38.13%      |
| 21 | 其中：买入返售证券                                    | 244,622,000.00 | 30.79%      |
| 22 | 资产合计   | 794,361,141.80 | 100.00%     |

### (二) 集合计划份额变动

单位：份

| 期初总份额          | 本期参与份额           | 本期退出份额           | 期末总份额          |
|----------------|------------------|------------------|----------------|
| 409,122,718.31 | 1,711,186,138.95 | 1,404,615,360.07 | 715,693,497.19 |

## 六、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。

## 七、备查文件目录

### (一) 备查文件目录

- 1、《华安理财 5 号日日赢集合资产管理计划合同》
- 2、《华安理财 5 号日日赢集合资产管理计划说明书》
- 3、《华安理财 5 号日日赢集合资产管理计划托管协议》
- 4、《华安理财 5 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  
二〇二〇年四月二十七日



客服电话：95318

资产管理总部客服电话：0551-65161552

公司网址：<http://www.hazq.com>