

华安资产-文津投资量化分级 资产管理计划清算报告

资产管理人：华安未来资产管理(上海)有限公司

资产托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行

报告送出日期：二〇一四年十二月四日

§ 1 重要提示

华安资产-文津投资量化分级资产管理计划资产管理合同（以下简称“本资产管理计划”）的合同成立日为 2013 年 11 月 29 日，合同有效期 1 年。按合同“二十一、资产管理合同的变更、终止与财产清算”之“（三）资产管理合同终止的情形包括下列事项：1、资产管理合同存续期限届满而未延期的。”约定，本资产管理计划于 2014 年 11 月 28 日期限届满终止。

华安未来资产管理(上海)有限公司作为本资产管理计划的资产管理人，和资产托管人中国工商银行股份有限公司上海市分行组成清算小组，对到期资产进行清算。

§ 2 产品概况

资产名称：	华安资产-文津投资量化分级资产管理计划	
合同生效日：	2013年11月29日	
合同到期日：	2014年11月28日	
报告期末资产管理计划份额总额：	优先：20,000,880.00 份	一般：10,001,400.00 份
投资目标：	应用量化投资策略，投资于中国金融期货交易所上市的股指期货合约，力争实现计划财产的保值增值。	

§ 3 资产管理计划运作期间财务报表

3.1 资产负债表（未经审计）

会计主体：华安资产-文津投资量化分级资产管理计划

报告截止日：2014 年 11 月 28 日（合同终止日）

单位：人民币元

资产	报告期末 2014年11月28日	负债和所有者权益	报告期末 2014年11月28日
资 产：		负 债：	
银行存款	26,975,864.17	短期借款	-

结算备付金	488,888.89	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	-	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
基金投资	-	应付赎回款	-
债券投资	-	应付管理人报酬	36,020.42
资产支持证券投资	-	应付托管费	4,502.55
衍生金融资产	-	应付客户服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	-
应收证券清算款	-	应交税费	-
应收利息	4,798.39	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	递延所得税负债	-
递延所得税资产	-	其他负债	-
其他资产	-	负债合计	40,522.97
		所有者权益：	
		实收基金	30,002,280.00
		未分配利润	-2,573,251.52
		所有者权益合计	27,429,028.48
资产总计	27,469,551.45	负债与持有人权益总计：	27,469,551.45

3.2 利润表（未经审计）

会计主体：华安资产-文津投资量化分级资产管理计划

本报告期：2013年11月29日(合同生效日)至2014年11月28日（合同终止日）

单位：人民币元

项 目	本报告期 2013年11月29日至2014年11月28日
一、收入	-1,746,466.92
1. 利息收入	930,373.08
其中：存款利息收入	203,653.25
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	726,719.83
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,676,840.00
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-2,676,840.00

股利收益	
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	
减：二、费用	826,784.60
1、管理人报酬	225,017.50
2、托管费	28,127.17
3、客户服务费	160,007.04
4、交易费用	404,571.05
5、利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
6、其他费用	9,061.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,573,251.52
所得税费用（以“-”号填列）	
四、净利润（净亏损“-”号填列）	-2,573,251.52

3.3 所有者权益（净值）变动表（未经审计）

会计主体：华安资产-文津投资量化分级资产管理计划

本报告期：2013 年 11 月 29 日(合同生效日)至 2014 年 11 月 28 日（合同终止日）

单位：人民币元

项 目	本报告期 2013 年 11 月 29 日至 2014 年 11 月 28 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(净值)	30,002,280.00	-	30,002,280.00
二、本期经营活动产生的净值变动数(本期利润)	-	-2,573,251.52	-2,573,251.52
三、本期资产参与或退出交易产生的净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期分配利润产生的净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益(净值)	30,002,280.00	-2,573,251.52	27,429,028.48

§ 4 资产管理计划的剩余财产分配

4.1 清算费用

按照《华安资产-文津投资量化分级资产管理计划资产管理合同》第二十二

节“资产管理合同的变更、终止和财产清算”的规定，清算费用是指计划财产清算小组在进行计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由计划财产清算小组优先从计划财产中支付。

本资产管理计划的清算费用包括划付清算款及各项相关费用（管理费、托管费等）而产生的划款手续费等，已在剩余财产中扣除。

4.2 计划剩余财产的分配

按《华安资产-文津投资量化分级资产管理计划资产管理合同》“六、份额的分级（三）收益分配规则：在本资产管理合同终止后，以本计划净资产为限优先分配优先受益份额的本金及基本收益，在优先分配优先受益份额的本金及基本收益后的剩余净资产分配予一般受益份额。本资产管理计划剩余财产的具体分配顺序见下表：

金额单位：人民币元

项 目	分 配 顺 序
一、2014年11月28日(合同终止日)所有者权益	27,429,028.48
二、可供分配优先受益人本金和利息	21,300,937.20
优先受益份额持有人持有的计划份额（份）	20,000,880.00
优先类计划份额持有人应得收益	1,300,057.20
三、可供分配一般受益人的剩余财产总额	6,128,091.28
一般受益份额持有人持有的计划份额（份）	10,001,400.00
一般受益份额持有人份额净值	0.6127

4.3 关于清算备付金、结算保证金、结息款和清算款支付安排的特别说明

1) 由于受中国证券登记结算公司清算备付金、结算保证金制度及资产托管人清算规则的影响，清算备付金、结算保证金账户内的资金按相关规则每月调整，备付金账户、保证金账户中该部分剩余财产按照中国证券登记结算公司相关政策，最长于合同终止后2个月可以完成清理。

2) 根据资产托管人清算规则，于每个季度下旬进行结息清算，预计本产品

最迟于 2015 年 3 月底可支付所有剩余结息款。

4.4 计划财产清算报告的告知安排

本清算报告已经资产托管人复核，报中国证监会备案并告知资产委托人。

4.5 计划财产相关账户的注销

计划财产清算完毕后，资产管理人配合资产托管人按照规定注销资产管理计划财产的资金账户、证券账户及其他账户。

资产托管人

中国工商银行股份有限公司
上海市分行

2014 年 12 月 4 日

资产管理人

华安未来资产管理(上海)有限公司

2014 年 12 月 4 日