

国元美好中国 4 号限额特定集合资产管理计划

资产管理报告

(2013 年 06 月 27 日—2013 年 09 月 30 日)

重要提示

本报告依照《证券公司客户资产管理业务办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》等法律、行政法规和中国证券业协会的有关规定制作。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，根据法律法规的规定、安全保管集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。

中国证券业协会对本集合计划出具了备案文件（中证协函[2013]776 号），但中国证券业协会对本集合计划做出的任何决定，均不表明中国证券业协会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

托管人已于 2013 年 10 月 15 日复核了本报告。本报告未经审计。

管理人、托管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：2013 年 06 月 27 日——2013 年 09 月 30 日

一、 集合计划简介

(一) 基本资料

名称：国元美好中国 4 号限额特定集合资产管理计划

类型：限额特定集合资产管理计划

成立日期：2013 年 6 月 27 日

成立规模：64541106.45 份

存续期：2 年零 3 个工作日

管理人：国元证券股份有限公司

(二) 管理人

名称：国元证券股份有限公司

设立日期：2001 年 10 月 18 日

注册地址：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：蔡咏

总裁：俞仕新

电话：95578 传真：0551 - 62634906

信息披露负责人：刘祥

公司网址：www.gyzq.com.cn

(三) 托管人

名称：中国民生银行

设立日期：1996 年 1 月 12 日

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

电话：(010) 58560666

传真：(010) 58560794

托管人网址：www.cmbc.com

二、集合计划业绩表现

截至 2013 年 9 月 30 日；国元美好中国 4 号的单位净值为 1.0289 元，累计单位净值为 1.0289 元，本期净值增长率为 2.89%%，集合计划累计净值增长率为 2.89%。

三、集合计划财务报告

1、集合计划资产负债表

单位：人民币

项 目	行次	2013 年 09 月 30 日
资 产：		
银行存款	1	1,873,733.64
结算备付金	2	0
存出保证金	3	0.00
股票投资	4	0.00
债券投资	5	0.00
资产支持证券投资	6	0.00

基金投资	7	0.00
衍生金融资产	8	
信托投资	9	6,4540,000.00
买入返售金融资产	10	0.00
应收证券清算款	11	0.00
应收利息	12	150.48
应收股利	13	0.00
应收申购款	14	
其他资产	15	
资产合计:	16	66,413,884.12
负债及持有人权益		
负债:		
短期借款	17	
交易性金融负债	18	
衍生金融负债	19	
卖出回购金融资产款	20	0.00
应付证券清算款	21	0.00
应付赎回款	22	
应付赎回费	23	
应付管理人报酬	24	0.00
应付托管费	25	8,406.52
应付销售服务费	26	0.00

应付利息	27	0.00
应付利润	28	
其他负债	29	0.00
负债合计	30	8,406.52
持有人权益：		
实收基金	31	64,541,106.45
未分配利润	32	1,864,371.15
持有人权益合计	33	66,405,477.60
负债与持有人权益总计：	34	66,413,884.12

2、集合计划利润表

单位：人民币元

项 目	行次	2013 年 06 月 27 日至 2013 年 9 月 30 日
一、收入	1	1872978.17
1、信托投资收入	2	1868953.68
2、债券差价收入	3	
3、资产支持证券差价收入	4	0
4、基金差价收入	5	0
5、衍生工具收益	6	0
6、债券利息收入	7	0

7、资产支持证券利息收入	8	0
8、存款利息收入	9	4024.49
9、基金红利收入	10	0
10、买入返售金融资产收入	11	0
11、公允价值变动收益（净损失以“-”填列）	12	0
12、其他收入	13	0
二、费用	14	8607.02
1、管理人报酬	15	0
2、托管费	16	8406.52
3、销售服务费	17	0
4、交易费用	18	0
5、利息支出	19	
6、卖出回购金融资产支出	20	0
7、其他费用	21	200.5
三、利润总额	22	1864371.15

3、期末集合计划资产组合情况(2013 年 09 月 30 日)

单位：人民币元

持仓种类	期末市值	占总资产比例
信托投资	64540000.00	97.18%

银行存款	1873733.64	2.82%
其他资产	150.48	
合 计	66413884.12	100%

四、重要事项提示

(一) 本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

(二) 本集合计划聘请的会计师事务所没有发生变更。

(三) 本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

(四) 本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

(五) 本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

五、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

1、中国证券业协会《关于国元证券股份有限公司发起设立国元美好 4 号限额特定集合资产管理计划的本案确认函》，中证协函[2013]776 号

2、《国元美好中国 4 号限额特定集合资产管理计划说明书》

3、《国元美好中国 4 号限额特定集合资产管理计划合同》

4、《国元美好中国 4 号限额特定集合资产管理计划托管协议》

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：合肥市寿春路 179 号国元大厦

网址：www.gyzq.com.cn

信息披露电话：95578

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人国元证券股份有限公司。



国元证券股份有限公司

2013 年 10 月 15 日