

华能信托·诚鑫财富管理集合资金信托计划

第一季度信息披露

尊敬的委托人、受益人：

兴业银行股份有限公司（以下简称“我行”）作为投资管理顾问，华能贵诚信托有限公司（以下简称“受托人”）作为受托人管理的“华能信托·诚鑫财富管理集合资金信托计划”（以下简称“本信托计划”）成立于 2013 年 11 月 22 日，已运作 3 个月。现向您报告本信托计划截至 2014 年 2 月 24 日的信托事务处理情况。

一、信托计划基本情况

信托计划名称：华能信托·诚鑫财富管理集合资金信托计划

信托计划成立日：2013 年 11 月 22 日

信托计划规模：截止报告日，本信托计划存续规模为 203,990.00 万元。

信托计划期限：信托计划期限不少于 12 个月，不设定最长存续期限，受托人可按照信托文件规定终止信托计划。

信托资金运用：经与投资管理顾问协商，受托人根据信托文件的规定集合运用信托资金，将信托资金投资于流动性资产、金融机构产品及其他投/融资类资产。

信托单位收益分配：信托计划存续期间，各期各类信托单位于其锁定期满之日/循环封闭期满之日内分配期间信托利益；信托计划终止时，分配各期各类信托单位期末信托利益。

信托计划受托人：华能贵诚信托有限公司

信托计划保管人：兴业银行股份有限公司

信托计划代理收付机构：兴业银行股份有限公司

信托计划投资管理顾问：兴业银行股份有限公司

信托计划募集账户：

开户名称：华能贵诚信托有限公司
开户银行：兴业银行贵阳分行营业部
银行账号：6020 1010 0100 1262 86

信托计划保管账户（信托财产专户）：

开户名称：华能贵诚信托有限公司
开户银行：兴业银行贵阳分行营业部
银行账号：6020 1010 0100 1250 71

二、信托单位的申购、赎回及存续

1、信托单位的申购：报告期内，本信托计划共设立 6 个开放日，共发行信托单位 228,190.00 万份，募集信托资金 228,190.00 万元。截止到本报告期末，本信托计划累计发行信托单位 228,190.00 万份，累计募集信托资金 228,190.00 万元。（各开放日设立详情可登陆我行网站 www.cib.com.cn 查询相关公告信息）

2、信托单位的赎回：报告期内，本信托计划共赎回信托单位 24,200.00 万份。截止到报告期末，本信托计划累计注销信托单位 24,200.00 万份。

3、信托单位存续情况：截至 2014 年 2 月 24 日，本信托计划存续信托单位 203,990.00 万份，

三、信托资金运用情况

（一）信托资金投资变动情况

本报告期内，信托资金新增投资额 376,703.00 万元，减少投资额 175,473.00 万元，净变动金额 201,230.00 万元。

（二）信托资金新增投资情况

序号	交易主体/项目名称	累计投资额(单位:万元)	当前余额(单位:万元)	投资年化收益率	投资期限	是否存续
1	山东信托.潍坊国资信托贷款单一资金信托项下的信托受益权	100,000.00	100,000.00	7.91%	1.2 年	是
2	兴业银行人民币高端理财 ⁽¹⁾	114,080.00	27,840.00	7.30% ⁽²⁾	94 日	是
3	兴蒙(5-1)期单一资金信托项下的信托受益权	15,000.00	15,000.00	8.075%	1.6 年	是
4	同业存款	19,783.00	18,390.00	7.26% ⁽³⁾		是
5	现金宝	87,840.00	-	1.50%	3 日	否
6	贵阳城投信托受益权转让项目	40,000.00	40,000.00	9.10%	3.9 年	是
合计						

	376,703.00	201,230.00			
--	------------	------------	--	--	--

注:(1)理财产品视为一个投资类别,因此此表的数据为各系列理财数据的累计数;下同

(2)此处的收益率为当前存续各类别的加权收益率

(3)此处的收益率为当前存续各类别的加权收益率

(三) 信托资金投资减少情况

序号	资金运用方式	交易主体/项目名称	本期回收投资资金(万元)	当前存续
1	流动性	兴业银行人民币高端理财	86,240.00	27,840.00
2	流动性	现金宝	87,840.00	0.00
3	流动性	同业存款	1,393.00 ⁽¹⁾	18,390.00
		合计	175,473.00	46,230.00

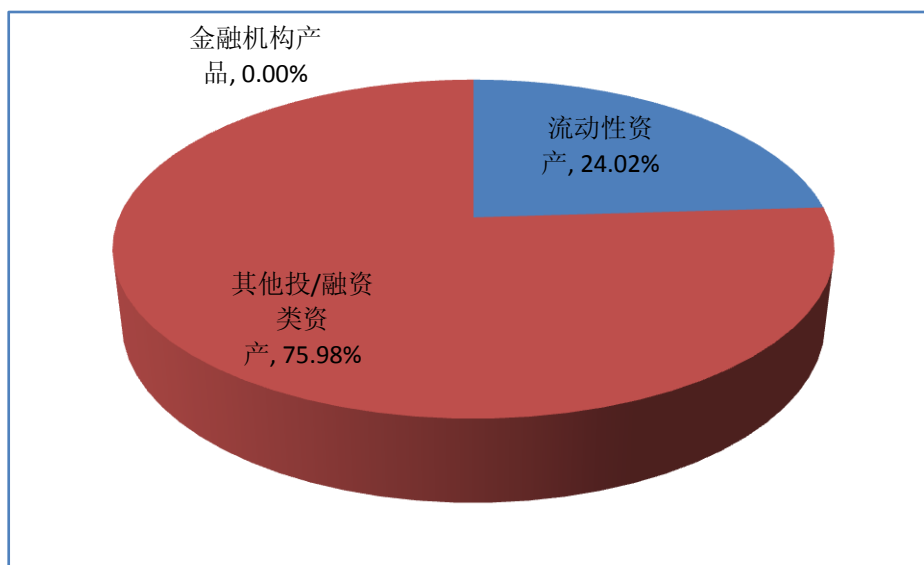
注:(1)此处包含投资收益再投资金额 1,093.00 万元

(四) 信托计划配置情况

1、配置结构表

资产类别	综合收益率(/年)	成本金额(万元)	资产配置比例
流动性资产	6.9138%	48,990.00	24.02%
其他投/融资类资产	8.2331%	155,000.00	75.98%
金融机构产品	0.0000%	-	0.00%
合计	7.9162%	203,990.00	100.00%

2、配置比例图示



经与投资管理顾问协商，受托人根据目前信托计划流动性情况及投资运作情况，暂时提高流动性资产配置比例，依据上述配置策略，截止本报告期末，信托资金加权平均投资年化收益率达 7.9612%。

3、投资明细构成

序号	交易主体/项目名称	当前余额 (单位：万元)	投资年化 收益率	投资期限	资产类别
1	山东信托.潍坊国资信托贷款单一资金信托项下的信托受益权	100,000.00	7.91%	1.2 年	融资类资产
2	兴业银行人民币高端理财	27,840.00	7.30%	94 日	流动性资产
3	兴蒙(5-1)期单一资金信托项下的信托受益权	15,000.00	8.075%	1.6 年	融资类资产
4	同业存款	18,390.00	7.26%		流动性资产
5	现金	2,760.00	0.72%		流动性资产
6	贵阳城投信托受益权转让项目	40,000.00	9.10%	3.9 年	融资类资产
合计		203,990.00			

四、信托资金收益情况

1、信托财产实现收入

本报告期内，本信托计划实现收入合计 9,040,699.99 元，全部为投资收益。

截止到本报告期末，信托财产实现收入累计 9,040,699.99 元，全部为投资收益。

2、信托费用支出

本报告期内，本信托计划累计发生费用支出 371,732.21 元，其中，支付保管人保管费 11,697.10 元，支付代理收付费 116,970.96 元，支付投资管理顾问费 35,091.29 元，因处理信托事务产生其他费用 207,972.86 元。本报告期内尚未支付受托人报酬及信托事务管理费。

截止到本报告期末，本信托计划累计发生费用支出 371,732.21 元，其中，支付保管人保管费 11,697.10 元，支付代理收付费 116,970.96 元，支付投资管理顾问费 35,091.29 元，因处理信托事务产生其他费用 207,972.86 元。

3、期间信托利益分配

根据《华能信托·诚鑫财富管理集合资金信托合同》约定，本报告期内分配信托利益合计 5,172,164.38 元，分配发行期利息 394.53 元，已全部分配完毕。

截止到本报告期末，本信托计划累计分配期间信托利益 5,172,164.38 元，发行期利息 394.53 元。

五、受托人后续尽职管理情况说明

受托人已指定信托经理对信托资金所投资各项目实施后续尽职管理，包括对各项信托投资项下的交易对手的财务经营状况进行持续监测、落实相关权益和风险控制措施等。截止报告日，本信托计划所投项目运行正常。

六、保管人保管报告情况说明

本信托计划保管人兴业银行股份有限公司已于 2013 年 12 月出具《保管报告》（2013 年第四季度）。（报告已经放置于受托人营业场所备查阅）

七、其他重大事项

本信托计划自成立至今，未发生信托经理变更的情形，未发生涉及诉讼或者损害信托财产、受益人利益的情形。报告期内无影响本信托计划正常运行的因素。

八、结论

本信托计划运作正常，尚未发生风险因素。

为保证本信托计划安全稳健运行，我行作为投资管理顾问，将继续与受托人一起，严格按照相关信托文件的约定，勤勉尽责，努力实现本信托计划受益人利益的最大化。

您可以登录我行网站 www.cib.com.cn 了解本信托计划运作情况。如您对本信托计划有疑问或对客户服务有任何要求，请联系兴业银行各营业网点客户经理。

特此公告。

兴业银行股份有限公司

2014年2月24日