

# 浙商金惠 3 号集合资产管理计划 2013 年第三季度资产管理报告

计划管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

计划托管人：中国光大银行股份有限公司

报告期间：2013 年 7 月 1 日—2013 年 9 月 30 日

## 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人浙江浙商证券资产管理有限公司依据《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。

中国证监会对浙商金惠 3 号集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具了批复（证监许可[2010]1598 号）。中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监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。

集合资产管理计划托管人中国光大银行股份有限公司于 2013 年 10 月 17 日对本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

管理人承诺以诚实信用、勤勉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。

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。

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 7 月 1 日—2013 年 9 月 30 日

## 一、 集合计划简介

### 1. 基本资料

集合计划名称：浙商金惠 3 号集合资产管理计划

集合计划类型：非限定性集合资产管理计划

集合计划成立日：2010 年 12 月 1 日

集合计划成立规模：257, 512, 575.10 份

集合计划报告期末计划总规模：64, 886, 211.41 份

集合计划存续期：2010 年 12 月 1 日-2015 年 11 月 30 日

集合计划投资目标：金惠 3 号以证券为主要投资对象。管理人将在有效控制风险和保持投资组合流动性的前期下，力争在本集合计划运作期间，实现集合计划资产的稳定增值。

### 2. 集合计划管理人

名称：浙江浙商证券资产管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市下城区天水巷 25 号

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号

法人代表：吴承根

联系人：翁富国

联系电话：0571-87901972

传真电话：0571-87902581

网 址： [www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)

### 3. 集合计划托管人

名称：中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

联系人：张建春

联系电话：010-63639180

网址： [www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

4. 注册登记机构:

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号

5. 会计师事务所和经办注册会计师

名称: 天健会计师事务所有限公司

办公地址: 浙江省杭州市西溪路 128 号 8 楼

经办注册会计师: 吴懿忻 石浩

联系电话: 0571-88216847

传真: 0571-88216880

## 二、 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

1. 主要财务指标:

单位: 人民币元

	主要财务指标	2013 年 9 月 30 日
1	期初单位集合计划资产净值	0.9435
2	期末单位集合计划资产净值	1.0209
3	期末单位集合计划累计资产净值	1.0429
4	期末集合计划资产净值	66,241,058.86
5	本期集合计划利润	10,360,916.60
6	期末集合计划未分配利润	1,354,847.45
7	单位期末集合计划未分配利润	0.0209
8	本期集合计划净值增长率%	8.20%
9	集合计划累计净值增长率%	4.34%

2. 财务指标的计算公式

(1) 期末单位集合计划资产净值 = 期末集合计划资产净值 ÷ 期末集合计划份额

(2) 期末单位集合计划累计资产净值 = 期末单位集合计划资产净值 + 单位集合计划累计分红

(3) 单位期末集合计划未分配利润 = 集合计划期末未分配利润 ÷ 期末集合计划份额

(4) 本期集合计划净值增长率 = (分红前一天单位净值 / 期初单位净值) × { 期末单位净值 / (分红前一天单位净值 - 分红金额) } - 1

(5) 集合计划累计净值增长率 = (第一次分红后单位集合计划资产净值增长率 + 1) × (第二次分红后单位集合计划资产净值增长率 + 1) × …… × (最后一次分红后

单位集合计划资产净值增长率+1) -1

### 3. 收益分配情况

集合计划成立以来，本集合计划收益分配情况：

分配红利日期	每 10 份集合计划分红	备注
-	-	本期未分配收益

### 4. 开放期

根据本计划说明书和合同约定，本计划开放日为：自成立日起，每满 3 个月的首 5 个工作日。

本报告期内本计划于 2013 年 9 月 2 日进入第十个开放期，开放日为：2013 年 9 月 2 日至 2013 年 9 月 6 日，共 5 个法定交易日。开放期内，投资者可以申购和赎回。

开放期结束后再次封闭。

## 三、 集合计划管理人报告

### 1. 业绩表现

截止到 2013 年 9 月 30 日，集合计划单位资产净值为 1.0209 元，本期净值增长率为 8.20%，集合计划单位累计资产净值 1.0429 元，累计净值增长率为 4.34%。

### 2. 投资主办简介

陈旻先生，现任浙江浙商证券资产管理有限公司研究员及投资主办。英国埃克塞特大学硕士学位，金融与投资专业。拥有 8 年证券从业经验。先后于国禾投资、申银万国证券客户资产管理总部任研究员和投资经理职位。擅长 TMT（科技、传媒、通信）等相关上市公司的研究。

### 3. 投资主办工作报告

三季度市场风格呈现多元化，在七月份延续了成长股行情之后，8 月份随着上海自贸区、优先股试点、三中全会改革预期等一系列主题的带领下，沪深 300、上证综指出现了强劲反弹，市场情绪亦随之改善。

我们曾说，“十年一轮的新政治周期已经启动，而新政治周期的政策红利远不止提高投资增速那么肤浅”，三季度资本市场恰恰印证了我们的这种判断。上海自贸区

的火速落地不仅让资本市场更让全体国人看到了新一届政府改革的决心，我们忽然发现原来除了“人口红利”，我们还有巨大“政策红利”。而随着经济结构调整、产业升级深化、上市公司治理水平提高，叠加政策红利的释放，有望从根本上提升中国资本市场的投资价值。

在今夏达沃斯论坛上，李克强总理提出，中国经济发展的奇迹已进入提质增效的第二季，改革、转型是两大手段。我们认为未来股市投资方向，同样应遵循“改革”和“转型”两条线索。转型方面，中期持有 TMT 中的 4G 投资、LED、智慧城市、大传媒等高景气子行业，以及环保、医药中业绩无忧的龙头。改革方面，在自贸区（金改）、土改、二胎等相关主题第一波炒作完成之后，市场的关注点将从概念向更实质影响过渡。我们将兼顾基本面的安全边际，又有政策红利的股价弹性的品种，作为这方面的主要标的。

#### 4. 内部性声明

##### (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》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

通过监控和检查，可以确认，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、公司相关制度和本集合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；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

## 四、 集合计划财务报表

### 1. 资产负债表：

日期：2013 年 9 月 30 日

单位：元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
----	------	----------	------

资 产:		负 债:	
银行存款	3,398,969.83	短期借款	0.00
结算备付金	477,786.65	交易性金融负债	0.00
存出保证金	159,071.87	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	55,440,666.78	卖出回购金融资产款	0.00
其中: 股票投资	53,600,256.52	应付证券清算款	880,307.05
债券投资	0.00	应付赎回款	0.00
基金投资	1,840,410.26	应付管理人报酬	71,645.29
权证投资	0.00	应付托管费	11,940.88
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	67,299.15
买入返售金融资产	0.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	1,803,609.90	应付利息	0.00
应收利息	1,956.18	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	9,809.98
应收申购款	0.00	<b>负债合计</b>	<b>1,041,002.35</b>
其他资产	6,000,000.00		
		<b>所有者权益:</b>	
		实收基金	64,886,211.41
		未分配利润	1,354,847.45
		<b>所有者权益合计</b>	<b>66,241,058.86</b>
<b>资产合计</b>	<b>67,282,061.21</b>	<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>67,282,061.21</b>

## 2. 损益表:

日期: 2013年7月1日至2013年9月30日

单位: 元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	11,655,184.80	27,255,113.35
1、利息收入	64,184.42	249,559.35
其中: 存款利息收入	64,184.42	213,539.49
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	0.00	36,019.86
2、投资收益	11,530,683.04	27,774,967.93
其中: 股票投资收益	11,332,512.80	26,997,039.00
债券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	126,157.35	76,158.44
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	72,012.89	701,770.49
3、公允价值变动收益	60,317.34	-769,413.93
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	1,294,268.20	3,224,987.37
1、管理人报酬	858,348.52	1,564,700.17
2、托管费	47,695.36	165,420.61
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	383,724.32	1,445,966.59
5、利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
6、其他费用	4,500.00	48,900.00
三、利润总和	10,360,916.60	24,030,125.98

### 3. 所有者权益（净值）变动表：

日期：2013年7月1日至2013年9月30日

单位：元

项目	本期金额			上期金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益	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）	103,655,201.07	-5,858,518.19	97,796,682.88	126,188,212.47	-11,410,416.44	114,777,796.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	10,360,916.60	10,360,916.60	0.00	5,153,747.69	5,153,747.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以“-”号填列）	-38,768,989.66	-867,136.56	-39,636,126.22	-22,533,011.40	398,150.56	-22,134,860.84
其中：1. 基金申购款	967,912.92	96.80	968,009.72	9,087,345.60	-87,345.60	9,000,000.00
2. 基金赎回款	-39,736,902.58	-867,233.36	-40,604,135.94	-31,620,357.00	485,496.16	-31,134,860.84
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	-2,280,414.40	-2,280,414.40	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	64,886,211.41	1,354,847.45	66,241,058.86	103,655,201.07	-5,858,518.19	97,796,682.88



## 五、 集合计划投资组合报告

### 1. 资产组合情况：

日期：2013年9月30日

单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例%
银行存款	3,398,969.83	5.05%
结算备付金	477,786.65	0.71%
存出保证金	159,071.87	0.24%
股票投资	53,600,256.52	79.67%
基金投资	1,840,410.26	2.74%
应收证券清算款	1,803,609.90	2.68%
应收利息	1,956.18	0.00%
其他资产	6,000,000.00	8.92%
资产合计	67,282,061.21	100%

注：由于四舍五入的原因，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

### 2. 报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

证券代码	证券名称	数量	市值	市值占净值%
002501	利源铝业	689,000	8,013,070.00	12.10%
B60103	盛屯矿业股票收益权专项集合	6,000,000	6,000,000.00	9.06%
002178	延华智能	500,000	4,655,000.00	7.03%
600108	亚盛集团	500,000	4,635,000.00	7.00%
600557	康缘药业	147,400	4,296,710.00	6.49%
600276	恒瑞医药	100,000	3,637,000.00	5.49%
000063	中兴通讯	200,000	3,320,000.00	5.01%
600000	浦发银行	300,000	3,027,000.00	4.57%
600705	中航投资	146,000	2,811,960.00	4.25%
000826	桑德环境	80,000	2,700,000.00	4.08%

## 六、 集合计划份额变动情况

本集合计划在本期份额变化如下：

期初总份额	本期参与份额	本期分红再投份额	本期退出份额	期末总份额
103,655,201.07	967,912.92	0	39,736,902.58	64,886,211.41

## 七、 重要事项揭示

1. 浙商证券股份有限公司（以下简称“浙商证券”）于2012年11月1日获得中国证

券监督管理委员会《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2012]1431号），获准设立全资证券资产管理子公司，即“浙江浙商证券资产管理有限公司”（以下简称“浙商资管”）。自获得批复以来，浙商资管积极筹备，于2013年4月18日完成工商登记，并于2013年7月22日正式取得《经营证券业务许可证》。根据监管部门批复要求，在浙江浙商证券资产管理有限公司取得《经营证券业务许可证》后，浙商证券经营范围减少证券资产管理业务一项，且所有资产管理计划的管理人将于2013年7月23日起由“浙商证券股份有限公司”变更为“浙江浙商证券资产管理有限公司”。因此，在本报告期内本集合计划资产管理人由“浙商证券股份有限公司”变更为“浙江浙商证券资产管理有限公司”，管理人董事长吴承根、总经理李雪峰；托管人的董事长、总经理没有发生变更。

2. 在本报告期内本集合计划投资主办发生变更，原投资主办周良不再担任本集合计划投资主办，现本集合计划投资主办由陈旻担任。。

## 八、 备查文件目录

### 1. 本集合计划备查文件目录

- (1) 《浙商金惠3号集合资产管理计划说明书》
- (2) 《浙商金惠3号集合资产管理合同》
- (3) 中国证监会《关于核准浙商证券有限责任公司设立浙商金惠3号集合资产管理计划的批复》
- (4) 《浙商金惠3号集合资产管理计划托管协议》
- (5) 《浙商金惠3号集合资产管理计划验资报告》
- (6) 管理人业务资格批件、营业执照

### 2. 查阅方式

浙商证券网址：[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)

客服电话：0571-967777

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人浙江浙商证券资产管理有限公司。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇一三年十月十八日