

# 长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划 2015年第一季度资产管理报告

## 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。

中国证监会于2011年7月11日对长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具核准文件（证监许可[2011]1080号），但中国证监会对本集合计划做出的任何决定，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。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证本集合资产管理计划一定盈利，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。

托管人已于2015年4月17日根据本集合计划合同的规定，复核了本报告中的主要财务指标、会计报表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。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告起止时间：2015年1月1日——2015年3月31日

## 一、集合计划简介

### (一) 基本资料

名称：长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划

类型：非限定性、无固定存续期限

成立日：2010年02月10日

成立规模：896,303,793.46份

管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

### (二) 管理人

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道1589号11楼10-11单元

法定代表人：聂祖荣

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1589号11楼10-11单元

湖北省武汉市江汉区新华路特8号

联系电话：（027）65799778

信息披露人：王钟雅

### (三) 托管人

名称：招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系电话：（0755）83199084

信息披露人：张燕

## 二、主要财务指标

### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2015年1月1日—2015年3月31日
1	集合计划本期利润	25,575,134.06
2	期末集合计划资产净值	126,267,928.36
3	期末单位集合计划资产净值	1.3107
4	累计单位集合计划资产净值	1.4157
5	本期集合计划净值增长率	29.07%
6	集合计划累计净值增长率	41.57%

### (二) 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/集合计划份额

2、累计单位集合计划资产净值=期末单位集合计划资产净值+单位集合计划已分红收益

3、本期集合计划净值增长率=(本期末单位集合计划资产净值-上期末单位集合计划资产净值+本期单位集合计划已分红收益)/上期末单位集合计划资产净值×100%

4、集合计划累计净值增长率=(累计单位集合计划资产净值-1)×100%

### 三、集合计划管理人报告

#### (一) 业绩表现

截至 2015 年 3 月 31 日，本集合计划单位净值 1.3107 元，累计单位净值 1.4157 元。本期本集合计划净值增长率为 29.07%，累计净值增长率 41.57%。

#### (二) 投资经理简介

童国林，1969 年 6 月出生，中南财经大学经济学硕士。先后任华宝兴业基金公司研究总监、基金经理，富国基金首席策略分析师，天弘基金公司总经理助理兼投资总监，上海安苏投资管理有限公司总经理。2014 年 8 月加入长江证券股份有限公司。童国林具有丰富的证券从业经验，自 2014 年 12 月 12 日开始担任长江证券超越理财基金管 II 和本集合计划投资主办人。

#### (三) 投资经理工作报告

##### 1、投资结果

本期基金管家投资业绩超越了市场，2015 年第一季度比较基准中证 800 指数上涨 19.99%，本产品单位净值增长率上涨了 29.07%，实现了 9.08% 的超额收益。本产品 2015 年 2 月 5 日进行了一次分红，每 10 份发放红利 0.75 元。同时第一季度，本产品在固定收益占比、每日申购赎回、管理人自由资金投资、分红机制四个方面修改了集合计划合同。第一季度初期，每月开放前 5 个工作日使得产品份额出现了大幅下滑，但是 3 月以后随着投资者对产品业绩的认可以及产品开放每日申购赎回，产品份额再次出现大幅上升。

截至 2015 年 3 月 31 日，本集合计划单位净值 1.2280 元，累计单位净值 1.4660 元。2015 年第一季度，净值增长率为 13.96%。

截至 2015 年 3 月 31 日，本集合计划单位净值 1.3107 元，累计单位净值 1.4157 元。

本期，在“被动投资的主动管理”理念之下，本集合在 2015 年度第一季取得了预期的投资业绩，本季度净值增长率为 29.07%。

##### 2、投资回顾与展望

2015 年第一季度，尽管经济持续下滑，股票市场却受政策面宽松的驱动，延续上涨行情。2015 年第一季度，市场风格再次转向创业板和中小板，其中沪深 300 指数上涨 14.64%，创业板指数上涨 58.67%，中小板指数上涨 46.60%。

操作方面，本产品继续坚持“被动投资的主动管理”理念，采取“稳定跟踪指数、适当板块轮动、顺势运用杠杆、分级基金套利”的具体投资策略。2015 年初，本集合开放了每日申购、赎回机制。虽然在一定程度上增加了操作的难度，但是也为投资者提供了更好的流动性。同时，本产品在第一季度，加入了正回购的功能，在严格控制风险的前提下为产品的投资操作提供了合理的杠杆。2015 年第一季度，本产品抓住了中小板和创业板的风格轮动、也抓住了 TMT 行业的大幅上涨，使得本产品获得了相对较高的收益。

展望未来，本集合将继续贯彻“被动投资的主动管理”的投资理念。2015 年第二季度，预计市场将继续呈现风格转换和板块轮动的态势，股票将震荡上行。本集合未来将继续主要投资于基金市场，并积极抓住行业配置、风格转换、市场热点所带来的投资机会，争取以最低的风险获取最大的收益。

#### (四) 内部监察报告

本报告期内，公司负责稽核监察的相关部门依照本公司已颁布执行的内部控制、稽核监察、风险控制、合规性检查、投资管理制度等规章制度，独立开展内部控制工作。

在开展工作的过程中，采用了现场与非现场、定期与不定期相结合的工作方法，具体采用了实时监控、现场检查、材料审阅、人员询问和综合分析等多种方法，对投资交易、财务核算等进行了全面细致的审查，对业务流程和规章制度的完善及执行进行了长期的跟踪督察。

## 四、集合计划财务报告

(一) 集合计划资产负债表 (2015 年 3 月 31 日)

单位: 人民币元

项目	期末余额	年初余额
<b>资 产:</b>		
银行存款	16,574,855.31	615,014.14
结算备付金	4,347,724.85	1,416,590.14
存出保证金	187,318.79	121,159.02
交易性金融资产	122,901,180.30	126,195,313.13
其中: 股票投资		15,438,294.72
债券投资	16,191,986	18,205,634
资产支持证券投资		
基金投资	106,709,194.30	92,551,384.41
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		5,387,328
应收利息	53,002.86	67,435.88
应收股利		
应收申购款	3,525,234.62	
其他资产		
<b>资产总计</b>	<b>147,589,316.73</b>	<b>133,802,840.31</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款	12,599,496	
应付证券清算款	5,995,896.44	
应付赎回款	2,327,167.59	
应付管理人报酬	137,871.53	106,536.08
应付托管费	15,352.87	21,307.22
应付销售服务费		
应付交易费用	240,839.89	272,588.15
应付税款		
应付利息	2,447.47	
应付利润		
短期借款	2,316.58	
<b>负债合计</b>	<b>21,321,388.37</b>	<b>400,431.45</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	96,336,910.68	124,260,455.79
未分配利润	29,931,017.68	9,141,953.07
<b>所有者权益合计</b>	<b>126,267,928.36</b>	<b>133,402,408.86</b>
<b>负债和持有人权益总计</b>	<b>147,589,316.73</b>	<b>133,802,840.31</b>

## (二) 集合计划利润表 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 31 日)

单位: 人民币元

项目	本期金额	本年累计数
<b>一、收入</b>	26,722,119.46	26,722,119.46
1.利息收入	66,712.56	66,712.56
其中: 存款利息收入	37,090.61	37,090.61
债券利息收入	26,881.19	26,881.19
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产利息收入	2,740.76	2,740.76
2.投资收益 (损失以“-”号填列)	24,534,858.27	24,534,858.27
其中: 股票投资收益	2,846,776.94	2,846,776.94
债券投资收益	3,649,825.77	3,649,825.77
资产支持证券投资收益		
基金投资收益	17,933,255.56	17,933,255.56
权证投资收益		
基金红利收益	105,000	105,000
股利收益		
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	2,120,548.63	2,120,548.63
4.其他收入 (损失以“-”号填列)		
<b>二、费用</b>	1,088,015.55	1,088,015.55
1.管理人报酬	242,767.91	242,767.91
2.托管费	48,553.62	48,553.62
3.销售服务费		
4.交易费用	793,003.81	793,003.81
5.利息支出	58,969.85	58,969.85
其中: 卖出回购金融资产支出	58,969.85	58,969.85
6.其他费用	3,690.21	3,690.21
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>	25,575,134.06	25,575,134.06

## 五、集合计划投资组合报告 (2015 年 3 月 31 日)

## (一) 期末集合计划资产组合情况

资产类别	期末市值	占资产总值的比例
银行存款和清算备付金	20,922,580.16	14.18%
股票	0.00	0.00%
债券	16,191,986	10.97%
基金	106,709,194	72.30%
买入返售证券	0.00	0.00%
其它资产	3,765,556.27	2.55%
合计	147,589,316.73	100.00%

注: “其它资产”包括“交易保证金”、“应收股利”、“应收利息”、“其他应收款”、“应收证券清算款”等项目。

## (二) 按市值占净值比例大小排序的前五名债券投资明细

代码	证券名称	证券总库存	证券市值	市值占资产净值比例
132001	14 宝钢 EB	69,360.00	11,789,812.80	9.34%
110023	民生转债	13,500.00	1,853,010.00	1.47%
125089	深机转债	10,700.00	1,573,713.20	1.25%
110029	浙能转债	7,000.00	975,450.00	0.77%

### (三) 按市值占净值比例大小排序的前五名基金投资明细

代码	证券名称	证券总库存	证券市值	市值占资产净值比例
150086	申万菱信中小板 B	6,465,000.00	12,244,710.00	9.70%
150052	信诚沪深 300B	5,962,000.00	11,256,256.00	8.91%
150029	信诚中证 500B	6,726,000.00	10,257,150.00	8.12%
150180	鹏华信息 B	6,329,452.00	9,684,061.56	7.67%
150107	易方达中小板指数 B	4,394,016.00	9,411,982.27	7.45%

### (四) 集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期红利再投份额	本期退出份额	期末总份额
124,260,455.79	37,727,195.12	0.00	65,650,740.23	96,336,910.68

## 六、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) 本报告期内，本集合计划管理人自2015年2月16日起由“长江证券股份有限公司”变更为“长江证券（上海）资产管理有限公司”。此项变更仅涉及资产管理计划管理人法人主体形式上的变更，并不涉及与投资者相关的合同项下权利、义务和责任的实质性变更。

(三) 本报告期内本集合计划投资组合策略没有发生重大改变。

(四) 本报告期内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。

## 七、备查文件目录

### (一) 本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会批准长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划推广的文件
- 2、《长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划说明书》
- 3、《长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划托管协议》
- 4、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：武汉市新华路特8号

网址：www.95579.com.cn

信息披露电话：(027) 65799778

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人长江证券（上海）资产管理有限公司。

长江证券（上海）资产管理有限公司

二〇一五年四月二一日

