

# 长江证券超越理财经典策略集合资产管理计划 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2月23日对长江证券超越理财经典策略集合资产管理计划(下称“集合计划”或“本集合计划”)出具核准文件(证监许可[2011]262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。

托管人已于2015年4月17日复核了本报告。

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：长江证券超越理财经典策略集合资产管理计划

类型：非限定性集合资产管理计划

成立日：2011年06月15日

成立规模：1,235,958,252.82份

存续期：无固定存续期限

管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

托管人：中国农业银行

### （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：中国农业银行

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

联系电话：（010）63201541

信息披露人：赵博文

## 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	33,319,596.29
2	期末集合计划资产净值	127,496,866.98
3	期末单位集合计划资产净值	1.2869
4	累计单位集合计划资产净值	1.2869
5	本期集合计划净值增长率	32.33%
6	集合计划累计净值增长率	28.69%

### （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 1.2869 元, 累计单位净值 1.2869 元, 本期净值增长率为 32.33%, 累计净值增长率 28.69%。

#### (二) 投资经理简介

孙五一, 经济学硕士, 16 年证券从业经验。先后在长江证券研究部、长信基金、长江证券证券投资总部和资产管理总部从事研究和投资管理工 作, 具有丰富的证券市场投资经验。

现任长江证券超越理财经典策略集合资产管理计划、长江证券超越理财量化精选集合资产管理计划投资主办人。

#### (三) 投资经理工作报告

##### 1、投资结果

截至 2015 年 3 月 31 日, 本集合计划单位净值 1.2869 元, 累计单位净值 1.2869 元。

##### 2、投资回顾与展望

在美国经济确定复苏, 但加息步伐姗姗来迟, 欧洲开始果断自救放水, 中国 A 股憧憬新政府改革红利的大背景下, 2015 年一季度全球股市普涨。A 股表现强势, 深成指涨幅达到 19.48%, 中小板指数和创业板指数一季度涨幅达 46.65%和 58.67%。个股风格上几乎所有分类指数都普涨, 市场呈现了非常明显的牛市特征。

本集合计划一季度采取了重仓均衡配置的投资思路, 但将大部分资产投向了小盘成长股, 取得了超越平均水平的投资业绩, 后期考虑到部分小盘股较高的估值, 本集合计划减持了部分小盘成长股, 加仓了部分低估值的地产金融股。

2015 年的牛市根本的原因还是资金市场的宽松和改革预期的强化, 这两点未来很长一段时间都不会发生变化。此外, 在经济结构调整的大背景下, 国名经济的格局会发生巨大的变化, 具有勃勃生机的外向的我国经济会不断孕育具有世界竞争力的行业巨人, 这将会在未来的几年给我们提供源源不断的优良投资对象, 让我们积极拥抱这个伟大的时代。

#### (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 (2014 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	19,004,186.92	19,979,401.67
结算备付金	733,642.82	887,477.97
存出保证金	141,874	163,947.86
交易性金融资产	109,139,539.30	99,316,716.98
其中: 股票投资	98,808,506.30	86,335,610
债券投资		
资产支持证券投资		



基金投资	10,331,033	12,981,106.98
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		8,185,606.27
应收利息	3,919.03	5,898.99
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
<b>资产总计</b>	<b>129,023,162.07</b>	<b>128,539,049.74</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		
应付证券清算款	1,138,611.03	4,043,624.02
应付赎回款		
应付管理人报酬	121,218.87	132,940.05
应付托管费	20,203.15	22,156.68
应付销售服务费		
应付交易费用	246,262.04	436,008.64
应交税费		
应付利息		
应付利润		
其他负债		
<b>负债合计</b>	<b>1,526,295.09</b>	<b>4,634,729.39</b>
<b>持有人权益：</b>		
实收计划份额资金	99,072,427.08	127,412,131.96
未分配利润	28,424,439.90	-3,507,811.61
<b>持有人权益合计</b>	<b>127,496,866.98</b>	<b>123,904,320.35</b>
<b>负债和持有人权益总计</b>	<b>129,023,162.07</b>	<b>128,539,049.74</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>	<b>34,635,265.96</b>	<b>34,635,265.96</b>
1、利息收入	65,338.38	65,338.38
其中：存款利息收入	43,664.88	43,664.88
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	21,673.50	21,673.50
2、投资收益（损失以“-”填列）	16,996,934.98	16,996,934.98
其中：股票投资收益	15,963,776.32	15,963,776.32
债券投资收益		
资产支持证券投资收益		
基金投资收益	998,158.66	998,158.66
权证投资收益		

基金红利收益		
股利收益	35,000	35,000
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	17,570,992.60	17,570,992.60
4、其他收入（损失以“-”填列）	2,000	2,000
<b>二、费用</b>	<b>1,315,669.67</b>	<b>1,315,669.67</b>
1、管理人报酬	350,998.97	350,998.97
2、托管费	58,499.82	58,499.82
3、销售服务费		
4、交易费用	881,475.21	881,475.21
5、利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
6、其他费用	24,695.67	24,695.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>33,319,596.29</b>	<b>33,319,596.29</b>

## 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	19,737,829.74	15.30
股票	98,808,506.30	76.58
债券		
基金	10,331,033.00	8.01
买入返售证券		
其它资产	145,793.03	0.11
合计	129,023,162.07	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股票投资明细

代码	证券名称	证券总库存	证券市值	市值占资产净值比例
300009	安科生物	150,820	3,880,598.60	3.04%
600366	宁波韵升	130,000	3,009,500.00	2.36%
300199	翰宇药业	60,000	2,890,200.00	2.27%
000655	金岭矿业	180,000	2,770,200.00	2.17%
300075	数字政通	40,000	2,492,400.00	1.95%

### （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
001009	上投摩根安全战略股票	10,001,000.00	10,331,033.00	8.10%

### （四）集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期红利转份额	本期退出份额	期末总份额
127,412,131.96	216,942.42	0.00	28,556,647.30	99,072,427.08

## 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经典策略集合资产管理计划推广的文件
- 2、《长江证券超越理财经典策略集合资产管理计划说明书》
- 3、《长江证券超越理财经典策略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](http://www.95579.com)

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

二〇一五年四月二十一日

