

浙商汇金大消费集合资产管理计划 2015 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：2015 年 7 月 1 日—2015 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。

浙商汇金大消费集合资产管理计划于 2011 年 4 月 28 日成立，中国证监会对浙商汇金大消费集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具了批复（证监许可[2011]341 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已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：2015 年 7 月 1 日—2015 年 9 月 30 日

一、集合计划简介

1. 基本资料

集合计划名称：浙商汇金大消费集合资产管理计划

集合计划类型：集合资产管理计划

集合计划成立日：2011 年 4 月 28 日

集合计划成立份额：876,254,135.49 份

集合计划报告期末计划总份额：115,925,029.00 份

集合计划存续期：2011 年 4 月 28 日-2021 年 4 月 28 日

集合计划投资目标：汇金大消费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提下，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：俞绍锋

联系电话：0571-87901972

传真电话：0571-87902581

网 址： 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

联系电话：010-63636363

网址：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：北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)
 办公地址：北京市西城区裕民路 18 号北环中心 22 层
 经办注册会计师：张庆栾、李鑫
 联系电话：010-82250676 0571-88920089
 传真：010-82250851 0571-88219989

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	2015 年 9 月 30 日
1	期初单位集合计划资产净值	1.8053
2	期末单位集合计划资产净值	1.4391
3	期末单位集合计划累计资产净值	1.7391
4	期末集合计划资产净值	166,824,109.75
5	本期集合计划利润	-45,306,800.46
6	期末集合计划未分配利润	50,899,080.75
7	单位期末集合计划未分配利润	0.4391
8	本期集合计划净值增长率%	-20.28%
9	集合计划累计净值增长率%	75.49%

2. 财务指标的计算公式

(1) 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

(2) 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

(3) 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

(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) 单位集合计划累计净值增长率 = (第一年度单位集合计划资产净值增长率 + 1) × (第二年度单位集合计划资产净值增长率 + 1) × (第三年度单位集合计划资产净值增长率 + 1) × × (上年度单位集合计划资产净值增长率 + 1) × (本期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
2014 年 6 月 30 日	1.00	-
2015 年 4 月 30 日	2.00	-

4. 开放期

根据本计划说明书和合同约定，本计划开放期为：封闭期结束后每个星期的星

期一（遇节假日顺延至下一工作日）。开放日内，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 2015 年 9 月 30 日，集合计划单位资产净值为 1.4391 元，本期净值增长率为-20.28%，集合计划单位累计资产净值 1.7391 元，累计净值增长率为 75.49%。

2. 投资主办简介

卢媛媛女士，现任浙商证券资产管理有限公司投资主办。哈尔滨工业大学工学学士，同济大学金融学硕士。超过 10 年证券从业经验，历任爱建证券、东海证券、海通证券高级研究员。拥有长期扎实的研究功底，善于把握行业规律，风格稳健。

3. 投资主办工作报告

三季度是中国股市大震荡的三个月，历史罕见，三大指数的跌幅均接近 30%。九月市场环境相对平稳，创业板有较大幅度反弹。创业板的反弹基本是超跌股反弹拉动，一些 TMT 个股反弹幅度较大。但这些超跌股反弹仍然缺乏清晰的投资主线，估值也没有到位。本产品仍然以审慎的策略控制仓位，精选个股。

但市场表现开始平稳，从某种角度看反映了市场对目前指数点位的认知，2800-3200 的底部区域基本成为共识。然而进入底部区域并不代表这个点位介入就不会亏损，因此景气行业和确定性的投资主线仍然是现在市场环境下必须坚守的原则。未来市场仍然以震荡为主，加仓步骤必然是缓慢逐步审慎进行的。

后续的市场主线将会越来越清晰，业绩确定性高，增长有爆发力的新消费如体育，影视传媒，旅游，医疗服务都有较好的表现。另外，新能源汽车产业链将是近两年反复炒作的热点。在本产品的配置中将进一步增加以上子领域的配置。

从长远看，中国进入股权时代已经是比较确定的事情。从资产配置的角度看，经过此次大跌后的股权相较其他品种极具吸引力。浙商资管秉承成长股投资理念，精选个股，我们坚信本产品一定会给客户带来丰厚的回报。

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：2015 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	117,217,480.85	短期借款	0.00
结算备付金	1,761,324.51	交易性金融负债	0.00
存出保证金	287,332.09	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	48,059,745.00	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	48,059,745.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	0.00	应付赎回款	262,104.38
基金投资	0.00	应付管理人报酬	160,813.84
权证投资	0.00	应付托管费	26,802.28
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	53,147.87
买入返售金融资产	0.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	50,332.90	应付利息	0.00
应收利息	40,564.41	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	89,801.64
应收申购款	0.00	负债合计	592,670.01
其他资产	0.00		
		所有者权益：	
		实收基金	115,925,029.00
		未分配利润	50,899,080.75
		所有者权益合计	166,824,109.75

资产合计	167,416,779.76	负债和所有者权益总计	167,416,779.76
-------------	----------------	-------------------	----------------

2. 损益表:

日期: 2015 年 7 月 1 日至 2015 年 9 月 30 日

单位: 元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	-43,290,980.66	75,730,347.68
1、利息收入	255,562.86	440,360.43
其中: 存款利息收入	255,562.86	440,360.43
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	0.00
2、投资收益	26,830,525.80	75,005,823.10
其中: 股票投资收益	26,718,293.13	74,702,661.05
债券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	0.00	0.00
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	112,232.67	303,162.05
3、公允价值变动收益	-70,377,069.32	283,940.69
4、其他收入	0.00	223.46
二、费用	2,015,819.80	35,332,830.42
1、管理人报酬	546,363.22	33,040,164.85
2、托管费	91,060.50	295,267.15
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	1,361,293.00	1,892,417.80
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	17,103.08	104,980.62
三、利润总和	-45,306,800.46	40,397,517.26

3. 所有者权益（净值）变动表：

日期：2015 年 7 月 1 日至 2015 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）	126,271,718.76	101,688,581.33	227,960,300.09	112,874,988.69	92,739,538.94	205,614,527.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	-45,306,800.46	-45,306,800.46	0.00	15,061,742.14	15,061,742.14
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）	-10,346,689.76	-5,482,700.12	-15,829,389.88	13,396,730.07	15,920,155.31	29,316,885.38
其中：1. 基金申购款	7,245,961.34	3,478,138.66	10,724,100.00	56,276,985.12	56,458,784.06	112,735,769.18
2. 基金赎回款	-17,592,651.10	-8,960,838.78	-26,553,489.88	-42,880,255.05	-40,538,628.75	-83,418,883.80
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	0.00	0.00	0.00	-22,032,855.06	-22,032,855.06
五、期末所有者权益（基金净值）	115,925,029.00	50,899,080.75	166,824,109.75	126,271,718.76	101,688,581.33	227,960,300.09

五、集合计划投资组合报告

1. 资产组合情况：

2015 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	117,217,480.85	70.02%
清算备付金	1,761,324.51	1.05%
存出保证金	287,332.09	0.17%
股票投资	48,059,745.00	28.71%
债券投资	0.00	0.00%
基金投资	0.00	0.00%

理财产品投资	0.00	0.00%
买入返售金额资产	0.00	0.00%
应收股利	0.00	0.00%
应收利息	40,564.41	0.02%
其他应收款	0.00	0.00%
资产合计	167,416,779.76	100.00%

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	市值占净值比
002196	方正电机	387,700.00	8,637,956.00	5.18%
000661	长春高新	78,128.00	7,586,228.80	4.55%
002219	恒康医疗	167,000.00	6,219,080.00	3.73%
002340	格林美	529,800.00	5,478,132.00	3.28%
300347	泰格医药	159,538.00	5,161,054.30	3.09%
600628	新世界	310,100.00	4,939,893.00	2.96%
600687	刚泰控股	250,140.00	3,344,371.80	2.00%
300206	理邦仪器	172,569.00	3,296,067.90	1.98%
600358	国旅联合	177,800.00	1,753,108.00	1.05%
300140	启源装备	79,900.00	1,641,945.00	0.98%

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	本期退出份额	期末总份额
126,271,718.76	7,245,961.34	-17,592,651.10	115,925,029.00

七、重要事项揭示

1. 本报告期内本集合计划管理人的总经理和托管人的董事长、总经理未发生变更。
2. 本报告期内本集合计划管理人投资主办未发生变更。

八、备查文件目录

1. 本集合计划备查文件目录

- (1) 《浙商汇金大消费集合资产管理计划说明书》
- (2) 《浙商汇金大消费集合资产管理计划合同》
- (3) 《浙商汇金大消费集合资产管理计划托管协议》
- (4) 《浙商汇金大消费集合资产管理计划验资报告》
- (5) 管理人业务资格批件、营业执照

2. 查阅方式

公司网址：www.stocke.com.cn

客服电话：95345

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
二〇一五年十月二十六日

