

财通证券资产管理有限公司
财通资管财臻1号集合资产管理计划
季度资产管理报告
(2016年二季度)

计划管理人：财通证券资产管理有限公司

计划托管人：中国工商银行股份有限公司浙江省分行

报告期间：2016年4月1日-2016年6月30日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人财通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。

财通资管财臻1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”或“本计划”）于2015年2月10日成立，并向中国证券投资基金业协会及中国证监会浙江监管局备案，但中国证券投资基金业协会及中国证监会浙江监管局对本集合计划做出的任何决定，均不表明其对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明客户参与本集合计划没有风险。

托管人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。

本报告涉及《财通资管财臻1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）及《财通资管财臻1号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）的相关内容若与《管理合同》及《说明书》中的相关内容不一致，以最新的《管理合同》及《说明书》为准。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2016年4月1日-2016年6月30日

一、集合计划简介

（一）基本资料

名称：财通资管财臻1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2015年02月10日

成立份额：49,200,376.24份

存续期：2年（可展期）

管理人：财通证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司浙江省分行

注册登记机构：财通证券资产管理有限公司

（二）集合计划管理人

名称：财通证券资产管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市上城区白云路26号143室

办公地址：浙江省杭州市杭大路15号

法定代表人：马晓立

公司网址：www.ctzg.com

（三）集合计划托管人

名称：中国工商银行股份有限公司浙江省分行

注册地址：杭州市中河中路150号

法定代表人：沈荣勤

联系人： 张松财

联系电话： 0571-87803888

二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

（一）主要财务指标

单位：元

	主要财务指标	2016 年 06 月 30 日
1	期末单位集合计划资产净值	0.7643
2	期末单位集合计划累计资产净值	2.0585
3	期末集合计划资产净值	87,736,010.33
4	本期集合计划利润	8,993,987.56
5	期末集合计划未分配利润	-27,057,878.07
6	单位期末集合计划未分配利润	-0.2357
7	本期集合计划净值增长率%	11.43%
8	集合计划累计净值增长率%	84.52%

（二）收益分配情况

集合计划成立以来，本集合计划收益分配具体分红收益情况详见管理人网站。

三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

截止到 2016 年 06 月 30 日，集合计划单位资产净值为 0.7643 元，本期净值增长率为 11.43%，集合计划单位累计资产净值 2.0585 元，累计净值增长率为 84.52%。

（二）投资主办简介

马宏毅先生，本科就读于北京工商大学金融工程专业，西南财大

EMBA。长期从事投研工作，从业7年。曾担任申银万国证券研究所中小公司分析师，中信证券自营部高级经理，财通证券资产管理部投资经理，中山证券锦弘和富投资有限公司副总经理，2015年加入财通证券资产管理有限公司任投资经理。

（三）投资主办工作报告

首先回顾下2季度的A股行情。2016年2季度，上证指数下跌2.47%，收于2929.61点；上证50下跌1.47%，沪深300下跌1.99%；创业板指数略跌0.47%，收于2227.9；中小板指数上涨0.41%；但是创业板综指却上涨6.72%，中小板综指上涨3.79%，由此导致全市场指数WIND全A上涨1.07%。所以总体来看，指数成分股是震荡收跌，但结构性行情火爆。次新股、稀土永磁、OLED、锂电池、特斯拉等概念板块涨幅均在20%以上，文化传媒、迪斯尼、国企改革等跌幅居前。

截至6月30日，财臻1号净值0.7643，累计净值2.0585，主要回撤是受到1月份的熔断机制的影响，但作为绝对收益产品，我们要求以后要做的更好。

1、对经济的看法

去年年底我们判断，2016年大概率经济见底，或者看到经济见底的信号，从当前一季度的运营情况来看，这个预判可能正在接近现实。二季度回过头来看，我们也依然维持这个判断。

从国际的角度来看，英国脱欧带来的影响会很长远，很难判断清楚对我国的影响。此次事件对于全球外汇和股市造成巨大冲击，然而一周过去，英国股市FT100指数已经完全收复脱欧前的跌幅，甚至创出年内

新高，相反倒是欧盟其他国家股市仍然元气大伤。当前的欧洲已经深陷人口老龄化、福利社会的重担、伊斯兰化等多重危机，从某种程度来说，摆脱欧洲大陆这个负担，才能使得英国政府更好的为本国利益服务。从中国的角度来看，我们认为这将重塑全球政治格局，使得中国的相对优势更好的显现出来。在国际利益博弈中，我们如能巧妙地把握和处理各种利益关系，那么中国的国际影响力将越来越大。

2、对股市的看法

股市结构性行情在 2 季度表现的淋漓尽致，这一次的存量博弈行情较以往都要强，主要原因来自于池子中的水太多。去年牛市积累下来的资金是往年不可比的，因此本轮的结构化行情如火如荼，很多股票创出了历史新高。

我们从净值保护的角度，对于 A 股整体仍保持谨慎乐观的看法，即我们不大认为指数会有较大的整体性表现，但向下的空间也不大，结构化行情仍然能持续一段时间。我们的重点，依然是把握结构性行情和个股机会，仓位维持在中性水平。我们会继续努力，做好这个产品，回报投资者。

（四）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》、《管理办法》、《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。本报告期内，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

本报告期内，集合计划管理人通过设立独立的风险控制部门，对集合理财业务进行事前审核、事中监控，日常对集合资产管理业务的重大事项进行风险评估，并提出风险控制措施。风险管理部还对业务授权、投资交易的执行情况进行监控，控制业务运作过程中存在的风险。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

我们认为，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《管理合同》及《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；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；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

（一）资产负债表

日期：2016 年 06 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	20,334,517.60	短期借款	0
结算备付金	2,314,305.70	交易性金融负债	0
存出保证金	428,387.12	衍生金融负债	0

财通资管臻1号集合资产管理计划2016年季度管理报告（二季度）

交易性金融资产	64,015,416.39	卖出回购金融资产款	0
其中：股票投资	64,015,416.39	应付证券清算款	4,345,978.88
债券投资	0	应付赎回款	0
基金投资	0	应付管理人报酬	102,372.45
权证投资	0	应付托管费	40,948.99
资产支持证券投资	0	应付销售服务费	0
衍生金融工具	0	应付交易费用	107,348.38
买入返售金融资产	0	应交税费	0
应收证券清算款	5,243,248.79	应付利息	0
应收利息	4,740.47	应付利润	0
应收股利	0	其他负债	7,957.04
应收申购款	0	负债合计	4,604,605.74
其他资产	0		
		所有者权益：	
		实收基金	114,793,888.40
		未分配利润	-27,057,878.07
		所有者权益合计	87,736,010.33
资产合计	92,340,616.07	负债和所有者权益总计	92,340,616.07

（二）损益表

日期：2016年4月1日至2016年06月30日

单位：元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	9,709,187.39	-11,769,840.96
1、利息收入	95,406.74	205,233.97
其中：存款利息收入	64,101.52	144,167.03
债券利息收入	0	0
资产支持证券利息收入	0	0
买入返售证券收入	31,305.22	61,066.94
2、投资收益	10,305,516.26	-7,449,652.47
其中：股票投资收益	11,114,838.26	-6,640,520.97
债券投资收益	0	0
基金投资收益	-839,581.74	-839,581.74
权证投资收益	0	0
资产支持证券投资收益	0	0
衍生工具收益	0	0
股利收益	30,259.74	30,450.24
3、公允价值变动收益	-691,735.61	-4,525,422.46
4、其他收入	0	0

二、费用	715,199.83	1,480,625.08
1、管理人报酬	102,372.45	205,146.05
2、托管费	40,948.99	82,058.48
3、销售服务费	0	0
4、交易费用	576,399.87	1,193,963.51
5、利息支出	0	0
其中：卖出回购金融资产支出	0	0
6、其他费用	-4,521.48	-542.96
三、利润总和	8,993,987.56	-13,250,466.04

（三）所有者权益（净值）变动表

日期：2016年4月1日至2016年06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）	114,793,888.40	-36,051,865.63	78,742,022.77	153,016,535.32	-27,766,322.69	125,250,212.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0	8,993,987.56	8,993,987.56	0	-22,244,453.60	-22,244,453.60
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）	0	0	0	-38,222,646.92	13,958,910.66	-24,263,736.26
其中：						
1. 基金申购款	0	0	0	0	0	0
2. 基金赎回款	0	0	0	-38,222,646.92	13,958,910.66	-24,263,736.26
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	0	0	0	0	0

五、期末所有者权益（基金净值）	114,793,888.40	-27,057,878.07	87,736,010.33	114,793,888.40	-36,051,865.63	78,742,022.77
-----------------	----------------	----------------	---------------	----------------	----------------	---------------

五、集合计划投资组合报告

（一）资产组合情况

2016 年 06 月 30 日

单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	20,334,517.60	22.02%
清算备付金	2,314,305.70	2.51%
存出保证金	428,387.12	0.46%
股票投资	64,015,416.39	69.33%
债券投资	0	0
基金投资	0	0
理财产品投资	0	0
买入返售金融资产	0	0
应收股利	0	0
应收利息	4,740.47	0.01%
其他应收款	0	0
资产合计	92,340,616.07	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。

（二）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
600666	奥瑞德	1,266,303.00	44,016,692.28	50.17%
000903	云内动力	1,061,600.00	8,524,648.00	9.72%
002445	中南文化	209,500.00	4,816,405.00	5.49%
002103	广博股份	163,980.00	3,314,035.80	3.78%
600593	大连圣亚	73,341.00	2,272,837.59	2.59%
002319	乐通股份	52,800.00	912,384.00	1.04%
600549	厦门钨业	5,332.00	158,413.72	0.18%

六、集合计划份额变动情况

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
114,793,888.40	0	0	114,793,888.40

七、重要事项揭示

（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、财产、托管业务的诉讼事项。

（二）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。

（三）未例明事项见公司网站公告。

八、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

1. 《财通资管财臻1号集合资产管理计划说明书》
2. 《财通资管财臻1号集合资产管理计划合同》
3. 《财通资管财臻1号集合资产管理计划托管协议》
4. 《财通资管财臻1号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

（二）查阅方式

财通证券资管网址：www.ctzg.com

客服电话：95336

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询管理人财通证券资产管理有限公司。

财通证券资产管理有限公司

二〇一六年七月十五日