

齐鲁北极星3号集合资产管理计划2016年第2季度报告

2016年6月30日



资产管理人：齐鲁证券（上海）资产管理有限公司

资产托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2016年7月21日

## § 1 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》、《证券公司客户资产管理业务规范》及其他有关规定制作。

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。托管人兴业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定于2016年07月18日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。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划合同及说明书。

本报告财务数据未经审计。

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。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

## § 2 集合资产概况

集合资产简称	北极星3号
集合资产代码	S76818
集合资产合同生效日	2015年11月24日
报告期末集合资产份额总额	193,272,709.52份

## § 3 主要财务指标

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2016年4月1日至2016年6月30日)
1. 本期已实现收益	2,604,374.85
2. 本期利润	2,977,137.72
3. 期末资产净值	198,024,590.51
4. 期末份额净值	1.025

## § 4 集合计划管理人报告

## 4.1 业绩表现

截止到2016年06月30日，本集合计划单位净值为1.025元，本期集合计划净值增长率1.49%。

## 4.2 投资经理简介

汪建，南京大学经济学硕士，14年证券从业经历，历任国泰君安证券衍生产品部董事总经理，资产管理总部副总经理、投资总监，安信基金管理有限公司副总经理（分管投研业务）等职务，现任齐鲁证券（上海）资产管理公司副总经理。

## 4.3 投资经理工作报告

### 1. 市场回顾和投资操作

今年上半年宏观经济逐步走稳，股票市场依旧低迷。年初在熔断政策仓促实施的背景下，股票市场出现了又一次剧烈下跌，虽后来有所反弹，但半年下来各类指数依然录得较大的负收益。

我们在去年末提前意识到市场的风险在积聚，因此把风险控制置于首位，加之持有股票基本面相当强劲，因此在这个过程中没有受到大的损失，并实现了一点正收益。

### 2. 市场展望和投资策略管理

展望下半年市场，政策依旧偏暖，宏观经济预计持续低位徘徊，在此格局下，市场参与主体有自救的意愿。但上方估值压力依然较大，因此股市很可能继续箱体震荡。我们计划延续以往的策略，自下而上精选个股，并继续严格控制风险，力争在下半年获得好于上半年的业绩。

## 4.4 风险控制与合规管理报告

本集合计划管理人通过独立的风险控制部门，加强对集合资产管理业务市场风险、信用风险和流动性风险的事前分析、事中监控和事后评估。风险控制部门根据监管规定和有效控制风险的需要，参加资产管理业务决策小组会议，对资产管理业务风险进行分析、评估；建立资产管理业务风险监控指标体系，确定、调整资产管理业务风险监控阈值，每日动态监控资产管理业务风险监控指标的变化情况，对预警事项进行分析、核查、报告并跟踪处理；根据相关指标的变动及资产管理业务开展情况，对净资本等风险控制指标进行敏感性风险和压力测试，提出控制或压缩相关业务规模的建议；定期或不定期出具资产管理业务风险控制报告。在本报告期内，资产管理业务市场风险、信用风险和流动性风险监控指标均符合公司规定。

本集合计划管理人通过独立的合规管理部门，依据有关法规的规定，针对本集合计划的运作特点，利用公司集中监控系统资产管理合规监控模块进行每日的风险监控，运用合规检查与合规审查等多种方式对集合计划的管理运作进行合规管理，确保集合计划合规运作。

管理人合规部门还定期组织对资产管理业务风险控制制度的建立和执行情况、监控预警报告及处置情况进行合规检查，确保资产管理业务在风险可测、可控、可承受前提下实现最大收益。

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、

公司相关制度和集合资产管理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；本集合计划的资产配置符合有关规定。

## § 5 财务会计报告

### 5.1 资产负债表

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年6月30日
资 产：	
银行存款	41,626,743.43
结算备付金	15,202,113.56
存出保证金	87,928.24
交易性金融资产	139,979,329.80
其中：股票投资	22,118,105.19
基金投资	101,313,227.57
债券投资	16,547,997.04
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	1,401,762.02
应收利息	34,259.61
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	198,332,136.66
	本期末 2016年6月30日
负 债 和 所 有 者 权 益	
负 债：	

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	—
应付赎回款	—
应付管理人报酬	252,109.91
应付托管费	25,211.01
应付销售服务费	—
应付交易费用	5,225.23
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	25,000.00
负债合计	307,546.15
所有者权益：	
实收基金	193,272,709.52
未分配利润	4,751,880.99
所有者权益合计	198,024,590.51
负债和所有者权益总计	198,332,136.66

## 5.2 利润表

会计主体：齐鲁北极星3号集合资产管理计划

本报告期：2016年4月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
一、收入	3,991,801.60
1. 利息收入	414,390.83
其中：存款利息收入	381,571.79

债券利息收入	8,730.14
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	24,088.90
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,142,507.01
其中：股票投资收益	2,332,796.23
基金投资收益	—
债券投资收益	146,369.29
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	—
股利收益	663,341.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	372,762.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	62,140.89
减：二、费用	1,014,663.88
1. 管理人报酬	860,796.27
2. 托管费	86,079.65
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	67,387.96
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 其他费用	400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,977,137.72
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,977,137.72

## § 6 集合计划投资组合报告

### 6.1 资产组合情况

单位：人民币 元

科目	期末市值	占期末总资产比例(%)
权益投资	123,431,332.76	62.23
其中：股票	22,118,105.19	11.15
其中：基金	101,313,227.57	51.08
固定收益投资	16,547,997.04	8.34
其中：债券	16,547,997.04	8.34
资产支持证券	—	—
买入返售金融资产	—	—
其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
银行存款和结算备付金合计	56,828,856.99	28.65
其他各项资产	1,523,949.87	0.77
合计	198,332,136.66	100.00

## 6.2 报告期末按公允价值占特定资产资产净值比例大小排序的前十名证券投资明细

序号	证券名称	数量 (份)	市值	市值占净值比 (%)
1	易货币	1,013,264.00	101,313,227.57	51.16
2	老板电器	179,652.00	6,605,804.04	3.34
3	长春高新	59,128.00	6,307,775.04	3.19
4	三一转债	52,170.00	5,547,236.10	2.80
5	蓝标转债	36,380.00	3,916,052.34	1.98
6	航信转债	26,150.00	2,883,822.00	1.46
7	电气转债	26,380.00	2,850,886.60	1.44
8	古井贡酒	51,789.00	2,483,282.55	1.25
9	16皖新EB	13,500.00	1,350,000.00	0.68
10	五粮液	40,100.00	1,304,453.00	0.66

## §7 集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
240,489,863.6	1,866,404.72	49,083,558.80	193,272,709.52

### § 8 重要事项揭示

- 8.1 在本报告期内管理人和托管人没有发生变更；
- 8.2 在本报告期内本集合计划管理人或托管人没有受到重大处罚；
- 8.3 在本报告期内本集合计划没有发生重大诉讼、仲裁事项；

### § 9 备查文件目录

#### 9.1 本集合计划备查文件目录

- 1、《齐鲁北极星3号集合资产管理计划风险揭示书》
- 2、《齐鲁北极星3号集合资产管理计划说明书》
- 3、《齐鲁北极星3号集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、管理人业务资格批件、营业执照

#### 9.2 查阅方式

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

信息披露电话：95538

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

#### 9.3 文件存放地点

上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行大厦17层。

齐鲁证券（上海）资产管理有限公司  
二〇一六年七月二十一日

