

海通海蓝宝益集合资产管理计划
(2016 年第 2 季报)
资产管理报告



计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司

计划托管人：交通银行股份有限公司

报告期间：2016 年 04 月 01 日 - 2016 年 06 月 30 日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人交通银行股份有限公司于2016年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

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，但不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

一、集合计划简介

(一) 基本计划资料

1、计划名称：	海通海蓝宝益集合资产管理计划
2、计划简称：	海蓝宝益
3、计划合同生效日：	2011年11月18日
4、成立规模：	441,511,450.64
5、报告期末计划份额总额：	23,520,845.43

(二) 计划产品说明

1、投资目标：	在充分控制投资风险的基础上，追求委托资产的当期稳定收益和长期稳健增值。
2、投资策略：	本集合计划通过深入分析国内外宏观经济走势、货币政策和资金供求关系等的特征和变化对金融市场特别是货币市场和债券市场的影响，将集合计划资产在国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、资产支持受益凭证、债券逆回购等资产间进行配置。
3、业绩比较基准：	本集合计划以获取低风险稳健收益为目标，以银行一年期定期存款基准利率+1%作为业绩基准。
4、风险收益特征：	本集合计划为债券型证券投资产品，属于低风险收益品种。

(三) 计划管理人

1、名称：	上海海通证券资产管理有限公司
2、注册地址：	上海市广东路689号海通证券大厦32楼
3、办公地址：	上海市广东路689号海通证券大厦32楼
4、邮政编码：	200001
5、国际互联网址：	www.htsamc.com
6、法定代表人：	裴长江
7、信息披露负责人：	赵高华
8、信息披露电话：	021-23212156

9、联系电话：	95553、4008888001
10、传真：	021-63410460
11、电子邮箱：	htam@htsec.com

(四) 计划托管人

1、名称：	交通银行股份有限公司
2、注册地址：	上海市浦东新区银城中路 188 号
3、办公地址：	上海市仙霞路 18 号
4、邮政编码：	200120
5、国际互联网址：	www.bankcomm.com
6、法定代表人：	牛锡明
7、信息披露负责人：	裴学敏
8、联系电话：	95559
9、传真：	021-62701262
10、电子邮箱：	zh_jjb@bankcomm.com

(五) 其他有关资料

1、聘请的会计师事务所	
名称：	众华会计师事务所（特殊普通合伙）
办公地址：	上海市中山南路 100 号金外滩广场 6 楼
2、计划注册登记机构	
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

二、主要财务指标和集合计划净值表现

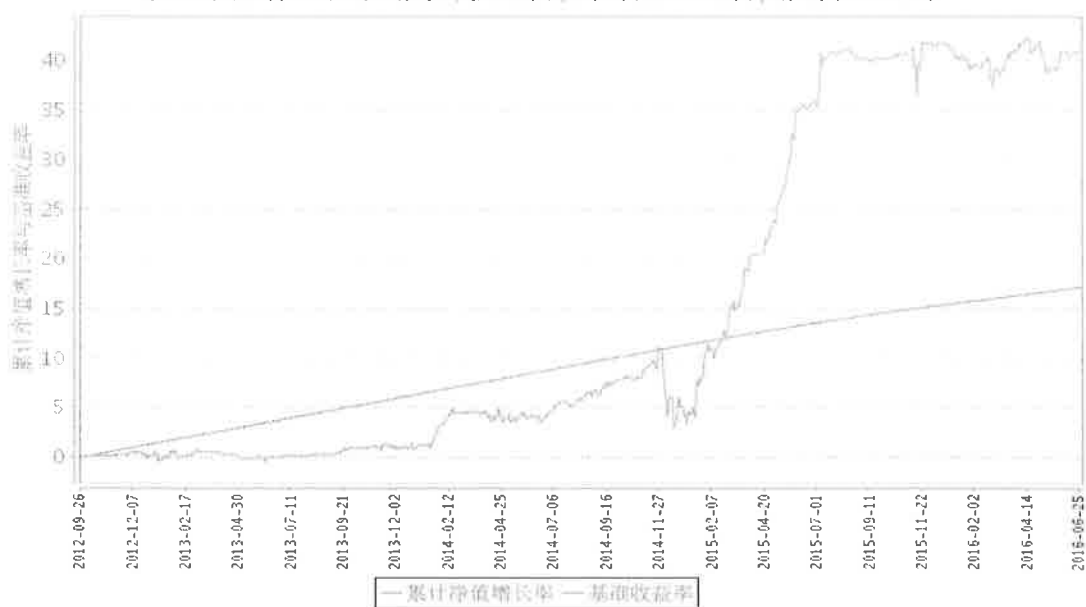
(一) 主要财务指标

(单位：人民币元)

	主要财务指标	2016 年 04 月 01 日 - 2016 年 06 月 30 日
1.	本期利润	226,284.63
2.	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	272,033.11
3.	期末集合计划资产净值	25,113,640.91
4.	期末单位集合计划资产净值	1.0677

(二) 累计净值增长率 (%) 与同期业绩比较基准收益率 (%) 的历史走势对比图

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



(三) 本计划合同生效以来每年的计划收益分配情况

年度	每 10 份计划份额分红数 (元)	备注
2015	1.6000	
2014	0.8720	
2013	0.5000	
合计	2.9720	

三、集合计划管理人报告

(一) 投资经理简介

丁巍，华东师范大学金融学硕士，CPA 非执业会员。现任上海海通证券资产管理有限公司投资经理，曾任万家基金管理有限公司债券研究员，拥有 4 年金融工作经验，4 年投资研究经验。

(二) 投资经理工作报告

综合来看，各项公布了或者未来一个月待公布的经济数据基本不会偏离市场的预期，6 月 CPI 即便小幅下行，也不会让市场产生明显下行动力。中央政策面依然在稳步推进货币的脱虚向实，央行也不会主动打破目前偏宽松的资金面，经济下行的压力仍在，未来很长一段时间都将处于“滴灌”状态，即通过各种手段把资金下放到切实需要的实体产业之中去。目前资金面、政策面及基本上债券均处于较为不错的环境，虽然面临外围市场可能的风险，但债市看多情绪渐浓。

操作上保持适度久期及适度杠杆策略，在更加确定的条件下增厚收益同时也力求控制组合波动，力争为投资者提供稳定的业绩回报。

四、集合计划财务报表

1、资产负债表

资产	期末余额	年初余额	负债与持有者权益	期末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	71,835.02	2,457,863.57	短期借款	-	-
清算备付金	23,370.86	495,297.53	交易性金融负债	-	-
存出保证金	5,141.28	23,099.70	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	22,219,480.75	20,344,380.01	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	-	-	应付证券清算款	101,360.82	-
债券投资	15,263,354.30	11,107,641.79	应付赎回款	-	-
基金投资	6,956,126.45	9,236,738.22	应付管理人报酬	16,518.12	16,442.28
资产支持证券投资	-	-	应付托管费	4,129.54	4,110.57
衍生金融资产	-	-	应付销售服务费	-	-
买入返售金融资产	2,300,011.50	-	应付交易费用	290.56	622.34
应收证券清算款	88,206.66	770,665.67	应交税费	-	-
应收利息	489,772.38	294,296.59	应付利息	-	-
应收股利	55,019.00	-	应付利润	-	-
应收申购款	-	-	其他负债	16,897.50	26,953.02
其他资产	-	-	负债合计	139,196.54	48,128.21
			所有者权益：	-	-
			实收计划	23,520,845.43	22,954,538.81
			未分配利润	1,592,795.48	1,382,936.05
			所有者权益合计	25,113,640.91	24,337,474.86
资产总计	25,252,837.45	24,385,603.07	负债及所有者权益	25,252,837.45	24,385,603.07

			总计	
--	--	--	----	--

2、利润表

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	295,401.79	332,376.10
1、利息收入	226,948.33	420,862.04
其中：存款利息收入	1,277.48	8,313.75
债券利息收入	224,549.67	411,257.59
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,121.18	1,290.70
2、投资收益（损失以“-”填列）	114,201.94	22,010.73
其中：股票投资收益	-	-
债券投资收益	31,392.48	27,446.29
基金投资收益	30,208.72	-340,825.33
权证投资收益	-	-
资产支持证券投资	-	-
投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
基金红利收益	52,600.74	335,389.77
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-45,748.48	-110,496.67
4、其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
二、费用	69,117.16	150,663.86
1、管理人报酬	50,078.36	98,660.59
2、托管费	12,519.58	24,665.13
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	1,501.98	8,017.66
5、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6、其他费用	5,017.24	19,320.48
三、利润总额	226,284.63	181,712.24

五、投资组合报告

1、本报告期末计划资产组合情况

项目名称	金额（元）	占计划资产总值比例%
股票	-	-
基金	6,956,126.45	27.55
债券	15,263,354.30	60.44
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	2,300,011.50	9.11
银行存款和结算备付金合计	95,205.88	0.38
应收证券清算款	88,206.66	0.35
其他资产	549,932.66	2.18
总计	25,252,837.45	100.00

注：因四舍五入原因，分项占比之和与合计数可能存在尾差。

2、本报告期末按市值占计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	市值（元）	市值占净值%
1	511990	华宝添益	20,233.00	2,023,178.60	8.06
2	482002	工银瑞信货币B	1,800,000.00	1,800,000.00	7.17
3	122945	09 虞水债	16,330.00	1,633,000.00	6.50
4	511820	鹏华货币 ETF	13,039.00	1,303,743.53	5.19
5	112046	112046 SZ	12,150.00	1,233,103.50	4.91
6	122142	11 鹿港债	11,060.00	1,137,852.80	4.53
7	112145	13 荣信 01	9,210.00	925,605.00	3.69
8	122339	13 香江债	8,040.00	860,119.20	3.42
9	112025	11 珠海债	8,000.00	854,400.00	3.40
10	122257	12 岳纸 01	7,010.00	697,495.00	2.78

注：因四舍五入原因，分项占比之和与合计数可能存在尾差。 -

六、集合计划份额变动情况

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
23,795,227.61	93,614.08	367,996.26	23,520,845.43

七、重要事项提示

(一) 本集合计划管理人相关事项

- 1、本集合计划管理人在本报告期内没有发生与本集合计划相关的诉讼事项。
- 2、本集合计划管理人办公地址未发生变更。
- 3、本集合计划的管理人高级管理人员没有受到任何处罚。

(二) 本集合计划相关事项

无

八、备查文件目录

(一) 备查文件目录

- 1、《海通海蓝宝益集合资产管理计划合同》
- 2、《海通海蓝宝益集合资产管理计划说明书》
- 3、《海通海蓝宝益集合资产管理计划风险揭示书》

(二) 查阅方式

网址：www.htsamc.com

热线电话：95553

