

央视 50 平衡集合资产管理计划季度报告

(2016 年第二季度)

第一节 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中国光大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。

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，投资者在做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。

本报告期间：2016年4月1日至2016年6月30日。

第二节 集合资产管理计划概况

名称	央视50平衡集合资产管理计划
类型	开放式、非限定性、存续期十年
成立日	2012年9月27日
报告期末份额总额	62,887,774.98 份
投资目标	本集合计划主要采取恒定混合战略等资产配置策略,运用指数投资组合管理技术,在有效降低组合波动率的基础上,实现集合计划资产保值增值目标。
投资理念	在工业化和城镇化的推动下,中国经济在今后较长时期仍将保持较快增长态势,为资本市场的繁荣和发展奠定了坚实的基础。秉承被动投资理念,在资产配置和组合管理方面采用透明规则,能够有效克服人性弱点对投资

	绩效的负面影响。
投资基准	本集合计划的业绩比较基准为：60% × 央视财经 50 指数收益率+40% × 一年期存款基准利率。
管理人	银河金汇证券资产管理有限公司
托管人	中国光大银行股份有限公司
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司

第三节 集合资产管理计划主要财务指标和业绩表现

一、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	2,256,668.44
净值增长率	3.20%
期末资产净值	73,060,495.19
期末每份额净值	1.162
期末每份额累计净值	1.377

二、业绩表现

截止 2016 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值 1.162 元，累计单位净值 1.377 元，本期集合计划净值增长率 3.20%。

三、本期每份额增长率与投资基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① -③	② -④
2016 年第二季度	3.20%	0.71%	2.12%	0.58%	1.08%	0.13%

第四节 管理人报告

一、投资主办人简介

王跃文，七年期货、十一年证券从业经验。先后就职于中国国际期货有限公司基金部、国信证券资产管理部、国都证券资产管理部；管理过多种不同规模、不同风格的理财产品。现任银河金汇证券资产管理有限公司执行总经理。

徐杰，为注册会计师（CPA），已通过 CFA 三级考试。毕业于北京大学，金融学硕士、地质学和经济学双学士。曾在普华永道会计师事务所从事金融机构审计，后加入银河证券负责公司预算管理。2014 年加入银河金汇证券资产管理有限公司，目前担任银河央视 50 平衡、银河 99 指数、银河安心收益 1 号、银河安心收益 2 号、银河智远 1 号、星汇 1 号等集合资产管理计划投资主办人。

二、投资主办人工作报告

本报告期内，央视50指数收益率3.12%，表现好于沪深300指数（收益率-1.99%）。本集合计划在报告期内收益率为3.20%，超越比较基准1.08%。主要原因是本集合计划超配的股票类资产表现较好，另外本集合计划在商品类、分级A等资产上获得了较好的收益。

展望未来，英国脱欧事件远未结束，其后续影响在持续发酵中。如果欧洲遭受重创，中国市场可能难以独善其身。环球货币超发严重。中国国内巨额企业债务在下半年集中到期，信用风险是否会爆发值得密切关注。市场充满不确定性。

国企改革可能加速、金融改革全方位推进、国家成立专门的债务统筹机构等重大事项，对于上述负面事项可能会有一定对冲左右，但是不宜盲目乐观。

管理人将密切关注市场形势发展，指数成份股的配置会在基准水平左右，同时精选个股进行投资，另外管理人将继续关注商品市场的投资机会。

三、风险控制报告

在本报告期内，本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》等相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，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。

报告期内，本集合计划管理人坚持规范运作、防范风险，保护投资者利益，

严格执行银河金汇证券资产管理有限公司内部控制和 risk 管理制度，加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，严格履行本集合计划合同规定。

在报告期内，投资主办人按照资产管理投资决策委员会授权的范围进行投资，投资范围和投资比例符合产品说明书规定，无越权交易行为发生。管理人和托管人按照各方约定的统一记账方法和会计处理原则，分别独立设置账套，每日核对资产净值，互相监督，以保证集合资产安全，保护投资者利益。

第五节 托管人报告

央视50平衡集合资产管理计划 (二零一六年第二季度) 托管报告

本计划托管人—中国光大银行根据《央视50平衡集合资产管理计划资产管理合同》和《央视50平衡集合资产管理计划资产托管协议》，在托管央视50平衡集合资产管理计划的过程中，严格遵守《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》及各项法规规定，对央视50平衡集合资产管理计划管理人—银河金汇证券资产管理有限公司2016年4月1日至2016年6月30日计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害计划份额持有人利益的行为。

在报告期内，银河金汇证券资产管理有限公司，遵守了《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》等有关法律法规。

信息披露符合《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》、《央视50平衡集合资产管理计划资产管理合同》及其相关法规的规定，计划管理人所编制和披露的《央视50平衡集合资产管理计划季度报告（2016年第二季度）》中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息是真实、准确的。

2016年7月20日

第六节 投资组合报告

一、资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占总资产比例
股票	53,623,277.71	73.25%
银行存款	3,882,488.83	5.30%
基金	13,159,598.94	17.98%
买入返售金融资产	2,500,062.50	3.41%
债券	6,458.58	0.01%
其他资产	37,331.34	0.05%
合计	73,209,217.90	100.00%

(注: 1. 其他资产包括: 结算备付金、存出保证金、应收利息、应收股利;

2. 因四舍五入原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。)

二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值%
1	600887	伊利股份	181,338.00	3,022,904.46	4.14%
2	000002	万科A	118,226.00	2,888,261.18	3.95%
3	601318	中国平安	88,220.00	2,826,568.80	3.87%
4	600016	民生银行	298,520.00	2,665,783.60	3.65%
5	600519	贵州茅台	9,097.00	2,655,596.24	3.63%
6	300017	网宿科技	29,900.00	2,009,280.00	2.75%
7	002415	海康威视	91,197.00	1,957,087.62	2.68%
8	600104	上汽集团	90,025.00	1,826,607.25	2.50%
9	000651	格力电器	92,524.00	1,778,311.28	2.43%
10	000333	美的集团	69,052.00	1,637,913.44	2.24%

带格式表格

带格式的: 居中

带格式的: 居中

带格式的: 居中

带格式的: 居中

带格式的: 居中

带格式的: 居中

带格式的: 居中

带格式的: 居中

带格式的: 居中

带格式的: 居中

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值%
1	123001	蓝标转债	60.00	6,458.58	0.01%

带格式的: 居中

四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

序号	证券代码	证券名称	数量	证券市值	市值占净值%
1	002467	国投全球债人民币	5,000,000.00	5,160,000.00	7.06%
2	482002	工银瑞信货币基金	2,069,476.30	2,069,476.30	2.83%
3	000575	兴全添利宝	1,058,367.05	1,058,367.05	1.45%
4	150145	高贝塔 A	550,000.00	558,250.00	0.76%
5	150331	网金融 A	500,000.00	551,500.00	0.75%
6	160216	国泰商品	900,000.00	404,100.00	0.55%
7	505888	嘉实元和	350,000.00	376,250.00	0.52%
8	150090	成长 A	350,800.00	358,517.60	0.49%
9	150130	医药 A	330,000.00	344,190.00	0.47%
10	150022	深成指 A	400,000.00	318,400.00	0.44%

带格式的：居中

带格式的：居中

带格式的：居中

带格式的：居中

带格式的：居中

带格式的：居中

带格式的：居中

带格式的：居中

带格式的：居中

带格式的：居中

五、期末市值占集合计划资产净值前十名买入返售金融资产明细

本集合计划报告期末未持有买入返售金融资产。

序号	证券代码	证券名称	证券市值	市值占净值%
1	204007	GC007	2,500,062.50	3.42%

六、期末市值占集合计划资产净值前十名权证证明细

本集合计划报告期末未持有权证。

七、投资组合报告附注

无。

第七节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	63,191,923.48
报告期间总参与份额	-
红利再投资份额	-
报告期间总退出份额	304,148.50
报告期末份额总额	62,887,774.98

第八节 重要事项提示

无。

第九节 信息披露的查阅方式

网址：<http://yhjh.chinastock.com.cn/>

热线电话：4008-888-888

银河金汇证券资产管理有限公司

二〇一六年七月二十一日