

# 中信证券积极策略 5 号集合资产管理计划

## 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信银行股份有限公司于2016年7月21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。

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：	中信证券积极策略5号集合资产管理计划
类型：	集合资产管理计划
成立日：	2015年2月3日
报告期末份额总额：	54,313,720.86
投资目标：	主要通过有效率的买入标的股票，积极主动地去争取实现自己的股东利益或投资收益，追求本集合计划资产的稳定增值
投资理念：	通过有效率的买入股票，积极主动地去争取实现自己的股东利益或投资收益，在适当的时候，积极行动买入相当份额的股票，充分履行股东权利，从而影响公司决策，改善公司运营情况来提升其市场价值，追求集合计划资产的长期稳定增值

投资基准： 无  
 管理人： 中信证券股份有限公司  
 托管人： 中信银行  
 注册登记机构： 中信证券股份有限公司

### 第三节 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

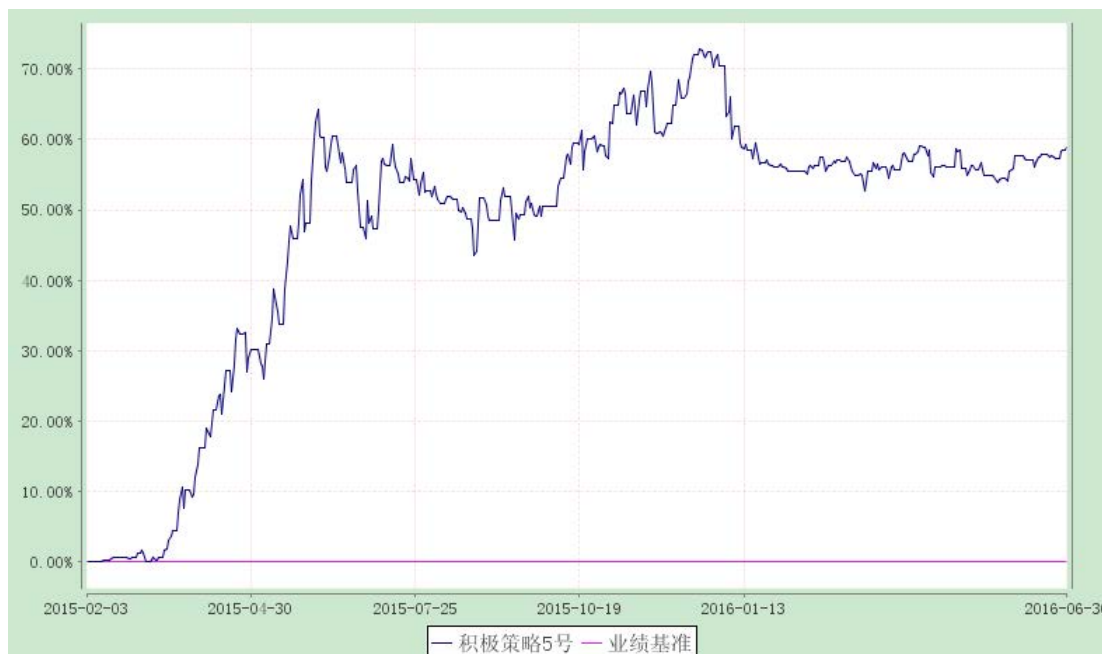
#### 一、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	944,729.02
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	340,725.98
加权平均每份额本期已实现净收益	0.0060
期末资产净值	55,285,490.77
期末每份额净值	1.0179
期末每份额累计净值	1.5229

#### 二、本期每份额净值增长率与投资基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	投资基准收益率②	① -②
这3个月	1.68%	0%	1.68%

#### 三、集合计划累计每份额净值增长率与投资基准收益率的历史走势对比图



### 第四节 管理人报告

#### 一、业绩表现

截至2016年06月30日,本集合计划单位净值1.0179元,累计单位净值1.5229

元，本期集合计划收益率增长 1.68%。

## 二、投资主办人简介

张晓亮，男，1981 年出生，北京大学经济学硕士，曾在三星经济研究所、渤海证券研究所从事消费电子、通信、计算机等行业研究，2010 年加入中信证券资产管理部，历任行业研究员、社保组合投资助理，现任中信优选成长、卓越成长、贵宾 1 号、贵宾 2 号集合计划投资主办人。

张燕珍，女，对外经济贸易大学金融学硕士，现任中信证券资产管理业务高级副总裁，入行以来一直从事行业和公司研究工作，9 年证券从业经验。

## 三、投资主办人工作报告

### 1、市场回顾和投资操作

2016 年二季度，市场经过年初熔断的大跌，3 月份的反弹，二季度市场总体维持底部的盘整。上证下跌-2.47%，沪深 300 下跌-1.99%，创业板下跌-0.47%；行业板块方面，电子、通信主题频出；食品饮料，家电等板块基本面略有好转带来估值修复；整体涨幅居前。

操作：账户在市场底部操作相对比较积极，在控制好仓位的基础上重点进行结构性机会的投资，在白酒、家电、农业等行业配置了较高的比重，取得了较好的效果。

### 2、市场展望和投资策略

展望 2016 年 3 季度，经济能否持续恢复成为资本市场关注的焦点，供给改革、国企改革会继续推进。货币政策在在全球经济疲弱的背景下货币政策有望持续宽松,美元加息预期降低，未来还需要关注人民币汇率。经过 2 季度的盘整，内外部市场给 A 股创造了阶段性较好的做多窗口。

3 季度，本集合计划将保持相对积极的心态，在严格控制账户风险的同时，积极灵活调整仓位和结构，以把握震荡行情的阶段性和结构性机会，争取为投资人带来中长期的良好回报。

#### 四、风险控制报告

2016年第二季度，中信证券针对本集合计划的运作特点，通过每日的风险监控工作以及风险预警机制，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，并提醒投资主办人采取相应的风险规避措施，确保集合计划合法合规、正常运行。同时，本集合计划通过完善的风险指标体系和定期进行的风险状况分析，及时评估集合计划运作过程中面临的各种风险，为投资决策提供风险分析支持，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致，以实现本集合计划追求中长期内资本增值的投资目标。在本报告期内，本集合计划运作合法合规，未出现违反相关规定的状况，也未发生损害投资者利益的行为。

#### 第五节 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	17,175,112.65	28.24%
债券	-	-
基金	23,314,628.2	38.33%
银行存款及清算备付金合计	17,966,824.78	29.54%
其他资产	2,366,266.12	3.89%
合计	60,822,831.75	100%

##### 二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例
1	000333	美的集团	80150	1,901,158	3.44%
2	600199	金种子酒	148000	1,642,800	2.97%
3	000858	五粮液	39800	1,294,694	2.34%
4	002567	唐人神	92530	1,293,569.4	2.34%
5	600887	伊利股份	73000	1,216,910	2.2%
6	601222	林洋能源	26500	1,109,025	2.01%
7	002304	洋河股份	10700	769,544	1.39%
8	002271	东方雨虹	40000	689,200	1.25%
9	600837	海通证券	37000	570,540	1.03%
10	600702	沱牌舍得	22000	555,280	1%

##### 三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

本集合计划报告期末未持有债券。

##### 四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例
1	519888	汇添富收益快线货币A	2278108400	22,781,084	41.21%
2	150224	富国中证全指	298900	292,922	0.53%

		证券公司指数 分级B			
3	150222	前海开源中航 军工指数分级 B	354900	240,622.2	0.44%

集合计划报告期末共持有3只基金。

五、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细  
本集合计划报告期末未持有权证。

六、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

## 第六节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	56,578,605.70
报告期间总参与份额	975,561.69
红利再投资份额	26,627.36
报告期间总退出份额	3,267,073.89
报告期末份额总额	54,313,720.86

## 第七节 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

- 1、2016年5月6日发布《中信证券积极策略5号集合资产管理计划第四次分红》，详见链接：

<http://www.cs.ecitic.com/news/newsContent.jsp?docId=3658875>

## 第八节 信息披露的查阅方式

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

热线电话：95548

