浙商汇金 1 号集合资产管理计划
2016 年第三季度资产管理报告

计划管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

计划托管人：中国农业银行股份有限公司

报告期间：2016 年 7 月 1 日－2016 年 9 月 30 日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人浙江浙商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。

浙商汇金 1 号集合资产管理计划于 2010 年 4 月 30 日成立，中国证监会对浙商汇金 1 号集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具了批复（证监许可[2009]1205 号）。中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

集合资产管理计划托管人中国农业银行股份有限公司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。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2016 年 7 月 1 日－2016 年 9 月 30 日

一、集合计划简介

1. 基本资料

集合计划名称：浙商汇金1号集合资产管理计划

集合计划类型：集合资产管理计划

集合计划成立日：2010年4月30日

集合计划成立份额：2,292,838,485.10份

集合计划报告期末计划总份额：227,686,891.09份

集合计划存续期：2010年4月30日-2017年4月30日

集合计划投资目标：汇金1号以证券投资基金为主要投资对象。管理人将在有效控制风险和保持投资组合流动性的前提下，力争在本集合计划运作期间，实现集合计划资产的稳定增值。

2. 集合计划管理人

名称：浙江浙商证券资产管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市下城区天水巷25号

办公地址：浙江省杭州市杭大路1号

法定代表人：李雪峰

联系人： 俞绍锋

联系电话：0571-87901972

传真电话：0571-87902581

网 址：www.stocke.com.cn

3. 集合计划托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人或负责人：蒋超良

联系人：吕晓萍

联系电话：010-68431281

网址：www.abchina.com

4. 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

5. 会计师事务所和经办注册会计师

名称：北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)

办公地址：北京市西城区裕民路18号北环中心22层

经办注册会计师：张庆栾、李鑫

联系电话：010-82250676　0571-88920089

传真：010-82250851　　0571-88219989

二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

1. 主要财务指标：

单位：人民币元

	主要财务指标	2016年9月30日
1	期初单位集合计划资产净值	1.5063
2	期末单位集合计划资产净值	1.5563
3	期末单位集合计划累计资产净值	1.8263
4	期末集合计划资产净值	354,359,486.32
5	本期集合计划利润	11,537,616.63
6	期末集合计划未分配利润	126,672,595.23
7	单位期末集合计划未分配利润	0.5563
8	本期集合计划净值增长率%	3.32%
9	集合计划累计净值增长率%	89.07%

2. 财务指标的计算公式

(1)单位期末集合计划未分配利润＝集合计划期末未分配利润÷期末集合计划份额

(2)期末单位集合计划资产净值＝期末集合计划资产净值÷期末集合计划份额

(3)期末单位集合计划累计资产净值＝期末单位集合计划资产净值+单位集合计划累计分红

(4)本期集合计划净值增长率＝(分红前一天单位净值/期初单位净值)*{期末单位净值/(分红前一天单位净值-分红金额)}-1

(5)单位集合计划累计净值增长率＝(第一年度单位集合计划资产净值增长率＋1)×(第二年度单位集合计划资产净值增长率＋1)×(第三年度单位集合计划资产净值增长率＋1)×……×(上年度单位集合计划资产净值增长率＋1)×(本期单位集合计划资产净值增长率＋1)-1

3. 收益分配情况

集合计划成立以来，本集合计划收益分配情况：

分配红利日期	每10份集合计划分红	备注
2011年1月21日	0.70	-
2015年3月20日	2.00	

4. 开放期

根据本计划说明书和合同约定，本计划开放日为：自成立日起，每满3个月的首5个工作日。开放期内，投资者可以申购和赎回。开放期结束后再次封闭。

三、集合计划管理人报告

1. 业绩表现

截止到2016年9月30日，集合计划单位资产净值为1.5563元，本期净值增长率为3.32%，集合计划单位累计资产净值1.8263元,累计净值增长率为89.07%。

2. 投资主办简介

邱小平，数量经济学硕士，10年金融工程相关工作经验，历任银河证券衍生品研究员、浙商证券研究所金融工程部经理、国海证券资管部投资经理、浙商资管公司投资经理。擅长开发稳健的量化对冲策略。

3. 投资主办工作报告

三季度沪深300、中证500分别上涨了3.15%和3.34%，中证股票基金、中证混合基金指数分别上涨了3.21%和0.88%，本计划持有基金和股票表现都相对较好，使得净值表现在仓位相对较低的情况下表现和主流指数相当，且明显跑赢偏股型基金指数。

在选择基金时，我们优先考虑基金经理的风控能力，剔除业绩波动较大的基金，再综合考虑基金的选股能力、业绩持续性等，在三季度也选出了一些表现优异的基金，如申万菱信量化小盘、汇丰晋信双核策略混合、兴全商业模式优选、长信量化先锋等，三季度大涨了7%~11%。在选择股票时，我们综合考虑股票的估值水平、盈利能力、成长性等，选择估值较低、盈利能力较强且成长性相对较好的股票，也取得了一定的超额收益。

下一季度，我们将继续完善现有的选基策略，争取挑选出较多的在未来能持续获得超额收益的基金经理，让持有人分享更多的优秀基金经理的投资成果。

4. 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》、《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

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

通过监控和检查，可以确认，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、公司相关制度和本集合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；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

1. 资产负债表：

日期：2016 年 9 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	34,749,654.02	短期借款	0.00
结算备付金	538,776.75	交易性金融负债	0.00
存出保证金	22,507.73	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	319,446,388.53	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	64,639,614.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	0.00	应付赎回款	0.00
基金投资	254,806,774.53	应付管理人报酬	232,178.81
权证投资	0.00	应付托管费	58,044.70
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	80,084.28
买入返售金融资产	0.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	0.00	应付利息	0.00
应收利息	9,764.13	应付利润	0.00
应收股利	134.09	其他负债	37,431.14
应收申购款	0.00	**负债合计**	407,738.93
其他资产	0.00		
		所有者权益：	
		实收基金	227,686,891.09
		未分配利润	126,672,595.23

		所有者权益合计	354,359,486.32
资产合计	354,767,225.25	**负债和所有者权益总计**	354,767,225.25

2. 损益表：

日期：2016 年 7 月 1 日至 2016 年 9 月 30 日　　单位：元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	13,090,545.88	-17,229,142.49
1、利息收入	122,902.60	399,942.02
其中：存款利息收入	118,894.27	395,933.69
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	4,008.33	4,008.33
2、投资收益	17,521,876.73	3,972,300.96
其中：股票投资收益	7,074,692.70	-6,511,852.03
债券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	4,372,689.67	-2,534,845.30
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	6,074,494.36	13,018,998.29
3、公允价值变动收益	-4,554,233.45	-21,604,985.47
4、其他收入	0.00	3,600.00
二、费用	1,552,929.25	5,024,569.44
1、管理人报酬	722,590.97	2,088,542.11
2、托管费	180,647.73	522,135.60
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	634,570.71	2,312,061.92
5、利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
6、其他费用	15,119.84	101,829.81
三、利润总和	11,537,616.63	-22,253,711.93

3. 所有者权益（净值）变动表：

日期：2016 年 7 月 1 日至 2016 年 9 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）	240,247,014.67	121,632,691.61	361,879,706.28	245,705,950.52	114,893,510.42	360,599,460.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	11,537,616.63	11,537,616.63	0.00	9,301,548.89	9,301,548.89
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）	-12,560,123.58	-6,497,713.01	-19,057,836.59	-5,458,935.85	-2,562,367.70	-8,021,303.55
其中：1.基金申购款	131,430.47	66,569.53	198,000.00	0.00	0.00	0.00
2.基金赎回款	-12,691,554.05	-6,564,282.54	-19,255,836.59	-5,458,935.85	-2,562,367.70	-8,021,303.55
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	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	227,686,891.09	126,672,595.23	354,359,486.32	240,247,014.67	121,632,691.61	361,879,706.28

五、集合计划投资组合报告

1. 资产组合情况：

2016年9月30日　　单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	34,749,654.02	9.80%
清算备付金	538,776.75	0.15%
存出保证金	22,507.73	0.01%
股票投资	64,639,614.00	18.22%
债券投资	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
基金投资	254,806,774.53	71.82%
理财产品投资	0.00	0.00%
股票质押权	0.00	0.00%
买入返售金额资产	0.00	0.00%

应收股利	134.09	0.00%
应收利息	9,764.13	0.00%
应收申购款	0.00	0.00%
其他应收款	0.00	0.00%
证券清算款	0.00	0.00%
资产合计	354,767,225.25	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。

2. 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
519983	长信量化先锋股票型证券投资基金	11,566,801.62	25,909,635.63	7.31%
511990	华宝添益	234,232.00	23,439,127.78	6.61%
519698	交银施罗德先锋股票证券投资基金	15,484,871.83	22,713,210.00	6.41%
000165	国投瑞银策略精选混合	11,472,826.09	19,457,913.05	5.49%
080012	长盛电子信息产业股票	8,425,846.38	18,503,158.65	5.22%
160212	国泰估值	6,777,677.36	15,920,764.12	4.49%
163415	兴全模式	8,610,218.14	15,860,021.81	4.48%
460005	华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金	5,830,677.14	14,720,127.51	4.15%
260112	景顺长城能源基建股票型证券投资基金	6,307,080.67	12,248,350.66	3.46%
163110	申万量化	4,614,213.20	12,070,781.73	3.41%

六、集合计划份额变动情况

本集合计划在本期份额变化如下：

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
240,247,014.67	131,430.47	12,691,554.05	227,686,891.09

七、重要事项揭示

1. 本报告期内本集合计划管理人的总经理和托管人的董事长、总经理未发生变更。

2. 本报告期内本集合计划管理人投资主办未发生变更。

八、备查文件目录

1. 本集合计划备查文件目录

（1）《浙商汇金 1 号集合资产管理计划说明书》

（2）《浙商汇金 1 号集合资产管理计划合同》

（3）《浙商汇金 1 号集合资产管理计划托管协议》

（4）《浙商汇金 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

2. 查阅方式

公司网址：www.stocke.com.cn

客服电话：95345

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人浙江浙商证券资产管理有限公司。

浙江浙商证券资产管理有限公司

二〇一六年十月二十五日