

浙商汇金大消费集合资产管理计划 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：中国光大银行股份有限公司

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。

浙商汇金大消费集合资产管理计划于 2011 年 4 月 28 日成立，中国证监会对浙商汇金大消费集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具了批复（证监许可[2011]341 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光大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：浙商汇金大消费集合资产管理计划

集合计划类型：集合资产管理计划

集合计划成立日：2011 年 4 月 28 日

集合计划成立份额：876,254,135.49 份

集合计划报告期末计划总份额：101,584,963.68 份

集合计划存续期：2011 年 4 月 28 日-无固定存续期限

集合计划投资目标：汇金大消费以证券为主要投资对象。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：中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

联系电话：010-63636363

网址：www.cebbank.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	1.1619
2	期末单位集合计划资产净值	1.0938
3	期末单位集合计划累计资产净值	1.5938
4	期末集合计划资产净值	111,113,082.54
5	本期集合计划利润	-6,818,177.08
6	期末集合计划未分配利润	9,528,118.86
7	单位期末集合计划未分配利润	0.0938
8	本期集合计划净值增长率%	-5.86%
9	集合计划累计净值增长率%	57.44%

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
2014 年 6 月 30 日	1.00	-
2015 年 4 月 30 日	2.00	

2016 年 4 月 29 日	2.00	
-----------------	------	--

4. 开放期

根据本计划说明书和合同约定，本计划开放期为：封闭期结束后每个星期的星期一（遇节假日顺延至下一工作日）。开放日内，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 1.0938 元，本期净值增长率为-5.86%，集合计划单位累计资产净值 1.5938 元，累计净值增长率为 57.44%。

2. 投资主办简介

卢媛媛女士，现任浙商证券资产管理有限公司投资主办。哈尔滨工业大学工学学士，同济大学金融学硕士。超过 10 年证券从业经验，历任爱建证券、东海证券、海通证券高级研究员。拥有长期扎实的研究功底，善于把握行业规律，风格稳健。

3. 投资主办工作报告

第三季度产品净值增长-0.62%，产品表现较为平淡。三季度期间市场震荡，以银行为代表的蓝筹股表现较为活跃，市场情绪谨慎，热点散乱。持仓自下而上，主要持有长期跟踪个股。7，8 月产品略微盈利，9 月预期新能源汽车政策落地，在 9 月上旬增加了新能源汽车配置，但政策落地时间和补贴政策均低于预期，造成当月产品略微亏损。目前产品整体仓位不高，未来配置注重自下而上，逐步调仓增加重点跟踪股票配置。

未来市场仍然是窄幅震荡加结构性特征的市场。对于新能源汽车板块，政策的影响极大，政策底预计要到明年上半年实现，以 2017 年补贴政策落地为标志，此后政策趋于稳定，行业将迎来 2 年的快速增长期。因此目前时点配置该行业过早，减仓为宜。通过近期对持仓品种的调研跟踪，四季度将加大军工行业配置，该行业呈现业绩增速加速的态势，同时具有较强的技术壁垒和进入壁垒，市场预期不充分，是熊市较好的配置品种。另外，服务于传统小企业的供应链管理行业也值得深入研究和配置。虽然 2016 年前三季度产品表现一般，但在熊市中通过坚持对个股的调研以及深入研究，我们积累了一批优质个股，相信努力不会白费，在熊市中持股除了注意控制仓位外，更需要耐心。

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	56,313,932.27	短期借款	0.00
结算备付金	508,973.54	交易性金融负债	0.00
存出保证金	203,375.79	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	54,326,836.27	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	54,326,836.27	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	0.00	应付管理人报酬	111,156.87
权证投资	0.00	应付托管费	18,526.15
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	89,859.83
买入返售金融资产	0.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	50,332.90	应付利息	0.00
应收利息	16,938.66	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	87,764.04
应收申购款	0.00	负债合计	307,306.89
其他资产	0.00		

		所有者权益：	
		实收基金	101,584,963.68
		未分配利润	9,528,118.86
		所有者权益合计	111,113,082.54
资产合计	111,420,389.43	负债和所有者权益总计	111,420,389.43

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	-5,880,270.75	-29,002,239.81
1、利息收入	136,647.61	418,388.90
其中：存款利息收入	136,647.61	418,388.90
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	0.00	0.00
2、投资收益	-3,933,009.13	-17,357,014.94
其中：股票投资收益	-4,142,948.95	-17,726,976.92
债券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	0.00	0.00
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	209,939.82	369,961.98
3、公允价值变动收益	-2,083,909.23	-12,063,613.77
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	937,906.33	2,811,025.15
1、管理人报酬	340,381.71	1,064,984.43
2、托管费	56,730.29	177,497.42
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	528,226.21	1,523,246.32
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	12,568.12	45,296.98
三、利润总和	-6,818,177.08	-31,813,264.96

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)	98,169,911.02	15,897,924.82	114,067,835.84	96,219,170.47	31,318,438.24	127,537,608.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	0.00	-6,818,177.08	-6,818,177.08	0.00	3,716,398.43	3,716,398.43
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)	3,415,052.66	448,371.12	3,863,423.78	1,950,740.55	-32,410.39	1,918,330.16
其中: 1. 基金申购款	13,833,265.90	1,739,854.10	15,573,120.00	9,468,946.06	1,669,200.18	11,138,146.24
2. 基金赎回款	-10,418,213.24	-1,291,482.98	-11,709,696.22	-7,518,205.51	-1,701,610.57	-9,219,816.08
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	-19,104,501.46	-19,104,501.46
五、期末所有者权益(基金净值)	101,584,963.68	9,528,118.86	111,113,082.54	98,169,911.02	15,897,924.82	114,067,835.84

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	56,313,932.27	50.54%
清算备付金	508,973.54	0.46%
存出保证金	203,375.79	0.18%
股票投资	54,326,836.27	48.76%
债券投资	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
基金投资	0.00	0.00%
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	0.00	0.00%
应收利息	16,938.66	0.02%
应收申购款	0.00	0.00%
其他应收款	0.00	0.00%
证券清算款	50,332.90	0.05%
资产合计	111,420,389.43	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
002171	楚江新材	377,200.00	6,299,240.00	5.67%
002089	新海宜	369,900.00	6,132,942.00	5.52%
600628	新世界	367,718.00	4,842,846.06	4.36%
002675	东诚药业	276,700.00	4,488,074.00	4.04%
600416	湘电股份	311,400.00	4,029,516.00	3.63%
002669	康达新材	159,608.00	3,824,207.68	3.44%
002341	新纶科技	176,800.00	3,505,944.00	3.16%
002686	亿利达	214,500.00	3,286,140.00	2.96%
002364	中恒电气	130,801.00	3,266,100.97	2.94%
600080	金花股份	255,974.00	3,081,926.96	2.77%

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
98,169,911.02	13,833,265.90	10,418,213.24	101,584,963.68

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) 《浙商汇金大消费集合资产管理计划说明书》
- (2) 《浙商汇金大消费集合资产管理计划合同》
- (3) 《浙商汇金大消费集合资产管理计划托管协议》
- (4) 《浙商汇金大消费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

