

海通海蓝消费精选集合资产管理计划

(2016 年第 3 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：中国工商银行股份有限公司

报告期间：2016 年 07 月 01 日 - 2016 年 09 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中国工商银行股份有限公司于 2016 年 10 月 24 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：	海通海蓝消费精选集合资产管理计划
2、计划简称：	海蓝消费精选
3、计划合同生效日：	2011 年 08 月 03 日
4、成立规模：	550,944,884.40
5、报告期末计划份额总额：	63,603,542.62

(二) 计划产品说明

1、投资目标：	把握中国经济增长方式转型背景下消费改善中孕育的投资机会，重点投资于基本面良好，具有高成长性或具有持续价值创造能力的公司，谋求计划资产的长期增值。
2、投资策略：	中国经济富有成长力并具有新兴加转轨的特征，特定的经济发展阶段和经济发展规律决定了我国未来消费拉动经济增长将成为未来经济发展的主要特点，相应地灵活配置组合资产并通过深入的基本面研究发掘优质的公司股票，可以获取超额收益。本计划通过宏观和微观双层面的分析，基于定量与定性相结合的分析方法确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，追求更高收益，控制组合风险。
3、业绩比较基准：	无
4、风险收益特征：	本计划为股票型证券投资产品，属于高风险收益品种。

(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：	李雪
8、信息披露电话：	021-23212038
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：	中国工商银行股份有限公司
2、注册地址：	北京市西城区复兴门内大街 55 号
3、办公地址：	北京市西城区复兴门内大街 55 号
4、邮政编码：	100140
5、国际互联网址：	www.icbc.com.cn
6、法定代表人：	姜建清
7、信息披露负责人：	赵会军
8、联系电话：	95588
9、传真：	010-66105798
10、电子邮箱：	custody@icbc.com.cn

(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

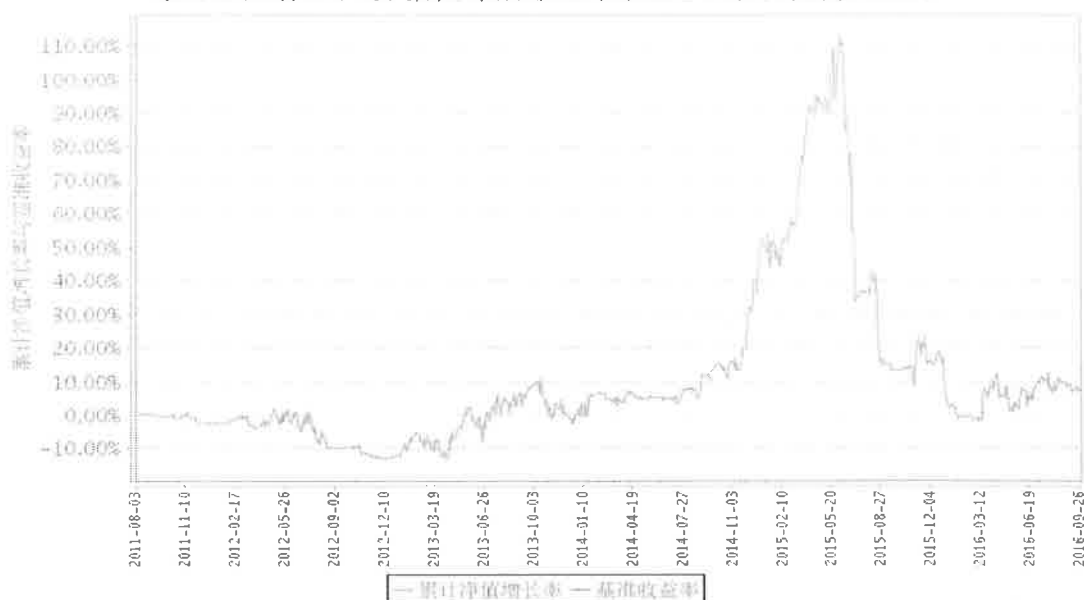
(一) 主要财务指标

(单位：人民币元)

	主要财务指标	2016 年 07 月 01 日 - 2016 年 09 月 30 日
1.	本期利润	19,724.31
2.	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,020,860.60
3.	期末集合计划资产净值	42,363,114.94
4.	期末单位集合计划资产净值	0.6660

(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



注：本集合资产管理计划无业绩比较基准。

(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	6.6000	
2013	0.3500	
合计	6.9500	

三、集合计划管理人报告

(一) 投资经理简介

秦岭松先生：上海海通证券资产管理有限公司权益投资部总监、美国霍夫斯塔大学工商管理硕士，南加州大学会计学硕士，CFA。现任海通季季升集合资产管理计划、海通海蓝消费精选集合资产管理计划、海通海富 15 号集合资产管理计划、海通海富 16 号集合资产管理计划、海通北极星 1 号集合资产管理计划投资经理。曾任海通证券公司交易员，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员，华泰柏瑞积极成长基金和量化先行基金基金经理，拥有 12 年投资管理经验。

(二) 投资经理工作报告

进入 3 季度，以贵州茅台、五粮液、长江电力等为代表的绩优蓝筹股和高股息率品种重新获得市场青睐，资金明显流入，而投资者情绪总体依然谨慎，中小型成长股表现平淡。国庆节前最后一周，央行通过逆回购到期自然回笼 4200 亿元，反映出在房地产价格坚挺的背景下，货币政策开始边际收缩的倾向。从实体经济层面看，民间投资的持续不振也减弱了货币投放的基础。从宏观数据看，8 月工业增加值出现双位数增幅，创近 3 年新高；央行口径的企业景气指数也开始出现轻微改善的迹象，但持续性仍有待观察。9 月以后，前期表现抢眼的绩优蓝筹股和高股息品种出现短期调整，而并购重组题材相对活跃。三爱富的重组方案公布后重新激起了市场对上海国资改革的良好预期。受美联储年底加息的因素影响，预计市

场在十月仍可能保持调整的基调，短期市场仍将缺乏业绩方面的强催化剂。近期 MSCI 表示 A 股市场的制度安排出现积极变化，A 股可能提前被纳入 MSCI 新兴市场指数，预期海外资金的也会趁 A 股的调整进行适当的布局。耐心等待，多看少动可能仍是投资者在年底前较好的选择。

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	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	16,293,718.05	9,425,067.00	短期借款	-	-
清算备付金	63,953.49	139,419.57	交易性金融负债	-	-
存出保证金	43,986.89	118,112.15	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	26,023,679.17	39,278,086.16	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	25,106,359.53	37,538,048.01	应付证券清算款	-	728,510.51
债券投资	-	-	应付赎回款	-	59,491.03
基金投资	917,319.64	1,740,038.15	应付管理人报酬	41,858.41	49,638.68
资产支持证券投资	-	-	应付托管费	8,720.49	10,341.36
衍生金融资产	-	-	应付销售服务费	-	-
买入返售金融资产	-	-	应付交易费用	2.06	21,561.80
应收证券清算款	-	35,081.77	应交税费	-	-
应收利息	3,329.66	3,743.98	应付利息	-	-
应收股利	-	-	应付利润	-	-
应收申购款	-	-	其他负债	14,971.36	20,298.95
其他资产	-	-	负债合计	65,552.32	889,842.33
			所有者权益：	-	-

			实收计划	63,603,542.62	66,984,461.62
			未分配利润	-21,240,427.68	-18,874,793.32
			所有者权益合计	42,363,114.94	48,109,668.30
资产总计	42,428,667.26	48,999,510.63	负债及所有者权益总计	42,428,667.26	48,999,510.63

2、利润表

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	230,259.18	-2,797,326.49
1、利息收入	15,884.26	86,672.15
其中：存款利息收入	15,884.26	80,997.48
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	5,674.67
其他利息收入	-	-
2、投资收益（损失以“-”填列）	1,215,511.21	-3,545,467.39
其中：股票投资收益	1,054,969.02	-3,547,668.76
债券投资收益	-	-
基金投资收益	1,908.29	-334,128.96
权证投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	158,633.90	336,330.33
基金红利收益	-	-
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,001,136.29	661,468.75
4、其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
二、费用	210,534.87	702,316.31
1、管理人报酬	130,102.17	381,975.88
2、托管费	27,104.58	79,578.24
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	48,232.24	225,248.83
5、利息支出	-	-

其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6、其他费用	5,095.88	15,513.36
三、利润总额	19,724.31	-3,499,642.80

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	25,106,359.53	59.17
基金	917,319.64	2.16
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	16,357,671.54	38.55
应收证券清算款	-	-
其他资产	47,316.55	0.11
总计	42,428,667.26	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	000639	西王食品	102,327.00	1,444,857.24	3.41
2	000661	长春高新	13,573.00	1,409,963.24	3.33
3	600570	恒生电子	22,449.00	1,255,797.06	2.96
4	300059	东方财富	65,363.00	1,251,701.45	2.95
5	002415	海康威视	49,277.00	1,205,808.19	2.85
6	300196	长海股份	29,056.00	1,188,390.40	2.81
7	600519	贵州茅台	3,980.00	1,185,681.80	2.80
8	300347	泰格医药	34,189.00	1,097,466.90	2.59
9	300199	翰宇药业	49,119.00	1,082,582.76	2.56
10	002450	康得新	58,968.00	1,066,141.44	2.52

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）
64,629,667.80	-	1,026,125.18	63,603,542.62

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、《海通海蓝消费精选集合资产管理计划合同》
- 2、《海通海蓝消费精选集合资产管理计划说明书》
- 3、《海通海蓝消费精选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



上海海通证券资产管理有限公司

2016年10月26日