

财通证券资产管理有限公司
财通资管财臻1号集合资产管理计划
季度资产管理报告
(2016年三季度)

计划管理人：财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浙江省分行

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财通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。

财通资管财臻1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”或“本计划”）于2015年2月10日成立，并向中国证券投资基金业协会及中国证监会浙江监管局备案，但中国证券投资基金业协会及中国证监会浙江监管局对本集合计划做出的任何决定，均不表明其对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明客户参与本集合计划没有风险。

托管人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。

本报告涉及《财通资管财臻1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）及《财通资管财臻1号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）的相关内容若与《管理合同》及《说明书》中的相关内容不一致，以最新的《管理合同》及《说明书》为准。

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

（一）基本资料

名称：财通资管财臻1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2015年02月10日

成立份额：49,200,376.24份

存续期：2年（可展期）

管理人：财通证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司浙江省分行

注册登记机构：财通证券资产管理有限公司

（二）集合计划管理人

名称：财通证券资产管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市上城区白云路26号143室

办公地址：浙江省杭州市杭大路15号

法定代表人：马晓立

公司网址：www.ctzg.com

（三）集合计划托管人

名称：中国工商银行股份有限公司浙江省分行

注册地址：杭州市中河中路150号

法定代表人：沈荣勤

联系人： 张松财

联系电话： 0571-87803888

二、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：元

	主要财务指标	2016年09月30日
1	期末单位集合计划资产净值	0.8525
2	期末单位集合计划累计资产净值	2.1467
3	期末集合计划资产净值	63,422,399.75
4	本期集合计划利润	8,138,053.64
5	期末集合计划未分配利润	-10,971,106.42
6	单位期末集合计划未分配利润	-0.1475
7	本期集合计划净值增长率%	11.54%
8	集合计划累计净值增长率%	105.82%

（二）收益分配情况

集合计划成立以来，本集合计划收益分配具体分红收益情况详见管理人网站。

三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

截止到2016年09月30日，集合计划单位资产净值为0.8525元，本期净值增长率为11.54%，集合计划单位累计资产净值2.1467元，累计净值增长率为105.82%。

（二）投资主办简介

马宏毅先生，本科就读于北京工商大学金融工程专业，西南财大

EMBA。长期从事投研工作，从业7年。曾担任申银万国证券研究所中小公司分析师，中信证券自营部高级经理，财通证券资产管理部投资经理，中山证券锦弘和富投资有限公司副总经理，2015年加入财通证券资产管理有限公司任投资经理。

（三）投资主办工作报告

1、 市场回顾

今年A股市场运行至今，自1月份熔断以来，事实上，后面都是一个慢牛的行情。WIND全A指数跌幅6.3%，上证指数跌幅8.85%。

截至9月30日，财臻1号累计净值2.1467，今年以来涨幅1.61%，跑赢各大指数。但是作为绝对收益产品，跑赢指数不是我们的目标，我们的目标是为客户持续赚钱。

2、 对于当前和未来中国经济局势的总体展望

站在当前的时点，我们想再次同各为投资者简单交流下我们对于市场的看法。

从宏观上看，中国正在从工业化进程向服务型经济转型的新常态，总需求基本满足的情况下，供给侧的改革对于提升经济运行的效率更为迫切。因此，宏观经济的换挡和增速下降成为必然，与之相对应，转型和创新成为经济的内在需求和外在动力。中国当前的经济总量已经跃居世界第二，制造业规模世界第一，庞大的外汇储备和贸易规模，为我们的转型提供坚实的物质基础。只要政策没有大的错误，中国很难出现拉美等国出现的中等收入陷阱。中长期看，我们对中国抱有极大的信心。

从投资的角度，由于日益增长的货币总量，所有资产类别的收益率都在下行，庞大的居民资产需要寻找新的出口。当房地产、债券、信托、

理财、大宗商品，都无法满足居民对于收益率要求时，权益类产品必将成为一个重要方向。这是我们看好股市的重大理由。在之前的月度和季度报告中，我们从不同方面，阐释了对于经济、股市、板块的看法，在这里，我们重申下对于股票投资的信心。当然，我们也提示股市的风险，其中一点就是注册制带来的供给大量上升、股票估值下移，以及国内外黑天鹅事件导致的偶发性市场波动。因此，未来选取好股票的难度会加大，博弈的天平会向专业的机构投资者倾斜。

3、 市场展望与投资策略

今年年底至明年一季度，各种风险的释放将较为集中，这也是耐心等待、精挑细选的极好时节。当前，为保证5年到期部分投资者的赎回和申购需求，我们产品的仓位较低，待产品开放期结束，我们将逐步建仓，布局来年。我们对于做好财臻1号非常有信心。投资者陪我们走过了最艰难的岁月，现在，是时候和我们一起见证美好的未来了。

再次感谢投资者的信任和选择，我们将继续努力，争取以更好的成绩，回馈投资者的厚爱。

（四）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》、《管理办法》、《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。本报告期内，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

本报告期内，集合计划管理人通过设立独立的风险控制部门，对集合理财业务进行事前审核、事中监控，日常对集合资产管理业务的重大事项进行风险评估，并提出风险控制措施。风险管理部还对业务授权、投资交易的执行情况进行监控，控制业务运作过程中存在的风险。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

我们认为，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《管理合同》及《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；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；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

（一）资产负债表

日期：2016 年 09 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	418,379.84	短期借款	0.00
结算备付金	863,424.62	交易性金融负债	0.00
存出保证金	361,434.04	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	41,635,458.25	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	41,635,458.25	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	100,640.80

权证投资	0.00	应付托管费	40,256.35
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	76,207.35
买入返售金融资产	0.00	应交税费	0.00
应收证券清算款	20,367,764.95	应付利息	0.00
应收利息	5,021.83	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	11,979.28
应收申购款	0.00	负债合计	229,083.78
其他资产	0.00		
		所有者权益：	
		实收基金	74,393,506.17
		未分配利润	-10,971,106.42
		所有者权益合计	63,422,399.75
资产合计	63,651,483.53	负债和所有者权益总计	63,651,483.53

（二）损益表

日期：2016年7月1日-2016年9月30日

单位：元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	8,736,877.78	-3,032,963.18
1、利息收入	64,111.86	269,345.83
其中：存款利息收入	53,209.77	197,376.80
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	10,902.09	71,969.03
2、投资收益	3,026,850.13	-4,422,802.34
其中：股票投资收益	3,046,474.49	-3,594,046.48
债券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	-19,888.36	-859,470.10
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	264.00	30,714.24
3、公允价值变动收益	5,645,915.79	1,120,493.33
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	598,824.14	2,079,449.22
1、管理人报酬	100,640.80	305,786.85
2、托管费	40,256.35	122,314.83

财通资管财臻1号集合资产管理计划2016年季度管理报告（三季度）

3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	453,904.75	1,647,868.26
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	4,022.24	3,479.28
三、利润总和	8,138,053.64	-5,112,412.40

（三）所有者权益（净值）变动表

日期：2016 年 7 月 1 日-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）	114,793,888.40	-27,057,878.07	87,736,010.33	114,793,888.40	-36,051,865.63	78,742,022.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	8,138,053.64	8,138,053.64	0.00	8,993,987.56	8,993,987.56
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）	-40,400,382.23	7,948,718.01	-32,451,664.22	0.00	0.00	0.00
其中：						
1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	-40,400,382.23	7,948,718.01	-32,451,664.22	0.00	0.00	0.00
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）	74,393,506.17	-10,971,106.42	63,422,399.75	114,793,888.40	-27,057,878.07	87,736,010.33

五、集合计划投资组合报告

（一）资产组合情况

2016年09月30日

单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	418,379.84	0.66%
清算备付金	863,424.62	1.36%
存出保证金	361,434.04	0.57%
股票投资	41,635,458.25	65.41%
债券投资	0	0
基金投资	0	0
理财产品投资	0	0
买入返售金额资产	0	0
应收股利	0	0
应收利息	5,021.83	0.01%
其他应收款	0	0
证券清算款	20,367,764.95	31.99%
资产合计	63,651,483.53	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。

（二）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
300215	电科院	880,440.00	20,126,858.40	31.73%
600593	大连圣亚	367,342.00	14,748,781.30	23.25%
000571	新大洲A	374,115.00	3,430,634.55	5.41%
600848	上海临港	153,200.00	3,304,524.00	5.21%
603816	顾家申购	1,000.00	24,660.00	0.04%

六、集合计划份额变动情况

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
114,793,888.40	0	-40,400,382.23	74,393,506.17

七、重要事项揭示

（一）本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计

划管理、财产、托管业务的诉讼事项。

（二）本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

（三）未例明事项见公司网站公告。

八、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

1. 《财通资管财臻1号集合资产管理计划说明书》
2. 《财通资管财臻1号集合资产管理计划合同》
3. 《财通资管财臻1号集合资产管理计划托管协议》
4. 《财通资管财臻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

（二）查阅方式

财通证券资管网址：www.ctzg.com

客服电话：95336

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询管理人财通证券资产管理有限公司。

二〇一六年十月十八日