

长江证券超越理财乐享 1 天集合资产管理计划 2016 年第四季度资产管理报告

重要提示

本报告依据《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。

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，但不保证本集合资产管理计划一定盈利，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。

托管人已于2017年1月19日根据本集合计划合同的规定，复核了本报告中的主要财务指标、会计报表和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告起止时间：2016年10月1日——2016年12月31日

一、集合计划简介

（一）基本资料

名称：长江证券超越理财乐享1天集合资产管理计划

类型：限定性集合资产管理计划

成立日：2013年5月15日

成立规模：1,486,890,206.49份

管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

托管人：交通银行股份有限公司

（二）管理人

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1589号11楼10-11单元

法定代表人：罗国举

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1589号11楼10-11单元

湖北省武汉市江汉区新华路特8号

联系电话：（027）65799778

信息披露人：王钟雅

（三）托管人

名称：交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号

联系电话：（021）32169999

信息披露人：张咏东

二、主要财务指标

（一）主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2016年10月1日—2016年12月31日
1	集合计划本期利润	230,889,132.4
2	期末集合计划份额（份）	25,106,872,313.15
3	期末集合计划资产净值（元）	25,106,872,313.15
4	期末当日年化收益率（%）	4.40%

三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

本集合计划自成立以来，业绩表现平稳，期末集合计划当日年化收益率为4.40%；自成立以来至本期末，本集合计划分红总金额（扣除业绩报酬）为1,022,618,908.01元。

（二）投资经理简介

朱文辉，清华大学经管学院工商管理硕士，CFA 证书持有者。独立管理过货币市场基金、债券基金和保本基金，固收投资管理经验超过 16 年。2016 年加入长江证券资产管理有限公司，先后服务于中国建设银行、平安保险集团、东方人寿、生命人寿、汇丰晋信基金、大成基金、兴业基金和大同证券。注重股票债券大类资产配置和投资风险控制，以绝对收益为目标，投资风格稳健。现任长江证券超越理财乐享 1 天集合资产管理计划、长江证券超越理财灵活配置集合资产管理计划和长江资管黄鹤、和谐系列资产管理计划投资主办人。

（三）投资经理工作报告

1、投资回顾

2016 年四季度，特朗普当选后，伴随美联储加息预期升温，全球资本市场波动加大。美股持续上涨、美债大幅下跌、美元创多年新高，新兴市场汇率承压，人民币贬值预期加剧。国内方面，经济数据持续向好，CPI、PPI 继续回升，通胀预期加强。流动性方面，央行意图维持紧平衡，持续收短放长的公开市场操作，货币市场波动加剧，货币利率大幅攀升。债市方面，受到海外市场、国内经济数据、通胀数据、资金面收紧等多重利空冲击，债券收益率大幅上行，收益率曲线进一步平坦化，信用利差走扩。

本集合计划在充分保证客户资金流动性的前提下，严格控制信用风险、维持债券组合较短久期，利用债券市场调整的时间窗口，加大债券配置力度。

2、未来操作策略

展望未来，房地产政策大幅收紧对经济拖累将在明年 1-2 季度显现，实体经济需求低迷难以驱动通胀数据持续上升，预计 2017 年通胀风险整体可控，上半年货币政策维持稳健中性的基调，需要密切关注。同时考虑到保持较低的货币市场利率是杠杆去化的前提，经济下行风险增大将为货币政策再度宽松打开空间。

四季度债市的大幅调整，我们判断目前债券收益率已具备配置价值。操作策略上，管理人将坚持以流动性和收益性为集合计划操作的首要目标，严格控制信用风险、管控债券组合久期，积极构建优化的市场投资组合，为集合计划争取更高的投资收益。

（四）内部监察报告

本报告期内，公司负责稽核监察的相关部门依照本公司已颁布执行的内部控制、稽核监察、风险控制、合规性检查、投资管理制度等规章制度，独立开展内部控制工作。

在开展工作的过程中，采用了现场与非现场、定期与不定期相结合的工作方法，具体采用了实时监控、现场检查、材料审阅、人员询问和综合分析等多种方法，对投资交易、财务核算等进行了全面细致的审查，对业务流程和规章制度的完善及执行进行了长期的跟踪督察。

长江证券（
骑

四、集合计划财务报告

(一) 集合计划资产负债表 (2016 年 12 月 31 日)

单位: 人民币元

项目	期末余额	期初余额
资产：		
银行存款	550,114,077.70	102,302,366.52
结算备付金	7,226,100.57	171,894.11
存出保证金	203,438.93	3,148.8
交易性金融资产	13,807,223,405.49	4,470,634,745.03
其中：股票投资		
债券投资	3,923,491,990.56	11,757,745.03
资产专项计划投资	9,883,731,414.93	11,757,745.03
基金投资		80,000,000.00
衍生金融资产		
买入返售金融资产	10,853,769,240.00	474,000,000.00
应收证券清算款	230,000,000.00	210,500,000.00
应收利息	332,267,755.85	376,000,000.00
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
资产总计	25,780,804,018.54	5,452,066,762.51
负债：		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款	294,899,157.65	
应付证券清算款		
应付赎回款		
应付管理人报酬	83,642,756.46	5,452,066,762.51
应付托管费	781,201.29	192,464.5
应付销售服务费		
应付交易费用	90,473.81	3,650.00
应付税款		
应付利息	275,301.30	
应付利润	285,256,778.94	27,810,133.7
短期借款	8,986,035.94	32,611.28
负债合计	673,931,705.39	30,062,445.52
所有者权益：		
实收基金	25,106,872,313.15	5,422,004,316.99
未分配利润		
所有者权益合计	25,106,872,313.15	5,422,004,316.99

负债与持有人权益总计:	25,780,804,018.54	5,452,066,762.51
-------------	-------------------	------------------

(二) 集合计划利润表 (2016 年 10 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)

单位: 人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	295,307,873.7	835,341,837.93
1、利息收入	293,812,181.0	828,975,180.58
其中: 存款利息收入	156,552,954.1	545,336,511.61
债券利息收入	29,053,138.5	46,750,433.71
资产支持证券利息收入	0.0	
买入返售金融资产收入	108,206,088.4	236,888,235.26
2、投资收益 (损失以“-”填列)	1,495,692.7	5,740,903.93
其中: 股票投资收益	0.0	
债券投资收益	-1,152,520.3	-1,674,167.89
资产专项计划投资收益	0.0	
基金投资收益	-101.9	53,648.21
权证投资收益	0.0	
基金红利收益	2,648,314.8	7,361,423.61
股利收益	0.0	
3、公允价值变动损益 (损失以“-”填列)	0.0	
4、其他收入 (损失以“-”填列)	0.0	625,753.42
二、费用	64,418,741.3	177,714,808.26
1、管理人报酬	61,300,630.0	170,734,103
2、托管费	2,096,331.8	5,856,708.22
3、销售服务费	0.0	
4、交易费用	7,920.4	8,932.86
5、利息支出	987,761.6	1,023,338.33
其中: 卖出回购金融资产支出	987,761.6	1,023,338.33
6、其他费用	26,097.5	91,725.85
三、利润总额	230,889,132.4	657,627,029.67

资产管理
逢

五、集合计划投资组合报告 (2016 年 12 月 31 日)

(一) 期末集合计划资产组合情况

资产类别	期末市值	占资产总值的比例
银行存款、清算备付金	557,340,178.27	2.16%
股票	0.00	0.00%
债券	3,923,491,990.56	15.22%
资产专项计划投资	9,883,731,414.93	38.34%
基金	0.00	0.00%
买入返售证券	10,853,769,240.00	42.10%
其它资产	562,471,194.78	2.18%
合计	25,780,804,018.54	100.00%

注: 1、“其它资产”包括“交易保证金”、“应收股利”、“应收利息”、“其他应收款”、“应收证券清算款”等项目;

2、本报告中因四舍五入的原因，投资组合报告中市值占资产总值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

(二) 按市值占净值比例大小排序的前五名债券投资明细

代码	证券名称	证券总库存	证券市值	市值占资产净值比例
127463	16 溧经开	1,400,000	140,000,000.00	0.5583%
139320	16 首创集团永续期债 02	1,400,000	140,000,000.00	0.5583%
1480055	14 湘潭高新债	1,000,000	109,409,566.48	0.4363%
139279	16 锡新城	1,000,000	100,000,000.00	0.3988%
112483	16 宝新 01	1,000,000	100,000,000.00	0.3988%

(三) 按市值占净值比例大小排序的前五名资产专项计划投资明细

代码	证券名称	证券总库存	证券市值	市值占资产净值比例
429658	天弘创新稳赢 1 号	1,836,926,535	1,850,619,050.00	7.3801%
3J8093	北信瑞丰丰祥 28 号	1,199,000,000	1,199,000,000.00	4.7815%
3M2034	创金合信雪峰 1 号	800,000,000	800,000,000.00	3.1903%
429688	天弘创新稳赢 2 号	650,000,000	650,000,000.00	2.5921%
421440	天弘中经贸融汇 1 号	590,511,000	590,511,000.00	2.3549%

(四) 集合计划份额变动单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期红利再投份额	本期退出份额	期末总份额
18,268,183,437.55	18,423,535,916.34	0.00	11,584,847,040.74	25,106,872,313.15

六、重要事项提示

(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人、财产、托管业务的诉讼事项。

(二) 本报告期内本集合计划投资组合策略没有发生重大改变。

(三) 2016年10月13日起本集合计划的管理人新任首席风险官为刘泉先生；2016年10月27日起本集合计划的管理人合规负责人变更为刘泉先生；2016年12月9日起本集合计划的管理人新增董事熊雷鸣先生、刘元瑞先生。

(四) 本报告期内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。

七、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、《长江证券超越理财乐享 1 天集合资产管理计划说明书》
- 2、《长江证券超越理财乐享 1 天集合资产管理计划托管协议》
- 3、管理人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点及查阅方式

查阅地址：武汉市新华路特 8 号

网址：www.95579.com

信息披露电话：(027) 65799778

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人长江证券（上海）资产管理有限公司。

长江证券（上海）资产管理有限公司
二〇一七年一月二十二日



