# 大同证券同丰 1 号集合资产管理计划 2016 年第 4 季度资产管理报告

## 一、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》(以下简称“《管理办法》”)《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称“《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大同证券同丰 1 号集合资产管理计划(以下简称“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。

托管人已复核了本报告中本集合计划项下财务数据。本报告未经审计。

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。

托管人保证复核内容不存在虚假记载或重大遗漏。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

## 二、集合计划产品概况

| | |
|---|---|
| 产品名称 | 大同证券同丰 1 号集合资产管理计划 |
| 成立日期 | 2016 年 10 月 31 日 |
| 成立规模 | 30,780,542.68 份 |
| 存续期 | |
| 管理人 | 大同证券有限责任公司 |
| 托管人 | 中国工商银行股份有限公司上海市分行 |

## 三、主要财务指标

| 主要财务指标 | | 单位：人民币元 |
|---|---|---|
| 序号 | 主要财务指标 | 2016 年 10 月 31 日-2016 年 12 月 31 日 |
| 1 | 本期利润 | 224,431.37 |
| | 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 224,431.37 |
| 3 | 期末集合计划资产净值 | 39,781,022.59 |

| | | |
|---|---|---|
| 4 | 期末单位集合计划资产净值 | 1.0000 |

注：主要财务指标如下：

“本期利润”指标的计算方法为当期净收益加上当期因对金融资产进行估值产生的未实现利得变动额。

## 四、集合计划管理人报告

（一）投资主办人简介

投资主办人李春，硕士研究生学历，毕业于华东师范大学应用数学专业。证券从业 11 年，历任东海证券股份有限公司自营分公司研究员、投资经理、资产管理分公司固定收益投资负责人，张家港农商行资产管理事业部投资主管，西部证券资产管理固定收益总监，2016 年 9 月加入大同证券资产管理分公司，分管投资管理业务，具有丰富的投资管理经验。

（二）投资主办人报告

1、业绩表现

市场概况：A 股市场在经历一季度大幅调整之后，于二三季度走出企稳盘整行情，截至 2016 年 9 月 30 日，前三季度上证指数下跌 16.64%，深成指下跌 17.71%，创业板指数下跌 24.15%。

投资运作：本产品成立于 2016 年 10 月 31 日，在操作时，始终注重风险控制，稳健操作。截至 2016 年 12 月 31 日，产品七日年化收益率为 6.1755%。

2、后市展望

2016 年利率债市场伴随资金面的剧烈波动，关键期限十年期国债到期收益率从年初的 2.83%一度跌至近 12 年来最低点 2.64%，并于 12 月中下旬资金面持续紧张时一度攀升至全

年高点 3.37%，年末收于 3.05%。政策性金融债、其他关键期限国债均跟随发生了收益率大幅波动，12 月银行间市场资金面持续紧张并导致短期资金成本快速攀升，受部分不良金融机构内控管理混乱等影响，流动性风险较快蔓延并在市场资金价格方面迅速得到体现。

2016 年全年信用债违约金额近 400 亿元，信用债 11 月末存续总规模 18 万亿元，信用成本约 0.2%，随着产业结构调整的不断深入、房地产及地方政府融资平台的政策变化、货币政策的转向等因素的叠加影响，2017 年信用成本总体上有进一步抬升的可能。

2017 年固定收益市场将面临更多的机遇和挑战。一方面，在央行货币政策“紧平衡”的大背景下，收益率进一步大幅下行的可能性不大；另一方面，商业银行监管拟进一步将表外业务纳入宏观审慎管理，商业银行表内外业务增速放缓甚至可能面临压缩，同时，同业业务近两年高速发展使流动性风险传递的敏感性进一步增强，资金面的摩擦成本面临快速提升。2017 年全年应当积极配置短久期信用债，适时根据资金来源的期限结构，把握关键时点的配置节奏，布局长久期利率债的阶段性交易机会。

## 五、集合计划财务报告

（一）集合计划会计报告

1、集合计划资产负债表（单位：人民币元）

| 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 | 160,266.65 | 短期借款 | 0.00 |
| 结算备付金 | 8,774.25 | 交易性金融负债 | 0.00 |
| 存出保证金 | 2,704.63 | 衍生金融负债 | 0.00 |
| 交易性金融资产 | 45,434,077.14 | 卖出回购金融资产款 | 8,010,000.00 |
| 其中：股票投资 | 0.00 | 应付证券清算款 | 0.00 |
| 债券投资 | 45,434,077.14 | 应付赎回款 | 0.00 |
| 基金投资 | 0.00 | 应付管理人报酬 | 17,049.90 |
| 权证投资 | 0.00 | 应付托管费 | 4,546.82 |
| 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 | 3,603.04 |
| 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 | 2,633.42 |
| 应收利息 | 433,495.27 | 应付利润 | 224,431.37 |
| 应收股利 | -16,030.80 | 其他负债 | 0.00 |
| 应收申购款 | 0.00 | **负债合计** | 8,262,264.55 |
| 其他资产 | 2,020,000.00 | | |
| | | **所有者权益：** | |
| | | 实收基金 | 39,781,022.59 |
| | | 未分配利润 | 0.00 |
| | | **所有者权益合计** | 39,781,022.59 |
| **资产合计** | 48,043,287.14 | **负债和所有者权益总计** | 48,043,287.14 |

## 2、集合计划利润表（单位：人民币元）

| 序号 | 项目 | 本期数 |
|---|---|---|
| 1 | 一、收入 | 251,363.93 |
| 2 | 1、利息收入 | 246,916.85 |
| 3 | 其中：存款利息收入 | 16,404.13 |
| 4 | 债券利息收入 | 230,504.57 |
| 5 | 资产支持证券利息收入 | 0.00 |
| 6 | 买入返售证券收入 | 8.15 |
| 7 | 2、投资收益 | 0.00 |
| 8 | 其中：股票投资收益 | 0.00 |
| 9 | 债券投资收益 | 0.00 |
| 10 | 基金投资收益 | 0.00 |
| 11 | 权证投资收益 | 0.00 |
| 12 | 资产支持证券投资收益 | 0.00 |
| 13 | 衍生工具收益 | 0.00 |

| | | |
|---|---|---|
| 14 | 股利收益 | 0.00 |
| 15 | 个股期权收益 | 0.00 |
| 16 | 3、公允价值变动收益 | 0.00 |
| 17 | 4、其他收入 | 4,447.08 |
| 18 | 二、费用 | 26,932.56 |
| 19 | 1、管理人报酬 | 17,049.90 |
| 20 | 2、托管费 | 4,546.82 |
| 21 | 3、销售服务费 | 0.00 |
| 22 | 4、交易费用 | 0.00 |
| 23 | 5、利息支出 | 4,606.02 |
| 24 | 其中：卖出回购金融资产支出 | 4,606.02 |
| 25 | 6、其他费用 | 729.82 |
| 26 | 三、利润总和 | 224,431.37 |

## （二）集合计划投资组合报告

### 1、资产组合情况

日期：2016 年 12 月 31 日（单位：人民币元）

| 资产类别 | 期末市值 | 占集合计划资产总值比例 |
|---|---|---|
| 银行存款 | 160,266.65 | 0.33% |
| 股票 | | |
| 债券 | 45,434,077.14 | 94.57% |
| 基金 | | |
| 买入返售金融资产 | | |
| 其他资产 | 2,448,943.35 | 5.1% |
| 合计 | 48,043,287.14 | 100% |

### 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三名证券明细（单位：人民币元）

| 证券代码 | 证券名称 | 库存数量(万) | 证券成本 | 成本占净值 |
|---|---|---|---|---|
| 145122 | 16 银控 02 | 30.0000 | 29,958,957.36 | 75.31% |
| AG9733 | 16 皖国贸 SCP004 | 10.0000 | 9,998,205.11 | 25.13% |
| 136592 | 16 鄂稻 01 | 2.5680 | 2,582,634.75 | 6.49% |
| 合　　计 | | 42.5680 | 42,539,797.22 | 106.93% |

3、投资组合报告附注

本集合计划本期投资的前三名证券中，无报告期内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

本集合计划投资的前三名证券中，没有投资于超出计划合同规定备选股票、基金库之外的证券。

集合计划其他资产的构成（单位：人民币元）：

| | |
|---|---|
| 应收证券清算款 | 0.00 |
| 应收利息 | 433,495.27 |
| 应收股利 | -16,030.80 |
| 结算备付金 | 8,774.25 |
| 存出保证金 | 2,704.63 |
| 理财产品 | 2,020,000.00 |
| 合计 | 2,448,943.35 |

## 六、备查文件目录

（一）关于大同证券经纪有限责任公司发起设立大同证券同丰 1 号集合资产管理计划的备案确认函（备案编码 SP5336）

（二）大同证券同丰 1 号集合资产管理计划成立公告

（三）大同证券同丰 1 号集合资产管理计划说明书

（四）大同证券同丰 1 号集合资产管理计划集合资产管理合同

（五）大同证券同丰 1 号集合资产管理计划资产托管协议

（六）管理人业务资格批件、营业执照

文件存放地点：山西省太原市青年路 8 号

网址：www.dtsbc.com.cn

客户服务电话：4007121212

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人大同证券有限责任公司资产管理部。

大同证券有限责任公司

2017 年 1 月 10 日