

大同证券同丰 2 号集合资产管理计划 2017 年第一季度资产管理报告

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 2 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 2 号集合资产管理计划
成立日期	2016 年 11 月 9 日
成立规模	35,651,518.61
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	2017 年 01 月 01 日-2017 年 03 月 31 日
1	本期利润	539,662.50
	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	539,662.50
3	期末集合计划资产净值	52,251,518.61



4	期末单位集合计划资产净值	1.0000
5	期末累计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

2017 年一季度银行间市场资金面总体呈现偏紧张态势，关键期限十年期国债到期收益率从年初的 3.02% 升至春节后的高点 3.48%，处于接近 3.5% 的高点，并于一季度末收至 3.28%。政策性金融债、其他关键期限国债均在一季度产生了一定幅度的波动，3 月中旬受商业银行 MPA 考核、光大银行可转债申购等多重因素叠加影响，银行间市场资金面再次持续紧张。北京时间 3 月 16 日凌晨 2:00，美国联邦储备委员会宣布将联邦基金利率目标区间上调 25 个基点到 0.75% 至 1.00% 水平。随后，中国人民银行随后跟随上调 7 天期、14 天期、28 天期公开市场操作逆回购利率和 184 天期、365 天期中期借贷便利 10Bp 至 2.45%、2.6%、2.75%、3.05%、3.2%。2 月份 CPI 同比增长 0.8%，较 1 月份有所

回落，PPI 同比增长 7.8%，但因工业原材料价格基数较小，通胀压力不大。

2017 年一季度信用债市场面临更多的潜在信用风险，信用风险由中低评级发行主体向中高评级发行主体扩散。因互保等行为产生的或有负债使信用风险呈现进一步蔓延的趋势。2017 年一季度，包括辉山乳业、齐星集团等企业发生信用风险并扩大至担保人，担保人面临较大垫资代偿风险，并在一定程度上对违约主体所在区域的融资环境造成了较大的负面影响。

2017 年固定收益市场正面和负面的因素同时存在。2017 年一季度工业企业开工情况较 2016 年有所好转，宏观经济环境呈现出一定程度的企稳迹象，但是否可持续仍待观察。美国加息周期仍处于前期阶段，并给人民币间接带来一定程度的贬值压力。后续政策面存在三大不确定性：1) MPA 首季实施考核后未达标银行的惩罚措施没有细则；2) 央行统一金融机构资管办法后，具体实施过程中的消化时间缓冲期间的不确定性；3) 对同业存单尤其是中小银行同业存单未来规模的限制。2017 年全年银行间市场同业资金成本仍会出现阶段性高企。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	负债和所有者权益	期末余额
资 产:		负 债:	
银行存款	328,286.15	短期借款	0.00

结算备付金	16,584.11	交易性金融负债	0.00
存出保证金	4,335.54	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	49,670,478.35	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	49,670,478.35	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	284,562.81
权证投资	0.00	应付托管费	9,719.71
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	764.22
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	0.00
应收利息	1,321,482.85	应付利润	778,461.69
应收股利	-36,139.96	其他负债	0.00
应收申购款	0.00	负债合计	1,073,508.43
贷款	0.00		
代理业务资产	0.00	所有者权益：	
融资租赁资产	0.00	实收基金	52,251,518.61
可供出售金融资产	0.00	资本公积	0.00
持有至到期投资	0.00	未分配利润	0.00
长期股权投资	0.00	所有者权益合计	52,251,518.61
长期应收款	0.00		
其他资产	2,020,000.00		
资产总计	53,325,027.04	负债和所有者权益总计	53,325,027.04

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	836,162.46
2	1、利息收入	797,541.44
3	其中：存款利息收入	2,476.88
4	债券利息收入	795,064.56
5	资产支持证券利息收入	0.00
6	买入返售金融资产收入	0.00
7	贷款利息收入	0.00
8	代理业务资产利息收入	0.00

9	租赁收入	0.00
10	2、投资收益（损失以“-”填列）	-384.57
11	其中：股票投资收益	0.00
12	债券投资收益	-384.57
13	基金投资收益	0.00
14	权证投资收益	0.00
15	资产支持证券投资收益	0.00
16	衍生工具收益	0.00
17	可供出售金融资产投资收益	0.00
18	持有至到期投资收益	0.00
19	股权投资收益	0.00
20	股利收益	0.00
21	个股期权收益	0.00
22	3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	0.00
23	4、其他收入（损失以“-”填列）	39,005.59
24	5、营业外收入	0.00
25	二、费用	296,499.96
26	1、管理人报酬	271,584.25
27	2、托管费	9,719.71
28	3、销售服务费	0.00
29	4、交易费用	0.00
30	5、利息支出	15,005.57
31	其中：卖出回购金融资产支出	15,005.57
32	6、其他费用	190.43
33	7、营业外支出	0.00
34	三、利润总额	539,662.50

（二）集合计划投资组合报告

1、资产组合情况

日期：2017 年 03 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	328,286.15	0.62%
股票	0.00	
债券	49,670,478.35	93.15%
基金	0.00	
买入返售金融资产	0.00	
其他资产	3,326,262.54	6.23%
合计	53,325,027.04	100%

2、报告期末按摊余成本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)	摊余成本	成本占净值
145125	16 博润 01	30.0000	29,969,593.28	57.36%
145090	16 市政 02	12.8000	12,744,934.73	24.39%
AG9733	16 皖国贸 SCP004	4.0000	3,999,646.37	7.65%
合 计		46.8000	46,714,174.38	89.40%

3、投资组合报告附注

本集合计划本期投资的前一名证券中，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一名证券中，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	1,321,482.85
应收股利	-36,139.96
结算备付金	16,584.11
存出保证金	4,335.54
理财产品	2,020,000.00
合计	3,326,262.54

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 2 号集合资产管理计划的备案确认函 (备案编码 SP6049)

(二) 大同证券同丰 2 号集合资产管理计划成立公告

(三) 大同证券同丰 2 号集合资产管理计划说明书

(四) 大同证券同丰 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同

(五) 大同证券同丰 2 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 4 月 10 日

