

**中金股票精选集合资产管理计划  
2017 年第 2 季度资产管理报告**

**2017 年 6 月 30 日**

集合计划管理人：中国国际金融股份有限公司  
集合计划托管人：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：2017 年 7 月 21 日

## §1 重要提示

本报告由中金股票精选集合资产管理计划（“本集合计划”）管理人中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）编制。

本集合计划托管人中国银行股份有限公司于 2017 年 7 月 21 日对本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等数据进行了复核。

本集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 4 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

本报告内容由管理人负责解释。

## §2 集合计划产品概况

集合计划全称:	中金股票精选集合资产管理计划
交易代码:	920002
集合计划运作方式:	非限定性、开放式
集合计划成立日:	2006 年 7 月 20 日
报告期末集合计划份额:	322,935,544.24 份
集合计划存续期:	无固定存续期限
投资目标:	追求资产的长期稳定收益，并分享经济增长的成果。
投资策略:	在既定的股票投资比例范围内，本计划的股票资产的配置将以中金公司研究部推荐股票池为基础，并偏重于具有长期增值潜力的稳健价值型股票，即大中盘蓝筹并具有稳健业务特征的行业与个股。
业绩比较基准:	无
风险收益特征:	本集合计划的投资范围和结构设计使其具有高流动性、较高风险、较高收益的特征，适合风险承受能力

	较高的投资者或投资组合中高风险配置部分。
集合计划管理人:	中国国际金融股份有限公司
集合计划托管人:	中国银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和集合计划净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 4 月 1 日-2017 年 6 月 30 日）
1.本期已实现收益	-18,833,654.95
2.本期利润	-9,895,639.19
3.加权平均集合计划份额本期利润	-0.0305
4.期末集合计划资产净值	418,387,117.07
5.期末集合计划份额净值	1.2956

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

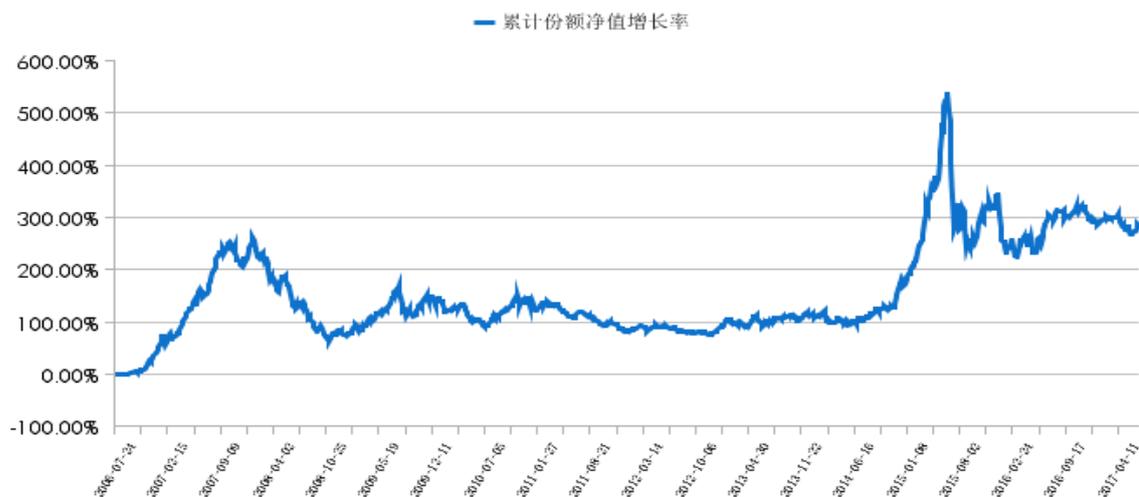
#### 3.2 集合计划净值表现

##### 3.2.1 本报告期集合计划份额净值增长率

阶段	净值增长率	净值增长率标准差
过去三个月	-2.27%	0.78%

##### 3.2.2 自集合计划成立以来集合计划累计净值增长率变动

中金股票精选集合资产管理计划累计份额净值增长率历史走势图  
(2006 年 7 月 20 至 2017 年 6 月 30 日)



## §4 管理人报告

### 4.1 集合计划投资主办人简介

姓名	职务	任本集合计划的投资主办人期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
文尽远	投资经理	2015-4-10	—	10 年	文尽远先生，中国人民大学会计学硕士。2008 年加入中金公司，从事研究分析工作，先后担任中金公司资产管理部农业研究员，轻工研究员，食品饮料研究员，电力和环保行业研究员，投资经理助理。现任中金股票策略、中金配置、中金股票精选、中金安心回报集合资产管理计划投资经理。

### 4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

#### 4.2.1 集合计划合规运作说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、其他

相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，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。

报告期内，本集合计划合法合规运作，投资管理符合相关法律法规、本集合计划说明书和合同的规定，不存在违法违规、未履行承诺或损害本集合计划份额持有人利益的情形。

#### 4.2.2 集合计划风险管理报告

报告期内，中金公司资产管理部风险管理委员会负责独立开展本集合计划投资运作的风险管理，定期向公司管理层提供合规与风险管理报告。

报告期内，本集合计划管理人坚持规范运作、防范风险、保护投资者利益，严格执行中金公司内部控制与风险管理制度，致力于加强业务合规性的定期监控与检查，落实各项法律法规和管理制度，以使本集合计划合同得到严格履行。

报告期内，本集合计划管理人严格遵守有关法律法规和本集合计划投资指引的各项规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划份额持有人获取长期稳健收益，未出现风险事故或其他损害集合计划份额持有人利益的情形。

### 4.3 报告期内集合计划的投资策略和业绩表现说明

#### 4.3.1 本集合计划业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本集合计划份额净值为 1.2956 元，累计份额净值为 3.7938 元，本期净值增长率为-2.27%。

#### 4.3.2 行情回顾及运作分析

2017 年。

#### 4.3.3 市场展望与投资策略

年初市场

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占集合计划总资产的比例
1	权益投资	385,559,637.76	89.85%
	其中：股票	385,559,637.76	89.85%
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	43,336,076.12	10.10%
7	其他资产	204,332.96	0.05%
8	合计	429,100,046.84	100.00%

注：其他资产包括存出保证金、应收利息、证券清算款、应收股利。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,879,513.00	0.93%
C	制造业	240,702,631.87	57.53%
D	电力、热力、燃气及水的生产和供应业	4,174,360.00	1.00%
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,248,063.72	1.25%
G	交通运输、仓储和邮政业	308.49	0.00%
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,609,040.45	2.54%
J	金融业	102,415,457.65	24.48%
K	房地产业	3,630,856.00	0.87%
L	租赁和商务服务业	13,371,588.12	3.20%
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	1,527,818.46	0.37%
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	385,559,637.76	92.15%

5.3 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资  
 明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占集合计划资产 净值比例
1	000651	格力电器	692,600	28,514,342.00	6.82%
2	601058	赛轮金宇	8,200,950	28,047,249.00	6.70%
3	000333	美的集团	496,091	21,351,756.64	5.10%
4	601318	中国平安	430,300	21,347,183.00	5.10%
5	600519	贵州茅台	39,552	18,662,611.20	4.46%
6	600612	老凤祥	346,744	16,980,053.68	4.06%
7	002400	省广股份	1,665,204	13,371,588.12	3.20%
8	601601	中国太保	393,000	13,310,910.00	3.18%
9	002470	金正大	1,714,564	12,910,666.92	3.09%
10	000970	中科三环	852,500	12,599,950.00	3.01%

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名债券投资  
 明细

本集合计划本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名资产支持  
 证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前五名权证投资  
 明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

## 5.8 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名基金投资 明细

## 5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内本集合计划投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.9.2 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	196,011.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,321.64
5	应收参与款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	204,332.96

### 5.9.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 5.9.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 5.9.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 集合计划份额变动

单位：份

报告期期初集合计划份额总额	325,431,873.77
报告期期间集合计划总参与份额	1,913,256.10
报告期期间集合计划总退出份额	4,409,585.63
报告期期间集合计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	
报告期期末集合计划份额总额	322,935,544.24

## §7 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，本集合计划未发生变更投资主办人、变更代理推广机构、巨额退出或出现其他可能对本集合计划的持续运作产生重大影响的情形。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 8.1.1 《中金股票精选集合资产管理计划说明书》
- 8.1.2 《中金股票精选集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 8.1.3 《中金股票精选集合资产管理计划托管协议》
- 8.1.4 《关于同意中国国际金融股份有限公司设立中金股票精选集合资产管理计划的批复》
- 8.1.5 《关于核准中金股票精选集合资产管理计划延长存续期和提高规模上限的批复》
- 8.1.6 《中金股票精选集合资产管理计划（展期）说明书》
- 8.1.7 《中金股票精选集合资产管理计划（展期）集合资产管理合同》
- 8.1.8 《中金股票精选集合资产管理计划（展期）托管协议》
- 8.1.9 管理人业务资格批件、营业执照

### 8.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和/或集合计划托管人的住所。

### 8.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人、集合计划托管人的住所或集合计划管理人网站 <http://www.cicc.com.cn/AssetMgmt> 查阅备查文件或致电：800-810-8802（固话用户），（010）6505-0105（手机用户）查询。

中国国际金融股份有限公司

2017 年 7 月 21 日

## 中金股票精选集合资产管理计划 2017年二季度托管报告

中国国际金融有限公司：

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中金股票精选集合资产管理计划（以下称“本计划”）的托管过程中，严格遵守《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》和托管协议的规定，认真履行了应尽的义务，不存在损害计划份额持有人利益的行为。

本报告期内，本托管人根据《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》和托管协议的规定，对本计划管理人的投资运作进行了必要的监督。

季度资产管理报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告中的数据核对一致。

中国银行股份有限公司

北京市分行

2017年07月21日

