

长江证券超越理财主题精选集合资产管理计划 2017年第二季度产管理报告

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。

中国证监会于2012年1月19日对长江证券超越理财主题精选集合资产管理计划(下称“集合计划”或“本集合计划”)出具核准文件(证监许可[2012]95号),但中国证监会对本集合计划做出的任何决定,均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明参与本集合计划没有风险。

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7月12日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:2017年4月1日——2017年6月30日

一、集合计划简介

（一）基本资料

名称：长江证券超越理财主题精选集合资产管理计划

类型：非限定性集合资产管理计划

成立日：2012年8月20日

成立规模：219,729,087.08份

管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

托管人：中国建设银行

（二）管理人

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道1589号11楼10-11单元

法定代表人：罗国举

办公地址：上海市浦东新区向城路288号国华人寿金融大厦8楼

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：中国建设银行股份有限公司

法定代表人：王洪章

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

联系电话：（010）67595096

信息披露人：田青

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	2017年4月1日—2017年6月30日
1	集合计划本期利润	-4,080,945.8
2	期末集合计划资产净值	37,060,310.59
3	期末单位集合计划资产净值	0.9254
4	累计单位集合计划资产净值	1.4804
5	本期集合计划净值增长率	-9.23%
6	集合计划累计净值增长率	48.04%

（二）财务指标的计算公式

1、期末单位集合计划资产净值=期末集合计划资产净值/集合计划份额

2、累计单位集合计划资产净值=期末单位集合计划资产净值+单位集合计划已分红收益

3、本期集合计划净值增长率=（本期末单位集合计划资产净值-上期末单位集合计划资产净值+本期单位集合计划已分红收益）/上期末单位集合计划资产净值×100%

4、集合计划累计净值增长率=（累计单位集合计划资产净值-1）×100%

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值 0.9254 元，累计单位净值 1.4804 元，本期净值增长率为-9.23%，累计净值增长率 48.04%。

(二) 投资经理简介

童国林，1969 年 6 月出生，中南财经大学经济学硕士。先后任华宝兴业基金公司研究总监、基金经理，富国基金首席策略分析师，天弘基金公司总经理助理兼投资总监，上海安苏投资管理有限公司总经理。2014 年 8 月加入长江证券股份有限公司。童国林具有丰富的证券从业经验，目前担任长江超越理财基金管家 II 集合资产管理计划、长江证券超越理财可转债集合资产管理计划、长江超越理财核心成长集合资产管理计划、长江资管超越理财琴台 3 号集合资产管理计划、长江资管步步为赢 1 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 3 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 6 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 7 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 8 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 11 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 13 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 15 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 18 号可转债集合资产管理计划和本集合计划投资主办人。

杨楠，1988 年 8 月出生，上海财经大学经济学硕士。2012 年 6 月加入中国国际期货担任研究员岗位，2014 年 11 月加入长江证券（上海）资产管理有限公司。目前担任长江超越理财基金管家 II 集合资产管理计划、长江证券超越理财可转债集合资产管理计划、长江超越理财核心成长集合资产管理计划、长江资管超越理财琴台 3 号集合资产管理计划、长江资管步步为赢 1 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 3 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 6 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 7 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 8 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 11 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 13 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 15 号可转债集合资产管理计划、长江资管步步为赢 18 号可转债集合资产管理计划和本集合计划投资主办人。。

(三) 投资经理工作报告

1、投资结果

截至 2017 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值 0.9254 元，累计单位净值 1.4804 元，本期净值增长率为-9.23%，累计净值增长率 48.04% 。

2、投资回顾与展望

(1) 投资回顾

2017 年第一季度成为本年经济增长的高点，随着房地产、基建投资和汽车消费的回落，叠加货币政策收紧引发利率上行，经济持续回暖的动力已经开始减弱。2017 年下半年，经济仍将面临一定的下行压力。十九大将于下半年召开，政府维稳意愿较强，因此，经济下行风险预计整体可控。金融监管政策趋严，未来仍将面临着去杠杆的局面。

股票市场方面，年初以来，市场风格明显偏向价值股，具有较高业绩确定性的板块和个股受到市场追捧。其中，上证综指下跌 0.93%，沪深 300 指数上涨 6.1%，创业板指数下跌 4.68%，中小板指数上涨 2.98%，整体风格分化明显。行业方面，根据申万一级行业指数统计，2017 年第二季度，家用电器、食品饮料、国防军工强势上涨，分别上涨 13.79%、9.55%、7.45%；而传媒、农林牧渔、纺织服装则分别下跌 5.3%、3.99%和 3.78%。港股市场随着国内资金继续南下，由于其尚属于估值洼地，2017 年第二季度仍维持上涨态势，其中恒生指数上涨 6.87%，并且年初至今已经上涨 17.11%。2017 年第三季度，A 股市场整体上行空间

券(上海
倚

有限，更多存在于结构性机会。

操作方面，该集合产品本季度更换投资经理。我们对产品投资策略进行了重新调整，采用 CPPI 策略控制产品的风险，同时，挖掘 TMT 行业的投资机会。本产品，权益资产投资于“中证 TMT 指数”成分股，力争超越指数；固定收益类资产采用可转债（可交换债）、以及中短期信用债。

（2）参与股指期货情况披露

本集合计划在第四季度未进行股指期货的交易。截至 2017 年 6 月 30 日，本集合计划未持仓任何股指期货合约。

（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。

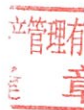
四、集合计划财务报告

（一）集合计划资产负债表（2017 年 6 月 30 日）

单位：人民币元

项目	期末余额	年初余额
资 产：		
银行存款	17,301,424.33	2,936,438.05
结算备付金	65,000.00	119,147.37
交易保证金	14,380.10	16,083.38
交易性金融资产	24,323,257.00	46,692,300.00
其中：股票投资	6,320,737.00	46,692,300.00
债券投资	10,995,380.00	0.00
基金投资	7,007,140.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	1,500,837.50
应收利息	234,512.99	1,069.81
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	29,644.27	98,814.23
其他资产	0.00	0.00
资产合计：	41,968,218.69	51,364,690.34
负 债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
应付证券清算款	4,076,115.84	0.00
应付赎回款	256,362.46	225,339.11
应付管理人报酬	210,902.18	50,649.10
应付托管费	6,099.22	8,441.57

应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	357,940.45	160,539.64
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	487.95	904.97
负债合计:	4,907,908.10	445,874.39
所有者权益:		
实收基金	40,048,452.17	45,611,882.46
未分配利润	-2,988,141.58	5,306,933.49
所有者权益合计	37,060,310.59	50,918,815.95
负债与持有人权益总计:	41,968,218.69	51,364,690.34



(二) 集合计划利润表 (2017年4月1日至2017年6月30日)

单位: 人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	-3,745,137.93	-3,246,410.67
1.利息收入	28,465.79	48,334.60
其中: 存款利息收入	10,904.38	17,782.22
债券利息收入	7,094.36	7,094.36
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产利息收入	10,467.05	23,458.02
2.投资收益 (损失以“-”号填列)	-3,733,260.14	-3,786,491.00
其中: 股票投资收益	-3,821,924.76	-3,845,126.15
债券投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	0.00	-30,029.47
权证投资收益	0.00	0.00
股指期货投资收益	0.00	0.00
基金红利收益	0.00	0.00
股利收益	88,664.62	88,664.62
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-40,343.58	491,745.73
4.其他收入	0.00	0.00
二、费用	335,807.87	574,858.11
1.管理人报酬	120,636.33	258,477.63
2.托管费	20,106.04	43,079.53
3.销售服务费	0.00	0.00
4.交易费用	193,799.96	270,804.45
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	1,265.54	2,496.50
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-4,080,945.80	-3,821,268.78

五、集合计划投资组合报告（2017年6月30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
银行存款和清算备付金	17,366,424.33	41.38%
股票	6,320,737.00	15.06%
债券	10,995,380.00	26.20%
基金	7,007,140.00	16.70%
买入返售	0.00	0.00%
其它资产	278,537.36	0.66%
合计	41,968,218.69	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股票投资明细

代码	证券名称	证券总库存	证券市值	市值占资产净值比例
002241	歌尔股份	75,000.00	1,446,000.00	3.90%
002236	大华股份	61,500.00	1,402,815.00	3.79%
002415	海康威视	43,400.00	1,401,820.00	3.78%
300136	信维通信	26,000.00	1,040,520.00	2.81%
002555	三七互娱	39,600.00	1,012,572.00	2.73%

（三）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
112333	16 鲁焦 01	33,000.00	3,319,800.00	8.96%
112314	16 华南 01	33,500.00	3,213,655.00	8.67%
132005	15 国资 EB	17,000.00	1,875,100.00	5.06%
113011	光大转债	17,500.00	1,838,550.00	4.96%
136011	14 瀚华 02	7,500.00	748,275.00	2.02%

（四）按市值占净值比例大小排序的前五名基金投资明细

代码	证券名称	证券总库存	证券市值	市值占资产净值比例
512330	南方中证 500 信息技术 ETF	4,504,000.00	3,567,168.00	9.63%
159939	广发中证全指信息技术 ETF	3,197,000.00	3,439,972.00	9.28%

（五）集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
44,934,524.05	9,671,265.09	14,557,336.97	40,048,452.17

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) 2017年4月24日起本集合计划的管理人新任副总经理董来富先生。

(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、中国证监会批准长江证券超越理财主题精选集合资产管理计划推广的文件
- 2、《长江证券超越理财主题精选集合资产管理计划说明书》
- 3、《长江证券超越理财主题精选集合资产管理计划托管协议》
- 4、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.cjzcgf.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

二〇一七年七月二十一日



公司