

长江资管月月丰利 1 号集合资产管理计划 2017 年第三季度资产管理报告



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10月24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：2017年7月1日——2017年9月30日

一、集合计划简介

（一）基本资料

名称：长江资管月月丰利1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2017年7月4日

成立规模：32,001,722.22 份

管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

（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：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

湖北省武汉市江汉区新华路特8号

联系电话：（021）80301234

信息披露人：高杨

（三）托管人

名称：宁波银行股份有限公司

负责人：陆华裕

联系地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

联系电话：0574-83052531

传真：0574-87050110

联系人：徐雍涛

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7月1日—2017年9月30日
1	集合计划本期利润	472799.11
2	集合计划本年累计利润	472799.11
3	集合计划本期收益率（年化）	6.0591%
4	集合计划本年累计收益率（年化）	6.0591%

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至 2017 年 9 月 30 日,本集合计划本期利润 472,799.11 元,本年累计利润 472,799.11 元,本期收益率 6.06%,本年累计收益率 6.06%。

(二) 投资经理简介

刘洁,上海财经大学管理学学士、经济学硕士。2005 年进入固定收益行业,曾就职于上海联合信用管理有限责任公司、太平洋资产管理有限责任公司、中银国际证券有限责任公司,从事固定收益投资及研究工作,2016 年进入长江证券资管,任投资主办人。

(三) 投资经理工作报告

1、投资结果

截至 2017 年 9 月 30 日,本集合计划本期利润 472,799.11 元,本年累计利润 472,799.11 元,本期收益率 6.06%,本年累计收益率 6.06%。

2、投资回顾与展望

三季度债券市场基本延续第二季度的窄幅震荡格局。央行连续 3 个月超额续作 MLF,货币政策维稳态度明显,不过在守住不在系统性风险底线目标的同时,监管层更多关注对实体经济的支持,在金融体系内则加强了对同业存单考核和货币基金的流动性管理。

考虑到经济持续回升动力不显,又保持较大韧性,央行货币政策维稳和监管继续加强的多方面影响下,预计债券市场仍会保持目前的震荡格局。从绝对水平来看,经过前期市场的调整,债市处于较好的配置窗口,自 7 月份成立后,本计划陆续进行建仓操作,基本策略是在控制信用风险、控制久期的前提下,精选各券,首先通过稳健的票息策略,为委托人提供相对稳定的收益保障。

展望四季度,本计划将在 10 月份迎来开放,因此流动性管理将是此后一段时间的重要工作。在确保流动性的前提下,将积极寻找短端确定性机会,以期增厚收益。市场方面,考虑到市场情绪转换较快,预计下一阶段或仍有反复,将继续保持谨慎。

(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 9 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	1,155,969.50	0.00
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	49,776,999.55	0.00
其中:股票投资	0.00	0.00

债券投资	49,776,999.55	0.00
基金投资	0.00	0.00
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00
买入返售金融资产	69,560,304.34	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	1,097,980.99	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计:	121,591,254.38	0.00
负债:		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	18,811.47	0.00
应付托管费	1,088.14	0.00
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	304.34	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	85,050.43	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	105,254.38	0.00
持有人权益:		
实收基金	121,486,000.00	0.00
未分配利润	0.00	0.00
所有者权益合计	121,486,000.00	0.00
负债和所有者权益总计	121,591,254.38	0.00

(二) 集合计划利润表 (2017年7月1日至2017年9月30日)

单位: 人民币 元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	553,429.78	553,429.78
1、利息收入	422,347.87	422,347.87
其中: 存款利息收入	671.63	671.63
债券利息收入	369,926.68	369,926.68
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	51,749.56	51,749.56

2、投资收益	131,081.91	131,081.91
其中：股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	4,979.99	4,979.99
基金投资收益	0.00	0.00
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	126,101.92	126,101.92
个股期权收益	0.00	0.00
3、公允价值变动收益	0.00	0.00
二、费用	84,400.77	84,400.77
1、管理人报酬	39,154.16	39,154.16
2、托管费	2,613.73	2,613.73
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	0.00	0.00
5、利息支出	42,632.88	42,632.88
其中：卖出回购金融资产支出	42,632.88	42,632.88
6、其他费用	0.00	0.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	469,029.01	469,029.01

五、集合计划投资组合报告（2017年9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	1,155,969.50	0.9507%
股票	0.00	0.00
基金	0.00	0.00
债券	49,776,999.55	40.9380%
买入返售证券	69,560,304.34	57.2083%
其它资产	1,097,980.99	0.9030%
合计	121,591,254.38	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
145524	17 复地 F1	300000	30,000,028.86	24.6942%
136584	16 铁牛债	200000	19,776,970.69	16.2792%

（三）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
32,001,722.22	118486000.00	29001722.22	121,486,000.00

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、托管业务的重大诉讼事项。

(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) 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、《长江资管月月丰利 1 号集合资产管理计划说明书》
- 2、《长江资管月月丰利 1 号集合资产管理计划托管协议》

(二) 存放地点及查阅方式

查阅地址：上海市浦东新区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层

网址：www.cjzcgf.com

信息披露电话：(021) 80301283

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。

