

光大阳光新兴产业集合资产管理计划 2018 年第 2 季度资产管理报告

计划管理人：上海光大证券资产管理有限公司

计划托管人：中国工商银行股份有限公司

报告期间：2018 年 04 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日

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。

中国证监会 2010 年 12 月 14 日对本集合计划出具了批准文件（证监机构字[2010]1821 号文《关于核准光大证券有限公司设立光大阳光新兴产业集合资产管理计划的批复》），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益作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主要财务指标、投资组合报告、集合计划份额变动情况中的数据。

管理人保证本报告中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告中的金额单位除特指外均为人民币元。

一、集合计划简介

计划名称	光大阳光新兴产业集合资产管理计划
计划交易代码	860008
计划产品类型	混合型
计划合同生效日	2011-01-31
成立规模	1284966952 元
计划合同存续期限	无固定存续期
报告期末资产份额总额	257,774,073.51 份
资产管理人	上海光大证券资产管理有限公司
资产托管人	中国工商银行股份有限公司

二、主要财务指标和集合计划净值表现

(一) 主要财务指标

(单位: 元)

主要财务指标	报告期 (2018年04月01日-2018年06月30日)
1. 本期已实现收益	3,369,375.29
2. 本期利润	-9,795,125.33
3. 加权平均份额本期利润	-0.0734
4. 期末资产净值	250,065,944.26
5. 期末份额净值	0.9701

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。

所述集合计划业绩指标不包括持有人交易本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。

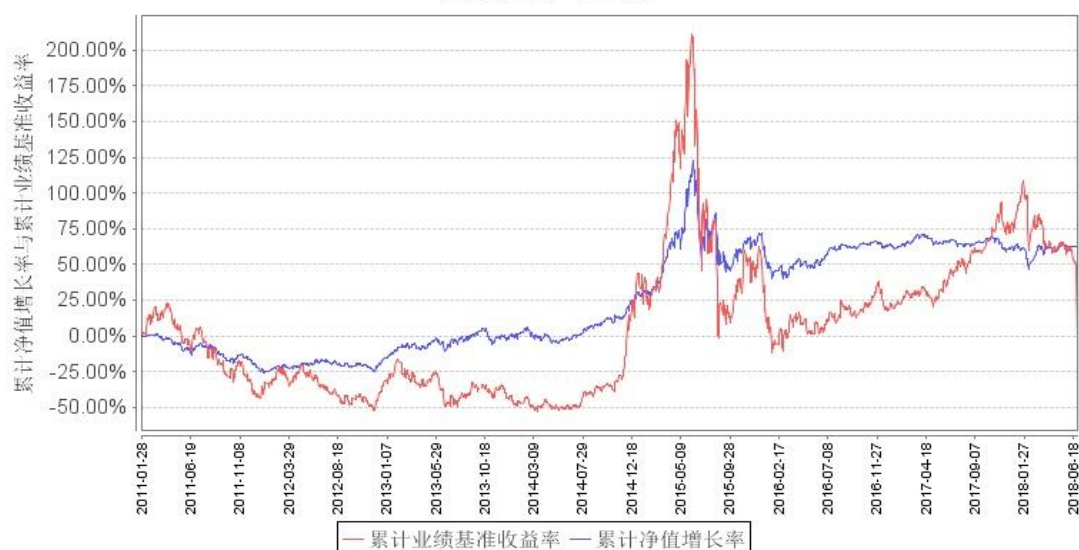
(二) 净值表现

1. 与同期业绩比较基准变动的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-38.73	0.31	-9.94	1.14	-28.79	-0.83

2. 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

光大阳光新兴产业集合资产管理计划累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



三、集合计划管理人报告

(一) 投资经理简介

沈吟 女士

英国拉夫堡大学金融管理硕士。现任上海光大证券资产管理有限公司多策略投资部副总经理，从 2009 年进入光大证券股份有限公司，曾任光大证券固定收益总部债券承销经理助理，金融市场总部投资经理。2014 年进入上海光大证券资产管理有限公司，担任绝对收益产品投资经理。

(二) 投资经理工作报告

2018 年二季度经济数据超预期回落，投资与净出口的回落拖累经济增长，一方面地方债与房地产的调控将推进投资增速的进一步下行，另一方面出口增速受累于全球复苏的下行以及贸易摩擦。固定资产投资、社融数据均不及预期，债券融资、非标融资均明显保持弱势。经济数据的超预期回落伴随着货币市场利率的回落。十年期国债收益率跌破 3.5%，而且仍处下行势头，人民币汇率跌破 6.6。企业盈利方面，上市公司业绩增速将放缓，将更注重内生增长和现金流管理。在经济数据超预期回落下，货币政策边际上有所放松，IPO 及 CDR 进程有所放缓。未来仍需持续关注中美贸易战带来的市场不确定性。

目前已投项目持续运作中，管理人将继续遴选优秀的固定收益型资产，力求为委托人提供长期持续的收益。

四、集合计划财务报告

(一) 集合计划会计报告

资产负债表（2018 年第二季度）

金额单位：元

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	16,296,212.51	12,904,476.37	短期借款	-	-
清算备付金	1,258,896.15	89,913.68	交易性金融负债	-	-
存出保证	58,477.18	24,416.68	衍生金融	-	-

金			融负债		
交易性金融资产	189,755,623.17	98,957,586.22	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	-	82,386,476.47	应付证券清算款	-	-
债券投资	-	-	应付赎回款	-	-
基金投资	189,755,623.17	16,571,109.75	应付管理人报酬	212,402.03	115,919.09
资产支持证券投资	-	-	应付托管费	44,250.40	24,149.81
理财投资	-	-	应付受托费	-	-
权证投资	-	-	应付销售服务费	-	-
衍生金融资产	-	-	应付投资顾问费	-	-
可供出售金融资产减值准备	-	-	应付交易费用	15,272.89	18,520.32
买入返售金融资产	34,000,000.00	-	应交税费	-	-
应收证券清算款	4,015,780.82	805,592.01	应付利息	-	-
应收利息	12,949.15	3,325.25	应付利润	-	-
应收股利	450,847.59	16,148.49	应付其他运营费用	-	-
应收申购款	4,520,000.00	-	其他负债	30,916.99	21,000.00
其他资产	-	-	负债合计	302,842.31	179,589.22
			所有者权益：		
			实收计划	257,774,073.51	72,166,218.52

			资本公 积	-	-
			未分配 利润	-7,708,129.25	40,455,650.96
			所有者 权益合 计	250,065,944.26	112,621,869.48
资产总计	250,368,786.57	112,801,458.70	负债及 所有者 权益总 计	250,368,786.57	112,801,458.70

利润表（2018 年第二季度）

金额单位：元

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	-8,677,213.75	-6,717,017.99
1、利息收入	245,367.01	272,278.23
其中：存款利息收入	44,391.24	71,302.46
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	200,975.77	200,975.77
2、投资收益（损失以“-”填列）	4,241,919.86	2,218,019.19
其中：股票投资收益	3,087,886.66	1,035,229.33
债券投资收益	-	-
基金投资收益	-207,328.47	-214,556.84
权证投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
理财产品投资收益	-	-
股利收益	1,361,361.67	1,397,346.70
基金红利收益	-	-
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-13,164,500.62	-9,207,315.41

4、汇兑损益（损失以“-”填列）	-	-
5、其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
二、费用	1,117,911.58	1,568,459.70
1、管理人报酬	406,950.55	721,458.30
2、托管费	84,781.36	150,303.81
3、销售服务费	-	-
4、运营服务费	-	-
5、投资顾问费	-	-
6、交易费用	614,218.75	673,314.06
7、财务费用	-	-
8、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
9、其他费用	11,960.92	23,383.53
三、利润总额	-9,795,125.33	-8,285,477.69
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	-9,795,125.33	-8,285,477.69

-

（二）投资组合报告

1、本报告期末计划资产组合情况

项目名称	金额（元）	占计划资产总值比例
股票	-	-
基金	189,755,623.17	75.79
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	34,000,000.00	13.58
银行存款和结算备付金合计	17,555,108.66	7.01
应收证券清算款	4,015,780.82	1.60

其他资产	5,042,273.92	2.01
总计	250,368,786.57	100.00

2、本报告期末按基金分类的基金投资组合

基金类别	市值(元)	占计划资产净值比例
封闭式基金	-	-
开放式基金	189,755,623.17	75.88
ETF 投资	-	-
合计	189,755,623.17	75.88

3、本报告期末按市值占计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

序号	证券代码	证券名称	数量(股)	市值(元)	市值占净值%
1	070088	嘉实货币 B	20,000,000.00	20,000,000.00	8.00
2	001930	华夏收益宝 B	20,000,000.00	20,000,000.00	8.00
3	003281	广发活期宝 B	20,000,000.00	20,000,000.00	8.00
4	519589	交银货币 B	20,000,000.00	20,000,000.00	8.00
5	001892	长盛新兴成长	12,691,667.78	13,948,142.89	5.58
6	260108	景顺长城新兴成长	10,536,129.99	13,781,258.03	5.51
7	000824	圆信永丰双红利 A	12,465,014.68	13,748,911.19	5.50
8	003940	银华盛世精选	11,135,811.35	12,927,563.40	5.17
9	004448	博时汇智回报	7,868,801.87	9,488,201.29	3.79
10	206007	鹏华消费优选	4,127,993.40	9,407,696.96	3.76

投资组合报告附注

- 1) 本集合计划本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。
- 2) 本集合计划投资的前十名股票中，没有投资于超出集合计划合同规定备选股票库之外的股票。
- 3) 集合计划其他资产的构成：

单位：元

存出保证金	58,477.18
应收利息	12,949.15
应收股利	450,847.59
应收申购款	4,520,000.00
信托投资	-
合计	5,042,273.92

五、集合计划份额变动情况

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
67,650,969.98	226,613,459.04	36,490,355.51	257,774,073.51

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）本集合计划聘请的会计师事务所没有发生变更。

（三）本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

（四）本集合计划管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有收到任何处罚。

七、备查文件目录

（一）中国证监会关于光大证券股份有限公司“光大阳光新兴产业集合资产管理计划”设立的批复

（二）“光大阳光新兴产业集合资产管理计划”验资报告，立信会师报字（2011）第 10310 号

（三）关于“光大阳光新兴产业集合资产管理计划”成立的公告

（四）“光大阳光新兴产业集合资产管理计划”计划说明书

（五）“光大阳光新兴产业集合资产管理计划”计划合同

（六） 管理人业务资格批件、营业执照

文件存放地点：上海市新闸路 1508 号静安国际广场 17 楼

网址：www.ebscn-am.com

信息披露电话：95525 转“2”

EMAIL：gdyg@ebscn.com

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人上海光大证券资产管理有限公司。

上海光大证券资产管理有限公司

2018 年 06 月 30 日