

光大阳光新兴产业集合资产管理计划  
资产管理报告  
2018 年第 3 季报

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 07 月 01 日至 2018 年 09 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	1284966952.60 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	456,110,006.50 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07月01日-2018年09月30日)
1. 本期已实现收益	997,457.84
2. 本期利润	-9,207,630.08
3. 期末资产净值	426,703,554.01
4. 期末份额净值	0.9355

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。

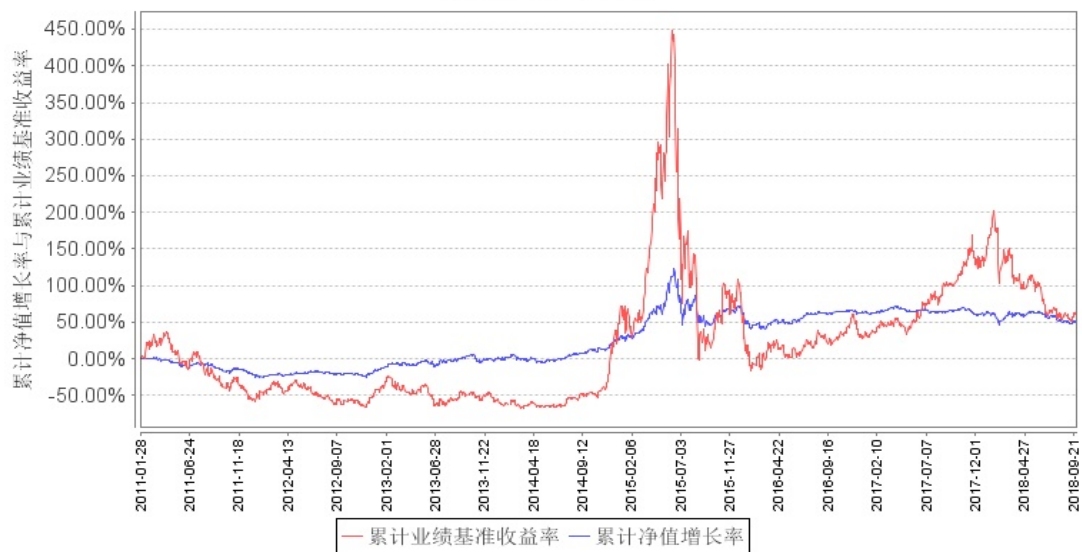
### (二) 净值表现

#### 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	-3.57	0.62	-2.05	1.35	-1.52	-0.73

#### 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 年三季度国内经济整体承压，景气度缓慢下行，供需两弱，社融增速持续下降，短期通胀压力上升。展望四季度，维持年内经济稳中放缓的判断，一方面经济下行压力仍然较大，中美贸易争端深化，加征关税的影响面扩大，对经济的实质影响将逐渐显现，叠加全球经济增长放缓，四季度出口下行压力有所加大；与此同时内需仍较疲弱，消费和固定资产投资的低迷态势难有大幅改观，虽然政策微调释放积极信号，货币趋于边际宽松，积极财政加码，有望带来缓解下行压力的边际变化，但其效果显现仍需时日，且受外部扰动及内部债务风险、高杠杆等制约，政策为预调微调，并非全面强刺激，难以逆转下行趋势。另一方面，我国在防范内外部重大风险方面稳扎稳打，经济承压能力增强，增长存在较强韧性，经济大幅下滑甚至爆发经济危机的风险较小。

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 年第三季度）

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	9,139,835.18	12,904,476.37	短期借款	-	-
清算备付金	1,687,826.09	89,913.68	交易性金融负债	-	-
存出保证金	45,263.07	24,416.68	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	324,763,104.27	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	1,885,479.45	-
债券投资	-	-	应付赎回款	5,099,235.26	-
基金投资	324,763,104.27	16,571,109.75	应付管理人报酬	367,756.80	115,919.09
资产支持证券投资	-	-	应付托管费	75,188.68	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	-	-	应付交	-	18,520.32

融资产减值准备			易费用		
买入返售金融资产	97,000,000.00	-	应交税费	-	-
应收证券清算款	-	805,592.01	应付利息	-	-
应收利息	-76,704.67	3,325.25	应付利润	-	-
应收股利	1,312,472.22	16,148.49	应付其他运营费用	-	-
应收申购款	300,000.00	-	其他负债	40,581.96	21,000.00
其他资产	-	-	负债合计	7,468,242.15	179,589.22
			所有者权益：		
			实收计划	456,110,006.50	72,166,218.52
			资本公积	-	-
			未分配利润	-29,406,452.49	40,455,650.96
			所有者权益合计	426,703,554.01	112,621,869.48
<b>资产总计</b>	<b>434,171,796.16</b>	<b>112,801,458.70</b>	<b>负债及所有者权益总计</b>	<b>434,171,796.16</b>	<b>112,801,458.70</b>

### 利润表（2018 年第三季度）

金额单位：元

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	-7,992,761.30	-14,709,779.29
1、利息收入	222,208.90	494,487.13
其中：存款利息收入	38,945.49	110,247.95
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	183,263.41	384,239.18

2、投资收益（损失以“-”填列）	1,990,117.72	4,208,136.91
其中：股票投资收益	-	1,035,229.33
债券投资收益	-	-
基金投资收益	-	-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	1,990,117.72	3,387,464.42
基金红利收益	-	-
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,205,087.92	-19,412,403.33
4、汇兑损益（损失以“-”填列）	-	-
5、其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
二、费用	1,214,868.78	2,783,328.48
1、管理人报酬	978,255.71	1,699,714.01
2、托管费	203,803.26	354,107.07
3、销售服务费	-	-
4、运营服务费	-	-
5、投资顾问费	-	-
6、交易费用	20,955.13	694,269.19
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	11,854.68	35,238.21
三、利润总额	-9,207,630.08	-17,493,107.77
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	-9,207,630.08	-17,493,107.77

## (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	324,763,104.27	74.80
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	97,000,000.00	22.34
银行存款和结算备付金合计	10,827,661.27	2.49
应收证券清算款	-	-
其他资产	1,581,030.62	0.36
总计	434,171,796.16	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	324,763,104.27	76.11
ETF 投资	-	-
合计	324,763,104.27	76.11

-

### 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	30,000,000.00	30,000,000.00	7.03
2	001930	华夏收益宝 B	30,000,000.00	30,000,000.00	7.03
3	003871	华泰柏瑞天添宝货币 B	30,000,000.00	30,000,000.00	7.03
4	003281	广发活期宝 B	30,000,000.00	30,000,000.00	7.03
5	210013	金鹰货币 B	30,000,000.00	30,000,000.00	7.03
6	519589	交银货币 B	20,000,000.00	20,000,000.00	4.69
7	001725	汇添富中国高端制造股票	11,007,642.60	13,957,690.82	3.27
8	001892	长盛新兴成长	12,691,667.78	13,808,534.54	3.24



9	000824	圆信永丰双红利 A	12,465,014.68	13,225,380.58	3.10
10	260108	景顺长城新兴成长	10,536,129.99	12,864,614.72	3.01

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	45,263.07
应收利息	-76,704.67
应收股利	1,312,472.22
应收申购款	300,000.00
信托投资	-
合计	1,581,030.62

## 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）
257,774,073.51	389,854,865.00	191,518,932.01	456,110,006.50

## 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：上海市新闻路 1508 号静安国际广场 17 楼

网址：[www.ebscn-am.com](http://www.ebscn-am.com)

信息披露电话：95525 转“2”

EMAIL：[gdyg@ebscn.com](mailto: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 09 月 30 日