

光大阳光内需动力集合资产管理计划
资产管理报告
2019 年第 2 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：中国光大银行股份有限公司

报告期间：2019 年 04 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日

重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券公司大集合资产管理业务适用 操作指引》及其他有关规定制作。

中国证监会 2010 年 07 月 08 日对本集合计划出具了批准文件(证监机构字[2010]931 号文《关于核准光大证券有限公司设立光大阳光内需动力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。 管理人保证本报告中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告中书中的内容由管理人负责解释。

本报告中的金额单位除特制外均为人民币元。

一、集合计划简介

计划名称	光大阳光内需动力集合资产管理计划
计划交易代码	860007
计划产品类型	混合型
计划合同生效日	2010-09-27
成立规模	1,272,943,568.12 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	80,703,342.77 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	中国光大银行股份有限公司

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 (2019年04月01日-2019年06月30日)
1. 本期已实现收益	4, 538, 877. 77
2. 本期利润	-2, 556, 203. 81
3. 期末资产净值	138, 386, 718. 40
4. 期末份额净值	1. 7148

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	-1.70	1.18	-3.62	1.37	1.92	-0.19

三、集合计划管理人报告**(一) 投资经理简介**

王海涛

北京师范大学经济学硕士, 逾 14 年证券投资与研究经验。历任华泰证券研究员、太平资产管理有限公司高级投资经理、平安信托有限公司高级投资经理、上海人寿保险股份有限公司权益投资部负责人、华宝证券股份有限公司投资管理部总经理。擅长价值投资, 对 A 股市场和港股市场有深入研究。2009 年从事权益账户投资管理以来, 除 2011 年和 2018 年外, 账户投资均取得正收益。2019 年 5 月加入上海光大证券资产管理有限公司, 拟任权益投资部部门负责人。

(二) 投资经理工作报告

二季度国内经济继续震荡寻底, 消费、投资、出口三驾马车均显乏力。美国经济也显露疲态, 欧洲经济更是持续低迷。A 股市场经历了一季度的大幅上涨后, 上冲乏力, 二季度呈

现出震荡盘整走势。二季度消费行业、金融行业表现较好，电子、通信行业表现最差。

二季度集合计划跑赢基准，二季度我们对持仓行业和品种做出了较大幅度的调整，对公用事业、机械、医药等行业进行了减持，增持了地产、汽车、建筑、金融等行业。截至二季度末，我们的仓位维持在 80%左右。

A 股市场在过去一年半时间中，陆续经历了经济下滑、贸易战、去杠杆等外在冲击的洗礼，展现出了较强的韧性。目前市场表面上仍然较为低迷，实际已经发生了较为明显的变化。过去三年中，优质蓝筹股大幅跑赢了题材股、垃圾股，整个市场的定价变得更为有效合理。经历了三年的大幅上涨，诸多蓝筹股股价均创出了历史新高，市场又一次出现了局部的泡沫。市场总是在不同风格间变换，但我们对于企业价值的投资挖掘是一以贯之的，我们坚信 A 股市场将会继续进化，逐渐与国际接轨，将会诞生一批又一批的优质上市公司，我们将坚持价值投资风格，与优秀企业一起成长。

四、集合计划财务报告

（一）集合计划会计报告

资产负债表（2019 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	11,039,068.70	9,338,026.96	短期借款	-	-
清算备付金	91,507.53	40,305.54	交易性金融负债	-	-
存出保证金	54,586.51	48,198.72	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	104,577,220.48	122,693,760.10	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	104,577,220.48	122,693,760.10	应付证券清算款	10,243,440.10	133,307.91
债券投资	-	-	应付赎回款	-	-
基金投资	-	-	应付管理人报	135,788.98	268,189.00

			酬		
资产支持证 券投资	-	-	应付托 管费	22,631.49	22,634.81
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	456,629.43	236,248.58
买入返售 金融资产	30,000,000.00	-	应交税 费	227,522.41	-
应收证券 清算款	3,711,329.61	-	应付利 息	-	-
应收利息	8,934.97	3,412.89	应付利 润	-	-
应收股利	-	-	应付其 他运营 费用	-	-
应收申购 款	-	-	其他负 债	9,916.99	20,000.00
其他资产	-	-	负债合 计	11,095,929.40	680,380.30
			所有者 权益：		
			实收计 划	80,703,342.77	89,261,253.59
			资本公 积	-	-
			未分配 利润	57,683,375.63	42,182,070.32
			所有者 权益合 计	138,386,718.40	131,443,323.91
资产总计	149,482,647.80	132,123,704.21	负债及 所有者 权益总 计	149,482,647.80	132,123,704.21

利润表（2019 年第二季度）

金额单位：元

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	-1,811,917.67	22,757,926.99
1、利息收入	92,475.81	147,255.28
其中：存款利息收入	84,058.70	138,009.25
债券利息收入	1,543.82	2,372.74
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,873.29	6,873.29
2、投资收益（损失以“-”填列）	5,211,026.20	9,463,686.37
其中：股票投资收益	4,151,722.16	8,404,382.33
债券投资收益	-122,384.38	-122,384.38
基金投资收益	-	-
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	1,181,688.42	1,181,688.42
基金红利收益	-	-
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-7,115,419.68	13,146,985.34
4、汇兑损益（损失以“-”填列）	-	-
5、其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
二、费用	744,286.14	1,447,032.90
1、管理人报酬	427,655.32	837,429.24
2、托管费	71,275.94	139,571.59
3、销售服务费	-	-
4、运营服务费	-	-

5、投资顾问费	-	-
6、交易费用	250,547.96	417,753.64
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	-5,193.08	52,278.43
三、利润总额	-2,556,203.81	21,310,894.09
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	-2,556,203.81	21,310,894.09

-

(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	104,577,220.48	69.96
基金	-	-
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	30,000,000.00	20.07
银行存款和结算备付金合计	11,130,576.23	7.45
应收证券清算款	3,711,329.61	2.53
其他资产	63,521.48	
总计	149,482,647.80	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	-	-
ETF 投资	-	-
合计	-	-

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	600529	山东药玻	450,000.00	10,251,000.00	7.41
2	601799	星宇股份	100,000.00	7,896,000.00	5.71
3	300144	宋城演艺	259,854.00	6,013,021.56	4.35
4	600566	济川药业	150,000.00	4,516,500.00	3.26
5	600741	华域汽车	180,000.00	3,888,000.00	2.81
6	000002	万科A	132,800.00	3,693,168.00	2.67
7	601166	兴业银行	200,000.00	3,658,000.00	2.64
8	002304	洋河股份	30,000.00	3,646,800.00	2.64
9	000895	双汇发展	140,000.00	3,484,600.00	2.52
10	600887	伊利股份	100,000.00	3,341,000.00	2.41

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	54,586.51
应收利息	8,934.97
应收股利	-
应收申购款	-
信托投资	-
合计	63,521.48

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)
86,528,400.79	-	5,825,058.02	80,703,342.77

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“光大阳光内需动力集合资产管理计划”设立的批复
- (二) “光大阳光内需动力集合资产管理计划”验资报告，立信会计师报字（2010）第 11949 号
- (三) 关于“光大阳光内需动力集合资产管理计划”成立的公告
- (四) “光大阳光内需动力集合资产管理计划”计划说明书
- (五) “光大阳光内需动力集合资产管理计划”托管协议
- (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

2019 年 07 月 22 日