

光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产
管理计划
资产管理报告
2019 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：中国光大银行股份有限公司

报告期间：2019 年 07 月 01 日至 2019 年 09 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 2009 年 5 月 31 日对本集合计划出具了批准文件（证监许可 [2009]448 号文《关于核准光大证券股份有限公司设立光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划的批复》），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	光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划
计划交易代码	860022
计划产品类型	-
计划合同生效日	2009-07-28
成立规模	6,757,438,551.16 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	661,056,209.55 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07月01日-2019年09月30日）
1. 本期已实现收益	30,213,710.29
2. 本期利润	81,023,704.41
3. 期末资产净值	1,049,861,040.25
4. 期末份额净值	1.5882

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	8.17	0.63	2.09	0.39	6.08	0.24

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，光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划的投资经理。

（二）投资经理工作报告

2019 年三季度 7 月 A 股市场面临 中美贸易谈判的反复、金融供给侧改革阶段性带来的信用紧缩、房地产政策高压等，这在一定程度上短期压制了市场上涨空间。8 月中旬中报季过后，LPR 推动的利率市场化改革，外资持续流入 A 股市场，QFII 投资额度取消，叠加中美贸易边际缓和因素等大大提升市场风险偏好，上证综指从 2733 点逐渐上涨至 3000 点之上，其中创业板和中小板涨幅好于主板。从行业来看，中信 21 个行业收涨，其中电子元器件、国防军工和计算机等行业市场表现较好，分别收涨 27.34%、18.87%和 15.71%，钢铁、商贸零售和石油石化等行业市场表现较差，分别收跌 4.61%、2.56%和 2.19%。

展望四季度，中美贸易谈判取得初步的阶段成果，权益市场风险偏好提升，公布的 9 月经济数据和社融数据将验证三季度经济下滑幅度是否在预期内，在货币中性的政策环境下，基本面仍然是主导股市的核心变量，预计国内经济仍然是宏观下滑微观企稳。整体来看，多国降息、LPR 改革的“内外双击”下流动性将持续改善，企业中长贷、中低评级信用债融资有望持续改善，流动性宽松和风险偏好提升将助力四季度市场行情更进一步。

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	33,593,029.68	6,701,566.08	短期借款	-	-
清算备付金	3,113,432.89	10,821,408.17	交易性金融负债	-	-
存出保证金	310,111.30	622,227.51	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	821,511,298.28	740,294,060.87	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股	175,359,030.93	132,229,849.53	应付证	30,824,587.96	5,000,000.00

票投资			券清算款		
债券投资	37,664,573.70	73,911,004.94	应付赎回款	-	-
基金投资	608,487,693.65	534,153,206.40	应付管理人报酬	1,313,128.78	2,372,815.03
资产支持证券投资	-	-	应付托管费	175,083.84	158,990.20
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	574,347.51	2,171,601.51
买入返售金融资产	210,000,000.00	164,930,799.90	应交税费	939,626.35	548.31
应收证券清算款	14,242,843.23	-	应付利息	-	-
应收利息	-7,297.56	1,125,306.62	应付利润	-	-
应收股利	939,354.54	924,587.33	应付其他运营费用	-	-
应收申购款	-	-	其他负债	14,957.67	50,000.00
其他资产	-	-	负债合计	33,841,732.11	9,753,955.05
			所有者权益：		
			实收计划	661,056,209.55	721,895,435.48
			资本公积	-	-
			未分配利润	388,804,830.70	193,770,565.95
			所有者权益合	1,049,861,040.25	915,666,001.43

			计		
资产总计	1,083,702,772.36	925,419,956.48	负债及 所有者 权益总 计	1,083,702,772.36	925,419,956.48

利润表（2019 年第三季度）

金额单位：元、%

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	86,694,183.46	242,184,489.11
1、利息收入	645,913.39	2,512,268.27
其中：存款利息收入	281,126.34	679,449.05
债券利息收入	121,118.04	1,090,972.66
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	243,669.01	741,846.56
2、投资收益（损失以“-”填列）	35,155,687.56	51,128,776.68
其中：股票投资收益	21,303,197.20	35,269,672.49
债券投资收益	-362,840.11	7,327,729.83
基金投资收益	5,637,623.06	-4,106,651.77
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	8,577,707.41	12,638,026.13
基金红利收益	-	-
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	50,892,582.51	188,543,444.16
4、汇兑损益（损失以“-”填列）	-	-
5、其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
二、费用	5,670,479.05	16,618,618.78
1、管理人报酬	3,888,834.86	11,363,759.38

2、托管费	518,511.31	1,515,167.91
3、销售服务费	-	-
4、运营服务费	-	-
5、投资顾问费	-	-
6、交易费用	1,147,869.81	3,473,007.58
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	115,263.07	266,683.91
三、利润总额	81,023,704.41	225,565,870.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	81,023,704.41	225,565,870.33

（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	175,359,030.93	16.18
基金	608,487,693.65	56.15
债券	37,664,573.70	3.48
权证	-	-
资产支持证券	-	-
买入返售金融资产	210,000,000.00	19.38
银行存款和结算备付金合计	36,706,462.57	3.39
应收证券清算款	14,242,843.23	1.31
其他资产	1,242,168.28	0.11
总计	1,083,702,772.36	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	608,487,693.65	57.96
ETF 投资	-	-
合计	608,487,693.65	57.96

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	001811	中欧明睿新常态	45,706,202.60	63,394,503.01	6.04
2	001071	华安媒体互联网混合	30,000,000.00	52,530,000.00	5.00
3	519712	交银阿尔法核心混合	20,545,126.20	48,774,129.60	4.65
4	206009	鹏华新兴产业	15,591,995.84	35,471,790.54	3.38
5	003095	中欧医疗健康混合 A	21,397,312.86	34,813,428.02	3.32
6	570005	诺德成长优势混合	17,009,193.65	33,576,148.27	3.20
7	002207	前海开源金银珠宝混合 C	31,635,808.30	30,781,641.48	2.93
8	690007	民生加银景气行业股票	9,876,049.38	29,410,875.05	2.80
9	100038	富国沪深 300 指数增强	17,953,807.92	28,977,445.98	2.76
10	210001	金鹰成分股优选	31,044,331.31	27,511,486.41	2.62

4、报告期末本计划投资的股指期货交易情况

代码	名称	持仓量 ¹ (买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					-
股指期货投资本期公允价值变动					-

5、本计划投资股指期货的投资政策2

-

6、报告期末本集合计划投资国债期货交易情况

代码	名称	持仓量 ³ （买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-
国债期货投资本期收益					-
国债期货投资本期公允价值变动					-

-

7、本期国债期货的投资政策4

-

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	310,111.30
应收利息	-7,297.56
应收股利	939,354.54

¹ 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

² 写股指期货投资政策，揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

³ 填写国债期货投资政策，揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

应收申购款	-
信托投资	-
合计	1,242,168.28

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）
687,311,967.97	201,731.12	26,457,489.54	661,056,209.55

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“光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划”设立的批复

（二）关于“光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划”成立的公告

（三）光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划说明书

（四）光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划资产管理合同

（五）管理人业务资格批复件、营业执照

（六）“光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产管理计划”验资报告

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

信息披露电话：95525 转“2”

EMAIL：gd yg@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。

2019 年 10 月 22 日