

长江证券超越理财灵活配置集合资产管理计划  
2021年第二季度资产管理报告

管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

托管人：交通银行股份有限公司

报告期间：2021年4月1日—2021年6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》（以下简称“《指导意见》”）及其他有关规定编制。

管理人保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同的约定，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。

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。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划的合同、风险揭示书等相关法律文件，了解所投资产品的风险收益特征，选择适合自己的产品。

本报告中财务资料未经审计。

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。

本报告期起止时间：2021 年 4 月 1 日—2021 年 6 月 30 日

## 一、集合计划简介

### （一）基本资料

名称：长江证券超越理财灵活配置集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2009 年 8 月 5 日

成立份额：1,508,951,084.39 份

报告期末总份额：1,577,599,880.71 份

存续期：2009 年 8 月 5 日-无固定存续期限

### （二）集合计划管理人

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 1198 号世纪汇一座 27 层

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

法定代表人：周纯

联系电话：4001-166-866

### （三）集合计划托管人

名称：交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

联系电话：95559

## 二、主要财务指标和净值表现

### （一）主要财务指标和净值表现

单位：人民币元

	主要财务指标和净值表现	2021 年 6 月 30 日
1	期初份额净值	1.0801
2	期末份额净值	1.0381
3	期末份额累计净值	1.4073
4	期末资产净值	1,637,699,237.63
5	本期利润	14,211,904.38
6	期末未分配利润	60,099,356.92
7	期末未分配份额利润	0.0381
8	本期份额净值增长率	0.76%
9	份额累计净值增长率	40.73%

## (二) 财务指标的计算公式

- 1、期末份额净值=期末资产净值/报告期末总份额
- 2、期末份额累计资产净值=期末份额资产净值+份额已分红收益
- 3、本期份额净值增长率=(分红前一天单位净值/期初单位净值)\*{期末单位净值/(分红前一天单位净值-单位分红金额)}-1
- 4、份额累计净值增长率=(期末份额累计净值-1)×100%

## 三、管理人履职报告

## (一) 集合计划投资表现

截止 2021 年 6 月 30 日, 本集合计划份额净值为 1.0381 元, 本期份额净值增长率为 0.76%, 期末份额累计净值 1.4073 元, 份额累计净值增长率为 40.73%。

## (二) 本报告期集合计划投资收益分配情况

序号	收益分配基准日	权益登记日	分红方式	分红方案
1	2021-5-17	2021-5-18	现金红利/ 红利再投资	每 10 份集合计划 A 类份额派发红利人民币 0.500 元; 每 10 份集合计划 B 类份额派发红利人民币 0.500 元。

## (三) 投资经理简介

姓名	任本集合计划的投资经理期限		说明
	任职日期	离任日期	
张帆	2019-5-10	-	香港理工大学精算学硕士。曾任汉口银行金融同业部华北团队负责人, 从事债券及非标资产的投资管理工作, 长江证券(上海)资产管理有限公司投资经理助理。现任长江证券(上海)资产管理有限公司投资经理。

## (四) 投资经理工作报告

国内债券市场上半年主要焦点在货币, 大致可分为三个阶段: 第一阶段是自社融去年 11 月顶部及永煤事件之后央行释放流动性呵护市场带来的下行, 至春节前央行公开市场投放不及预期而被打破, 引燃市场对国内货币政策收紧的预期。第二阶段下跌持续至春节后 2 月下旬, 央行公开市场稳定投放维持资金面宽松同时一季度利率债供给较少, 信用利差低位徘徊, 一二级利率债绝对位置性价比吸引第一阶段踏空资金陆续进场, 在此期间, 尽管通胀预期仍有扰动但政策面持续

对大宗商品价格的调控以及对通胀暂时性的定调稳定了市场对货币政策节奏的预期，并未破坏利率持续下行的通道。第三阶段，5 月底随着美联储二季度回收流动性的试探动作及季末流动性预期引发市场再次担忧，债市 6 月中上旬略有回调，但短期货币依然宽松及经济数据低于预期，市场收益率在中期利空的压制下谨慎下行。

#### （五）管理人内部声明

##### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《指导意见》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，争取为份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害份额持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

##### 2、内部监察报告

本报告期内，管理人负责稽核监察的相关部门依照管理人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。

#### （六）公平交易专项说明

##### 1、公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

##### 2、异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划与管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 四、托管人履职报告

托管人履职报告详见《托管报告》。

## 五、财务会计报告（未经审计）

(一) 资产负债表 (报告截止日: 2021 年 6 月 30 日)

单位: 人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
<b>资 产:</b>		<b>负 债:</b>	
银行存款	73,027,075.95	短期借款	0.00
结算备付金	40,941,741.61	交易性金融负债	0.00
存出保证金	635.16	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	1,010,866,579.03	卖出回购金融资产款	0.00
其中: 股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	1,010,866,579.03	应付赎回款	17,092,128.49
基金投资	0.00	应付管理人报酬	4,329,885.21
权证投资	0.00	应付托管费	122,453.64
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融资产	0.00	应付交易费用	3,325.05
买入返售金融资产	450,000,000.00	应交税费	86,109.86
应收证券清算款	50,098,684.94	应付利息	0.00
应收利息	28,759,203.19	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	0.00
应收申购款	5,639,220.00	<b>负债合计</b>	21,633,902.25
其他资产	0.00		
		<b>所有者权益:</b>	
		实收基金	1,577,599,880.71
		未分配利润	60,099,356.92
		所有者权益合计	1,637,699,237.63
<b>资产合计</b>	1,659,333,139.88	<b>负债和所有者权益总计</b>	1,659,333,139.88

(二) 利润表 (2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日)

单位: 人民币元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	15,823,538.88	40,632,899.50
1、利息收入	16,113,933.50	40,440,534.01
其中: 存款利息收入	213,580.17	339,382.86
债券利息收入	12,729,342.64	34,285,808.37
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	3,171,010.69	5,815,342.78
2、投资收益	-290,394.62	192,365.49
其中: 股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	-290,394.62	207,294.69
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	0.00	0.00
个股期权收益	0.00	0.00
差价收入增值税抵减	0.00	-14,929.20
3、公允价值变动收益	0.00	0.00
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	1,611,634.50	3,641,949.85
1、管理人报酬	1,184,521.96	2,547,712.53
2、托管费	379,047.04	815,268.00
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	30.00	30.00
5、利息支出	1,535.44	153,542.82
其中：卖出回购金融资产支出	1,535.44	153,542.82
6、其他费用	9,060.00	18,360.00
7、增值税金及附加	37,440.06	107,036.50
三、利润总和	14,211,904.38	36,990,949.65

## 六、投资组合报告

(一) 期末集合计划资产组合情况 (报告截止日: 2021 年 6 月 30 日)

单位: 人民币元

项目	期末金额	占期末总资产比例
银行存款	73,027,075.95	4.40%
清算备付金	40,941,741.61	2.47%
存出保证金	635.16	0.00%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	1,010,866,579.03	60.92%
资产支持证券投资	0.00	0.00%
基金投资	0.00	0.00%
资产管理产品投资	0.00	0.00%
买入返售金融资产	450,000,000.00	27.12%
其他资产	84,497,108.13	5.09%
资产合计	1,659,333,139.88	100.00%

注: (1) 其他资产包括“应收股利”、“应收利息”、“应收证券清算款”和“其他应收款”等项目; (2)

由于四舍五入的原因, 期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

(二) 期末按摊余成本占计划资产净值比例大小排序的前五名债券明细

证券代码	证券名称	数量(张)	摊余成本(元)	占计划资产净值比例
200215	20 国开 15	700,000.00	70,711,384.83	4.32%
101800349	18 张家公资 MTN001	700,000.00	70,003,984.18	4.27%
101901296	19 渝经开 MTN001	600,000.00	60,001,012.32	3.66%
101800353	18 华闻传媒 MTN001	560,000.00	56,001,307.17	3.42%
101901546	19 江宁科学 MTN002	500,000.00	50,002,969.89	3.05%

(三) 资产管理计划运用杠杆情况

截至本报告期末,本集合计划从事交易所市场和银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元。

## 七、期末关联方持有集合计划情况

单位:份

项目	持有份额总数	占总份额比例
管理人董事、监事、从业人员及其配偶	1,525,430.11	0.10%
管理人控股股东、实际控制人或者其他关联方	168,370,150.94	10.67%

## 八、集合计划份额变动的情况

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
1,747,633,489.07	599,105,548.82	769,139,157.18	1,577,599,880.71

## 九、重要事项提示

(一) 涉及管理人、资产管理计划财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,未发生涉及对管理人运营管理及本集合计划运作产生重大影响的,与本集合计划管理人、委托财产、托管业务相关的重大诉讼事项。

(二) 投资策略的改变

本报告期内,本集合计划投资策略未发生重大改变。

(三) 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本集合计划的管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何处罚。

(四) 管理人、托管人的专门托管部门的重大人事变动

1、本报告期内,自 2021 年 4 月 20 日起杨忠先生担任本集合计划管理人总经理,唐吟波女



士离任本集合计划管理人总经理。

2、本报告期内，本集合计划的托管人未发生重大人事变动。

（五）投资经理的变更

本报告期内，本集合计划未发生投资经理变更。

（六）关联交易

1、资产管理计划参与关联方证券的情况

本报告期内，本集合计划资产未投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。

2、一般关联交易和重大关联交易

本报告期内，本集合计划未发生重大关联交易或一般关联交易。

（七）利益冲突

本报告期内，本集合计划的投资运作不存在可能发生利益冲突的情况。

（八）其他重大事项

本报告期内，本集合计划未发生涉及投资者权益的其他重大事项。

## 十、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、《长江证券超越理财灵活配置集合资产管理计划资产管理合同》等法律文件
- 2、管理人业务资格批件、营业执照
- 3、本报告期内按规定披露的各项公告

（二）存放地点及查阅方式

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.cjzcg1.com

客服电话：4001-166-866

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。

长江证券（上海）资产管理有限公司

二〇二一年七月二十一日