

# 大通星海大现金集合资产管理计划

## 2017 年四季度资产管理报告

### 一、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》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及其他有关规定制作。

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。本报告未经审计。

管理人、托管人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。本报告期起止时间：2017年10月1日-2017年12月31日

### 二、集合计划产品概况

集合计划名称	大通星海大现金集合资产管理计划
集合计划类型	限定性集合资产管理计划
报告期末集合计划份额	120,707,000.00
业绩比较基准	当期活期储蓄存款利率（目前为 0.35%/年）
集合计划管理人	大通证券股份有限公司
集合计划托管人	中国证券登记结算有限责任公司

### 三、主要财务指标

单位：人民币元

集合计划本期净收益	1,428,914.28
期末集合计划资产净值	120,707,000.00
预估年化收益率	3.2915%

## 四、投资主办报告

### 1、集合计划主办简介

幸莉，东北财经大学国民经济学硕士。多年研究与投资业务经历，具有证券从业资格。历任大通证券资产管理总部研究员，大通证券资产管理总部投资经理。擅长宏观研究与分析，熟悉固定收益市场，追求稳定回报，多年固定收益市场投资经历形成了成熟、稳健的投资风格。

### 2、报告期内投资策略

2017年4季度，生产方面，受冬季限产以及高基数影响，虽然12月PMI小幅回落，全年PMI仍在51%以上，处于扩张区间。消费总体平稳，汽车、地产消费成为拖累消费增速的重要因素。地产、制造业、基建投资增速均回落，固定资产投资增速迅速回落。受全球经济回暖影响，出口成为拉动经济的亮点。我国经济正处于经济动能转换期，原有经济动能在供给侧改革、金融去杠杆政策下有所弱化，而以信息技术、软件、商务服务为代表的新动能正逐步呈现出新的增长方向。在2018年新动能的提升尚不能完全弥补原有经济动能的回落的前提下，预计2018年全年GDP增速将有所回落。

从中央经济工作会议的定调来看，要实现我国经济由“高速增长阶段”向“高质量发展阶段”转变，达成提质增效的目标将允许经济增速出现一定程度下行。2017年金融去杠杆成果显著，审慎监管依旧是2018年主导流动性的核心要素，预计力度在边际上将有所减弱。

在投资策略上，管理人将优化现金类资产在期限与金额上的配置，在保证开放日产品流动性的前提下，获得超额收益。

本集合计划于2017年12月25日进行了第二十次收益分配。

## 五、投资组合报告

### （一）集合计划会计报告

#### 1、集合计划资产负债表（2017年12月31日）

单位：元

资 产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
-----	------	----------	------

资产：		负债：	
银行存款	110,848,093.31	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产	10,000,000	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	31,397.91
基金投资	10,000,000	应付托管费	46,103.57
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	1,814,140.19	应付利息	
应收股利	118,506.20	应付利润	79,560.32
应收申购款		其他负债	1,916,677.90
其他资产		负债合计	2,073,739.70
		所有者权益：	
		实收基金	120,707,000
		未分配利润	
		所有者权益合计	120,707,000
资产合计：	122,780,739.70	负债与持有人权益总计：	122,780,739.70

## 2、集合计划经营业绩表（2017年10月1日-2017年12月31日）

单位：元

项目	本期金额	本年累计金额
一、收入	1,758,473.36	7,687,930.14
1、利息收入	1,656,491.26	7,569,423.94
其中：存款利息收入	1,656,491.26	7,569,423.94
债券利息收入	0.00	
资产支持证券利息收入	0.00	
买入返售金融资产收入	0.00	
2、投资收益（损失以“-”填列）	101,982.10	118,506.20
其中：股票投资收益	0.00	

债券投资收益	0.00	
资产支持证券投资收益	0.00	
基金投资收益	0.00	
权证投资收益	0.00	
衍生工具收益	0.00	
股利收益	101,982.10	118,506.20
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	0.00	
4、其他收入（损失以“-”填列）	0.00	
二、费用	329,559.08	1,573,647.91
1、管理人报酬	296,383.77	1,416,256.69
2、托管费	21,170.21	101,161.03
3、销售服务费	0.00	
4、交易费用	0.00	
5、利息支出	0.00	
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	
6、其他费用	12,005.10	56,230.19
三、利润总额	1,428,914.28	6,114,282.23

## （二）资产组合报告

项目	期末金额（元）	占集合计划总资产比例（%）
银行存款（估值表）	110,848,093.31	90.28%
其中：活期存款	848,093.31	0.69%
定期存款	110,000,000.00	89.59%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
基金	10,000,000.00	8.14%
其他（应收利息等）	1,932,646.39	1.57%
资产总值	122,780,739.70	100.00%

附注：1、表中其他项是指应收利息；2、因四舍五入，占总资产比例分项与合计项存在尾差。

## （三）投资组合报告附注

本集合计划投资的品种全部为银行存款和交易所债券逆回购，没有投资于超出集合计划合同规定之外的品种。

## 六、集合计划份额变动

单位：份

报告期初集合计划份额总额	142,280,000.00
报告期内集合计划申购份额	892,019,000.00
报告期内集合计划赎回份额	913,592,000.00
报告期末集合计划份额总额	120,707,000.00

## 七、备查文件目录

### （一）备查文件目录

- 1、《大通星海大现金集合资产管理合同》
- 2、《大通星海大现金集合资产管理计划说明书》
- 3、集合计划管理人业务资格批件、营业执照

### （二）存放地点及查阅方式

查阅地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号，大连期货大厦3811室

公司网址：[www.estock.com.cn](http://www.estock.com.cn)

客服热线：4008-169-169

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人大通证券股份有限公司。

大通证券股份有限公司

二〇一八年一月三日