

旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划 2013 年第一季度资产管理报告

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。

中国证监会对东莞证券旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具批准文件（文号：证监许可〔2010〕717 号），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。

托管人已于 2013 年 4 月 10 日复核了本报告。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：2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 3 月 31 日

一、集合计划简介

名称： 旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划

类型： 非限定性集合计划

管理人： 东莞证券有限责任公司

托管人： 中国工商银行股份有限公司广东省分行

成立日： 2010 年 08 月 10 日

成立规模： 329,474,467.18 份

存续期： 5 年

二、主要财务指标

（一）主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2013 年 1 月 1 日-2013 年 3 月 31 日
1	集合计划本期利润	-367,310.18
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-1,544,874.37
3	单位集合计划净收益	-0.0090
4	期末集合计划资产净值	104,953,372.68
5	单位集合计划资产净值	0.6081
6	本期集合计划净值增长率	-0.39%
7	集合计划累计净值增长率	-39.19%

（二）财务指标的计算公式

- 1、单位集合计划净收益 = 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 ÷ 集合计划份额
- 2、单位集合计划净值 = 集合计划净值 ÷ 集合计划份额
- 3、本期集合计划净值增长率 = [期末单位净值 / (分红除权前单位净值 - 单位分红金额) * 分红除权前单位净值 / 期初单位净值 - 1] * 100%
- 4、集合计划累计净值增长率 = (单位集合计划资产累计净值 - 1) * 100%

三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

截至 2013 年 3 月 31 日，集合计划单位净值为 0.6081 元，本期净值增长率为 -0.39%，集合计划单位累计净值为 0.6081 元，集合计划累计净值增长率为 -39.19%。

（二）投资主办简介

丁文进先生

丁文进，男，1979 年生。2001 年毕业于中山大学，获会计学、地质学双学士学位。2001 年至 2004 年，进入浦发银行广州分行，任公司金融部经理，业绩在全分行排名前五位，获“杰出表现奖”。2005 年赴澳大利亚麦考瑞大学留学，获商科硕士学位（会计与金融方向）。2007 年进入花旗银行广州分行，负责为珠三角中小企业提

供融资服务，进一步加深了对实体经济的认识。2008年2月入职东莞证券，2011年5月至2012年10月期间，担任东莞证券旗峰1号策略精选集合资产管理计划投资经理，2012年6月担任旗峰2号积极配置集合资产管理计划投资经理。

（三）投资主办工作报告

1、投资策略回顾

2013年一季度以来，市场先扬后抑。1月份在经济弱复苏，IPO暂停，新领导层上任等利好的带动下，市场延续去年12月以来单边上行的态势，银行股表现尤为抢眼。但2月下旬以来，IPO重启传言甚嚣尘上，地产新国五条出台，银行业出台规范理财产品新规，加之前期涨幅过大，市场陷入调整态势，沪指重心围绕2300点中枢反复震荡。截至2013年3月31日，旗峰2号净值0.6081，季度下跌0.39%；同期沪深300下跌1.10%，跑赢指数0.71个百分点。操作上，一季度以来旗峰2号按照偏重于“周期+成长”的配置策略，在市场调整过程中周期股以及部分消费股的拖累较为明显，不过成长股的表现仍然较好（包括电子、传媒、信息服务等）。

2、投资管理展望

展望二季度，数据显示经济弱复苏格局仍在延续。3月份中国制造业PMI指数50.9，较上月上升0.8个百分点，创下11个月来的新高。汇丰PMI终值51.6，这一数值自去年11月以来已连续第5个月在枯荣线上方，表明中国经济仍然保持了温和复苏的态势。1-2月份规模以上工业企业利润17.2%的增速水平，高于去年全年增速5.27%，

略低于 12 月当月增速 17.3%，且存在去年同期基数较低的因素（去年 2 月增速为-5.2%），显示工业企业盈利仍在继续去年四季度以来的好转趋势，但如同经济复苏动能减弱，工业盈利增长的动能也在衰减。目前市场的担忧主要来自于两方面：一是，银监会的最近两次动作（包括约束理财产品投资非标债权资产，以及要求农村中小金融机构从严控制平台贷款），显示管理层正打出清理规范融资渠道的组合拳，短期对市场流动性包括对股市情绪造成不利影响，不过中长期对社会融资总量的影响可能不会很大，“上帝为你关上一扇门，必定会为你打开另一扇门”，尽管管理层对经济下行的容忍度在提高，但仍会在增长和结构之间寻求平衡。二是，各地房地产调控细则陆续披露，未来将观察各地执行情况和市场成交量的变化。

受到地产调控以及银行规范理财产品等政策影响，市场于一季度末转入弱势调整格局，短期市场可能继续向下，但是二季度的行情可能是跌出来的，操作上，从年线附近开始考虑逢低逐步加仓，适当增加成长股持仓，自下而上慎选业绩预期较好的品种，继续关注电子、通信、传媒、信息服务等板块。

四、集合计划财务报告

（一）集合计划会计报告书

1、集合计划资产负债表（2013 年 3 月 31 日）

单位：人民币元

项目	2013年03月31日	2012年期末余额
资 产：		
银行存款	3,838,065.54	3,712,043.03
结算备付金	2,254,265.40	3,864,795.29
存出保证金	128,246.73	325,038.65
交易性金融资产	85,246,118.26	43,368,842.44
其中：股票投资	60,478,088.80	20,228,462.99
债券投资	2,992,500.00	3,000,000.00
基金投资	21,775,529.46	20,140,379.45
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	12,000,120.00	40,002,000.00
应收证券清算款	2,668,282.88	18,246,392.13
应收利息	97,442.59	35,551.93
应收股利	14,326.16	30,007.80
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计：	106,246,867.56	109,584,671.27
负 债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	1,016,726.50	0.00
应付赎回款	0.00	0.00

应付管理人报酬	90,693.11	92,248.41
应付托管费	22,673.29	23,062.11
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	126,004.88	100,969.97
应付税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	37,397.10	30,000.00
负债合计	1,293,494.88	246,280.49
所有者权益:		
实收基金	172,601,304.32	179,098,990.90
未分配利润	-67,647,931.64	-69,760,600.12
所有者权益合计	104,953,372.68	109,338,390.78
负债与持有人权益总计:	106,246,867.56	109,584,671.27

2、集合计划利润表(2013年1月1日至2013年3月31日)

单位: 人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	701,672.56	701,672.56
1、利息收入	237,656.10	237,656.10
其中: 存款利息收入	47,335.20	47,335.20
债券利息收入	55,479.45	55,479.45
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	134,841.45	134,841.45
2、投资收益(损失以“-”填列)	-713,547.73	-713,547.73
其中: 股票投资收益	-486,880.51	-486,880.51
债券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	-389,321.16	-389,321.16

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	162,653.94	162,653.94
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	1,177,564.19	1,177,564.19
4、其他收入（损失以“-”填列）	0.00	0.00
二、费用	1,068,982.74	1,068,982.74
1、管理人报酬	268,607.51	268,607.51
2、托管费	67,151.87	67,151.87
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	725,526.26	725,526.26
5、利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
6、其他费用	7,697.10	7,697.10
三、利润总额	-367,310.18	-367,310.18

（二）集合计划投资组合报告（2013年3月31日）

1、资产组合情况

单位：人民币元

项 目	期末市值	占总资产比例
银行存款、清算备付金合计	6,220,577.67	5.91%
股票投资	60,478,088.80	57.47%
证券投资基金	21,775,529.46	20.69%
债券投资	2,992,500.00	2.84%
其他资产	13,763,445.13	13.08%
资产总值	105,230,141.06	100%

注：其他资产包括：应收利息、应收股利、买入返售证券款、应

收证券清算款等项目。

2、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名 证券明细

序号	证券名称	证券代码	数量 (份/股)	期末市值 (人民币元)	市值占集合计划资产净值比例
1	南方现金增利货币B	202302	10,245,529.46	10,245,529.46	9.76%
2	申万收益	150022	8,000,000.00	6,448,000.00	6.14%
3	银华稳进	150018	5,500,000.00	5,082,000.00	4.84%
4	宜华木业	600978	710,000.00	3,947,600.00	3.76%
5	远光软件	002063	250,768.00	3,927,026.88	3.74%
6	捷成股份	300182	112,510.00	3,638,573.40	3.47%
7	青龙管业	002457	331,561.00	3,594,121.24	3.42%
8	中顺洁柔	002511	148,390.00	3,205,224.00	3.05%
9	长信科技	300088	116,324.00	3,148,890.68	3.00%
10	12 金王债	112141	30,000.00	2,992,500.00	2.85%

3. 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，无报告期内被监管部门立案调查的证券，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证券中，没有投资于超出计划合同规定备选股票、基金库之外的证券。

(3) 集合计划其他资产的构成:

应收利息(人民币元)	97,442.59
应收股利	14,326.16
应收证券清算款	1,651,556.38
买入返售证券	12,000,120.00
合计(人民币元)	13,763,445.13

(三) 集合计划份额变动

单位: 份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总额
179,098,990.90	0.00	6,497,686.58	172,601,304.32

五、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会批准旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划推广的文件
- 2、《旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划说明书》
- 3、《旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、《旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划托管协议》
- 5、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：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心23楼

网址：www.dgzq.com.cn

信息披露电话：0769-22102279

联系人：李世玲

EMAIL：zcgl@dgzq.com.cn

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东莞证券有限责任公司资产管理部。

东莞证券有限责任公司

2013年4月19日