

旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划

2013 年第三季度资产管理报告

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 10 月 16 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07月01日 - 2013年9月30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：混合类产品

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07月01日-2013年09月30日
1	集合计划本期利润	9,136,371.48
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-650,931.15
3	单位集合计划净收益	-0.0042
4	期末集合计划资产净值	107,048,184.94

5	单位集合计划资产净值	0.6947
6	本期集合计划净值增长率	9.06%
7	集合计划累计净值增长率	-30.53%

(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 9 月 30 日，集合计划单位净值为 0.6947 元，本期净值增长率为 9.06%，集合计划单位累计净值为 0.6947 元，集合计划累计净值增长率为 -30.53%。

(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 年第三季度 A 股市场震荡上行，截止 2013 年 9 月 30 日，上证指数涨 9.88%；沪深 300 指数涨 9.47%；中小板指数涨 17.46%；创业板指数涨 35.21%，传媒娱乐、医疗器械等成长股表现突出，创业板指数创历史新高。从三季度的整体表现来看，一方面，代表经济转型的新兴产业个股持续受到市场资金的追捧；另一方面，随着上市公司中报公布完毕，政策预期较强的上海自贸区、土地改革、民营银行等题材股炒作热情高涨。截止 2013 年 9 月 30 日，旗峰 2 号净值 0.6947，全季上涨 9.06%，跑输沪深 300 指数 0.41 个百分点。操作上，旗峰 2 号持有的信息服务、传媒等成长股，以及食品饮料、酒店旅游、医药等消费股取得明显的超额收益，不过地产产业链上的周期股表现不佳，对净值造成一定拖累。

八月份、九月份的经济数据显示国内经济增速呈现止跌企稳迹

象，不过细究起来，主要是受企业补库存因素影响。由于企业补库存通常持续时间为三个月左右，且 18 大以后三公消费受到抑制（致使上年同期消费高基数），预计四季度经济复苏进程仍有波折。此外，尽管美联储 9 月份维持现有量化宽松政策，但若美国就业持续好转，不排除四季度迈开 QE 退出步伐，对全球大宗商品价格，以及新兴国家热钱流出造成不利影响。

2、投资管理展望

展望四季度，A 股市场可能仍将呈现结构性行情走势，总体来看，投资机会仍然集中在业绩增长预期良好的成长股和消费股上面。需要注意的是，成长股的投资节点上，需要评估一下几个因素的影响：1、10 月份上市公司三季报逐步公布，个股可能出现估值切换行情，对于业绩不达预期的品种可能面临较大幅度调整。2、IPO 重启的进程对市场构成影响。3、临近年末，公募基金相对排名考核的诉求增强，机构扎堆的品种可能出现“多杀多”现象。操作策略上，旗峰 2 号注重以基本面为依据，不追涨，多看少动，耐心持有基本面较好、中长线看好的品种。板块方面，重点看好大众消费品、信息消费（包括通信、软件、电子等），做好持仓结构优化。

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 09 月 30 日）

单位：人民币元

项目	2013年09月30日	年初余额
资 产：		
银行存款	6,095,678.51	3,712,043.03
结算备付金	755,700.58	3,864,795.29
存出保证金	120,191.95	325,038.65
交易性金融资产	93,731,471.23	43,368,842.44
其中：股票投资	76,426,990.00	20,228,462.99
债券投资	17,304,481.23	3,000,000.00
基金投资	0.00	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	5,800,058.00	40,002,000.00
应收证券清算款	205,173.62	18,246,392.13
应收利息	541,487.11	35,551.93
应收股利	0.00	30,007.80
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计：	107,249,761.00	109,584,671.27
负 债：	0.00	0.00

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	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	87,190.83	92,248.41
应付托管费	21,797.69	23,062.11
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	37,065.67	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	55,521.87	30,000.00
负债合计	201,576.06	246,280.49
所有者权益：		
实收基金	154,088,605.54	179,098,990.90
未分配利润	-47,040,420.60	-69,760,600.12
所有者权益合计	107,048,184.94	109,338,390.78
负债与持有人权益总计：	107,249,761.00	109,584,671.27

2、集合计划利润表(2013年07月01日至2013年09月30日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	9,772,508.45	16,626,611.45
1、利息收入	418,243.03	973,911.41
其中：存款利息收入	100,038.98	185,732.72
债券利息收入	278,225.66	489,542.11
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	39,978.39	298,636.58
2、投资收益（损失以“-”填列）	-433,037.21	6,531,952.11
其中：股票投资收益	-323,435.20	7,408,950.63
债券投资收益	-65,820.00	-65,820.00
基金投资收益	-94,482.01	-1,480,011.66
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	50,700.00	668,833.14
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	9,787,302.63	9,120,747.93
4、其他收入（损失以“-”填列）	0.00	0.00
二、费用	636,136.97	2,874,961.61
1、管理人报酬	268,670.39	798,278.93
2、托管费	67,167.61	199,569.76

3、销售服务费	0	0
4、交易费用	286,337.49	1,843,475.05
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	13,961.48	33,637.87
三、利润总额	9,136,371.48	13,751,649.84

(二) 集合计划投资组合报告 (2013年09月30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、存 出保证金合计	6,971,571.04	6.50%
股票投资	76,426,990.00	71.26%
证券投资基金	0.00	0.00%
债券投资	17,304,481.23	16.14%
其他资产	6,546,718.73	6.11%
资产总值	107,249,761.00	100.00%

注：其他资产包括：应收利息、应收股利、买入返售金融资产、
 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/ 张)	期末市值 (人民币元)	市值占集 合计划资 产净值比 例
1	贝因美	002570	260,000	10,816,000.00	10.10%
2	东华软件	002065	280,000	8,366,400.00	7.82%
3	网宿科技	300017	124,907	7,119,699.00	6.65%
4	双汇发展	000895	150,000	6,967,500.00	6.51%
5	中国国旅	601888	150,000	6,216,000.00	5.81%
6	大北农	002385	440,000	5,654,000.00	5.28%
7	天士力	600535	120,000	5,402,400.00	5.05%
8	广田股份	002482	240,000	4,980,000.00	4.65%
9	13 即发 CP001	041360034	50,000	4,957,000.00	4.63%
10	13 珠江钢管 CP001	041365006	50,000	4,950,500.00	4.62%

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）	541,487.11
应收证券清算款	205,173.62
买入返售金融资产	5,800,058.00
合计（人民币元）	6,546,718.73

(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
159,622,607.64	0.00	5,534,002.10	154,088,605.54

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 10 月 21 日