



创金价值成长5期

集合资产管理计划季度资产管理报告

(2013年7月1日—2013年9月30日)

第一节 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》)及其它有关规定制作。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产,但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

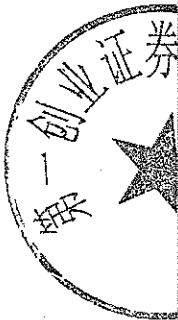
本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间:2013年7月1日至2013年9月30日。

第二节 集合资产管理计划概况

一、基本资料

名称	创金价值成长5期集合资产管理计划
类型	非限定性集合资产管理计划
成立日	2013年2月28日
报告期末份额总额	1,939,407,195.78份
存续期	无固定存续期
投资目标	秉承价值投资理念,前瞻性研究宏观经济、行业、以及企业基本面变化,积极主动进行资产配置,精选个股,分享优秀企业的成长成果,实现资产的长期稳健增值。





业绩比较基准	沪深300指数×70%+中证全债指数×30%
风险收益特征	较高风险，高收益
批复文号	中证协函（2013）247号
管理人	第一创业证券股份有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司

二、管理人

名称：第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市笋岗路12号中民时代广场B座25-26楼

法定代表人：刘学民

电话：755-25832583

传真：（0755）25831718

网址：<http://www.fcsc.com>

三、托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：010-95588

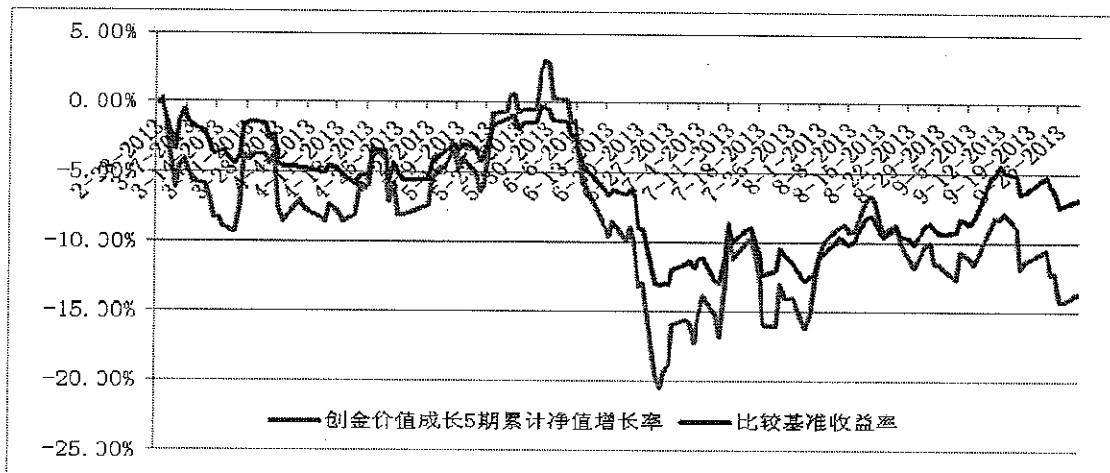
网址：<http://www.icbc.com.cn>

第三节 集合资产管理计划财务指标

一、主要财务指标（单位：人民币元）

集合计划本期利润	50,202,774.93
集合计划本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-147,916,926.78
集合计划份额本期净收益	0.0259
期末集合计划资产净值	1,690,720,424.58
期末集合计划单位净值	0.8720
期末集合计划单位累计净值	0.8720

二、集合计划单位累计净值增长率与投资基准收益率的历史走势对比图



第四节 管理人报告

一、集合资产管理计划业绩表现

本集合计划于2013年2月28日成立,截至2013年9月30日,集合计划单位净值0.8720元,单位累计净值0.8720元,本集合计划自成立之日起累计净值增长率为-12.8%。

二、投资主办人简介

苏彦祝先生:现任第一创业证券副总裁、创金资产管理总部总经理,清华大学硕士,十余年证券、基金行业从业经历。曾就职南方基金,任南方避险增值基金经理、南方绩优成长基金经理、投资部总监等。2012年7月《证券时报》主办的“2012中国最佳财富管理机构暨最佳经纪商评选”活动中,苏彦祝获评“中国最佳资管产品经理”,其管理的创金价值成长获评“中国最佳权益类资管产品”。

曹春林先生:1998年获厦门大学经济学学士学位,进入证券行业工作。2004年起在茂业集团从事资本运作及证券投资工作,2010年初加盟第一创业证券资产管理总部。

三、投资主办人工作报告

(一) 投资回顾

2013年三季度基本面方面,三季度经济呈现较为明显的复苏迹象。PMI持续在50以上

运行,且回升幅度持续好于历史均值,而在基建投资维持较高增速及制造业投资持续回升下,投资总体维持稳中有升,此外外需也在呈现有所好转的局面,虽然并不是根本性的变化。政策面方面,6月“钱荒”之后,央行对流动性的管理更加注重预期的稳定,整体资金面呈现稳中偏紧,以进一步推动银行的去杠杆进程。A股市场在6月份的暴跌后震荡回升,三季度上证指数上涨了8.97%。

三季度开始在“钱荒”缓解后低估值的蓝筹股有较好的估值修复,但后来市场热点开始转向以自贸区、土地流转为代表的主题性炒作,市场活跃度有明显上升在三季度我们对持仓结构进行了一定的调整,持仓更加均衡,适度增加了与土地流转、环保等主题相关的个股仓位。三季度产品净值上涨2.71%。

(二) 投资展望

四季度最受关注的事件是11月份召开的十八届三中全会,预计在此之前市场将保持活跃态势,主题性投资仍是市场热点。十八届三中全会是否会成为市场风格切换的催化剂还有待观察。关注即将召开的十八届三中全会带来的投资机会以及年底可能的估值切换机会。

四、集合资产管理计划风险控制报告

1、集合资产管理计划运作合规性声明

报告期内,管理人严格遵守《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》、本集合计划合同以及管理人关于客户资产管理业务制度的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划的资产,在严格控制风险的基础上,致力于投资者利益的最大化。本报告期内,本集合计划的运作合法合规,不存在损害集合计划份额持有人权益的行为,本集合计划的投资管理符合相关法律法规。

2、风险控制报告

本集合计划管理人的内部风险控制工作主要由公司风险管理部负责。风险管理部采取授权管理、逐日监控、绩效评估、定期与不定期检查等多种方式对本集合计划的管理运作进行风险控制。风险管理部通过风险监控与风险预警机制,重点检查本集合计划是否达到各项风险控制指标,是否存在损害集合计划持有人利益的行为,及时发现和处理本集合计划运作过程中可能出现的风险。对报告期内发现的风险事项,风险管理部已及时进行了风险揭示,并



督促相关部门及时采取风险应对措施予以解决。

我们认为，本报告期内，集合计划管理人始终能按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划合同及说明书的要求，对集合计划进行运作管理；本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易情况；相关信息披露和财务数据皆真实、准确、完整、及时。

第五节 投资组合报告

一、期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例%
股票投资	1,545,163,765.10	86.53%
债券投资	0.00	0.00%
基金投资	0.00	0.00%
应收利息	42,690.72	0.00%
银行存款及清算备付金	114,177,543.33	6.39%
其他资产	126,421,461.72	7.08%
合计	1,785,805,460.87	100.00%

说明：①其他资产包括存出保证金和应收证券清算款、买入返售金融资产等

②部分项目可能存在小数点位差调整

二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	证券市值（元）	占净值（%）
1	600837	海通证券	11,143,661	139,407,199.11	8.25%
2	000651	格力电器	4,986,402	132,438,837.12	7.83%
3	000024	招商地产	4,553,649	109,287,576.00	6.46%
4	000039	中集集团	7,962,132	104,861,278.44	6.20%
5	000786	北新建材	5,753,170	95,732,748.80	5.66%
6	600108	亚盛集团	10,149,819	94,088,822.13	5.57%
7	600201	金宇集团	3,828,425	88,589,754.50	5.24%
8	002503	搜于特	7,495,693	87,474,737.31	5.17%
9	601311	骆驼股份	7,071,940	76,942,707.20	4.55%
10	000581	威孚高科	3,107,003	73,294,200.77	4.34%



三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	证券市值（元）	占净值（%）

四、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

第六节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	2,049,082,338.52
报告期间总参与份额	2,319,684.08
其中：红利再投资份额	0.00
报告期间总退出份额	111,994,826.82
报告期末份额总额	1,939,407,195.78

第七节 重要事项提示

一、本集合计划管理人及托管人相关事项

1、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。

2、本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在本报告期内没

有受到任何处罚。

二、本集合计划相关事项

- 1、 本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。
- 2、 本报告期内集合计划未进行收益分配。
- 3、 本集合计划于2013年8月14日发布了关于开放办理参与、退出业务的公告。

第八节 信息披露的查阅方式

一、本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会《关于第一创业证券股份有限公司发起设立创金价值成长5期集合资产管理计划成立的备案确认函》（中证协函（2013）247号）
- 2、《创金价值成长5期集合资产管理计划说明书》
- 3、《创金价值成长5期集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 4、 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：深圳市罗湖区笋岗路中民时代广场B座25层

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人第一创业证券股份有限公司。

网址：<http://www.fcsc.com>

热线电话：4008881888

