

## 旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划

### 2014 年第二季度资产管理报告

#### 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 2014 年 7 月 14 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：2014年4月1日 - 2014年6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	2014年4月1日-2014年6月30日
1	集合计划本期利润	625,206.71
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-2,725,546.83
3	单位集合计划净收益	-0.0204
4	期末集合计划资产净值	84,047,027.32

5	单位集合计划资产净值	0.6292
6	本期集合计划净值增长率	0.77%
7	集合计划累计净值增长率	-37.08%

## (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 =  $[\text{期末单位净值} / (\text{分红除权前单位净值} - \text{单位分红金额}) * \text{分红除权前单位净值} / \text{期初单位净值} - 1] * 100\%$

4、集合计划累计净值增长率 =  $(\text{单位集合计划资产累计净值} - 1) * 100\%$

## 三、集合计划管理人报告

### (一) 业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，集合计划单位净值为 0.6292 元，本期净值增长率为 0.77%，集合计划单位累计净值为 0.6292 元，集合计划累计净值增长率为 -37.08%。

### (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。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。2008 年加入东莞证券担任行业研究员。2011 年 5 月至 2012 年 10 月担任东莞证券旗峰 1 号投资主办人。2012 年 5 月至 2014 年 2 月担任深圳分公司投资总监助理，同年 6 月起兼任东莞证券旗峰 2 号投资主办人。2014 年 3 月起，担任深圳分公司副总经理，先后兼任旗峰 2 号、财富 1 号、创新 1 号投资主办人。

### （三）投资主办工作报告

#### 1、投资策略回顾

受地产链基本面回落的拖累，2014 年上半年国内宏观经济步入典型衰退期。政策上，管理层坚持“稳增长、调结构、防风险”的底线思维，在确保不发生大的风险暴露的前提下，采取“定向降准”等微刺激政策，对经济托底维稳。在经济延续下行趋势、信用风险基本可控、欧美经济复苏、A 股 IPO 扩容等多重因素影响下，上半年国内资本市场表现为“债市强于股市”的特征，在存量资金的主导下，A 股市场波动率仅在 10%以内，在大类资产配置上的吸引力显著下降。分市场来看，一是以金融、地产等周期品为主的主板市场维持弱势震荡；二是中小盘成长股在年初经过一轮强势上涨后，经历了三个月的调整，近期在 IPO 发行节奏低于预期，以及新股发行定价较低的刺激下，估值出现向上修复。截止 6 月末，旗峰 2 号净值 0.6292，第二季度

涨 0.77%；同期沪深 300 指数涨 0.88%，跑输大盘 0.11 个百分点。

## 2、投资管理展望

宏观基本面上，在国内“微刺激”政策和外需转暖的影响下，作为领先指标的 PMI 数值均有不同程度回升，经济延续恢复趋势。不过同时我们也必须注意到，房地产销售放缓、去库存压力加大，继续成为拖累经济增长的重要变量。展望后市，新股发行担忧正逐步被市场消化，经济稳增长背景下货币政策可能进一步放松，中报业绩预告可能诱发个股行情机会，预计市场整体表现将逐步好转，主要的投资机会可能仍在业绩预期较好，前期调整较为充分的成长股上。操作上，持股待涨，注意个股中报业绩披露状况，及时做好评估。坚持两条主线配置思路：(1) 低估值大盘蓝筹，包括保险券商、地产；(2) 基本面改善，中报业绩预期较好，市值小于百亿元、机构持股比例低的成长股和消费股，重点关注特高压、计算机、农业、医药。

## 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 (2014 年 6 月 30 日)

单位:人民币元

项目	2014 年 6 月 30 日	年初余额
资 产：		

银行存款	118,649.24	6,247,866.64
结算备付金	2,003,218.76	4,514,285.71
存出保证金	70,685.60	82,459.79
交易性金融资产	62,106,265.67	17,831,600.00
其中：股票投资	47,491,315.67	894,300.00
债券投资	3,000,000.00	16,937,300.00
基金投资	11,614,950.00	0.00
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券 投资	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00
买入返售金融资产	18,000,180.00	66,000,660.00
应收证券清算款	1,705,829.17	1,037,208.42
应收利息	148,763.74	493,551.16
应收股利	1,924.85	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	84,155,517.03	96,207,631.72
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	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	68,543.29	81,807.39
应付托管费	17,135.83	20,451.86
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	20,330.89	18,471.04
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	2,479.70	7,000.00
负债合计	108,489.71	127,730.29
所有者权益：		
实收基金	133,581,028.74	140,818,625.33
未分配利润	-49,534,001.42	-44,738,723.90
所有者权益合计	84,047,027.32	96,079,901.43
负债和所有者权益总 计	84,155,517.03	96,207,631.72

## 2、集合计划利润表(2014年4月1日至2014年6月30日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	1,040,691.38	-6,426,228.22
1、利息收入	381,542.36	1,120,887.52
其中：存款利息收入	113,638.02	240,388.88
债券利息收入	118,257.53	386,630.13
资产支持证券利息收入	0.00	0
买入返售证券收入	149,646.81	493,868.51
2、投资收益	-2,691,604.52	-10,145,348.84
其中：股票投资收益	-3,094,022.43	-10,556,408.75
债券投资收益	4,180.00	12,072.00
基金投资收益	0.00	0.00
权证投资收益	0.00	0
资产支持证券投资收益	0.00	0
衍生工具收益	0.00	0
股利收益	398,237.91	398,987.91
3、公允价值变动收益	3,350,753.54	2,598,233.10
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	415,484.67	949,147.27
1、管理人报酬	208,459.48	435,228.81
2、托管费	52,114.85	108,807.15
3、销售服务费	0.00	0



4、交易费用	144,662.56	384,130.53
5、利息支出	0.00	0
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0
6、其他费用	10,247.78	20,980.78
三、利润总和	625,206.71	-7,375,375.49

## (二) 集合计划投资组合报告 (2014年6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	2,192,553.60	2.61%
股票投资	47,491,315.67	56.43%
证券投资基金	11,614,950.00	13.80%
债券投资	3,000,000.00	3.56%
其他资产	19,856,697.76	23.60%
资产总值	84,155,517.03	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	银华日利	511880	50,000	5,117,950.00	6.0894%
2	广发货币 B	270014	5,000,000	5,000,000.00	5.9491%
3	中国平安	601318	100,000	3,934,000.00	4.6807%
4	东华软件	002065	190,638	3,835,636.56	4.5637%
5	豪迈科技	002595	78,464	3,699,577.60	4.4018%
6	西陇化工	002584	222,000	3,452,100.00	4.1073%
7	12 制药债	112132	30,000	3,000,000.00	3.5694%
8	中国卫星	600118	160,000	2,956,800.00	3.5180%
9	中信证券	600030	250,000	2,865,000.00	3.4088%
10	英威腾	002334	200,000	2,774,000.00	3.3005%

### 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）	148,763.74
应收股利	1,924.85
应收证券清算款	1,705,829.17
买入返售金融资产	18,000,180.00
合计（人民币元）	19,856,697.76

(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
135,375,145.27	0.00	1,794,116.53	133,581,028.74

## 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：宋冬燕

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深圳分公司。

东莞证券有限责任公司

2014 年 7 月 16 日