

旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划

2014 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 1 号策略精选集合资产管理计划(下称“集合计划”或“本集合计划”)出具批准文件(文号:证监许可〔2009〕1113 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 10 月 20 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 07 月 01 日 - 2014 年 09 月 30 日

一、集合计划简介

名称：旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划

类型：基金宝产品

管理人：东莞证券有限责任公司

托管人：招商银行股份有限公司

成立日：2009 年 12 月 22 日

成立规模：1,044,153,357.57 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 07 月 01 日--2014 年 09 月 30 日
1	集合计划本期利润	22,960,859.14
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	9,210,651.92
3	单位集合计划净收益	0.0336
4	期末集合计划资产净值	227,840,789.14
5	单位集合计划资产净值	0.8311
6	本期集合计划净值增长率	10.72%

7	集合计划累计净值增长率	-16.89%
---	-------------	---------

(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

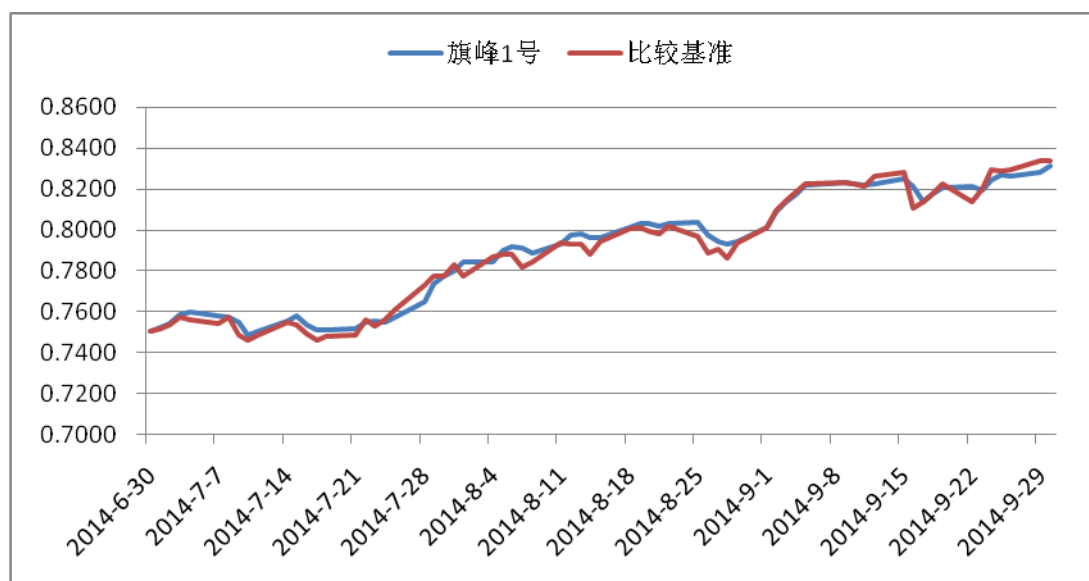
3、本期集合计划净值增长率 = $\frac{\text{期末单位净值} - (\text{分红除权前单位净值} - \text{单位分红金额})}{\text{期初单位净值} - 1} \times 100\%$

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

(三) 集合计划累计净值历史走势图 (单位: 元)

旗峰 1 号单位净值增长率与业绩比较基准增长率走势对比

图：



三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至 2014 年 09 月 30 日，集合计划单位净值为 0.8311 元，本期净值增长率为 10.72%，集合计划单位累计净值为 0.8311 元，集合计划累计净值增长率为-16.89%。

(二) 投资主办简介

丁硕先生

男，1983 年生。北京大学光华管理学院经济学学士，清华大学经济管理学院工商管理硕士 (MBA)，特许金融分析师 (CFA)。先后任职于招商证券股份有限公司、北京兴凯投资咨询有限公司、阳光保险集团股份有限公司，历任权益类交易员、行业研究员、投资经理等，对于大类资产配置、投资组合管理、行业个股研究具有较深的理解，投资业绩持续战胜比较基准。8 年证券从业及投资管理经验。

(三) 投资主办工作报告

1、投资策略回顾

二季度末我们判断“7月开始，A股将进入2014年中报披露期，综合卖方机构自上而下的A股盈利预测判断，我们认为A股整体看，盈利的季度同比增速依然处于下行通道中，三季度可能是全年低点。因此未来更多关注政策受益行业的投资机会，对中报预期较好的公司给予更大的关注。IPO对市场短期的冲击基本已经过去，后续持续观察其对成长股的影响。”

三季度市场在政策预期偏多及沪港通等概念的带动下逐渐走强，

市场风格有所转换，大盘蓝筹股逐渐占优，中报业绩不达预期的公司出现较大调整，市场整体符合预期。

2、投资管理展望

宏观经济方面，中采PMI 9月数据为51.1，与8月数据持平，略好于市场预期的51.0，其中生产指数53.6，新出口订单指数50.2，环比均有所上升，整体表明制造业仍处于增长态势。

政策方面，国庆前期央行放松住房信贷政策，加上前期各地纷纷放宽限购政策，对实体经济存在一定的刺激作用；国务院办公厅下发了多举措并举着力缓解企业融资成本高问题的指导意见；国资委有望近期发布国有企业改革的三类框架型指导意见，即混合所有制改革指导意见、组建国有资产投资公司指导意见、董事会三项职权改革指导意见。

市场方面，前期大盘蓝筹股开始占优，创业板在众多公司不达预期及高估值的影响下超额收益已经不明显。即将进入三季度披露期，上述趋势仍将延续，特别需要注意业绩不达预期的高估值成长股，对业绩较好的公司可给予更大的关注。由于高层仍然强调改革的重要性，因此未来仍是关注政策受益行业、公司的投资机会。

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 09 月 30 日)

单位:人民币元

项目	2014 年 09 月 30 日	年初余额
资 产：		
银行存款	3,438,763.67	1,810,646.04
结算备付金	2,860,027.43	1,996,934.21
存出保证金	85,341.33	160,539.29
交易性金融资产	173,093,341.67	233,190,082.15
其中：股票投资	34,005,917.40	38,348,725.40
债券投资	11,032,665.64	41,415,649.48
基金投资	128,054,758.63	153,425,707.27
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	0.00	10,000,100.00
应收证券清算款	48,014,153.33	11,440,146.39
应收利息	567,921.07	249,739.90
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计:	228,059,548.50	258,848,187.98

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	149,686.01	176,013.56
应付托管费	37,421.49	44,003.37
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	27,818.94	80,675.15
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	3,832.92	7,000.00
负债合计	218,759.36	307,692.08
所有者权益:		
实收基金	274,148,040.64	341,742,769.30
未分配利润	-46,307,251.50	-83,202,273.40
所有者权益合计	227,840,789.14	258,540,495.90
负债与持有人权益总计:	228,059,548.50	258,848,187.98

2、集合计划利润表(2014年07月01日至2014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	24,101,897.29	24,229,097.12
1、利息收入	490,298.15	1,494,060.94
其中：存款利息收入	29,930.27	68,643.67
债券利息收入	196,205.65	1,027,143.65
资产支持证券利息收入	0.00	0
买入返售证券收入	264,162.23	398,273.62
2、投资收益（损失以“-”填列）	9,861,391.92	15,558,122.31
其中：股票投资收益	4,111,351.18	3,849,477.93
债券投资收益	1,054,768.84	1,264,678.66
基金投资收益	4,071,035.34	7,854,322.95
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	624,236.56	2,589,642.77
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	13,750,207.22	7,176,463.87
4、其他收入（损失以“-”填列）	0.00	450.00
二、费用	1,141,038.15	3,183,218.38
1、管理人报酬	453,336.18	1,397,280.99

2、托管费	113,334.05	349,320.42
3、销售服务费	0.00	0
4、交易费用	560,013.85	1,395,593.70
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	14,354.07	41,023.27
三、利润总额	22,960,859.14	21,045,878.74

(二) 集合计划投资组合报告 (2014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	6,384,132.43	2.80%
股票投资	34,005,917.40	14.91%
债券投资	11,032,665.64	4.84%
证券投资基金	128,054,758.63	56.15%
其他资产	48,582,074.40	21.30%
资产总值	228,059,548.50	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	华泰柏瑞量化增强指数	000172	17,909,009.01	22,744,441.44	9.9826%
2	中欧价值	166005	15,783,757.34	21,828,936.40	9.5808%
3	兴全社会责任股票	340007	7,081,444.75	12,158,840.64	5.3366%
4	博时卓越	160512	8,546,153.85	11,887,700.01	5.2175%
5	东方利群混合型发起式证券投资基金	400022	10,104,082.45	10,530,474.73	4.6219%
6	医药 B	150131	7,600,000.00	8,192,800.00	3.5958%
7	09 美好债	112012	76,810	7,698,205.44	3.3788%
8	诺安灵活配置混合	320006	5,553,272.55	6,941,590.69	3.0467%
9	富国天成红利混合	100029	4,541,242.73	6,221,048.42	2.7304%

10	国泰金牛创新 股票	020010	4,517,593.32	6,130,374.14	2.6906%
----	--------------	--------	--------------	--------------	---------

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）	567,921.07
应收股利	0.00
买入返售金融资产	0.00
证券清算款	48,014,153.33
合计（人民币元）	48,582,074.40

(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
293,122,504.12	0.00	18,974,463.48	274,148,040.64

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 1 号策略精选集合资产管理计划推广的文件

2、《旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划说明书》

3、《旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划资产管理合同》

4、《旗峰 1 号策略精选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

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10月23日