

旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划 2015 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 2015 年 4 月 15 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：2015 年 1 月 1 日 - 2015 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： 混合类产品

管理人： 东莞证券股份有限公司

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	2015 年 1 月 1 日-2015 年 3 月 31 日
1	集合计划本期利润	17,568,783.67
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	13,597,602.20
3	单位集合计划净收益	0.1289
4	期末集合计划资产净值	93,726,531.41
5	单位集合计划资产净值	0.8886
6	本期集合计划净值增长率	22.38%
7	集合计划累计净值增长率	-11.14%

（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 2015 年 3 月 31 日，集合计划单位净值为 0.8886 元，本期净值增长率为 22.38%，集合计划单位累计净值为 0.8886 元，集合计划累计净值增长率为 -11.14%。

（二）投资主办简介

邓翔先生

男，1982年生，中山大学经济学硕士，注册会计师（CPA），注册国际投资分析师（CIIA）。两年会计师事务所审计经验，六年证券从业经验，先后就职于毕马威会计师事务所，广州长金投资等公司，担任审计员，研究员等职务，2012年加入东莞证券深圳分公司，担任研究员，投资经理助理等职务。

袁军先生

男，1979年生，杭州商学院国际金融专业本科毕业，历任江南证券杭州营业部投资咨询主管、浙江核新软件技术有限公司金融产品研究、杭州第三波投资咨询有限公司私募研究。2009年加入东莞证券清溪营业部，任首席投资顾问。2015年2月任职于东莞证券深圳分公司投资研究岗。擅长通过研究市场行为和宏观政策分析来确定策略，判断行业变化以寻找价值型投资标的。12年证券投资经验，有较强投资逻辑和风控能力。

（三）投资主办工作报告

1、投资策略回顾

回顾一季度行情，宏观经济依然弱势，周期股在经过去年12月的估值修复行情之后整体表现较为疲软，多以脉冲性行情为主。但市场热点纷呈，各种互联网，工业4.0等相关概念的公司纷纷上涨。市场流动性非常宽裕，两融余额不断提升，日成交额再次回到万亿规模。两会上总理对于“互联网+”的表态以及周小川的“资金进股市也是支持实体”极大的激发了市场的热情，市场在三月再次走出单边上涨的行情，并一举突破09年的高点3478。旗峰2号在一季度重点配置了互联网，工业4.0等热点板块，并在市场走出单边上涨行情时大幅提升了仓位，取得了不错的效果。

2、投资管理展望

宏观经济仍然较为弱势。3月汇丰PMI预览初值49.2，低于市场预期的50.5，比2月终值下降1.5个点，回落到枯荣线下方，创下

2014 年 5 月以来新低。周期品价格有所分化，钢铁价格与地产销量有所回升，化工品价格总体稳定、水泥与煤炭价格则持续下行。总体来看，旺季需求复苏的迹象较为微弱。

外围方面，美国 2 月制造业 PMI 和服务业 PMI 终值均大幅超出预期，美联储加息预期增强。但美联储大幅下调未来加息点位预测显著超出市场预期。欧元贬值刺激海外需求带动出口订单增加，欧元区经济温和扩张。希腊向欧盟递交了改革方案得到各成员国财长的认可，欧元集团将希腊援助计划延长四个月，希腊局势得到缓和。

市场资金面较为宽松，央行继续通过降准降息，SLF 等释放流动性。美元指数触及 100 之后掉头向下，短期减缓了资本外流的压力，对国内资金面较为有利。

短期来看，市场处于极度强势中，难有深幅调整出现，预计市场整固之后仍有上行的可能。由于实体经济没有见到明显的改善迹象，主板中金融，地产等预计多以脉冲性机会为主，难有趋势性行情。市场的热点仍然将集中在互联网，工业 4.0 等热门板块上。互联网板块整体涨幅较大，但由于触网的公司越来越多，涉及的新概念也越来越多，比如互联网保险，能源互联网等，板块容量足够大，仍会有个股行情，需要重点寻找板块中涨幅相对较小、又有新题材的公司。另外，重点关注前期涨幅较小的板块，比如食品饮料，电力设备等。需要关注的风险点主要在于流动性的变化，一是美元指数重返 100 以上可能带来的资本外流的预期；二是两融余额停止增长；三是新股发行规模超预期。基于良好的预期，本产品计划继续保持积极稳健策略，根据

上述原则选择个股进行投资。

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 (2015年3月31日)

单位:人民币元

项目	2015年3月31日	年初余额
资 产:		
银行存款	5,384,013.70	12,419,557.30
结算备付金	2,161,597.40	1,437,485.21
存出保证金	82,771.52	70,318.85
交易性金融资产	72,009,533.53	66,262,660.52
其中: 股票投资	66,754,229.84	43,698,730.17
债券投资	0.00	15,400,965.00
基金投资	5,255,303.69	7,162,965.35
权证投资	0	0
资产支持证券投资	0	0
衍生金融工具	0	0
买入返售金融资产	13,000,130.00	10,000,100.00
应收证券清算款	1,695,214.25	1,699,942.33
应收利息	2,516.78	748,799.85
应收股利	31,008.80	0
应收申购款	0	0
其他资产	0	0
资产合计	94,366,785.98	92,638,864.06
负 债:		

短期借款	0	0
交易性金融负债	0	0
衍生金融负债	0	0
卖出回购金融资产款	0	0
应付证券清算款	264,503.51	11,176,447.49
应付赎回款	0	0
应付管理人报酬	74,685.49	70,600.68
应付托管费	18,671.36	17,650.18
应付销售服务费	0	0
应付交易费用	281,161.21	99,749.23
应交税费	0	0
应付利息	0	0
应付利润	0	0
其他负债	1,233.00	5,000.00
负债合计	640,254.57	11,369,447.58
所有者权益：		
实收基金	105,481,772.47	111,928,148.31
未分配利润	-11,755,241.06	-30,658,731.83
所有者权益合计	93,726,531.41	81,269,416.48
负债和所有者权益总计	94,366,785.98	92,638,864.06

2、集合计划利润表(2015年1月1日至2015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	18,576,041.84	18,576,041.84
1、利息收入	199,784.54	199,784.54
其中：存款利息收入	14,857.82	14,857.82
债券利息收入	134,465.61	134,465.61

资产支持证券利息收入	0	0
买入返售证券收入	50,461.11	50,461.11
2、投资收益	14,405,075.83	14,405,075.83
其中：股票投资收益	14,013,215.35	14,013,215.35
债券投资收益	105,326.62	105,326.62
基金投资收益	244,146.23	244,146.23
权证投资收益	0	0
资产支持证券投资收益	0	0
衍生工具收益	0	0
股利收益	42,387.63	42,387.63
3、公允价值变动收益	3,971,181.47	3,971,181.47
4、其他收入	0	0
二、费用	1,007,258.17	1,007,258.17
1、管理人报酬	210,326.49	210,326.49
2、托管费	52,581.58	52,581.58
3、销售服务费	0	0
4、交易费用	733,177.10	733,177.10
5、利息支出	0	0
其中：卖出回购金融资产支出	0	0
6、其他费用	11,173.00	11,173.00
三、利润总和	17,568,783.67	17,568,783.67

（二）集合计划投资组合报告（2015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、存	7,628,382.62	8.08%

出保证金合计		
股票投资	66,754,229.84	70.74%
证券投资基金	5,255,303.69	5.57%
债券投资	0.00	0.00%
其他资产	14,728,869.83	15.61%
资产总值	94,366,785.98	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	三安光电	600703	260,000	5,527,600.00	5.8976%
2	奥瑞金	002701	144,300	5,105,334.00	5.4471%
3	汇川技术	300124	115,420	4,821,093.40	5.1438%
4	国泰货币	020007	4,510,801	4,510,801.27	4.8127%
5	华英农业	002321	420,000	4,099,200.00	4.3736%
6	登海种业	002041	90,000	3,745,800.00	3.9965%
7	金正大	002470	100,700	3,705,760.00	3.9538%
8	海宁皮城	002344	150,000	3,574,500.00	3.8138%
9	潍柴动力	000338	110,000	3,440,800.00	3.6711%
10	软控股份	002073	160,000	3,200,000.00	3.4142%

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）	2,516.78
应收股利	31,008.80
证券清算款	1,695,214.25
买入返售金融资产	13,000,130.00
合计（人民币元）	14,728,869.83

（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
111,928,148.31	-	6,446,375.84	105,481,772.47

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股份有限公司深圳分公司。

东莞证券股份有限公司

2015 年 4 月 20 日