

旗峰多盈 3 号集合资产管理计划 2015 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。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用旗峰多盈 3 号集合资产管理计划（下称“集合计划”或“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 7 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：2015 年 4 月 1 日—2015 年 6 月 30 日

一、集合计划简介

名称：旗峰多盈 3 号集合资产管理计划

类型：固定收益类产品

管理人：东莞证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

成立日：2014年2月21日

成立规模：96,555,938.49份

存续期：3年，可展期

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4月1日—2015年6月30日
1	集合计划本期利润	1,332,067.41
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,217,067.41
3	单位集合计划净收益	0.0256
4	期末集合计划资产净值	49,304,015.67
5	单位集合计划资产净值	1.0356
6	本期集合计划净值增长率	2.78%
7	集合计划累计净值增长率	13.13%

（二）财务指标的计算公式

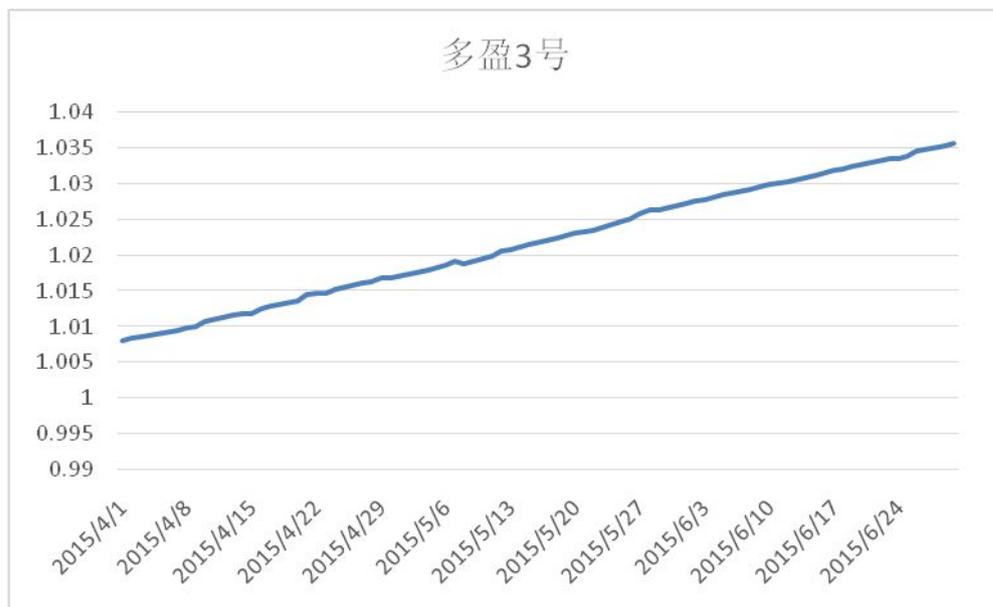
1、单位集合计划净收益=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额÷集合计划份额

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) 集合计划累计净值历史走势图 (单位: 元)



三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至2015年6月30日,集合计划单位净值为1.0356元,本报告期净值增长率为2.78%,集合计划单位累计净值为1.1313元,集合计划累计净值增长率为13.13%。

(二) 投资主办简介

黄浩东

男,清华大学经济管理学院管理学学士及工商管理硕士,历任天华阳光控股公司高级财务经理、东莞证券深圳分公司研究员,东莞证券深圳分公司投资经理助理等职,现任东莞证券投资经理,擅长货币

政策研究、债券信用研究和投资组合管理。

自 2015 年 3 月起任旗峰多盈 3 号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

二季度经济增速将较一季度继续下滑。二季度工业增速降至2008年以来最低；虽然房地产销售近期有所明显改善，但仍未传导至投资端，整个二季度房地产投资增速回落对经济有较大的负面作用。

资金面，央行采取了一系列操作，其中操作包括了降息，降准，MLF降价加量，公开+定向逆回购。央行态度已经比较明确，就是维持现有较为宽松的货币政策。

二季度利率债收益率整体先跌后涨。一季度经济数据疲软，央行超预期大幅度降准，债市获多重利好，利率债收益率大幅回落。10年国债最低下探至3.35%，10年国开债最低下探至3.77%。随后长端触底反弹，中短期仍在资金面利好下继续下探，导致期限价差迅速扩大，曲线十分陡峭。

二季度信用债债市表现为收益率震荡下行，在5月中下旬触及低点后，收益率出现普遍上行。

本集合计划主要投向于公司债、私募债和股票质押式回购，集合单位净值在平稳上升。

2、投资管理展望

从货币政策来看，央行在实施较为宽松货币政策，降准和降息也只是对市场的流动性补充，市场对相关政策已经开始钝化，未来政策

效果还待观察。即使6月末降息和降准有所超预期，但市场依然是表现得很平淡。目前来看，货币政策从紧的概率不大，宽松依然可期。近期权益市场大回调，对债券市场压力逐步减少。我们对三季度乃至下半年的债券市场态度依然保持乐观态度。

展望2015年三季度，本集合计划继续维持上季度持仓，主要投向于公司债、私募债和股票质押式回购。

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6月30日)

单位：人民币元

项目	2015年6月30日	年初余额
资 产：		
银行存款	88,033.67	392,324.49
结算备付金	354,882.18	0.00
存出保证金	13,123.77	18,709.34
交易性金融资产	45,150,604.10	89,759,388.51
其中：股票投资	0.00	0.00
债券投资	45,150,104.11	89,758,888.28
基金投资	499.99	500.23
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	8,704,063.46	1,400,000.00

应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	2,025,272.57	6,597,321.85
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:	56,335,979.75	98,167,744.19
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	6,999,719.94	999,942.00
应付证券清算款	0.00	300,302.30
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	0.00	0.00
应付托管费	24,249.58	52,011.54
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	4,869.50	10,563.12
应交税费	0.00	0.00
应付利息	645.36	177.40
应付利润	0.00	0.00
其他负债	2,479.70	5,000.00
负债合计	7,031,964.08	1,367,996.36
所有者权益:		
实收基金	47,608,310.02	96,627,795.24
未分配利润	1,695,705.65	171,952.59
所有者权益合计	49,304,015.67	96,799,747.83
负债和所有者权益总计	56,335,979.75	98,167,744.19

2、集合计划利润表(2015年4月1日至2015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	1,418,324.02	3,138,043.69
1、利息收入	1,303,324.02	3,092,428.55
其中：存款利息收入	4,078.26	20,269.73
债券利息收入	1,092,000.00	2,767,454.19
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	207,245.76	304,704.63
2、投资收益	0.00	-25,874.68
其中：股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	0.00	-25,874.68
基金投资收益	0.00	0.00
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	0.00	0.00
3、公允价值变动收益	115,000.00	71,489.82
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	86,256.61	258,378.50
1、管理人报酬	0.00	0.00
2、托管费	24,249.58	63,286.94
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	0.00	33,770.25
5、利息支出	58,446.68	154,300.92
其中：卖出回购金融资产支出	58,446.68	154,300.92
6、其他费用	3,560.35	7,020.39

三、利润总和	1,332,067.41	2,879,665.19
--------	--------------	--------------

(二) 集合计划投资组合报告 (2015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	456,039.62	0.81%
债券投资	45,150,104.11	80.14%
证券投资基金	499.99	0.00%
信托产品投资	0.00	0.00%
其他资产	10,729,336.03	19.05%
资产总值	56,335,979.75	100.00%

注:其他资产包括:应收利息、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/张)	期末市值 (人民币元)	市值占集合计划资产净值比例
1	13 丰投 01	118175	300,000	30,000,090.41	60.85%
2	12 河钢 01	112164	100,000	10,150,000.00	20.59%
3	12 福星门	118038	50,000	5,000,013.70	10.14%
4	华宝添益	511990	5	499.99	0.00%

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：

买入返售金融资产	8,704,063.46
应收证券清算款	0.00
应收利息	2,025,272.57
合计（人民币元）	10,729,336.03

（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
47,608,310.02	0.00	0.00	47,608,310.02

五、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、《旗峰多盈3号集合资产管理计划说明书》
- 2、《旗峰多盈3号集合资产管理合同》

3、《旗峰多盈 3 号集合资产管理计划托管协议》

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：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：李娜

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 7 月 17 日