

旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划 2015 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 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 10 月 22 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 7 月 1 日 - 2015 年 9 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： 无固定存续期限

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 7 月 1 日-2015 年 9 月 30 日
1	集合计划本期利润	-4,565,619.48
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-894,026.35
3	单位集合计划净收益	-0.0252
4	期末集合计划资产净值	33,096,344.76
5	单位集合计划资产净值	0.9341
6	本期集合计划净值增长率	-7.82%
7	集合计划累计净值增长率	-3.05%

（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 9 月 30 日，集合计划单位净值为 0.9341 元，本期净值增长率为-7.82%，集合计划单位累计净值为 0.9695 元，集合计划累计净值增长率为-3.05%。

（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

回顾三季度行情，市场遭遇多重利空打击，大幅下挫。首先，六月末管理层清查配资，其影响的时间和力度都超出市场普遍预期。其次，八月末人民币大幅贬值以及对于美元加息的预期，导致市场对资本外流的担心日益加剧。此外，宏观经济继续疲弱，上半年疯涨的创业板面临着高估值和部分预期被证伪等因素也压制着市场的情绪。虽然管理层陆续推出多重救市措施，但市场仍然连续击穿多个整数关口。9月，市场在跌破3000点之后出现企稳迹象，主板持续缩量，而创业板个股开始活跃，部分业绩优良且估值逐渐进入合理区域的个股开始受到资金关注。三季度，旗峰2号主要以低仓位应对市场的系统性风险，间或参与了部分个股的反弹机会，净值回撤幅度大幅优于指数。

2、投资管理展望

宏观经济依然疲弱，8月份工业利润同比大降，由7月份同比下降2.9%转为8月份同比下降8.8%；累计降幅大幅扩大，由上个月的-1%下降到-1.9%。9月财新制造业PMI初值47.0，比上月下降0.3个百分点，创2009年3月以来最低。

近期市场利空因素释放的较为充分，其一9月30日是清理配置的大限，预计10月这一因素的影响将消退；其二美联储9月议息会议决定暂不加息，人民币在8月快速贬值后近期保持稳定，市场对于汇率贬值的担忧有所缓解。此外，10月将召开十八届五中全会，制定十三五规划，政策面上会对市场有一定的刺激。

预计四季度预计市场震荡上行的概率较大。一方面，如上所述，利空因素基本出尽，目前最大的不确定性在于三季报，但市场对于较差的三季报已经有了一定的预期，只要三季报不会超预期的差可能就不会对市场构成重大影响；另一方面，目前公募，私募仓位均较低，场外资金稍有进场即可能推动市场上行。经过三季度的大幅下跌，很多个股又重新进入到合理的价值区间。未来我们将重点关注以下几个板块：一是国企改革，央企整合；二是在估值进入合理区域的成长股。

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9月30日）

单位：人民币元

项目	2015年9月30日	年初余额
资 产:		
银行存款	6,153,572.43	12,419,557.30
结算备付金	246,240.39	1,437,485.21
存出保证金	155,276.44	70,318.85
交易性金融资产	18,095,455.40	66,262,660.52
其中: 股票投资	8,095,455.40	43,698,730.17
债券投资	0.00	15,400,965.00
基金投资	10,000,000.00	7,162,965.35
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	8,866,100.00	1,699,942.33
应收利息	1,744.40	748,799.85
应收股利	746.70	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	33,519,135.76	92,638,864.06
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	317,338.63	11,176,447.49
应付赎回款	0.00	0.00

应付管理人报酬	22,665.39	70,600.68
应付托管费	7,555.14	17,650.18
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	71,491.74	99,749.23
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	3,740.10	5,000.00
负债合计	422,791.00	11,369,447.58
所有者权益：		
实收基金	35,431,516.73	111,928,148.31
未分配利润	-2,335,171.97	-30,658,731.83
所有者权益合计	33,096,344.76	81,269,416.48
负债和所有者权益总计	33,519,135.76	92,638,864.06

2、集合计划利润表(2015年7月1日至2015年9月30日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	-4,188,442.91	32,568,420.46
1、利息收入	135,902.55	415,973.34
其中：存款利息收入	61,093.98	131,527.07
债券利息收入	69,545.22	204,010.83
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	5,263.35	80,435.44
2、投资收益	-652,752.33	34,221,441.97
其中：股票投资收益	-719,634.03	33,301,555.27
债券投资收益	-11,250.00	94,076.62
基金投资收益	63,134.14	538,119.72

权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	14,997.56	287,690.36
3、公允价值变动收益	-3,671,593.13	-2,068,994.85
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	377,176.57	3,224,552.30
1、管理人报酬	93,909.26	535,211.28
2、托管费	27,053.70	137,379.18
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	245,953.21	2,520,241.74
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	10,260.40	31,720.10
三、利润总和	-4,565,619.48	29,343,868.16

(二) 集合计划投资组合报告 (2015 年 9 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	6,555,089.26	19.56%
股票投资	8,095,455.40	24.15%
证券投资基金	10,000,000.00	29.83%
债券投资	0.00	0.00%
其他资产	8,868,591.10	26.46%
资产总值	33,519,135.76	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	160609	鹏华货币 B	10,000,000	10,000,000.00	30.21%
2	300207	欣旺达	65,000	1,623,700.00	4.91%
3	300232	洲明科技	60,000	1,230,000.00	3.72%
4	300284	苏交科	40,100	872,576.00	2.64%
5	2185	华天科技	60,000	804,600.00	2.43%
6	300097	智云股份	20,000	705,000.00	2.13%
7	2488	金固股份	33,724	652,559.40	1.97%
8	601766	中国中车	50,000	648,500.00	1.96%
9	300136	信维通信	20,000	555,400.00	1.68%
10	300182	捷成股份	12,000	522,120.00	1.58%

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)	1,744.40
应收股利	746.70
证券清算款	8,866,100.00
买入返售金融资产	0.00
合计(人民币元)	8,868,591.10

(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
64,466,938.78	41,913,059.41	70,948,481.46	35,431,516.73

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 24 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10月26日