

旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划 2015 年第四季度资产管理报告

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 2016 年 1 月 19 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 10 月 1 日—2015 年 12 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： 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 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日
1	集合计划本期利润	2,979,231.31
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	3,170,570.36
3	单位集合计划净收益	0.1492
4	期末集合计划资产净值	21,705,683.66
5	单位集合计划资产净值	1.0217
6	本期集合计划净值增长率	9.38%
7	集合计划累计净值增长率	5.71%

（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 12 月 31 日，集合计划单位净值为 1.0217 元，本期净值增长率为 9.38%，集合计划单位累计净值为 1.0571 元，集合计划累计净值增长率为 5.71%。

（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

回顾四季度行情，市场在经过第三季度的连续下跌之后于9月末逐渐企稳，配资清理也于9月末基本结束，市场在四季度出现一波反弹，创业板指数表现较强，最高逼近3000点这一8月成交密集区。IPO重启，券商自营盘允许卖出，注册制推出时间明确等宣告市场重回常态，投资者的注意力重新转移到经济基本面，流动性，改革预期等方面。疲弱的基本面，宽裕的流动性以及改革预期共同驱动创业板领涨市场，主板仅在国企改革，险资举牌等事件驱动下有脉冲性机会。临近四季度末，虽然美联储加息落地，但市场的担忧转向一月份即将到期的限售股解禁禁令，加之连续反弹之后逼近前期成交密集区，市场转为区间震荡。四季度，在利空基本出尽之后，旗峰2号逐步加大了仓位，配置方向上仍以成长股为主，间或参与了周期股的交易性机会，净值有一定的上涨。

2、投资管理展望

宏观经济依然疲弱，1-11 月份，全国规模以上工业企业利润总额同比下降 1.9%，降幅较 1-10 月份缩小 0.1 个百分点。单个月来看，11 月份规模以上工业企业利润总额同比下降 1.4%，降幅较 10 月收窄 3.2 个百分点。

中央经济工作会议提出，2016 年要更加注重供给侧结构性改革，主要是抓好去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大任务，积极稳妥化解产能过剩、帮助企业降低成本、化解房地产库存、扩大有效供给、防范化解金融风险，并多次提及资本市场在其中承担重要使命。央行宣布从 2016 年起将现有的差别准备金动态调整和合意贷款管理机制升级为宏观审慎评估体系（MPA）

展望 1 月，大方向来看，资产荒导致大类资产配置向股市转移短期难以证伪，险资频频举牌即可验证这一逻辑。1 月份是宏观数据，企业年报等的真空期，政策面也相对平淡，注册证尚未执行，美联储加息于 12 月落地，1 月连续加息的可能微乎其微。1 月份最大的扰动因素就在于大股东解禁禁令将于 1 月 8 日到期，据估算解禁金额达到 8300 亿，当然实际不可能全部在 1 月份卖出，但仍对市场构成心理影响，需关注管理层是否会出台安抚措施减缓解禁对市场构成的冲击。另外需关注人民币汇率的走势，虽然人民币大幅贬值的可能性不大，但如果持续的贬值也会对市场构成压制。

重点板块上新兴产业仍然是主要的配置方向，同时密切关注险资举牌等因素带来的周期板块短期博弈机会。

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 (2015 年 12 月 31 日)

单位:人民币元

项目	2015 年 12 月 31 日	年初余额
资 产:		
银行存款	10,290,544.94	12,419,557.30
结算备付金	548,935.33	1,437,485.21
存出保证金	101,220.83	70,318.85
交易性金融资产	11,397,336.62	66,262,660.52
其中: 股票投资	11,389,514.96	43,698,730.17
债券投资	0.00	15,400,965.00
基金投资	7,821.66	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	0.00	1,699,942.33
应收利息	2,164.24	748,799.85
应收股利	1,531.31	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	22,341,733.27	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	544,227.52	11,176,447.49
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	13,461.20	70,600.68
应付托管费	4,487.08	17,650.18
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	68,873.81	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	5,000.00	5,000.00
负债合计	636,049.61	11,369,447.58
所有者权益：		
实收基金	21,243,936.50	111,928,148.31
未分配利润	461,747.16	-30,658,731.83
所有者权益合计	21,705,683.66	81,269,416.48
负债和所有者权益总计	22,341,733.27	92,638,864.06

2、集合计划利润表(2015年10月1日至2015年12月31日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	3,440,979.80	36,009,400.26
1、利息收入	17,768.59	433,741.93
其中：存款利息收入	16,652.48	148,179.55
债券利息收入	0.00	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	1,116.11	81,551.55
2、投资收益	3,614,550.26	37,835,992.23
其中：股票投资收益	3,343,020.67	36,644,575.94
债券投资收益	0.00	94,076.62
基金投资收益	260,618.38	798,738.10
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	10,911.21	298,601.57
3、公允价值变动收益	-191,339.05	-2,260,333.90
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	461,748.49	3,686,300.79
1、管理人报酬	48,798.56	584,009.84
2、托管费	16,266.22	153,645.40
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	380,409.24	2,900,650.98
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	16,274.47	47,994.57
三、利润总和	2,979,231.31	32,323,099.47

（二）集合计划投资组合报告（2015年12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 出保证金合计	10,940,701.10	48.97%
股票投资	11,389,514.96	50.97%
证券投资基金	7,821.66	0.04%
债券投资	0.00	0.00%
其他资产	3,695.55	0.02%
资产总值	22,341,733.27	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	电旗股份	832853	300,000.00	2,865,000.00	13.20%
2	信维通信	300136	70,000.00	2,068,500.00	9.53%
3	奥瑞金	2701	40,000.00	1,130,400.00	5.21%
4	欧浦钢网	2711	31,998.00	1,120,569.96	5.16%
5	胜利精密	2426	30,000.00	780,600.00	3.60%
6	神州泰岳	300002	59,450.00	778,795.00	3.59%
7	东港股份	2117	15,000.00	690,300.00	3.18%
8	金龙机电	300032	20,000.00	608,000.00	2.80%
9	欣旺达	300207	20,000.00	562,000.00	2.59%
10	鹏博士	600804	20,000.00	474,400.00	2.19%

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）	2,164.24
应收股利	1,531.31
证券清算款	0.00
买入返售金融资产	0.00
合计（人民币元）	3,695.55

（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
35,431,516.73	3,521,246.36	17,708,826.59	21,243,936.50

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

2016 年 1 月 19 日