

兴业证券金麒麟 1 号集合资产管理计划 2015 年年度报告



计划管理人：兴证证券资产管理有限公司

计划托管人：兴业银行股份有限公司

报告期间：2015-01-01 至 2015-12-31

重要提示

本报告依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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。

中国证监会于2008年12月30日对兴业证券金麒麟1号（原名：兴业卓越1号）集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”），出具了批准文件（《关于核准兴业证券股份有限公司设立兴业卓越1号集合资产管理计划的批复》，证监机构字[2008]1468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。

管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

托管人已于2016年3月25日复核了本报告。保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本集合计划2015年年度报告的财务资料已经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

目 录

一、集合计划简介.....	4
二、主要财务指标.....	8
三、集合计划管理人报告.....	9
四、集合计划财务报告.....	12
五、集合计划投资组合报告.....	17
六、集合计划持有人户数、持有人结构.....	19
七、重要事项提示.....	20
八、备查文件目录.....	21

一、集合计划简介

(一) 基本资料

产品名称：兴业证券金麒麟 1 号

产品类型：集合资产管理计划

计划运作方式：通过筹集委托人资金交由托管人托管，由集合资产管理计划管理人统一管理和运用，投资于中国证监会认可的投资品种，并将投资收益按比例分配给委托人。

投资目标：2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 7 日：本集合计划属于稳健型的限定性集合资产管理计划，主要投资于公司债，并辅以其他固定收益类和现金类金融工具的投资，在强调本金安全、严格控制风险和满足充分流动性的前提下充分把握公司债券市场的历史性发展机遇，实现本计划资产的稳定增值。

2015 年 12 月 8 日-2015 年 12 月 31 日：本集合计划属于相对保守型的集合资产管理计划，主要投资于公司债，并辅以其他固定收益类和现金类金融工具的投资，在优先考虑本金安全性、严格控制风险和满足充分流动性的前提下充分把握公司债券市场的历史性发展机遇，实现本计划资产的稳定增值。

投资策略：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 7 日：

投资范围：（1）本集合计划主要投资于公司债；

（2）投资于国债、金融债、央行票据、中期票据、企业债、可转换公司债、短期融资券、资产支持证券、债券型开放式基金、债券正回购和逆回购、银行定期存款和协议存款及中国证监会认可的其他固定收益类品种；

（3）投资于银行活期存款和通知存款、货币市场基金、期限不超过 28 天的债券逆回购等短期金融工具；

（4）参与新股和新债网下、网上申购；

（5）法律法规和中国证监会允许集合计划投资的其他品种。

本集合计划的投资组合比例为：

（1）固定收益类品种，主要为公司债，还包括国债、金融债、央行票据、中期票据、企业债、可转换公司债、短期融资券、资产支持证券、债券型开放式基金、银行定期存款和协议存款及中国证监会认可的其他固定收益类品种：20-95%。其中，公司债比例不低于 10%，可转债比例不高于 30%；

（2）短期金融工具，包括银行活期存款和通知存款、货币市场基金、期限不超过 28 天的债

券逆回购等资产比例：5-100%；

(3) 通过一级市场申购、可转债转股等方式所形成的股票资产：0-20%。其中，单只股票资产不得超过计划净值的 10%（由于申购新股或可转债转股等方式导致超过该比例上限的股票资产，应于其可交易之日起 5 个工作日内卖出超过部分以符合该比例）；

(4) 本集合计划参与证券回购融入资金余额不得超过资产净值的 40%；

(5) 管理人应自本集合计划投资运作期开始之日起 3 个月内使集合计划的投资组合比例符合上述资产组合设计的要求。因证券市场波动、投资对象合并、集合计划规模变动等外部因素致使集合计划的投资组合比例不符合上述规定的，管理人应当在 10 个工作日内进行调整。

2015 年 12 月 8 日至 2015 年 12 月 31 日：

1、投资范围

(1) 本集合计划主要投资于公司债；(2) 投资于国债、金融债、央行票据、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、企业债、中小企业私募债、可转换公司债、短期融资券、资产支持证券（含资产支持收益凭证、资产支持票据等）、债券型基金、分级基金优先级份额、债券正回购和逆回购、银行存款、同业存单、大额存单、商业银行理财计划、有明确预期收益率的集合资金信托计划及中国证监会认可的其他固定收益类品种；(3) 投资于银行活期存款和通知存款、货币市场基金、期限不超过 28 天的债券逆回购等短期金融工具；(4) 在相关政策法规允许的前提下，参与新股和新债网下、网上申购；(5) 法律法规和中国证监会允许集合计划投资的其他品种。

2、投资组合比例

本集合计划的投资组合比例为：(1) 固定收益类品种，主要为公司债，还包括国债、金融债、央行票据、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、企业债、中小企业私募债、可转换公司债、短期融资券、资产支持证券（含资产支持收益凭证、资产支持票据等）、债券型基金、分级基金优先级份额、银行存款、同业存单、大额存单、商业银行理财计划、有明确预期收益率的集合资金信托计划及中国证监会认可的其他固定收益类品种：占资产总值的 0-95%。其中，中小企业私募债投资比例不高于资产总值的 40%，单只中小企业私募债投资比例不超过资产总值的 5%，可转债比例不高于资产总值的 30%，有明确预期收益率的集合资金信托计划投资比例不超过资产总值的 20%；(2) 短期金融工具，包括银行活期存款和通知存款、货币市场基金、期限不超过 28 天的债券逆回购等资产比例：不低于资产净值的 5%；(3) 通过一级市场申

购、可转债转股等方式所形成的股票资产：占资产总值的0-20%。其中，单只股票资产不得超过计划净值的10%（由于申购新股或可转债转股等方式导致超过该比例上限的股票资产，应于其可交易之日起5个交易日内卖出超过部分以符合该比例）；（4）本集合计划参与证券回购融入资金余额不得超过资产净值的40%。

比较基准：2015年1月1日至2015年12月7日：中信标普全债指数

风险收益特征：2015年1月1日-2015年12月7日：本集合计划属于“保守型”的理财产品，适合向“保守型”及高于“保守型”的投资者推广。

2015年12月8日-2015年12月31日：本集合计划属于“相对保守型”的理财产品，适合向“相对保守型”及高于“相对保守型”的投资者推广。

合同生效日、成立日期：2009年3月27日

成立规模：1,878,241,178.12

存续期：不设固定存续期限

（二）管理人：兴证证券资产管理有限公司

住所：福建省平潭综合实验区管委会现场指挥部办公大楼一楼

法定代表人：刘志辉

联系地址：上海市民生路1199弄3号楼

联系电话：021-38565866

传真：021-38565863

联系人：龚苏平

网址：www.ixzzcgl.com

（三）托管人：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

邮政编码：350001

法定代表人：高建平

联系电话：021-62677777-212036

传真：021-62159217

联系人：罗敏

网址: www.cib.com.cn

(四) 会计师事务所简介

名称: 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址: 上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

执行事务合伙人: 卢伯卿(LU POCHIN CHRISTOPHER)

联系电话: 021-23166376

经办注册会计师: 陶坚、宫明亮

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12月7日
1	集合计划本期利润	19,665,386.08
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	16,815,102.88
3	加权平均计划份额本期利润	0.1065
4	期末集合计划资产总值	200,207,067.15
5	期末集合计划资产净值	143,109,162.03
6	期末单位集合计划资产净值	1.1888
7	期末累计单位集合计划资产净值	1.5088
8	本期单位集合计划净值增长率	11.24%
9	单位集合计划累计净值增长率	59.98%

单位: 人民币元

	主要财务指标	2015年12月8日—2015年12月31日
1	本期已实现收益	1,101,768.50
2	本期利润	1,101,768.50
3	期末资产净值	505,663,508.77

(二) 财务指标计算公式

$$(1) \text{ 加权平均单位集合计划本期利润} = \left(\frac{P}{S_0 + \sum_{i=1}^n \frac{\Delta S_i \times (n-i)}{n}} \right)$$

其中: P为本期利润, s0为期初集合计划单位总份额, n为报告期内所含的交易天数, i为报告期内的第i个交易日, $\Delta S_i = i$ 交易日集合计划单位总份额 - (i-1) 交易日集合计划单位总份额。

(2) 本期集合计划净值增长率 = [(本期第一次分红前单位净值 ÷ 期初单位净值) × (本期第二次分红前单位净值 ÷ 本期第一次分红后单位净值) × …… × (期末单位净值 ÷ 本期最后一次分红后单位净值) - 1] * 100%

若只有1次分红, 本期集合计划净值增长率 = [(分红前一天单位净值 / 期初单位净值) * (期末单位净值 / (分红前一天单位净值 - 单位分红金额)) - 1] * 100%

其中:

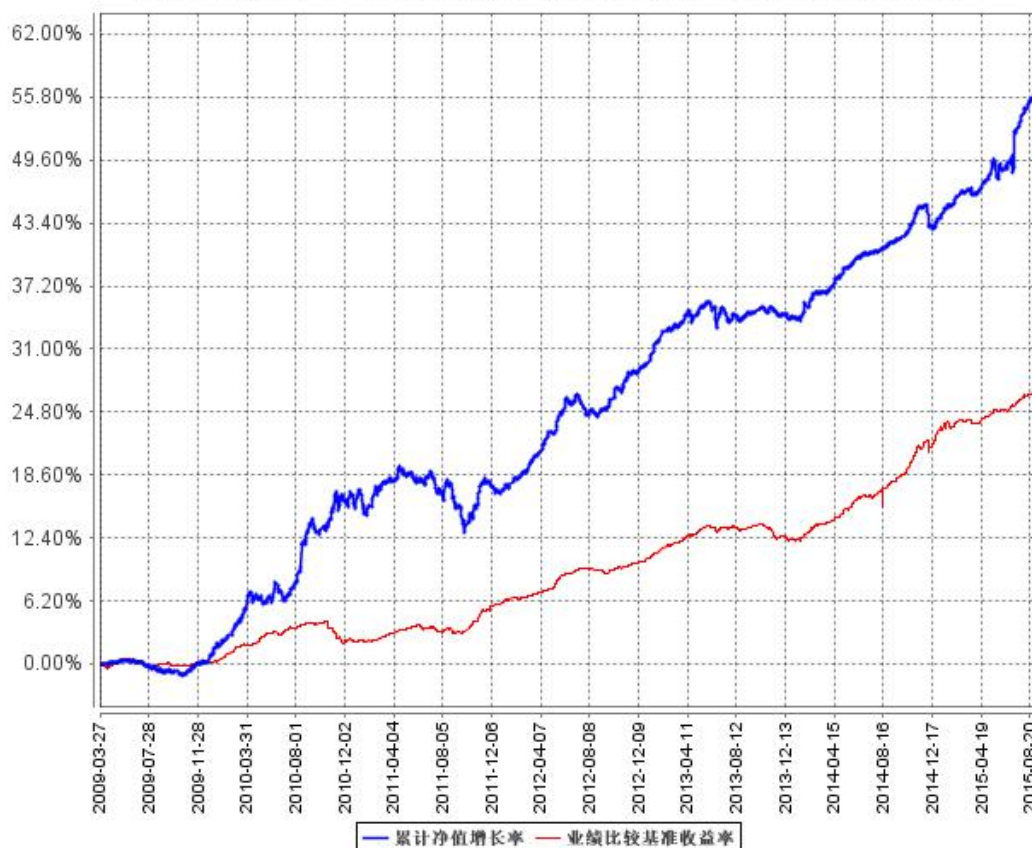
分红前单位净值按除息日前一交易日的单位净值计算

分红后单位净值 = 分红前一日单位净值 - 单位分红金额

(三) 集合计划累计净值增长率与比较基准收益率的历史走势对比图

1、2015年1月1日—2015年12月7日

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



(四) 集合计划收益分配情况

年度	每 10 份计划份额分红数 (元)	备注
2015-12-08	1.88	-
2015-04-20	0.10	-

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

1、2015年1月1日至2015年12月7日，本计划净值涨幅为8.70%，而本计划的业绩比较基准“中信标普全债指数”涨幅为4.18%。

2、2015年12月8日—2015年12月31日，本计划净值收益率为0.4217%。

(二) 投资经理简介

陆成来: 上海财经大学统计学专业博士, 现任兴证资管副总经理兼固定收益部总监。2002年5月至2012年9月历任兴业证券资产管理分公司副总监、兴业证券股份有限公司研究所策略

部经理、资深研究员，固定收益部投资经理、总经理助理、董事副总经理，兴业证券客户资产管理部副总监兼投资主办。2011年9月至2012年9月任兴业证券金麒麟5号投资主办。2012年9月进入中海基金管理有限公司工作，曾任投资副总监兼固定收益部总监。2013年1月至2015年5月任中海惠裕纯债分级基金基金经理，2013年9月至2015年5月任中海惠丰纯债分级基金基金经理，2013年11月至2015年5月任中海惠利纯债分级基金基金经理。

何林泽：南开大学金融工程硕士，现任兴证证券资产管理有限公司投资经理。历任兴业证券资产管理分公司固定收益与金融工程研究员、投资经理助理。

（三）投资经理工作报告

1、投资回顾

2015年的债券市场延续了2014年的牛市走势，债券收益率持续下行，仅在1季度末和11月初出现较为明显的调整。具体来看：（1）2014年12月初由于中证登对企业债质押入库政策调整导致债券市场出现了较大程度的调整，不过在短暂的事件性冲击后，债券市场于12月底企稳，进入2015年1季度后，在年初机构刚性配置需求驱动及宽松货币政策引导下，债券市场收益率重回下行趋势，3月中下旬，持续的IPO扰动导致资金面出现波动，而天量地方债置换计划也使得债券市场持续承压，债券市场整体在3月中下旬出现了明显的调整。（2）进入2季度后，随着地方债相关配套政策的出台，地方债的需求端迎来新的解决途径，债券市场承压减轻，而2季度货币政策进一步的宽松使得债券市场收益率持续下行，进入6月后，随着半年时间点的临近以及IPO的持续冲击，流动性小幅趋紧，而5、6月份股票市场几近疯狂的状态对债券市场也产生了一定的挤出效应，债券市场在6月份随之出现小幅调整。（3）进入3季度后，在6月底股灾影响下，7月初IPO突然暂停，大量以打新为首的低风险偏好资金被动涌入债券市场，在巨大配置需求下，债券市场收益率在3季度一路下行，中途几乎没有出现过任何调整。（4）进入4季度后，在配置需求驱动下债券市场收益率在10月份继续下行，10月中旬天威英利中票出现违约，11月初山水短融意外违约，两起违约事件尤其是山水违约事件导致市场对信用债的信用风险担忧大幅发酵，信用债收益率随之出现明显调整，进入12月份后，经过市场一个月的消化，债券市场企稳，债券市场收益率也重回下行态势。

我们在2014年度资产管理报告中，肯定了经济基本面、通胀水平及货币政策对2015年债券市场的支撑作用，同时我们注意到经济基本面持续走弱背景下，微观企业信用风险会持续上升，这一点都在2015年债券市场中得到了验证。经济增长速度换挡期、结构调整阵痛期、前期刺激政策消化期“三期叠加”背景下，低利率是必然要求，引导利率下行也成为央行2015年货币政策的重要目标，这些因素都导致了债券市场出现了历史罕见的持续两年的大牛市。在产品运作方面，“金麒麟1号”在2015年的收益率高于业绩基准收益率，主要是我们适当拉长了债券组合久期并加大了杠杆操作力度，这使得本产品收益率在收益率下行趋势中获得较明显的超额收益，此外，我们适时参与了一些分级基金优先级的波段操作，增强了产品收益率。

截止2015年12月7日，“金麒麟1号”2015年的投资收益率为11.24%，高于业绩比较基准“中信标普全债指数”的涨幅，而从15年12月8日起，产品合同进行了变更，新合同生效后，投资收益率这一指标不再适用于“金麒麟1号”。

截止2015年12月31日，“金麒麟1号”持仓中：债券市值为4.7亿元，占资产净值的92.7%；基金市值为0.2亿元，占资产净值的3.95%。

2、市场展望与投资计划

对于2016年的债券市场，我们依然认为经济基本面、通胀水平和货币政策是有利于债券市场的，“三期叠加”背景下，低利率环境是实体经济回暖的必然需求，我们认为2016年债

券的收益率仍有继续下降的空间，但下降幅度相比2015、2014年相对有限。宏观经济增速中枢2016年大概率将继续下移，房地产投资和制造业投资都会继续保持低位，基建投资作为经济托底的手段在2016年力度会加大但刺激效果很难有太多期待，服务业和消费是推动经济增长最有活力的因素，但力度仍然有限；从通货膨胀的角度来看，需求疲弱和大宗商品的弱周期使得2016年的通胀水平仍将保持低位；因此宏观基本面是有利于债券慢牛延续的，而从货币政策的角度来看，在降低社会融资成本的目标下，央行货币政策很难收紧，但进一步宽松却一方面受制于人民币贬值压力，另一方面受制于持续宽松背景下金融体系风险上升，因此虽然2016年货币政策难以收紧，但继续大幅宽松亦较难期待，不过总体来说，中性略松的货币政策环境对债券市场仍是有利的。我们认为2016年债券市场的利率波动风险相对有限，最大风险来自信用风险的不断上升，宏观经济的持续走弱导致微观企业经营的不断恶化，我们预计2016年信用违约事件会继续增加。

基于上述理由，我们依然看好2016年债券市场的慢牛走势，投资者仍将获得票息与资金利得的双重收益，而我们在投资上一方面要根据产品流动性的需要，安排好产品久期和杠杆水平，以充分享受债券牛市的收益，但同时要强化个券信用风险的甄别工作，以最大限度地规避信用风险。

（四）风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2、风险控制报告

2015年，集合计划管理人通过独立的风险管理部门，对各项业务风险进行全面的监督、检查和评价。公司设立风险管理部，通过系统监控和人工检查相结合的方式，对集合资产管理计划的投资风险、信用风险、操作风险等进行全面的监督和检查，同时在交易系统中对各类风险指标进行限制，实现交易的事前控制，确保集合资产管理计划合法合规。对日常集合资产管理计划出现的各类问题，风险管理部及时进行风险提示，提出合规管理与风险管理建议，并督促相关部门及时整改。

经过审慎核查，截至2015年12月31日，本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；因产品规模变动、证券市场波动等原因，本集合计划在报告期内存在单只证券投资比例不符合合同约定的情况，管理人已在规定的时间内予以调整，并及时向福建证监局及中国证券投资基金业协会报告；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。集合计划管理人通过动态评估集合计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保本集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

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

期间：2015年1月1日—2015年12月7日

单位：人民币元

资产	期末余额	年初余额	负债和所有者 权益	期末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	7,025,678.36	1,938,518.05	短期借款	-	-
结算备付金	1,117,385.01	1,332,222.43	交易性金融负债	-	-
存出保证金	217,838.44	18,321.78	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	181,762,996.98	498,019,200.90	卖出回购金融资产款	56,999,045	29,999,700
其中：股票投资			应付证券清算款	-	1,666.70
债券投资	176,546,599.99	460,899,264.85	应付赎回款	-	-
资产支持证券投资	-	10,000,000	应付赎回费	-	-
基金投资	5,216,396.99	27,119,936.05	应付管理人报酬	18,370.42	330,977.58
衍生金融资产	-	-	应付托管费	4,935.34	88,919.35
买入返售金融资产		100,000,510	应付销售服务费	-	-
应收证券清算款	5,087,504.30		应付交易费用	14,496.32	5,110.82
应收利息	4,966,017.78	11,790,739.62	应付税费	-	-
应收股利	29,646.28	-	应付利息	23,687.85	-
应收申购款	-	-	应付利润	-	-
其他资产	-	-	其他负债	37,370.19	50,000
			负债合计	57,097,905.12	30,476,374.45
			所有者权益：	-	-
			实收基金	120,377,399.56	540,236,500.46

			未分配利润	22,731,762.47	42,386,637.87
			所有者权益合计	143,109,162.03	582,623,138.33
资产合计:	200,207,067.15	613,099,512.78	负债与持有人权益总计:	200,207,067.15	613,099,512.78

期间：2015年12月8日—2015年12月31日

单位：人民币元

资产	期末余额	年初余额	负债和所有者权益	期末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	109,140,026.99		-短期借款	-	-
结算备付金	1,117,385.01		-交易性金融负债	-	-
存出保证金	217,838.44		-衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	489,149,908.83		-卖出回购金融资产款	64,998,645.00	-
其中：股票投资	-		-应付证券清算款	100,012,063.17	-
债券投资	455,957,673.17		-应付赎回款	-	-
资产支持证券投资	13,185,736.98		-应付赎回费	-	-
基金投资	20,006,498.68		-应付管理人报酬	941,720.34	-
衍生金融资产	-		-应付托管费	16,095.26	-
买入返售金融资产	65,000,325.00		-应付销售服务费	-	-
应收证券清算款	-		-应付交易费用	40,587.27	-
应收利息	8,142,985.05		-应付税费	-	-
应收股利	15,989.69		-应付利息	19,817.36	-
应收申购款	-		-应付利润	1,052,021.84	-
其他资产	-		-其他负债	40,000.00	-
			负债合计	167,120,950.24	-
			所有者权益：		
			实收基金	505,663,508.77	-
			未分配利润	-	-
			所有者权益合计	505,663,508.77	-
资产合计：	672,784,459.01		负债与持有人权益总计：	672,784,459.01	-

2、集合计划经营业绩表(2015-01-01至2015-12-31)

计划管理人及编制人：兴证证券资产管理有限公司

期间：2015年1月1日—2015年12月7日 单位：人民币元

项 目	本期金额	上期金额
一、收入	22,896,667.21	25,211,177.01
1、利息收入	13,154,942.51	16,569,996
其中：存款利息收入	251,938.92	249,256.03
债券利息收入	12,167,572.82	15,061,939.97
资产支持证券利息收入	471,342.47	208,657.53
买入返售金融资产收入	264,088.30	1,050,142.47
2、投资收益（损失以“-”填列）	6,891,441.50	5,544,264.21
其中：股票投资收益		
债券投资收益	-104,675.46	-1,382,465.29
资产支持证券投资		
基金投资收益	6,996,116.96	6,926,729.50
权证投资收益		
衍生工具收益		
股利收益		
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	2,850,283.20	3,096,916.80
4、其他收入（损失以“-”填列）		
二、费用	3,231,281.13	3,437,976.84
1、管理人报酬	1,315,136.26	2,542,257.61
2、托管费	353,320.17	682,994.51
3、销售服务费		
4、交易费用	578,552.56	48,038.40
5、利息支出	898,488.11	97,392.35
其中：卖出回购金融资产支出	898,488.11	97,392.35
6、其他费用	85,784.03	67,293.97
三、利润总额	19,665,386.08	21,773,200.17

期间：2015年12月8日—2015年12月31日 单位：人民币元

项 目	本期金额	上期金额
一、收入	2,138,216.76	-

1、利息收入	2,156,137.37	-
其中：存款利息收入	50,955.18	-
债券利息收入	2,097,154.15	-
资产支持证券利息收入	6,958.08	-
买入返售金融资产收入	1,069.96	-
2、投资收益（损失以“-”填列）	-17,920.61	-
其中：股票投资收益	-	-
债券投资收益	-40,410.01	-
资产支持证券投资	-	-
收益	-	-
基金投资收益	22,489.40	-
权证投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-	-
4、其他收入（损失以“-”填列）	-	-
二、费用	1,036,448.26	-
1、管理人报酬	920,722.98	-
2、托管费	10,454.18	-
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	-	-
5、利息支出	101,750.88	-
其中：卖出回购金融资产支出	101,750.88	-
6、其他费用	3,520.22	-
三、利润总额	1,101,768.50	-

3、集合计划所有者权益(资产净值)变动表（2015-01-01至2015-12-31）

计划管理人及编制人：兴证证券资产管理有限公司 单位：人民币元

2015年1月1日-2015年12月7日

项 目	本金额			上年金额		
	实收计划	未分配利润	所有者权益合计	实收计划	未分配利润	所有者权益合计
一、年初所有者权益（计划净值）	540,236,500.46	42,386.63	582,623.1	149,657,518.	9,747,286.40	159,404,804.72

		7.87	38.33	32		
二、本年经营活动产生的计划净值变动数（本年净利润）	-	19,665,386.08	19,665,386.08		21,773,200.17	21,773,200.17
三、本年计划份额交易产生的计划净值变动数（减少以“-”号填列）	-419,859,100.90	-37,645,347.10	-457,504,448	390,578,982.14	17,408,216.67	407,987,198.81
其中：1、计划申购款	12,764,433.24	1,581,556.60	14,345,989.84	645,994,672.28	34,862,509.67	680,857,181.95
2、计划赎回款	432,623,534.14	39,226,903.70	471,850,437.84	255,415,690.14	17,454,293	272,869,983.14
四、本年向计划份额持有人分配利润产生的计划净值变动数	-	1,674,914.38	1,674,914.38		6,542,065.37	6,542,065.37
五、年末所有者权益（计划净值）	120,377,399.56	22,731,762.47	143,109,162.03	540,236,500.46	42,386,637.87	582,623,138.33

2015年12月8日-2015年12月31日

项目	本年金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（净值）	115,597,838.26	-	-
二、本期经营活动产生的净值变动数（本期利润）	-	1,101,768.50	1,101,768.50
三、本期基金份额交易产生的净值变动数（净值减少以“-”号填列）	390,065,670.51	-	390,065,670.51
其中：1. 申购款	392,081,986.30	-	392,081,986.30
2. 赎回款（以“-”号填列）	2,016,315.79	-	2,016,315.79
四、本期向份额持有人分配利润产生的净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	1,101,768.50	1,101,768.50
五、期末所有者权益（净值）	505,663,508.77	-	505,663,508.77

五、集合计划投资组合报告

(一) 期末集合资产组合情况

日期：2015年12月31日

单位：人民币

序号	项 目	金额（元）	占总资产比例%
1	固定收益投资	469,143,410.15	69.73
	其中：债券	455,957,673.17	67.77
	资产支持证券	13,185,736.98	1.96
2	买入返售金融资产	65,000,325.00	9.66
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	110,257,412.00	16.39
4	其他资产	28,383,311.86	4.22
5	合计	672,784,459.01	100.00

(二) 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占集合计划资产净值比例（%）	
1	报告期内债券融资余额		16.13%
	其中：买断式回购融资		0.00%
序号	项目	金额	占集合计划资产净值比例（%）
2	报告期末债券融资余额	64,998,645.00	12.85%
	其中：买断式回购融资	-	-

(三) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	405,940,079.88	80.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	50,017,593.29	9.89
8	合计	455,957,673.17	90.17

(四) 按市值占净值比例排序的期末投资证券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (份)	摊余成本	占期末计划 净值的比例
----	------	------	-------------	------	----------------

					(%)
1	101569028	15 泛海 MTN001(总价)	450,000	45,391,057.43	8.98
2	122219	12 榕泰债(总价)	382,610	39,046,996.17	7.72
3	112145	13 荣信 01(总价)	300,000	30,158,594.52	5.96
4	125691	15 白沙洲(总价)	300,000	30,000,000.00	5.93
5	136109	15 康达债(总价)	300,000	29,989,190.63	5.93
6	122327	13 卧龙债(总价)	280,400	29,207,918.22	5.78
7	1180182	11 泛海 01(总价)	200,000	21,567,252.68	4.27
8	125703	15 惠憬 01(总价)	200,000	20,017,593.29	3.96
9	112193	13 美邦 01(总价)	196,000	19,679,121.11	3.89
10	112168	12 三维债(总价)	157,180	14,928,611.50	2.95

(三) 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, 无报告期内发行主体被监管部门立案调查的, 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, 没有投资于超出集合资产管理计划合同规定范围之外的证券

六、集合计划持有人户数、持有人结构

(一) 持有人户数、持有人结构

1	报告期末集合计划持有人户数	839
2	平均每户持有计划份额	602697.865

序号	项目	份额(份)	占总份额比例%
1	机构投资者持有计划份额	277,929,435.70	54.96%
2	个人投资者持有计划份额	227,734,073.07	45.04%

(二) 本期集合计划份额的变动

2015年1月1日-2015年12月7日

单位:份 期初总份额	本期参与份额(含管理人红利再投资份额)	本期退出份额	期末总份额
540,236,500.46	12,764,433.24	432,623,534.14	120,377,399.56

2015年12月8日-2015年12月31日

单位:份 期初总份额	本期参与份额(含管理人红利再投资份额)	本期退出份额	期末总份额
115,597,838.26	392,081,986.30	2,016,315.79	505,663,508.77

七、重要事项提示

（一）本报告期内集合计划管理人及托管人没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

（二）本报告期内集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

（三）本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

（四）本报告期内集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

（五）兴业证券股份有限公司（简称“兴业证券”）于2014年成立兴证证券资产管理有限公司（简称“兴证资管”）作为开展资产管理业务的全资子公司，并由兴证资管承接原由兴业证券作为资产管理计划管理人的全部权利义务，原兴业证券作为管理人管理的所有资产管理计划管理人均变更为兴证资管，已向相关监管机构报告。

（六）本报告期内集合计划合同于2015年12月8日发生变更，已向相关监管机构报告。

八、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

1. 中国证监会关于兴业证券股份有限公司“兴业卓越1号集合资产管理计划”设立的批复；
2. “兴业卓越1号集合资产管理计划”验资报告；
3. 关于“兴业卓越1号集合资产管理计划”成立的公告；
4. 关于兴业证券金麒麟1号集合资产管理计划合同变更事项的公告
5. “兴业证券金麒麟1号集合资产管理计划”计划说明书；
6. “兴业证券金麒麟1号集合资产管理计划”托管协议；
7. 管理人业务资格批件、营业执照；
8. 中国证监会福建监管局关于兴业证券股份有限公司集合资产管理计划更名无异议的函；
9. 关于集合资产管理计划更名的公告；
10. 关于变更金麒麟1号投资主办人的公告；
11. 管理人法人主体形式变更的公告；
12. 关于产品合同变更的公告。

(二) 存放地点及查阅方式

文件存放地点：上海市浦东新区民生路1199弄3号楼4楼

网址：www.ixzcg1.com

信息披露电话：021-38565866

联系人：陆昶文

服务电话：021-38565866

EMAIL：zcgl@xyzq.com.cn

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人兴证证券资产管理有限公司。

兴证证券资产管理有限公司
2016年3月30日

