



# 安信证券安银 2 号集合资产管理计划

## 2016 年第一季度报告

管理人：安信证券股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司

报告期：2016 年 1 月 1 日—2016 年 3 月 31 日



## 重要提示

本报告由集合计划管理人编制。托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合资产管理计划合同规定，已复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，委托人在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划合同及风险揭示书。

本报告中的财务资料未经审计。本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 3 月 31 日止。

## 目 录

一、集合资产管理计划概要 .....	1
二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现 .....	2
(一) 主要财务指标 .....	2
(二) 账户净值表现 .....	2
(三) 收益分配情况 .....	2
三、管理人报告 .....	3
(一) 业绩表现 .....	3
(二) 投资主办人简介 .....	3
(三) 投资主办人工作报告 .....	3
(四) 风险控制报告 .....	4
(五) 公平交易专项说明 .....	5
(六) 异常交易行为的专项说明 .....	5
四、财务会计报告 .....	6
(一) 集合计划资产负债表 .....	6
(二) 集合计划利润表 .....	7
五、投资组合报告 .....	8
(一) 资产组合情况 .....	8
(二) 报告期末市值占集合计划资产净值比例前十名证券投资明细 .....	8
(三) 集合计划份额变动情况 .....	8
六、重大事项报告 .....	9

## 一、集合资产管理计划概要

集合计划名称	安信证券安银2号集合资产管理计划
集合计划类型	限额特定集合资产管理计划
集合计划成立日	2015年4月3日
集合计划成立总份额	36,320,800.00份
集合计划报告期末总份额	36,320,800.00份
集合计划存续期	一年
管理人	安信证券股份有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司

## 二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

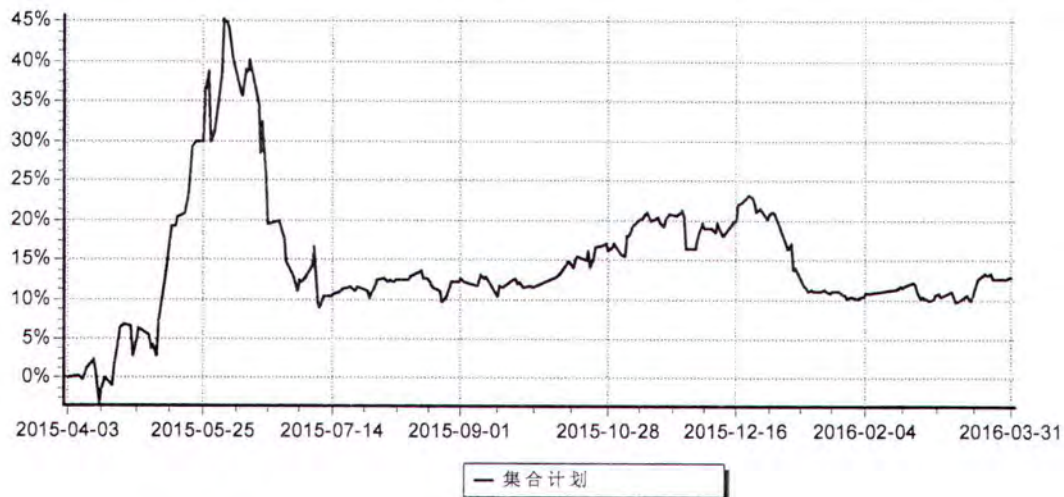
### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

序号	主要财务指标	报告期（2016年1月1日-2016年3月31日）
1	集合计划本期利润	-2,950,543.03
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-1,747,722.09
3	期末集合计划资产净值	40,978,053.98
4	期末单位集合计划资产净值	1.1282
5	期末单位集合计划累计净值	1.1282
6	本期单位集合计划净值增长率	-6.72%
7	单位集合计划累计净值增长率	12.82%

### (二) 账户净值表现

#### 1、集合计划累计单位净值增长率历史走势图



### (三) 收益分配情况

本集合计划本期没有分红。

### 三、管理人报告

#### （一）业绩表现

截至期末，本集合计划单位净值为1.1282元，累计净值为1.1282元，本期净值增长率-6.72%。

#### （二）投资主办人简介

李哲，男，复旦大学数量经济学专业金融工程方向硕士，9年证券从业经验。先后供职于大鹏证券资产管理部、招商证券风险管理部、平安信托投资管理部。在大鹏证券工作期间，担任投资经理助理；在招商证券工作期间，担任市场风险经理；平安信托工作期间，担任投资经理。现任安信证券公司资产管理部高级研究员。

#### （三）投资主办人工作报告

##### 1、投资回顾

本季度市场再次走出大幅下跌走势。1月份受国内外多种不利因素影响，市场呈现出快速暴跌，短时间的跌幅达到了去年股灾的水平。随着经济指标出现改善迹象，人民币汇率开始企稳，投资者的风险偏好开始上升，股市出现反弹。本季度上证指数下跌535.26点（跌幅15.12%），深证成指下跌2209.52点（跌幅17.45%），中小板指数下跌1529.03点（跌幅18.22%），创业板指数下跌475.76点（跌幅17.53%）。本集合管理计划在市场再次出现极端情况下及时减仓，控制住了净值回撤，为之后市场恢复能够及时修复净值打下基础。

##### 2、市场展望

股票市场在一季度末二季度初时已经走出了之前的阴影，风险偏好迅速回升。在相对利空较少的二季度前期，是不多的有效反弹时间窗口。具体来看，行业景气度较高的新能源汽车产业链、虚拟现实和智能汽车等高科技行业都具备持续性的投资机会，同时供给侧改革下的周期板块以及部分大消费品种也具备较好的弹性，这些将是本产品重点关注的行业方向。

债券市场，周期品的价格反弹，带动了基本面改善的预期，这也是债市出现波动的主要原因。我们认为债市的行情并未结束。一季度的经济基本面改善的趋势很难延续，二季度在缺乏增量资金的带动下，经济放缓的可能性很大。另外，由于通胀相对温和且二季度 CPI 可能进一步回落，宽松的政策空间打开。二季度债市不必太过悲观，债市仍值得期待。

#### （四）风险控制报告

##### 1、集合计划合规性声明

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》及其他相关法律法规的规定，严格执行安信证券内部各项管理制度，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。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关的法律法规、集合资产管理合同与说明书、与公司相关制度进行投资运作，没有出现重大违法违规行为，投资管理各项业务均符合相关规定。

##### 2、风险控制报告

本报告期内，安信证券针对本集合计划的运作特点，通过日常风险监控工作

和风险预警机制，对业务运作过程中可能出现的风险状况进行全面检查，及时进行风险提示，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，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关法律法规、公司制度和集合计划合同书进行集合计划资产的管理运作。本集合计划持有的证券符合投资范围及投资比例的要求，相关的信息披露和财务数据皆真实、准确、及时。

#### （五） 公平交易专项说明

报告期内，管理人严格执行公司资产管理业务公平交易相关制度，建立了较完善的投资决策体系，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。同时，将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，并建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

#### （六） 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划各项交易均严格按照相关法律法规、集合资产管理合同的有关要求执行，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。



## 四、财务会计报告

### (一) 集合计划资产负债表(2016 年 3 月 31 日)

单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	254,331.08	短期借款	—
结算备付金	1,008,808.03	交易性金融负债	—
存出保证金	33,684.51	衍生金融负债	—
交易性金融资产	509,128.04	卖出回购金融资产款	—
其中：股票投资	509,126.80	应付证券清算款	—
债券投资	—	应付赎回款	—
基金投资	1.24	应付管理人报酬	89,112.73
权证投资	—	应付托管费	6,854.83
资产支持证券投资	—	应付销售服务费	—
衍生金融工具	—	应付交易费用	33,283.30
买入返售金融资产	38,600,298.50	应交税费	—
应收证券清算款	713,183.89	应付利息	—
应收利息	3,599.97	应付利润	—
应收股利	—	其他负债	15,729.18
应收申购款	—	<b>负债合计</b>	<b>144,980.04</b>
其他资产	—		
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	36,320,800.00
		未分配利润	4,657,253.98
		<b>所有者权益合计</b>	<b>40,978,053.98</b>
<b>资产总计</b>	<b>41,123,034.02</b>	<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>41,123,034.02</b>

## (二) 集合计划利润表

单位：人民币元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	-2,588,227.26	-2,588,227.26
1. 利息收入	277,084.46	277,084.46
其中：存款利息收入	5,737.11	5,737.11
债券利息收入	225,350.72	225,350.72
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	45,996.63	45,996.63
2. 投资收益	-1,662,490.78	-1,662,490.78
其中：股票投资收益	-3,067,318.82	-3,067,318.82
债券投资收益	123,279.18	123,279.18
基金投资收益	1,128,848.85	1,128,848.85
权证投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	152,700.01	152,700.01
3. 公允价值变动收益	-1,202,820.94	-1,202,820.94
4. 其他收入	—	—
二、费用	362,315.77	362,315.77
1. 管理人报酬	262,698.35	262,698.35
2. 托管费	20,207.54	20,207.54
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	75,650.70	75,650.70
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	3,759.18	3,759.18
三、利润总和	-2,950,543.03	-2,950,543.03

## 五、投资组合报告

### (一) 资产组合情况

项目名称	期末市值(人民币元)	占总资产比例
银行存款和结算备付金	1,263,139.11	3.07%
股票	509,126.80	1.24%
债券	—	—
基金	1.24	—
其他资产	39,350,766.87	95.69%
合计	41,123,034.02	100.00%

### (二) 报告期末市值占集合计划资产净值比例前十名证券投资明细

序号	证券代码	名称	数量	期末市值(元)	占期末集合计划净值比例
1	300028	金亚科技	25,610.00	509,126.80	1.24%
2	160222	国泰食品	1.00	0.76	—
3	150199	食品B	1.00	0.48	—

### (三) 集合计划份额变动情况

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
36,320,800.00	—	—	36,320,800.00

## 六、重大事项报告

- (一) 经安永华明会计事务所验资，本集合计划于2015年4月3日成立。
- (二) 本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大变化。
- (三) 本报告期内集合计划没有需要披露的相关事项。
- (四) 本报告期内管理人没有需要披露的相关事项。
- (五) 本报告期内托管人没有需要披露的相关事项。
- (六) 信息披露的查阅方式：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)。



地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 A 座 13 楼

邮编：518026

传真：0755-82558219

网站：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

