

# 国海天信投资新三板 1 号集合资产管理计划 2016 年第 1 季度资产管理报告

(2016 年 01 月 25 日 - 2016 年 03 月 31 日)

## 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》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》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。

集合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计划合同及风险揭示书。

托管人已于 2016 年 4 月 20 日复核了本报告，本报告未经审计。

管理人保证本报告中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告中的内容由管理人负责解释。



## 一、集合资产管理计划概况

**产品名称：**国海天信投资新三板 1 号集合资产管理计划

**成立日期：**2016 年 1 月 25 日

**成立规模：**30,094,538.87 份

**存续期限：**2.5 年

**投资目标：**在严格管理风险前提下，为集合计划持有人追求资产增值。

**投资理念：**本集合计划遵循稳健投资的投资理念，在有效控制风险的前提下，主要通过投资升值潜力较大的新三板挂牌公司的股票，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。

**风险收益特征：**本集合计划的优先级属于中风险产品，适合风险承受能力适中，追求稳健投资收益的投资者；本集合计划的进取级属于高风险产品，适合风险承受能力较高，追求高预期收益的投资者。

**管理人：**国海证券股份有限公司

**投资顾问：**福建天信投资咨询顾问股份有限公司

**托管人：**中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

## 二、主要财务指标

### (一) 主要财务指标

序号	主要财务指标	2016年01月25日-2016年03月31日
1	集合计划本期利润	-78,780.33 元
2	集合计划本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-78,780.33 元
3	报告期末集合计划资产净值	30,015,758.54 元
4	报告期末天信投资新三板1号A单位净值	1.018 元
5	报告期末天信投资新三板1号B单位净值	0.955 元
6	报告期末天信投资新三板1号A累计单位净值	1.018 元
7	报告期末天信投资新三板1号B累计单位净值	0.955 元
8	报告期末天信投资新三板1号A累计净值增长率	1.80%
9	报告期末天信投资新三板1号B累计净值增长率	-4.50%

### (二) 财务指标的计算公式

- 1、报告期末单位净值=报告期末集合计划资产净值÷集合计划份额
- 2、报告期末累计单位净值=报告期末单位净值+单位集合计划已分红收益
- 3、报告期末累计净值增长率=(报告期末累计单位净值-1)×100%

## 三、集合计划管理人报告

### (一) 业绩表现

截至2016年03月31日,天信投资新三板1号A单位净值为1.018元,累计单位净值为1.018元,累计净值增长率为1.80%;天信投资新三板1号B单位净值为0.955元,累计单位净值为0.955元,累计净值增长率为-4.50%。

### (二) 投资主办人简介

姜雄涛先生，金融学硕士，8 年以上证券从业经历，2008 年 7 月加入国海证券，先后任职于国海证券资产管理部、证券资产管理分公司，熟悉产品开发、交易结构设计、非标资产投资等业务，具备较强的实践操作和风险控制能力。2016 年 1 月起任本集合计划投资主办人。

### (三) 投资主办人工作报告

截至 2016 年 3 月底，新三板挂牌家数已经超过 6300 家，相比 2015 年底新增了 1220 家，其中做市转让增加 303 家，协议转让增加 917 家；总市值超过 2 万亿，相比 2015 年底增加 2 千亿；日均成交个股数量达到 900 余家，相比 2015 年增长接近翻倍。一季度，三板做市指数（899002）下跌 13.43%，表现强于上证指数（-15.12%）和创业板指数（-17.53%）。

2016 年二季度，本集合计划将秉承价值+长期投资理念。从国家政策引导的行业中精选企业；提前布局可能进入创新层的企业；挖掘跌破定增价的价值低估企业；寻找具有转板潜力的企业。

### (四) 内部监察报告

#### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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、勤勉尽责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。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害投资人利益的行为，本集合计划的投资管理符合各项法律法规的规定。

#### 2、内部监察报告

本报告期内，本集合计划管理人通过每日的风险监控，加强对各项业

务风险的事前防范、事中监控和事后评估，日常对集合资产管理业务的重  
大事项进行风险评估，并提出风险控制措施。

本集合计划管理人高度重视业务一线的岗位控制，证券资产管理分公  
司内部设立风险管理岗位，履行一线风险管理责任，负责拟订风险控制制  
度和流程并组织实施，识别、评估和防范资产管理业务中各环节各类风险。  
风险管理部及法律合规部对集合资产管理计划的运作合规风险、操作风险  
等进行全面的监督和检查，对业务流程和规章制度的完善及执行进行了长  
期的跟踪督查，对资产管理业务的投资交易过程进行了后台监控。稽核审  
计部每年开展一次对证券资产管理分公司的现场稽核，对其经营活动的合  
规性、内部控制的有效性等情况进行稽核。

通过以上措施，我们认为，在本报告期内，本集合计划管理人的行为  
遵循了相关法律法规、公司规章制度的规定，符合本集合计划资产管理合  
同和说明书的约定，未出现诸如账外经营、与其他业务混合操作、挪用资  
产、内幕交易、操纵市场等行为；本集合计划持有的证券符合规定的品种  
和比例要求；相关信息披露和财务数据皆真实、准确和完整。

## 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

单位：人民币元

资 产	期末余额	年初余额
资 产：		
银行存款	29,800,997.45	
结算备付金	356,250	
存出保证金		
交易性金融资产		
其中：股票投资		

债券投资		
资产支持证券投资		
基金投资		
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收利息	6,732.55	
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
应收证券清算款		
资产合计:	30,163,980.00	
负债和所有者权益	期末余额	年初余额
负债:		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款		
应付证券清算款		
应付赎回款		
应付管理人报酬	81,515.94	
应付托管费	8,151.60	
应付销售服务费	54,343.92	
应付交易费用	4,210	
应付税费		
应付利息		
应付利润		
其他负债		
负债合计	148,221.46	
所有者权益:		
实收基金	30,094,538.87	
未分配利润	-78,780.33	
所有者权益合计	30,015,758.54	
负债与持有人权益总计:	30,163,980.00	

## 2、集合计划利润表

单位:人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	65,231.13	65,231.13
1、利息收入	65,231.13	65,231.13
其中:存款利息收入	34,852.85	34,852.85

债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	30,378.28	30,378.28
<b>2、投资收益（损失以“-”填列）</b>		
其中：股票投资收益		
债券投资收益		
资产支持证券投资收益		
基金投资收益		
权证投资收益		
衍生工具收益		
股利收益		
信托红利收益		
<b>3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）</b>		
<b>4、其他收入（损失以“-”填列）</b>		
<b>二、费用</b>	144,011.46	144,011.46
1、管理人报酬	81,515.94	81,515.94
2、托管费	8,151.60	8,151.60
3、销售服务费	54,343.92	54,343.92
4、交易费用		
5、利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
6、其他费用		
<b>三、利润总额</b>	-78,780.33	-78,780.33

## (二) 集合计划投资组合报告

### 1、报告期末资产组合情况

资产类别	期末市值(元)	占资产总值比例
银行存款及结算备付金	30,157,247.45	99.98%
其他资产	6732.55	0.02%
合计	30,163,980.00	100.00%

注：“其它资产”包括“交易保证金”、“应收股利”、“应收利息”“其他应收款”、“应收证券清算款”、“信托投资”等项目。

### 2、集合计划份额变动情况

单位：份

天信投资新三板 1 号 A 报告期初总份额	0
天信投资新三板 1 号 A 报告期间增加份额	20054172.29



天信投资新三板1号A报告期间减少份额	0.00
天信投资新三板1号A报告期末份额总额	20054172.29
天信投资新三板1号B报告期初总份额	0
天信投资新三板1号B报告期间增加份额	10,040,366.58
天信投资新三板1号B报告期间减少份额	0.00
天信投资新三板1号B报告期末份额总额	10040366.58

## 五、备查文件目录

### (一) 本集合计划备查文件目录

- 1、《国海天信投资新三板1号集合资产管理计划说明书》
- 2、《国海天信投资新三板1号集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《国海天信投资新三板1号集合资产管理计划风险揭示书》
- 4、《国海天信投资新三板1号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：深圳市福田区竹子林教育科技大厦24层

网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

信息披露电话：0755-82835793

投资者对本报告有任何疑问，可咨询管理人国海证券股份有限公司。

国海证券股份有限公司

二〇一六年四月二十二日