

旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划 2016 年第一季度资产管理报告

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 4 月 20 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：2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 3 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	2016 年 1 月 1 日-2016 年 3 月 31 日
1	集合计划本期利润	-1,094,811.10
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-1,122,032.78
3	单位集合计划净收益	-0.0635
4	期末集合计划资产净值	17,236,637.76
5	单位集合计划资产净值	0.9755
6	本期集合计划净值增长率	-4.52%
7	集合计划累计净值增长率	1.09%

（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 2016 年 3 月 31 日，集合计划单位净值为 0.9755 元，本期净值增长率为 -4.52%，集合计划单位累计净值为 1.0109 元，集合计划累计净值增长率为 1.09%。

（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

回顾一季度行情，一月初市场在人民币贬值，大股东减持禁令到期等利空因素影响下再次出现单边下跌，上证指数跌破去年8月的低点并创出新低，此后汇率逐渐企稳市场在低位逐步筑底。三月下半段，在注册制和战略新兴板暂缓的利好刺激下，市场放量反弹后逼近前期整理平台的上沿。年初，我们的仓位适中，在一月的大跌中跌幅小于指数；二月初我们逐渐加大仓位抓住了反弹机会，并在二月末的大跌前及时减仓，保住了反弹成果；三月初在市场方面不明的情况下我们一直低仓位应对，并在市场放量突破时及时加仓。总体来看，得益于较好的仓位管理，一季度我们的净值跌幅远小于指数。

2、投资管理展望

展望未来一段时间，仅靠注册制和战略新兴板放缓等政策利好刺激不足以支撑市场反弹的太远，研判市场的主要关注点仍然应该放在

经济数据，特别是利率，汇率，房价等因素上。首先，今年以来周期品价格出现一波上涨，隐含的预期是房地产销售火爆带来经济企稳回升，如果未来公布的经济数据不是非常强劲，对周期板块会构成较大的利空。特别是近期深圳，上海等地出台了新的地产调控政策，可能会影响地产的销售，投资数据。其次，今年以来猪肉，蔬菜价格持续上涨，一线城市地产销售火爆，如果未来通胀数据超预期或房地产价格持续上涨，可能会引发货币政策不再宽松的担忧；第三，目前美国已经先于其他经济体进入加息周期，虽然近期人民币汇率走势平稳，但二季度美国仍有加息的可能。

综上，目前压制市场的因素较多，市场难以走出单边上行的行情。但我们也应该看到，资产荒仍然在延续，再次单边下行的可能也不大，市场更多的可能是继续维持存量博弈的结构性行情，这就要求我们精选板块和个股。在此位置，我们看好新能源汽车，虚拟现实，智能驾驶等新兴产业以及养殖等高景气度行业。

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（2016年3月31日）

单位：人民币元

项目	2016年3月31日	年初余额
资 产：		

银行存款	5,895,647.20	10,290,544.94
结算备付金	236,314.45	548,935.33
存出保证金	49,540.36	101,220.83
交易性金融资产	13,103,406.66	11,397,336.62
其中：股票投资	13,095,550.00	11,389,514.96
债券投资	0.00	0.00
基金投资	7,856.66	7,821.66
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	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	2,697.04	2,164.24
应收股利	32.70	1,531.31
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	19,287,638.41	22,341,733.27
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	1,949,045.33	544,227.52
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	11,206.37	13,461.20
应付托管费	3,735.45	4,487.08
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	80,770.44	68,873.81

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	6,243.06	5,000.00
负债合计	2,051,000.65	636,049.61
所有者权益：		
实收基金	17,668,864.58	21,243,936.50
未分配利润	-432,226.82	461,747.16
所有者权益合计	17,236,637.76	21,705,683.66
负债和所有者权益总计	19,287,638.41	22,341,733.27

2、集合计划利润表(2016年1月1日至2016年3月31日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	-730,329.72	-730,329.72
1、利息收入	18,392.96	18,392.96
其中：存款利息收入	18,392.96	18,392.96
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	0.00	0.00
2、投资收益	-775,944.36	-775,944.36
其中：股票投资收益	-774,480.75	-774,480.75
债券投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	0.00	0.00
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	-1,463.61	-1,463.61

个股期权收益	0.00	0.00
3、公允价值变动收益	27,221.68	27,221.68
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	364,481.38	364,481.38
1、管理人报酬	33,811.13	33,811.13
2、托管费	11,270.40	11,270.40
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	308,656.79	308,656.79
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	10,743.06	10,743.06
三、利润总和	-1,094,811.10	-1,094,811.10

(二) 集合计划投资组合报告 (2016年3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	6,181,502.01	32.05%
股票投资	13,095,550.00	67.90%
证券投资基金	7,856.66	0.04%
债券投资	0.00	0.00%
其他资产	2,729.74	0.01%
资产总值	19,287,638.41	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	289,000.00	2,615,450.00	15.17%
2	保千里	600074	70,000.00	1,127,000.00	6.54%
3	恒生电子	600570	15,000.00	875,100.00	5.08%
4	西部证券	002673	30,000.00	810,600.00	4.70%
5	东兴证券	601198	30,000.00	809,700.00	4.70%
6	金固股份	002488	30,000.00	756,600.00	4.39%
7	硕贝德	300322	50,000.00	747,000.00	4.33%
8	雏鹰农牧	002477	40,000.00	746,000.00	4.33%
9	掌趣科技	300315	60,000.00	725,400.00	4.21%
10	纳川股份	300198	50,000.00	713,000.00	4.14%

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）	2,697.04
应收股利	32.70
证券清算款	0.00
买入返售金融资产	0.00
合计（人民币元）	2,729.74

（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
21,243,936.50	2,131,800.47	5,706,872.39	17,668,864.58

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4月20日