

## 旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划 2016 年第二季度资产管理报告

### 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 1 号策略精选集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具批准文件（文号：证监许可〔2009〕1113 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 7 月 15 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 4 月 1 日—2016 年 6 月 30 日

## 一、集合计划简介

名称：旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划

类型：固定收益类产品

管理人：东莞证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

成立日：2009 年 12 月 22 日

成立规模：1,044,153,357.57 份

存续期：无固定存续期限

## 二、主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2016 年 4 月 1 日--2016 年 6 月 30 日
1	集合计划本期利润	18,379,875.22
2	期末集合计划资产净值	1,710,077,029.49

## 三、集合计划管理人报告

### （一）投资主办简介

黄浩东

男，清华大学经济管理学院管理学学士及工商管理硕士，历任天华阳光控股公司高级财务经理、东莞证券深圳分公司研究员，东莞证券深圳分公司投资经理助理等职，现任东莞证券投资经理，擅长货币

政策研究、债券信用研究和投资组合管理。自 2014 年 12 月 24 日起任旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划投资经理。

高春梅

女，北京大学，硕士，近 7 年信用评级和债券研究工作经验。曾任北京君维诚信用评级有限公司分析师、生命保险资产管理有限公司信用研究员、平安证券资产管理部信用研究员、东莞证券深圳分公司信用研究员、投资经理等职。

## （二）投资主办工作报告

### 1、投资策略回顾

上半年债券市场有所波动，基础货币投放更多在维护短期流动性，除了一季末的MPA突然袭击导致市场出现流动性紧张外，其他时间资金面均较为宽松。但年初至今央行只降准一次，这也代表了监管的态度，宁愿大量市场操作，也不愿意推高市场的杠杆。紧平衡将是今年全年的流动性节奏。房地产一季度复苏是支撑经济的主要因素，目前整体去化情况良好。利率债长端一季度出现明显的调整，二季度有所收复。信用债上半年出现了一些回调，但半年末时，信用债已经恢复到了前期高位。

旗峰1号2015年年末组合主要配置于高等级企业债、公司债以及股票质押业务。

### 2、投资管理展望

下半年，央行紧平衡的策略、财政发力、通胀预期提升、监管对杠杆的趋严等因素都将制约市场走势。信用债信用风险下半年应该不

会集中爆发，但个别信用事件无法避免。监管政策如果出现偏严，例如大规模降低杠杆，那么信用债流动性将会出现一定程度的风险，严重情况下会出现爆仓的踩踏事件。短期看城投债依然是市场最后的信仰，但新的城投债需要更多关注区域经济情况。产业债则分化严重，存在不少不确定性。

展望下季度，旗峰1号依然以城投债及股票质押为主要的投向，同时适度增加杠杆提高产品收益率。

## 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6月30日）

单位：人民币元

项目	2016年6月30日	年初余额
资 产：		
银行存款	1,775,103.97	97,641,554.39
结算备付金	10,376,401.64	13,299,665.93
存出保证金	172,088.80	105,781.13
交易性金融资产	1,463,628,559.11	1,215,037,112.48
其中：股票投资	0.00	0.00
债券投资	1,463,628,559.11	1,215,037,112.48
基金投资	0.00	0.00
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	648,817,511.25	314,162,742.82
应收证券清算款	0.00	2,988,895.83
应收利息	41,243,046.11	31,854,569.07
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	8,052,000.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计：	2,166,012,710.88	1,683,142,321.65
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	419,444,747.72	281,997,375.00
应付证券清算款	0.00	86,084,933.45
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	6,528,484.80	3,174,035.45
应付托管费	746,455.33	620,203.39
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	240,915.31	265,434.89
应付税费	0.00	0.00
应付利息	170,042.41	5,879.68
应付利润	24,225,034.85	20,462,431.37
其他负债	4,580,000.97	3,275,919.24
负债合计	455,935,681.39	395,886,212.47
所有者权益：		
实收基金	1,710,077,029.49	1,287,256,109.18
未分配利润	0.00	0.00
所有者权益合计	1,710,077,029.49	1,287,256,109.18
负债与持有人权益总计：	2,166,012,710.88	1,683,142,321.65

## 2、集合计划利润表(2016年4月1日至2016年6月30日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	28,540,576.96	52,944,889.96
1、利息收入	28,466,810.14	52,603,765.63
其中：存款利息收入	162,783.73	345,203.46
债券利息收入	20,326,490.50	38,338,813.60
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	7,977,535.91	13,919,748.57
2、投资收益（损失以“-”填列）	73,766.82	221,124.33
其中：股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	73,766.82	221,124.33
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	0.00	0.00
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
4、其他收入（损失以“-”填列）	0.00	120,000.00
二、费用	10,160,701.74	17,298,029.88
1、管理人报酬	6,539,306.93	11,182,128.03
2、托管费	746,455.33	1,394,665.99
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	0.00	0.00
5、利息支出	2,774,341.35	4,592,205.79
其中：卖出回购金融资产支出	2,774,341.35	4,592,205.79
6、其他费用	100,598.13	129,030.07

三、 利润总额	18,379,875.22	35,646,860.08
---------	---------------	---------------

## (二) 集合计划投资组合报告 (2016年6月30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	12,323,594.41	0.57%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	1,463,628,559.11	67.57%
证券投资基金	0.00	0.00%
其他资产	690,060,557.36	31.86%
资产总值	2,166,012,710.88	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	11 一重债	122114	1,010,000	101,000,000.00	5.9062%
2	16 江夏城投债	1680249	600,000	60,000,000.00	3.5086%
3	16 郑新发展 PPN001	31664025	500,000	50,000,000.00	2.9238%
4	16 化纤债	118566	500,000	50,000,000.00	2.9238%
5	16 瀚瑞债 01	1680184	500,000	50,000,000.00	2.9238%

6	14 招商债	122374	499,140	49,914,000.00	2.9188%
7	15 瀚瑞投资 PPN004	31571058	400,000	40,000,000.00	2.3391%
8	16 开元 01	118707	400,000	40,000,000.00	2.3391%
9	15 泸州停车项目 NPB01	1524001	400,000	40,000,000.00	2.3391%
10	15 淹城 01	S79102	400,000	40,000,000.00	2.3391%

### 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）	41,243,046.11
应收股利	0.00
买入返售金融资产	648,817,511.25
证券清算款	0.00
应收申购款	0.00
合计（人民币元）	690,060,557.36

### （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
1,311,285,354.06	1,226,594,475.84	827,802,800.41	1,710,077,029.49

## 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 1 号策略精选集合资产管理计划推广的文件
- 2、《旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划说明书》
- 3、《旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、《旗峰 1 号策略精选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

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疑问,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 7 月 15 日