

国海天信投资新三板 1 号集合资产管理计划 2016 年第 2 季度资产管理报告

(2016 年 04 月 01 日 - 2016 年 06 月 30 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 7 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 04 月 01 日 - 2016 年 06 月 30 日
1	集合计划本期利润	-299741.21 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	-144391.21 元
3	报告期末集合计划资产净值	29716017.33 元
4	报告期末天信投资新三板 1 号 A 单位净值	1.043 元
5	报告期末天信投资新三板 1 号 B 单位净值	0.876 元
6	报告期末天信投资新三板 1 号 A 累计单位净值	1.043 元
7	报告期末天信投资新三板 1 号 B 累计单位净值	0.876 元
8	报告期末天信投资新三板 1 号 A 累计净值增长率	4.30%
9	报告期末天信投资新三板 1 号 B 累计净值增长率	-12.40%

(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 06 月 30 日，天信投资新三板 1 号 A 单位净值为 1.043 元，累计单位净值为 0.881 元，累计净值增长率为 4.30%；天信投资新三板 1 号 B 单位净值为 1.043 元，累计单位净值为 0.881 元，累计净值增长率为-11.90%。

(二) 投资主办人简介

孙凡先生

MBA，毕业于北京大学光华管理学院，师从曹凤岐教授。10 年从业经验，现任国海证券资管二部高级投资经理，国海金贝壳量化 1 号投资主办。加入国海之前历任金元证券衍生品总部特级交易员，中信期货首席黄金/钢材分析师。擅长量化策略模型的研究和交易。

(三) 投资主办人工作报告

截至 2016 年 6 月底，新三板挂牌家数 7685 家，相比 2016 年 3 月底新增了 1336 家，其中做市转让增加 152 家，协议转让增加 1184 家，总市值超过 3 万亿，相比 2015 年底增加 2 千多亿，日均成交个股数量达到 976 家。6 月份新三板分层出来后，基础层 6732 家，创新层 953。二季度，三板做市指数（899002）下跌 8.83%，表现强于上证指数（-2.47%）和创业板指数（-0.47%）。

2016 年三季度，本集合计划将继续秉承价值+长期投资理念。着眼国家政策、社会经济发展趋势，布局未来前沿行业；侧重创新层、高成长型企业，挖掘潜质巨大的低估值企业；抓住市场契机，择机介入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	期初余额	期末余额
资产:		
银行存款	25,744,190.19	16,887,049.49
结算备付金	140,000.00	40,793.81
存出保证金		4,177.26
交易性金融产品	4,392,000.00	4,128,000.00
其中: 股票投资	4,392,000.00	4,128,000.00
债券投资		
资产支持证券投资		
基金投资		
贵金属投资		
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		9,000,000.00
应收利息	38,621.85	3,397.70
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
资产总计	30,314,812.04	30,063,418.26
负债及持有人权益	期初余额	期末余额
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	156,664.06	193,466.57
应付托管费	15,666.40	19,346.65
应付销售服务费	104,442.68	128,977.71
应付交易费用	5,610.00	5,610.00
应交税费		
应付利息		
应付利润		
其他负债		
负债合计	282,383.14	347,400.93

持有人权益		
实收基金	30,094,538.87	30,094,538.87
未分配利润	-62,109.97	-378,521.54
所有者权益合计	30,032,428.90	29,716,017.33
负债和所有者权益总计	30,314,812.04	30,063,418.26

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	-99712.65	-34,481.52
1. 利息收入	55637.35	120,868.48
其中:存款利息收入	44495.52	79,348.37
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
同业存单利息收入	0.00	
买入返售金融资产利息收入	11141.83	41,520.11
黄金合约租出利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益	0.00	0.00
其中:股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	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
贵金属投资收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益	-155350.00	-155,350.00
汇兑收益	0.00	
4. 其他收入	0.00	0.00
二、费用	200028.56	344,040.02
1. 管理人报酬	111950.63	193,466.57
2. 托管费	11195.05	19,346.65
3. 销售服务费	74633.79	128,977.71
4. 交易费用	2249.09	2,249.09
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	0.00	0.00
三、利润总额	-299741.21	-378,521.54
所得税费用	0.00	
净利润	-299741.21	-378,521.54

(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	16,932,020.56	56.32%
股票投资	4,128,000.00	13.73%
其他资产	9,003,397.70	29.95%
合计	30,063,418.26	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报告期内增加份额	20054172.29
天信投资新三板1号A报告期内减少份额	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报告期内增加份额	10,040,366.58
天信投资新三板1号B报告期内减少份额	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

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

二〇一六年七月二十一日



