

国信中证新三板 1 号集合资产管理计划季度管理报告

(2016 年 7 月 1 日—2016 年 9 月 27 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》(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。

中国证券投资基金业协会于 2015 年 6 月 15 日对国信中证新三板 1 号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)出具了备案文件《关于国信证券股份有限公司发起设立国信中证新三板 1 号集合资产管理计划的备案确认函》(中基协备案函【2015】953 号)。

管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉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 10 月 26 日复核了本报告。本报告未经审计。

管理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。

一、集合计划简介

(一) 基本资料

名称: 国信中证新三板 1 号集合资产管理计划

成立日: 2015 年 5 月 29 日

成立规模: 199,508,833.50 份

报告期末计划总份额: 199,508,833.50 份

存续期: 两年

管理人: 国信证券股份有限公司

托管人: 中国工商银行股份有限公司深圳市分行

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

(二) 管理人

名称：国信证券股份有限公司

设立日期：1994 年 6 月

注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

资产管理业务批准文号：证监机构字【2002】176 号

鑫网网址：www.guosen.com.cn

(三) 托管人

名称：中国工商银行股份有限公司深圳市分行

办公地址：深圳市深南东路金融中心大厦北座

邮编：518000

负责人：林谦

(四) 投资顾问

名称：深圳市中证投资资讯有限公司

地址：深圳市福田区福华路嘉汇新城汇商中心 25 层部分

法定代表人：赵 维

二、主要财务指标

1、主要财务指标

序号	主要财务指标	本季度
1	集合计划本期利润（元）	-43,031.65
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（元）	-43,031.65
3	期末集合计划资产净值（元）	199,268,018.78

4	期末单位集合计划资产净值（元）	0.999
5	期末单位集合计划累计资产净值（元）	0.999
6	本期集合计划单位净值增长(元)	0.000

2、财务指标计算公式

- (1) 期末单位集合计划资产净值 = 期末集合计划资产净值 ÷ 集合计划份额
- (2) 期末单位集合计划累计资产净值 = 期末单位集合计划资产净值 + 单位集合计划累计分红值
- (3) 本期集合计划单位净值增长 = 本期末集合计划单位累计净值 - 本期期初集合计划单位累计净值

三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

本集合计划于 2015 年 5 月 29 日成立，截至 2016 年 9 月 27 日，集合计划单位净值为 0.999 元，累计单位净值为 0.999 元，本季度单位净值未发生增减。

（二）投资经理简介

报告期内本集合计划投资主办：

吴胜明，北京大学管理学硕士，13 年证券从业经验。曾任联合证券研究员、国信证券经济研究所资深分析师、大成基金管理有限公司研究员、国信证券资产管理总部研究员。现任国信证券资产管理总部投资主办。

（三）投资经理工作报告

本季度新三板市场延续了 2015 年 7 月以来的盘整态势，三板成份指数本季度下跌 4.22%，三板做市指数本季度下跌 4.47%。新三板市场处于快速发展之中，挂牌公司家数由 6 月底的 7685 家（做市转让家数 1570，协议转让家数 6115）上升至 9122 家（做市转让家数 1640，协议转让家数 7482）。

本季度我们大量调研了三板挂牌公司，深入研究市场、行业和公司，寻找、

评估和洽谈各种适合本集合计划的定增机会。本季度本集合计划未持有股票仓位，资产主要分布在开放式货币市场基金品种上。本集合计划单位净值未发生增减。

根据《国信中证新三板 1 号集合资产管理合同》第二十二章第一条的约定，本集合计划已于 2016 年 9 月 23 日终止。

（四）风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

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》、《管理办法》、《实施细则》及其他法律法规的规定，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，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，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的风险控制部门，加强对各项业务风险的事前、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。风险监管总部定期对业务授权、投资交易进行了全面细致的审查，对业务中出现的问题，风险监管总部已进行及时的风险揭示，并督促相关部门尽快解决。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险监管总部日常监控、重点检查的结果。

本集合计划管理人的内部风险控制工作主要由国信证券风险监管总部负责。风险监管总部采用授权管理、逐日监控、定期与不定期检查以及绩效评估等多种方法对集合计划的管理运作进行风险控制。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和《国信中证新三板 1 号集合资产管理计划管理合同》及《国信中证新三板 1 号集合资产管理计划说明书》的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

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9月27日)

单位：人民币元

资产	行次	期末余额	负债与持有人权益	行次	期末余额
资 产：			负 债：		
银行存款	1	200,512,124.76	短期借款	17	0.00
结算备付金	2	0.00	交易性金融负债	18	0.00
存出保证金	3	1,298.70	衍生金融负债	19	0.00
交易性金融资产	4	0.00	卖出回购金融资产款	20	0.00
其中：股票投资	5	0.00	应付证券清算款	21	0.00
债券投资	6	0.00	应付赎回款	22	0.00
基金投资	7	0.00	应付管理人报酬	23	1,156,987.46
权证投资	8	0.00	应付托管费	24	92,562.88
资产支持证券	9	0.00	应付销售服务费	25	0.00
投资			应付交易费用	26	0.00
衍生金融工具	10	0.00	应交税费	27	0.00
买入返售金融资产	11	0.00	应付利息	28	0.00
应收证券清算款	12	0.00	应付利润	29	0.00
应收利息	13	24,133.36	其他负债	30	19,987.70
应收股利	14	0.00	负债合计		1,269,538.04
应收申购款	15	0.00			
其他资产	16	0.00	所有者权益：		
			实收基金		199,508,833.50
			未分配利润		-240,814.72
			所有者权益合计		199,268,018.78
资产合计		200,537,556.82	负债和所有者权益总		200,537,556.82
			计		

2、集合计划经营业绩表(2016年7月1日至2016年9月27日)

单位：人民币元

序号	项目	本季度	本年累计
1	一、收入	1,226,555.88	3,939,014.36
2	1、利息收入	27,205.60	31,962.22

3	其中：存款利息收入	27,205.60	31,962.22
4	债券利息收入	0.00	0.00
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	0.00	0.00
7	2、投资收益	1,199,350.28	3,907,052.14
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	0.00	0.00
10	基金投资收益	0.00	0.00
11	权证投资收益	0.00	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
13	衍生工具收益	0.00	0.00
14	股利收益	1,199,350.28	3,907,052.14
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	3、公允价值变动收益	0.00	0.00
17	4、其他收入	0.00	0.00
18	二、费用	1,269,587.53	3,954,991.54
19	1、管理人报酬	1,157,036.95	3,635,003.59
20	2、托管费	92,562.88	290,800.25
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	0.00	0.00
23	5、利息支出	0.00	0.00
24	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
25	6、其他费用	19,987.70	29,187.70
26	三、利润总和	-43,031.65	-15,977.18

(二) 集合计划投资组合报告 (2016年9月27日)

1、资产组合情况

资产项目	期末市值 (人民币元)	占总资产比例 (%)
银行存款、清算备付金、 应收证券清算款和存出保 证金	200,513,423.46	99.99%
股票	0.00	0.00%
基金投资	0.00	0.00%
债券逆回购	0.00	0.00%
应收利息、红利、其他应 收款项和其他资产	24,133.36	0.01%

合计	200,537,556.82	100.00%
----	----------------	---------

2、按市值占净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本报告期股票期末余额为零。

3、按市值占净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本报告期基金期末余额为零。

4、按市值占净值比例大小排序的前十名其他品种明细

本报告期其他品种期末余额为零。

(三) 集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额总额	199,508,833.50
报告期内总参与份额	0.00
红利再投资份额	0.00
报告期内总退出份额	0.00
报告期末份额总额	199,508,833.50

五、重要事项提示

(一) 本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理、财产、托管业务的重大诉讼事项。

(二) 本集合计划聘请的会计师事务所没有发生变更。

(三) 本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

(四) 本报告期内集合计划的投资组合策略没有重大改变。

(五) 本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

(六) 在本报告期内本集合计划没有投资与管理人有关联方关系的公司发行的证券。

(七) 据《国信中证新三板 1 号集合资产管理合同》第二十二章第一条的约

定，本集合计划已于 2016 年 9 月 23 日终止。国信证券股份有限公司作为本集合计划管理人已与托管人中国工商银行股份有限公司深圳市分行于 2016 年 9 月 23 日至 9 月 27 日对本集合计划资产进行了清算。

六、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、《关于国信证券股份有限公司发起设立国信中证新三板 1 号集合资产管理计划的备案确认函》（中基协备案函【2015】953 号）
- 2、《国信中证新三板1号集合资产管理计划管理合同》
- 3、《国信中证新三板1号集合资产管理计划说明书》
- 4、管理人资产管理业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点及查阅方式

查阅地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦26楼

网址：www.guosen.com.cn

客服热线：95536

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人国信证券股份有限公司。

国信证券股份有限公司
二〇一六年十月二十六日

