

# 东北证券 6 号核心优势 集合资产管理计划季度报告

(2016 年第四季度)

集合计划管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

集合计划托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年一月十八日

## 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》）及其他有关规定由集合资产管理计划管理人编制。

中国证监会2011年11月21日对本集合计划出具了核准文件《关于核准东北证券股份有限公司设立东北证券6号核心优势集合资产管理计划的批复》（证监许可[2011]1842号），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，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、托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

集合资产管理计划托管人中国建设银行股份有限公司于2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期间：2016年10月1日至2016年12月31日。

## 一、集合资产管理计划概况

名称：东北证券6号核心优势集合资产管理计划

类型：非限定性集合资产管理计划

成立日：2012年6月21日

报告期末份额总额：567,847,673.19份

存续期：不设固定期限

投资目标：本集合计划在追求集合资产安全的基础上，力争为集合计划份额持有人创造稳定持续的投资收益。

投资范围：国内依法发行的固定收益品种，包括中国境内依法发行的债券、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据，保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、银行存款、债券回购以及中国证监会认可的其他投资品种。

管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

## 二、主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	本期数
集合计划本期利润（元）	3,175,583.54
集合计划本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	3,168,872.54
期末集合计划资产净值（元）	567,847,673.19
期末单位集合计划资产净值（元）	1.000
期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.000
本期集合计划单位净值增长率	0.00%

## 三、管理人报告

### （一）业绩表现

本集合计划在 2012 年 6 月 21 日成立，截止 2016 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.000 元，累计单位净值 1.000 元，本期集合计划单位净值增长率 0.00%。

## （二）投资主办人简介

赵威先生，武汉理工大学管理科学与工程硕士，具有 4 年固定收益市场投资分析经验，在固定收益投资研究方面具备扎实功底。历任华泰证券固定收益部投资助理、国金证券固定收益部投资助理，从事可转债投资、债券质押式报价回购、银行间市场债券销售交易和投资顾问工作。后于东北证券北京分公司南京市场部负责投资顾问、产品设计，现任东北证券现金管家集合资产管理计划投资主办人、东北证券固定收益融通宝 1 号集合资产管理计划投资主办人、东北证券固定收益融通宝 2 号集合资产管理计划投资主办人、东北证券固定收益融通宝 5 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇固定收益融通宝 9 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇固定收益融通宝 12 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇固定收益融通宝 16 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇固定收益融通宝 3 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇固定收益融通宝 8 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇固定收益融通宝 17 号集合资产管理计划投资主办人、东北证券 6 号核心优势集合资产管理计划投资主办人、东北证券融达 10 号集合资产管理计划投资主办人、东北证券融达 11 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇融达 15 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇融达 16 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇融达 20 号集合资产管理计划投资主办人、东证融汇融达 21 号集合资产管理计划投资主办人。

## （三）投资主办人工作报告

### 1、市场以及操作回顾

2016 年四季度，特朗普意外当选、央行货币政策转向、国海证券代持事件爆发、美联储加息，市场流动性空前紧张，收益率全线上行，市场出现了流动性枯竭的状况。12 月下旬在监管部门的联合行动下，市场情绪出现了缓和，流动性逐渐修复。

### 2、市场展望与投资策略

预计 2017 年一季度，市场流动性基本保持稳定，资金成本中枢难以回到 2016

年三季度的宽松，信用债估值将小幅修复。基于以上观点，2017 年一季度投资策略安排如下：

（1）精选个券，严守信用风险底线，重点配置高性价比城投底仓，适当配置有核心竞争力的龙头产业债；

（2）缩短久期，降低久期错配，防范流动性风险。

#### （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

本集合计划自2012年6月21日成立，开始投资管理运作，截至2016年12月31日，管理人针对本集合计划的运作特点，通过每日的风险监控工作以及风险预警机制，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，并提醒投资主办人采取相应的风险规避措施，确保集合计划合法合规、正常运行。同时，本集合计划通过完善的风险指标体系和定期进行的风险状况分析，及时评估集合计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

在本报告期内，管理人严格按照有关的法律法规、集合资产管理合同与说明书以及管理人相关制度进行投资运作，没有出现违反相关规定的状况，也未发生损害投资者利益的内幕交易和违规交叉交易等行为。

## 四、托管人报告

### 东北证券 6 号核心优势集合资产管理计划

#### 2016 年第四季度托管人报告

中国建设银行根据《东北证券 6 号核心优势集合资产管理计划合同》和《东北证券 6 号核心优势集合资产管理计划托管协议》，自 2012 年 6 月 21 日起托管东北证券 6 号核心优势集合资产管理计划（以下称“本计划”）资产。

2016 年第四季度期间，中国建设银行及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

2016 年第四季度期间，中国建设银行对管理人的投资运作行为按合同约定进行了监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

2016 年第四季度期间，中国建设银行对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

中国建设银行复核了本计划资产管理报告(2016 年第四季度报告)中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。

中国建设银行资产托管业务部

2017 年 1 月 18 日

## 五、集合计划财务报告

(一) 集合计划资产负债表 (2016-12-31)

单位：元

资 产：		负债与持有人权益	期末余额
银行存款	1,386,823.72	负 债：	
结算备付金	0.00	短期借款	0.00
存出保证金	1,057.68	交易性金融负债	0.00
交易性金融资产	755,902,413.33	衍生金融负债	0.00
其中：股票投资	0.00	卖出回购金融资产款	205,500,000.00

债券投资	755,902,413.33	应付证券清算款	0.00
基金投资	0.00	应付赎回款	0.00
权证投资	0.00	应付赎回费	0.00
资产支持证券投资	0.00	应付管理人报酬	126,035.50
衍生金融工具	0.00	应付托管费	33,609.52
买入返售金融资产	0.00	应付投资咨询费	0.00
应收证券清算款	0.00	应付交易费用	5,227.00
应收利息	19,550,988.83	应交税费	0.00
应收股利	0.00	应付利息	168,232.96
应收申购款	0.00	应付利润	3,145,505.39
其他资产	0.00	其他负债	15,000.00
		<b>负债合计</b>	208,993,610.37
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	567,847,673.19
		未分配利润	0.00
<b>资产合计</b>	776,841,283.56	<b>持有人权益合计</b>	567,847,673.19

(二) 集合计划经营利润表 (2016-10-1 至 2016-12-31) 单位: 元

序号	项目	本期数
1	一、收入	3,827,523.83
2	1、利息收入	3,742,546.37
3	其中：存款利息收入	9,153.53
4	债券利息收入	3,613,610.43
5	买入返售证券收入	119,782.41
6	2、投资收益	78,266.46
7	其中：股票投资收益	26,488.00
8	债券投资收益	51,778.46
9	基金投资收益	0.00
10	权证投资收益	0.00
11	资产支持证券投资收益	0.00
12	衍生工具收益	0.00
13	股利收益	0.00
14	3、公允价值变动收益	6,711.00
15	4、其他收入	0.00
16	二、费用	651,940.29
17	1、管理人报酬	194,681.42
18	2、托管费	51,795.23

19	3、销售服务费	0.00
20	4、交易费用	766.54
21	5、利息支出	370,210.10
22	其中：卖出回购金融资产支出	370,210.10
23	6、其他费用	34,487.00
25	三、利润总和	3,175,583.54

## 六、投资组合报告

### (一) 资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占总资产比例
债券投资	755,902,413.33	97.30%
基金	0	0.00%
银行存款	1,386,823.72	0.18%
清算备付金	0	0.00%
其他资产	19552046.51	2.52%
合计	776,841,283.56	100.00%

注：1. 其他资产：包括应收利息和存出保证金。

#### 2. 其他资产：

项目名称	金额(元)	占总资产比例(%)
应收利息	19,550,988.83	2.52%
存出保证金	1,057.68	0.00%
合计	19,552,046.51	2.52%

3. 本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### (二) 期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

注：本集合计划报告期末未持有股票。

### (三) 期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

序号	证券代码	证券名称	数量	市值(元)	占组合净值比例(%)
1	135216	16 马经开	500,000.00	50,324,207.44	8.86%
2	118610	16 连房政	500,000.00	49,965,383.45	8.80%
3	145094	16 江都 01	500,000.00	49,947,921.48	8.80%
4	118846	16 镇新债	500,000.00	49,945,731.78	8.80%
5	135758	16 鑫源 01	400,000.00	40,893,284.04	7.20%
6	135398	16 鑫域 01	400,000.00	40,720,631.97	7.17%
7	135655	16 新航债	400,000.00	40,392,088.85	7.11%
8	145054	16 黔西南	400,000.00	39,874,028.41	7.02%

9	135752	16 通泰 01	380,000.00	37,878,008.74	6.67%
10	118409	15 宁温泉	300,000.00	30,553,176.01	5.38%

(四) 期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

注：本集合计划报告期末未持有基金。

(五) 期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

注：本集合计划报告期末未持有权证。

(六) 投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未到受到公开谴责、处罚。

## 七、集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	769,137.48
报告期内总参与份额	567,078,535.71
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	567,847,673.19

## 八、重要事项提示

(一) 本集合计划管理人相关事项

1、本集合计划管理人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

2、本集合计划管理人办公地址没有发生变更。

3、本集合计划的管理人及其高级管理人员没有受到任何处罚。

(二) 本集合计划托管人相关事项

1、本集合计划托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划托管人、财产、托管业务的诉讼事项。

2、本集合计划托管人办公地址没有发生变更。

3、本集合计划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。

### （三）本集合计划相关事项

1、本报告期内，本集合计划合同变更后，集合计划的投资组合策略发生变化。本集合计划投资组合比例为：（1）投资于现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、期限为7天内(含7天)的债券逆回购、到期日在1年内(含1年)的政府债券、到期日在1年内(含1年)的央行票据等高流动性短期金融产品等现金类资产占集合计划资产总值的比例为0-100%；（2）投资于固定收益类产品，包括国债、到期日在1年以上(不含1年)的地方政府债、到期日在1年以上(不含1年)的央行票据、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、短期融资券、资产支持证券、中期票据、非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、期限在7天以上（不含7天）的债券逆回购等固定收益类金融产品、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划的资产占集合计划资产总值的比例为0-100%。

2、本报告期内集合计划未进行收益分配。

3、本集合计划没有投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券。

4、本报告期内，我公司在公司网站公告东北证券6号核心优势集合资产管理计划资产管理合同变更事宜，并按《东北证券6号核心优势集合资产管理计划资产管理合同》的约定，在公告后2个工作日内以书面或电子方式向委托人发送合同变更征询意见。东北证券6号核心优势集合资产管理计划合同变更于2016年11月4日正式生效。管理人已向中国证券投资基金业协会备案。

5、本报告期内，管理人于公司网站发布调整投资主办人公告，东北证券6号核心优势集合资产管理计划投资主办人由张仲华、祝迪川先生担任。自2016年10月31日起，张仲华、祝迪川先生不再担任东北证券6号核心优势集合资产管理计划投资主办人，由赵威先生担任东北证券6号核心优势集合资产管理计划投资主办人。管理人已向中国证券投资基金业协会备案。

## 九、备查文件目录及查阅方式

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会《关于核准东北证券股份有限公司设立东北证券6号核心优势集合资产管理计划的批复》（证监许可[2011]1842号）
- 2、《东北证券6号核心优势集合资产管理计划说明书》
- 3、《东北证券6号核心优势集合资产管理计划管理合同》
- 4、《东北证券6号核心优势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：上海浦东新区杨高南路 729 号陆家嘴世纪金融广场 1 号楼 16 层  
网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

客户服务电话：021-20361067

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东证融汇证券资产管理有限公司。

东证融汇证券资产管理有限公司

2017年1月18日