

国海金贝壳 9 号（债券增强）集合资产管理计划 2016 年第 4 季度资产管理报告

（2016 年 10 月 01 日 - 2016 年 12 月 31 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 2017 年 1 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：国海金贝壳 9 号（债券增强）集合资产管理计划

产品类型：限定性集合资产管理计划

成立日期：2013 年 5 月 31 日

成立规模：160,488,972.80 份

存续期限：无固定存续期限

投资目标：本产品主要投资于固定收益类证券、银行存款等，力争获取安全稳健收益，在严格控制风险的情况下适度投资风险类资产力争获取潜在高收益，以实现绝对正收益为目的。

投资策略：实施稳健投资策略，深入研究，准确研判市场趋势，通过配置固定收益类证券获取低风险稳定收益，同时把握固定收益市场的交易性机会，从而在控制整体风险的情况下，力争为投资者实现长期稳健收益。

风险收益特征：本集合计划属风险适中产品，适合具备一定风险承受能力、追求长期稳健收益的投资者。

管理人：国海证券股份有限公司

托管人：中国银行股份有限公司

二、主要财务指标

（一）主要财务指标

| 序号 | 主要财务指标 | 2016年10月01日-2016年12月31日 |
|----|--------------------------|-------------------------|
| 1 | 集合计划本期利润 | 518.8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 | 545.2元 |
| 3 | 报告期末集合计划资产净值 | 891,691.54元 |
| 4 | 报告期末单位集合计划资产净值 | 0.9684元 |
| 5 | 报告期末单位集合计划累计资产净值 | 1.1684元 |
| 6 | 本期集合计划净值增长率 | -3.7498% |
| 7 | 集合计划累计净值增长率 | 16.84% |

注：本产品已于2016年12月21日完成改造并进行份额折算，为使以上指标具有参照意义，报表中“报告期末单位集合计划资产净值”、“报告期末单位集合计划累计资产净值”为2016年12月20日的产品运作情况，特此说明。

（二）财务指标的计算公式

1、报告期末单位集合计划资产净值=报告期末集合计划资产净值÷集合计划份额

2、报告期末单位集合计划累计资产净值=报告期末单位集合计划资产净值+单位集合计划已分红收益

3、本期集合计划净值增长率=(本期末单位集合计划资产净值-上期末单位集合计划资产净值+本期单位集合计划已分红收益)/上期末单位集合计划资产净值×100%

4、集合计划累计净值增长率=(报告期末单位集合计划累计资产净值-1)×100%

三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

截至 2016 年 12 月 20 日，集合计划单位净值为 0.9684 元，累计单位净值为 1.1684 元，累计净值增长率为 16.84%；2016 年 12 月 21 日后产品完成改造，产品单位净值恒定为 1.00 元。

（二）投资主办人简介

王者旻，英国华威大学理学硕士（经济和金融专业），2007 年就职于中信建投证券资管管理部，一直从事证券投资业务，2015 年 10 月加入国海证券，债券产品的研究设计和投资管理经验达 8 年以上。2016 年 7 月起任本集合计划投资主办人。

（三）投资主办人工作报告

1、2016 年四季度工作回顾

2016 年四季度的主要工作重心在于改造“金贝壳 9 号（债券增强）集合资产管理计划”，着手将其改造为以债券标准化资产为投资对象的债券增强型多期限集合产品，改造内容主要涉及投资范围与投资标的的估值、开放期安排与投资周期设计、自有资金参与情况、收益分配与业绩报酬提取、管理费与托管费、参与费与退出费、投资程序与风险控制组织架构等。

至 2016 年 12 月中旬已完成相关产品改造，12 月 20 日公司发布《关于国海金贝壳 9 号（债券增强）集合资产管理计划合同条款修改、变更生效的公告（二）》，变更后的合同于 2016 年 12 月 21 日生效。原有投资人同意合同变更的，已于 2016 年 12 月 21 日参与本计划 84 天第 1 期产品份额。

（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 末 余 额 | 年 初 余 额 |
|-----------------|------------|--------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 106,277.28 | 695,748.85 |
| 结算备付金 | 27.46 | 17,385.65 |
| 存出保证金 | | 2,992.26 |
| 交易性金融资产 | | 1,793,876.30 |
| 其中：股票投资 | | 228,075.00 |
| 债券投资 | | 1,208,126.30 |
| 资产支持证券投资 | | |
| 基金投资 | | 357,675.00 |
| 衍生金融资产 | | |
| 买入返售金融资产 | 800,000.00 | |
| 应收证券清算款 | | 40,762.37 |
| 应收利息 | 932.84 | 4,439.36 |
| 应收股利 | | |
| 应收申购款 | | |
| 其他资产 | | |
| | | |
| 资产合计： | 907,237.58 | 2,555,204.79 |
| 负 债 和 所 有 者 权 益 | 期 末 余 额 | 年 初 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 | | 99,990.00 |
| 应付证券清算款 | | 94,065.77 |
| 应付赎回款 | | |
| 应付管理人报酬 | 10,715.3 | 1,903.11 |
| 应付托管费 | 2,383.62 | 422.92 |
| 应付销售服务费 | | |
| 应付交易费用 | 2,447.12 | 1,478.63 |

| | | |
|-------------|------------|--------------|
| 应付税费 | | |
| 应付利息 | | 75.52 |
| 应付利润 | | |
| 其他负债 | | |
| 负债合计 | 15,546.04 | 197,935.95 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 890,931.56 | 2,239,106.52 |
| 未分配利润 | 759.98 | 118,162.32 |
| 所有者权益合计 | 891,691.54 | 2,357,268.84 |
| | | |
| 负债与持有人权益总计： | 907,237.58 | 2,555,204.79 |

2、集合计划利润表

单位：人民币元

| 项目 | 本期金额 | 本年累计金额 |
|----------------------|----------|-------------|
| 一、收入 | 1,307.99 | -156,008.37 |
| 1、利息收入 | 1,319.75 | 10,702.77 |
| 其中：存款利息收入 | 429.72 | 6,756.50 |
| 债券利息收入 | 890.03 | 2,994.80 |
| 资产支持证券利息收入 | | |
| 买入返售金融资产收入 | | 951.47 |
| 2、投资收益（损失以“-”填列） | -11.4 | -137,826.99 |
| 其中：股票投资收益 | | 27,103.00 |
| 债券投资收益 | -11.4 | -74,438.88 |
| 资产支持证券投资收益 | | |
| 基金投资收益 | | -90,635.11 |
| 权证投资收益 | | |
| 衍生工具收益 | | |
| 基金红利收入 | | |
| 股利收益 | | 144 |
| 3、公允价值变动损益（损失以“-”填列） | -26.4 | -29,968.22 |
| 4、其他收入（损失以“-”填列） | 26.04 | 1,084.07 |
| 二、费用 | 789.19 | 40,884.16 |
| 1、管理人报酬 | 577.34 | 10,715.30 |
| 2、托管费 | 131.04 | 2,383.62 |
| 3、销售服务费 | | |
| 4、交易费用 | 1.1 | 3,110.74 |
| 5、利息支出 | | 56.59 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 56.59 |
| 6、其他费用 | 79.71 | 24,617.91 |
| 三、利润总额 | 518.8 | -196,892.53 |

(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 | 106,277.28 | 11.71% |
| 股票 | 0 | 0.00% |
| 债券 | 0 | 0.64% |
| 基金 | 0 | 0.00% |
| 其他资产 | 800,960.30 | 88.29% |
| 合计 | 907,237.58 | 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”、“买入返售”等项目。

2、报告期末证券投资明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 回购利率(%) | 证券市值(元) | 占资产净值比例 |
|----|-----------|------|---------|---------|---------|
| 1 | 206012.SH | R012 | 5.0 | 800,000 | 88.18% |

3、集合计划份额变动情况

单位：份

| | |
|----------|------------|
| 报告期初总份额 | 955,805.27 |
| 报告期间参与份额 | 0.00 |
| 报告期间退出份额 | 64,873.71 |
| 报告期末份额总额 | 890,931.56 |

五、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、《国海金贝壳9号集合资产管理计划风险揭示书》
- 2、《国海金贝壳9号集合资产管理计划说明书》
- 3、《国海金贝壳9号（债券增强）集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、《国海金贝壳9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

投资者对本报告书如有疑问，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

二〇一七年一月二十三日



