

华林证券满天星 1 号

集合资产管理计划 2016 年第四季度报告



计划管理人：华林证券股份有限公司

计划托管人：宁波银行股份有限公司

报告期间：2016 年 10 月 1 日至 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》（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。

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 2017 年 1 月 13 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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

托管人宁波银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，复核了本报告中的主要财务指标、会计报表和投资组合报告等内容。

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 10 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。

一、集合计划简介

名称：华林证券满天星 1 号集合资产管理计划

简称：“满天星 1 号”

类型：集合计划

管理人：华林证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

成立日：2016 年 9 月 29 日

成立规模：73,896,888.44 份

存续期：3 年

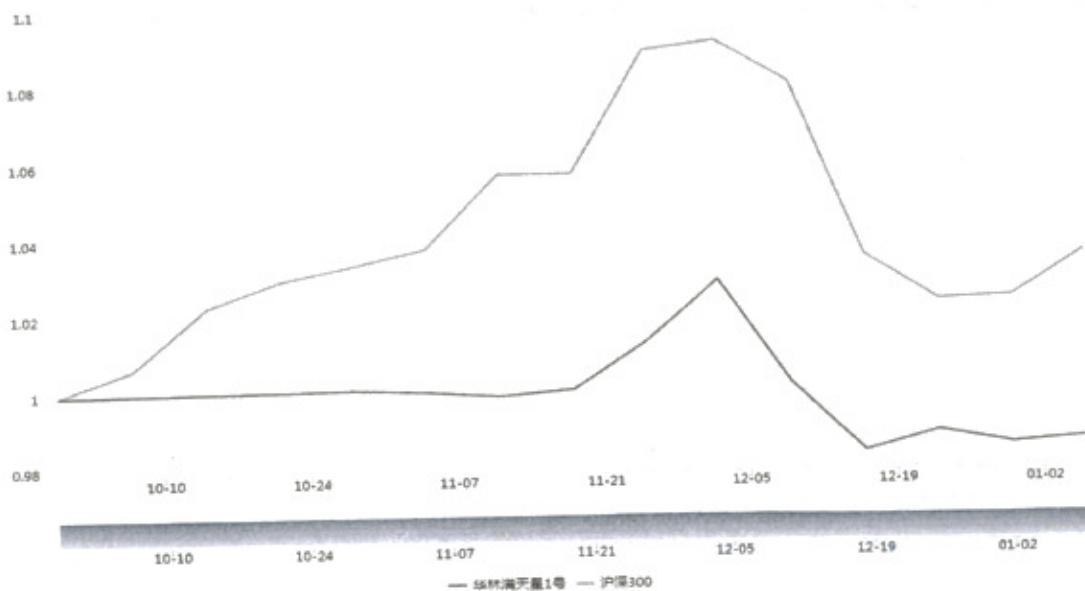
二、主要财务指标

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

项目	主要财务指标	2016年10月1日至2016年12月31日
1	集合计划本期利润	-1,212,204.18
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-1,140,526.05
3	期末集合计划资产净值	72,682,558.46
4	期末单位集合计划资产净值	0.9836
5	期末单位集合计划累计资产净值	0.9836
6	本期集合计划净值增长率	-1.64%
7	集合计划累计净值增长率	-1.64%

(二) 集合计划累计净值历史走势图



三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截止到 2016 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值为 0.9836 元，累计单位净值为 0.9836 元，集合计划累计净值增长率为-1.64%。

(二) 投资主办人简介

该集合计划投资主办人为郑培焯，西安财经学院金融学学士，五年金融行业从业经验，曾供职于光大证券深南大道营业部，光大银行深圳分行公司业务部，熟悉金融行业运作及市场资金流向，善于基本面选股，风格稳健。

(三) 投资主办人工作报告

1、运行情况

本计划成立于 2016 年 9 月 29 日，因国庆放假和政策新规要求集合资管计划需先备案后开立证券账户所致，产品前期主要投资于货币式基金，开始入市建仓时间为 11 月初，由于当时大盘处于相对高位，为控制风险，建仓初期保持较低仓位，12 月大盘回调超过 6%，由于仓位较低，产品净值小幅回撤，待后期市场走稳再逐步增仓，同时参与网下打新增强收益。

2、投资展望

四季度市场整体波动较大，蓝筹股在今年以来持续上涨过程中导致估值偏离，同时监管机构规范保险举牌和债券市场的持续下跌，导致股市在 12 月份风险集中释放，短期跌幅较大。宏观经济上由于

供给侧改革的持续收缩，周期性行业盈利开始增速，我们开始看到企业的基本面出现好转迹象，重资产行业受国企改革和经济周期变化的影响开始跑赢市场，而中小创板块由于整体估值仍然较贵，后期有进一步释放风险的可能。我们认为，由于国内经济短期仍处于反复筑底的阶段，短期市场难有系统性机会，但由于政策推行大力扶植的行业存在结构性的机会，我们看好受益于混改和供给侧改革所带来企业基本面变化预期的板块，自下而上选取底部低估值蓝筹中线持仓会成为未来较长一段时间的投资策略。

（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》、《证券公司监督管理条例》、《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、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管理部门，加强对集合资产管理业务风险的事前分析、事中监控和事后评估，并提出风险控制措施。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管理部日常监控、重点检查的结果。

本集合计划管理人的风险控制工作主要通过资产管理业务部门内控和合规风控部外部监控来进行。合规风控部全面负责风险的揭示及管理，采用授权管理、逐日监控、绩效评估以及定期与不定期检查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 12 月 31 日)

单位: 人民币元

资产	期初余额	期末余额	负债与持有人权益	期初余额	期末余额
资产:			负债:		
银行存款	0.07	8,786,700.21	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.00	2,542,512.90	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	0.00	42,897.31	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	73,891,089.00	61,724,411.00	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
其中: 股票投资	0.00	21,724,411.00	应付证券清算款	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	73,891,089.00	40,000,000.00	应付管理人报酬	2,024.57	188,318.96
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	101.23	9,415.97
资产支持证券投资	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00	应付交易费用	0.00	227,625.70
买入返售金融资产	0.00	0.00	应交税费	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收利息	5,799.37	6,034.07	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	5,363.60	其他负债	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	负债合计	2,125.80	425,360.63
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益:		
			实收基金	73,896,888.44	73,896,888.44
			未分配利润	-2,125.80	-1,214,329.98
			所有者权益合计	73,894,762.64	72,682,558.46
资产合计	73,896,888.44	73,107,919.09	负债和所有者权益总计	73,896,888.44	73,107,919.09

2、集合计划经营业绩表 (2016 年 10 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)

单位：人民币元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	-617,086.05	-617,086.05
2	1、利息收入	201,762.07	201,762.07
3	其中：存款利息收入	38,568.83	38,568.83
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	163,193.24	163,193.24
7	2、投资收益	-747,169.99	-747,169.99
8	其中：股票投资收益	-919,136.36	-919,136.36
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	0.00	0.00
13	衍生工具收益	0.00	0.00
14	股利收益	171,966.37	171,966.37
15	3、公允价值变动收益	-71,678.13	-71,678.13
16	4、其他收入	0.00	0.00
17	二、费用	595,118.13	597,243.93
18	1、管理人报酬	186,294.39	188,318.96
19	2、托管费	9,314.74	9,415.97
20	3、销售服务费	0.00	0.00
21	4、交易费用	399,509.00	399,509.00
22	5、利息支出	0.00	0.00
23	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
24	6、其他费用	0.00	0.00
25	三、利润总和	-1,212,204.18	-1,214,329.98

(二) 集合计划投资组合报告 (2016 年 12 月 31 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	8,786,700.21	12.02%
清算备付金	2,542,512.9	3.48%
存出保证金	42,897.31	0.06%
股票投资	21,724,411.00	29.71%
基金投资	40,000,000.00	54.71%
应收股利	5,363.60	0.01%
应收利息	6,034.07	0.01%
合计	73,107,919.09	100%

2、报告期末按市值占集合计划净值比例大小排序的持仓股票明细

股票代码	股票名称	数量	市值	市值占净值比
600565	迪马股份	1,000,000	7,420,000.00	10.21%
600150	中国船舶	252,700	6,977,047.00	9.60%
000623	吉林敖东	183,600	5,689,764.00	7.83%
300568	星源材质	20,000	1,637,600.00	2.25%

3、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的基金明 细

基金代码	基金名称	数量	市值	市值占净值比
2139090	宝盈货币 B	40,000,000	40,000,000	55.03%

4、集合计划份额变动

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
73,896,888.44	0	0	73,896,888.44

五、重要事项提示

（一）本集合计划管理人及托管人相关事项

1、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人、财产、托管业务的诉讼事项。

2、本报告期内投资主办人没有发生变更。

3、本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

4、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。

（二）本集合计划相关事项

1、本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变。

2、本报告期内集合计划未进行收益分配。



六、信息披露的查阅方式

查阅网址：www.chinalions.cn

咨询电话：400 188 3888

