

# 国金工银量化恒盛精选 D 类 50 期集合资产管理计划

## 2016 年年度资产管理报告

### 第一节 重要提示

本报告由国金工银量化恒盛精选 D 类 50 期集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）管理人编制。管理人保证本报告所载资料的真实性、准确性和完整性。

本集合计划托管人中国工商银行股份有限公司海南省分行于 2017 年 3 月 15 日对本报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告等数据进行复核，数据真实、准确。

管理人承诺以诚实信用、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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划说明书。

本报告相关财务资料已经审计。

本报告期间：2016 年 4 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日

本报告中的内容由管理人负责解释。

### 第二节 集合计划报告

集合计划名称：	国金工银量化恒盛精选 D 类 50 期集合资产管理计划
集合计划类型：	集合资产管理计划
成立日：	2016 年 4 月 29 日
存续期：	18 个月
报告期末集合计划总份额：	【560,000,000.00】份 （其中含管理人持有份额【0.00】份，占比【0.00%】）
投资目标：	在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
投资理念：	本集合计划遵循稳健投资的理念，通过优选个股与优化组合的方式，在较低的回撤幅度下，获取长期稳健绝对收益。
管理人：	国金证券股份有限公司
托管人：	中国工商银行股份有限公司海南省分行
投资顾问：	浙江思考投资管理股份有限公司
注册登记机构：	国金证券股份有限公司



### 第三节 主要财务指标和集合计划净值表现

#### 一、 主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	81,033,059.51
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	82,391,582.80
加权平均每份额本期利润	0.1456
期末资产净值	641,033,059.51
期末每份额净值	1.1447
期末每份额累计净值	1.1447

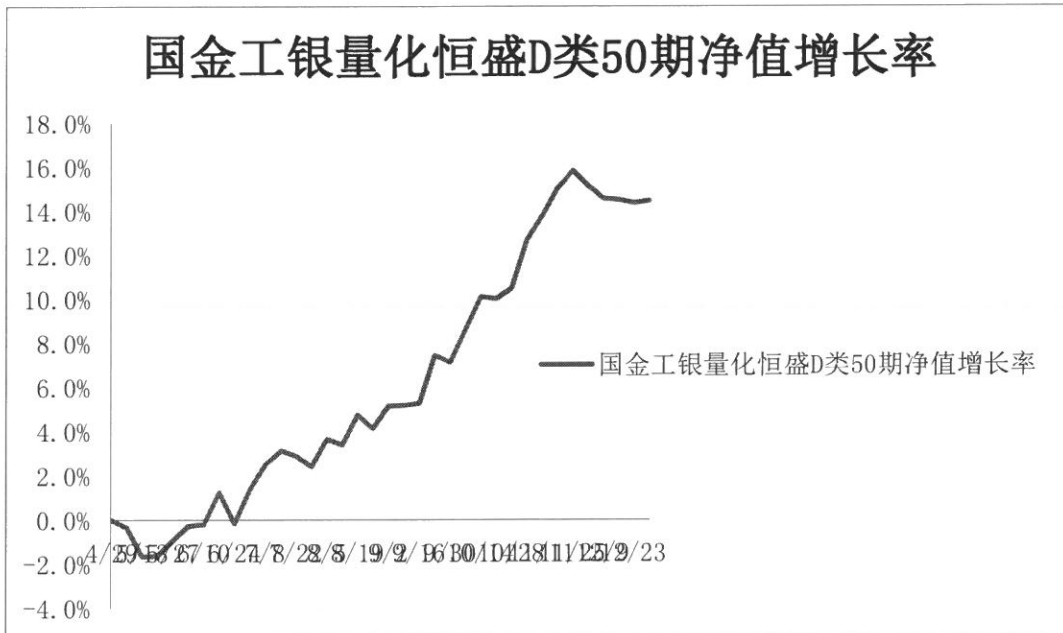
#### 二、 财务指标计算公式

1、 期末每份额净值=期末资产净值÷集合计划份额

#### 三、 收益分配情况

本集合计划报告期内无收益分配。

#### 四、 集合计划累计净值增长率历史走势图



### 第四节 管理人报告

#### 一、 业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日,本集合计划单位净值为 1.1447 元,累计单位净值 1.1447 元,本期集合计划收益率为 14.47%。

## 二、投资主办人简介

董波先生:研究生学历,具有 5 年证券行业从业经历。2010 年至 2013 年就职于中航证券资产管理分公司,先后任职华北区副总经理,资产管理分公司市场总监。2013 年加入国金证券股份有限公司,曾任资产管理分公司资产管理三部助理总经理,投资经理。现任资产管理分公司资产管理五部副总经理(部门负责人),投资经理。

## 三、投资主办人工作报告

### 1、 市场回顾和投资操作

2016 年第四季度,在深港通开通,人民币贬值等一系列大事件的影响下,市场呈现二八分化,大盘蓝筹股涨幅好于小盘股,市场做多情绪浓厚,但新股发行节奏明显加快,对市场形成一定压力。上证指数国庆节后连续发力,在一带一路、险资举牌、股权转让等概念催动下,最高涨至 3301 点,12 月份指数有所回调,最终季度涨幅为 3.29%;深市尤其是中小创股票普遍受估值回归影响,震荡向下,跌幅明显,深圳成指下跌 3.69%,中小板指数下跌 4.59%,创业板下跌 8.74%。本期内采取积极交易策略,精选个股,重仓参与这波行情,仓位最高时达 100%,同时通过大宗交易和差价交易方式,稳步盈利。在 12 月上旬,我们预见到股市可能面临短期回调,遂逐渐降低仓位至 50%以下,闲置资金进行现金管理。

### 2、 市场展望和投资策略

2017 年国内经济环境仍有一定压力,供给侧改革和国企改革力度会逐渐加强,我们认为市场仍会延续 2016 年的个股分化行情。新股发行节奏仍可能很快,次新股和各类定增解禁压力很大;3500 点以上套牢盘较大,当时海量的抄底资金、国家队资金等都在这个点位,指数涨到这个点位以上就会有减持的动力。好的一点是,在目前资金面较宽松的状态下,货币通胀压力出现,资产慌及楼市泡沫的逐渐破裂会使部分资金进入股市,市场存在结构性行情。我们将延续我们的大宗交易+礼花弹策略,同时严格控制回撤,灵活调整仓位,以期产品能取得更好的成绩。

## 四、风险控制报告

2016年年度，国金证券针对本集合计划的运作特点，通过控制风险头寸，配置持仓结构和量化与行研联合排雷来管理事前风险；通过监控实时系统，交易员跟踪盯盘和及时警示个股异常波动来监督事中风险；通过评估绩效，报告每日风险管理，进行每月投资检讨以及强制止损机制等措施来对事后风险进行反馈和评估。同时，本集合计划通过完善的风险控制体系及时评估集合计划运作过程中面临的各种风险，为投资决策提供风险分析支持，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，本集合计划运作合法合规，未出现违反相关规定的状况，也未发生损害投资者利益的行为。

## 第五节 集合资产管理计划财务报告

### 一、集合资产管理计划资产负债表

日期：2016-12-31

单位：人民币元

资产	期末数	期初数
资产：		
银行存款	6,810,010.48	0.00
结算备付金	2,334,686.26	0.00
存出保证金	524,282.03	0.00
交易性金融资产	577,485,500.00	0.00
其中：股票投资	327,485,500.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
基金投资	250,000,000.00	0.00
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00
买入返售金融资产	74,300,037.15	0.00
应收证券清算款	851,109.73	0.00
应收利息	7,180.38	0.00
应收股利	143,697.50	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	662,456,503.53	0.00

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债与持有人权益	期末数	期初数
负 债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	317,852.26	0.00
应付托管费	158,926.14	0.00
应付销售服务费	0.00	0.00
应付投资顾问费	20,673,397.69	0.00
应付交易费用	255,767.93	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	17,500.00	0.00
负债合计	21,423,444.02	0.00
所有者权益：		
实收基金	560,000,000.00	0.00
未分配利润	81,033,059.51	0.00
所有者权益合计	641,033,059.51	0.00
负债和所有者权益总计	662,456,503.53	0.00

## 二、 集合资产管理计划经营业绩表

日期：2016年04月 - 2016年12月

单位：人民币元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	106,554,203.68	0.00
2	1、利息收入	2,061,374.68	0.00
3	其中：存款利息收入	937,753.26	0.00
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	1,123,621.42	0.00
7	2、投资收益	105,851,352.29	0.00

8	其中：股票投资收益	105,409,569.54	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	441,782.75	0.00
15	3、公允价值变动收益	-1,358,523.29	0.00
16	4、其他收入	0.00	0.00
17	二、费用	25,521,144.17	0.00
18	1、管理人报酬	800,797.21	0.00
19	2、托管费	400,398.68	0.00
20	3、销售服务费	0.00	0.00
21	4、交易费用	2,421,287.93	0.00
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	21,898,660.35	0.00
25	三、利润总和	81,033,059.51	0.00

## 第六节 投资组合报告

### 一、报告期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例
股票	327,485,500.00	49.44%
债券	0.00	0.00%
基金	250,000,000.00	37.74%
回购	74,300,037.15	11.22%
证券理财产品	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	9,144,696.74	1.38%
其他	1,526,269.64	0.23%
合计	662,456,503.53	100.00%

其他包括：存出保证金、应收利息、应收股利、证券清算款等。

### 二、报告期末市值占集合计划资产净值前五名股票明细



序号	代码	名称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	002715	登云股份	4,580,000	163,002,200.00	25.43%
2	000014	沙河股份	5,670,000	117,879,300.00	18.39%
3	000713	丰乐种业	4,000,000	46,600,000.00	7.27%
4	601375	中原证券	1,000	4,000.00	0.00%

### 三、报告期末市值占集合计划资产净值前五名基金明细

序号	代码	名称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	000301	德邦德利货币 B	250,000,000	250,000,000.00	39.00%

### 四、报告期末市值占集合计划资产净值前五名回购明细

序号	代码	名称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	204001	GC001	74,300,037.15	74,300,037.15	11.59%

#### 投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前五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受到公开谴责、处罚。

## 第七节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	560,000,000.00
红利再投资份额	0.00
报告期间参与份额	0.00
报告期间退出份额	0.00
报告期末份额总额	560,000,000.00

## 第八节 重要事项提示

### 一、本集合计划管理人及托管人相关事项

- 1、报告期内，本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生与本集合计划相关的诉讼事项。
- 2、报告期内，本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。
- 3、报告期内，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、本集合相关事项

无

## 第九节 信息披露的查阅方式

网址：<http://www.gjzq.com.cn>

电话：021-60935621



国金证券股份有限公司

二〇一七年三月十五日