

# 国金慧睿 2 期量道 1 号集合资产管理计划

## 2016 年年度资产管理报告

### 第一节 重要提示

本报告由国金慧睿 2 期量道 1 号集合资产管理计划（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。

本集合计划托管人平安银行股份有限公司于 2017 年 3 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告等数据，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 8 月 22 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：	国金慧睿 2 期量道 1 号集合资产管理计划
集合计划类型：	集合资产管理计划
成立日：	2016 年 8 月 22 日
存续期：	无固定期限
报告期末集合计划总份额：	【81,000,000.00】份 (其中含管理人持有份额【0.00】份，占比【0.00%】)
投资目标：	以持续超越大盘和极低的回撤幅度为目标，力求在给投资人带来稳健收益的同时实现风险的最小化。
投资理念：	本集合计划利用大量的市场数据，结合中国市场的特点，综合运用金融理论、数学方法和计算机技术，搭建股票策略。同时利用股指期货对冲，以长期获得相对大盘的稳定的收益，并且回撤幅度很小。策略适应各种风格的市场，穿越牛熊。
管理人：	国金证券股份有限公司



托管人:	平安银行股份有限公司
投资顾问:	浙江量道资产管理有限公司
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	1,840,859.88
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,331,390.01
加权平均每份额本期利润	0.0230
期末资产净值	82,840,859.88
期末每份额净值	1.0227
期末每份额累计净值	1.0227

#### 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

本集合计划在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 1.0227 元,累计单位净值 1.0227 元,本期集合计划收益率为 2.27%。

### 二、投资主办人简介

董波先生,英国约克大学数理统计专业学士,英国约克大学数理金融专业、英国伦敦政治经济学院统计专业双硕士,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,现任资产管理分公司资产管理五部副总经理,投资经理。

### 三、投资主办人工作报告

#### 1、市场回顾和投资操作

国金慧睿二期量道 1 号资产管理计划于 9 月中旬开始运作,整体策略表现稳定,净值实现持续增长,只有在 11 月份市场极度分化的时候出现过小幅回撤。2016 年产品整体表现来看,9 月及 10 月表现非常稳健,11 月份沪深股市在经历一轮大小指数严重分化的指数上攻行情后在 12 月出现较大幅度回调,多变的市场环境对阿尔法策略和择时策略均构成较大挑战。11 月由于蓝筹股的持续拉升和中小板的走弱,对以中小板股票为主要建仓标的阿尔法及择时策略组合形成较大冲击,在市场不利的情况下公司对策略的建仓时机,建仓标的和仓位配置及时做出了调整,将过去以中证 500 为主改为中证 500 和沪深 300 混合,同时配合择时多头策略和灵活的基差交易,有效的控制和降低了组合风险,提高了整体收益。12 月大盘虽然出现较大幅度下行,但是策略组合及产品净值均已经创出新高。

#### 2、市场展望和投资策略

2017 年,预计政策上仍然以“宽财政,紧货币”为导向,出现较大的趋势性行情难度较大,整体上依然以震荡行情和结构性机会为主。近期证监会在期指问题上频繁吹风,我们认为大概率会在年初开始对期指的持仓和保证金限制逐步解禁,这对于阿尔法策略来说是重要利好,意味着我们可以以更低的成本更有效的进行操作,盈利空间也会更大。

### 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	198,225.59	0.00
结算备付金	5,494,838.56	0.00
存出保证金	17,583,145.60	0.00
交易性金融资产	49,507,600.00	0.00
其中：股票投资	49,507,600.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	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	10,400,005.20	0.00
应收证券清算款	291.78	0.00
应收利息	6,142.32	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	83,190,249.05	0.00

集计划资产负债表（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	20,716.07	0.00
应付托管费	31,074.06	0.00
应付销售服务费	0.00	0.00
应付投资顾问费	166,937.89	0.00
应付交易费用	125,161.15	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	5,500.00	0.00
负债合计	349,389.17	0.00
所有者权益：		
实收基金	81,000,000.00	0.00
未分配利润	1,840,859.88	0.00
所有者权益合计	82,840,859.88	0.00
负债和所有者权益总计	83,190,249.05	0.00

## 二、 集合资产管理计划经营业绩表

日期：2016年08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	2,631,893.91	0.00
2	1、利息收入	237,949.89	0.00
3	其中：存款利息收入	87,567.03	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	150,382.86	0.00
7	2、投资收益	1,884,474.15	0.00
8	其中：股票投资收益	3,819,926.51	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	-1,987,617.00	0.00
14	股利收益	52,164.64	0.00
15	3、公允价值变动收益	509,469.87	0.00
16	4、其他收入	0.00	0.00
17	二、费用	791,034.03	0.00
18	1、管理人报酬	29,372.85	0.00
19	2、托管费	44,059.28	0.00
20	3、销售服务费	0.00	0.00
21	4、交易费用	501,479.95	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	216,121.95	0.00
25	三、利润总和	1,840,859.88	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	49,507,600.00	59.51%
债券	0.00	0.00%
基金	0.00	0.00%
回购	10,400,005.20	12.50%
证券理财产品	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	5,693,064.15	6.84%
其他	17,589,579.70	21.14%
合计	83,190,249.05	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	600488	天药股份	141,700	879,957.00	1.06%
2	600216	浙江医药	68,700	871,116.00	1.05%
3	600812	华北制药	134,900	844,474.00	1.02%
4	002433	太安堂	77,200	836,848.00	1.01%
5	600888	新疆众和	83,300	652,239.00	0.79%

### 三、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	10,400,005.20	10,400,005.20	12.55%

### 四、报告期末市值占集合计划资产净值前五名期货明细

序号	代码	名称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	IC1701	中证 500 股指期货 1701 合约	35	-43,520,400.00	-52.53%

注：持有空头合约股指期货市值用负数表示，持有多头合约股指期货市值用正数表示。

#### 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	81,000,000.00
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	81,000,000.00

## 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