

国海天信投资新三板 1 号集合资产管理计划 2017 年第 2 季度资产管理报告

(2017 年 04 月 01 日—2017 年 06 月 30 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 7 月 13 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：国海天信投资新三板 1 号集合资产管理计划

成立日期：2016 年 1 月 25 日

成立规模：30,094,538.87 份

存续期限：2.5 年

投资目标：在严格管理风险前提下，为集合计划持有人追求资产增值。

投资理念：本集合计划遵循稳健投资的投资理念，在有效控制风险的前提下，主要通过投资升值潜力较大的新三板挂牌公司的股票，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。

风险收益特征：本集合计划的优先级属于中风险产品，适合风险承受能力适中，追求稳健投资收益的投资者；本集合计划的进取级属于高风险产品，适合风险承受能力较高，追求高预期收益的投资者。

管理人：国海证券股份有限公司

投资顾问：福建天信投资咨询顾问股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

二、主要财务指标

(一) 主要财务指标

序号	主要财务指标	2017年04月01日—2017年06月30日
1	集合计划本期利润	-349,354.22 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	-98,054.72 元
3	报告期末集合计划资产净值	27,403,571.35 元
4	报告期末天信投资新三板1号A单位净值	1.053 元
5	报告期末天信投资新三板1号B单位净值	0.626 元
6	报告期末天信投资新三板1号A累计单位净值	1.143 元
7	报告期末天信投资新三板1号B累计单位净值	0.626 元
8	报告期末天信投资新三板1号A累计净值增长率	14.30%
9	报告期末天信投资新三板1号B累计净值增长率	-37.4%

(二) 财务指标的计算公式

- 1、报告期末单位净值=报告期末集合计划资产净值÷集合计划份额
- 2、报告期末累计单位净值=报告期末单位净值+单位集合计划已分红收益
- 3、报告期末累计净值增长率=(报告期末累计单位净值-1)×100%

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至2017年06月30日,天信投资新三板1号A单位净值为1.053元,累计单位净值为1.143元,累计净值增长率为14.30%;天信投资新三板1号B单位净值为0.626元,累计单位净值为0.626元,累计净值增长率为-37.4%。

(二) 投资主办人简介

李军先生，现任资本市场总部总经理助理，投资主办，毕业于上海财经大学，数量经济学硕士，具备理工、经济复合学历背景。历任中海信托股份有限公司信托业务总部高级信托经理、申万宏源证券有限公司资产管理事业部资本市场总部产品总监，擅长各类资本市场业务、大类资产混合投资业务和创新资本市场业务。

(三) 投资主办人工作报告

截至2017年6月底，新三板挂牌家数11298家，相比2017年1月底新增了843家，其中做市转让减少103家，协议转让增加946家，总市值超过6千亿股。

2017年三季度，本集合计划将继续秉承价值+长期投资理念。着眼国家政策、社会经济发展趋势，布局未来前沿行业；侧重创新层、高成长型企业，挖掘潜质巨大的低估值企业；抓住市场契机，择机介入具有转板潜力的企业。

(四) 内部管控

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、内部监督管理

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	期初余额	期末余额
资产：		
银行存款	19,040,642.47	19,199,967.42
结算备付金		
存出保证金		
交易性金融产品	9,012,000.00	8,632,200.00
其中：股票投资	9,012,000.00	8,632,200.00
债券投资		
资产支持证券投资		
基金投资		
贵金属投资		
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		
应收利息	4,188.91	3,837.78
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
资产总计	28,056,831.38	27,836,005.20
负债及持有人权益	期初余额	期末余额
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		
应付证券清算款		
应付赎回款		
应付管理人报酬	104,966.69	207,947.81
应付托管费	10,496.66	20,794.83
应付销售服务费	119,788.38	188,442.46
应付交易费用		248.75
应交税费		
应付利息		
应付利润		
其他负债		15,000.00
负债合计	235,251.73	432,433.85
持有人权益		
实收基金	30,094,538.87	30,094,538.87
未分配利润	-2,272,959.22	-2,690,967.52
所有者权益合计	27,821,579.65	27,403,571.35
负债和所有者权益总计	28,056,831.38	27,836,005.20

2、集合计划利润表

单位:人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	-220,636.35	487,513.09
1. 利息收入	34,683.65	70,833.09
其中: 存款利息收入	34,683.65	70,833.09
债券利息收入		
资产支持证券利息收入		
同业存单利息收入		
买入返售金融资产利息收入		
黄金合约租出利息收入		
2. 投资收益	-4,020.50	-4,020.50
其中: 股票投资收益	-4,020.50	-4,020.50
债券投资收益		
资产支持证券投资收益		
衍生工具收益		
股利收益		
贵金属投资收益		
3. 公允价值变动收益	-251,299.50	420,700.50
汇兑收益		
4. 其他收入		
二、费用	128,717.87	244,181.22
1. 管理人报酬	102,981.12	207,947.81
2. 托管费	10,298.17	20,794.83
3. 销售服务费		
4. 交易费用	438.58	438.58
5. 利息支出		
其中: 卖出回购金融资产支出		
6. 其他费用	15,000.00	15,000.00
三、利润总额	-349,354.22	243,331.87
所得税费用		
净利润	-349,354.22	243,331.87

(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)	占资产净值比例
银行存款及结算备付金	19,199,967.42	68.98%
股票投资	8,632,200.00	31.01%
其他资产	3837.78	0.01%
合计	27,836,005.20	100.8456%

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”、“信托投资”等项目。

2、集合计划份额变动情况

单位：份

天信投资新三板1号A报告期初总份额	20,054,172.29
天信投资新三板1号A报告期内增加份额	0.00
天信投资新三板1号A报告期内减少份额	0.00
天信投资新三板1号A报告期末份额总额	20,054,172.29
天信投资新三板1号B报告期初总份额	10,040,366.58
天信投资新三板1号B报告期内增加份额	0.00
天信投资新三板1号B报告期内减少份额	0.00
天信投资新三板1号B报告期末份额总额	10,040,366.58

五、备查文件目录

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、《国海天信投资新三板1号集合资产管理计划说明书》
- 2、《国海天信投资新三板1号集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《国海天信投资新三板1号集合资产管理计划风险揭示书》
- 4、《国海天信投资新三板1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：上海市黄浦区福佑路8号人保寿险大厦11层

网址：www.ghzq.com.cn

信息披露电话：021-61018023

投资者对本报告有任何疑问，可咨询管理人国海证券股份有限公司。

