



创金价值成长5期集合资产管理计划

季度资产管理报告

(2017年7月1日—2017年9月30日)

第一节 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》）及其它有关规定制作。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容。

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。

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2017年7月1日至2017年9月30日。

第二节 集合资产管理计划概况

一、基本资料

名称	创金价值成长5期集合资产管理计划
类型	非限定性集合资产管理计划
成立日	2013年2月28日
报告期末份额总额	52,812,305.17份
存续期	无固定存续期
投资目标	秉承价值投资理念，前瞻性研究宏观经济、行业、以及企业基本面变化，积极主动进行资产配置，精选个股，分享优秀企业的成长成果，实现资产的长期稳健增值。



业绩比较基准	沪深300指数×70% +中证全债指数×30%
风险收益特征	较高风险
管理人	第一创业证券股份有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司

二、管理人

名称：第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人：刘学民

电话：95358

网址：<http://www.firstcapital.com.cn>

三、托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

电话：010-95588

网址：<http://www.icbc.com.cn>

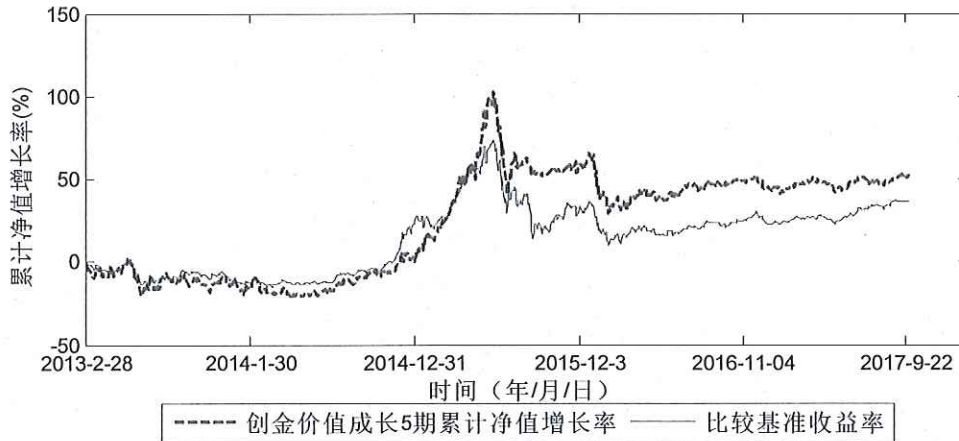
第三节 集合资产管理计划财务指标

一、主要财务指标（单位：人民币元）

集合计划本期利润	723,802.00
集合计划本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-86,172.52
期末集合计划资产净值	56,431,519.72
期末集合计划单位净值	1.069
期末集合计划累计单位净值	1.540



二、集合计划累计单位净值增长率与投资基准收益率的历史走势对比图



第四节 管理人报告

一、集合资产管理计划业绩表现

本集合计划于2013年2月28日成立,截至2017年9月30日,集合计划单位净值1.069元,累计单位净值1.540元,本集合计划自成立之日起累计净值增长率为54%。

二、投资主办人简介

陈建军女士,中南林业科技大学硕士研究生。目前就职于第一创业资产管理部,加盟之前分别就职于创金合信基金研究部和第一创业资产管理部投研部,覆盖商贸零售、餐饮旅游以及轻工制造行业研究,在此之前,曾就职于茂业国际(00848.HK)投资者关系部,拥有董事会秘书资格,主要负责上市公司信息披露、投资者关系以及百货行业研究,拥有多次行业并购及境外融资经验,熟悉公司资本运作。通过多年的工作和学习,对消费行业有较深的理解,善于自上而下选股,积累了一套关于成长类和困境反转类股票的投资经验。



三、投资主办人工作报告

（一）投资回顾

过去一段时间市场出现了显著的结构分化，部分公司出现了大幅度上涨，超额收益十分显著，但不排除其中部分标的未来一段时间进入休整期的可能。

（二）投资展望

从中长期看，优质企业经过多年成长，已经初步完成了物质基础和管理能力的积累，随着外部制约因素的减弱和消除，部分优质企业将进入良性循环的发展轨道，因此前期市场的结构性分化只是一次对于价值投资的启蒙，随着优质企业的经营状况不断改善及竞争力的持续提升，市场会对未来经济的发展方向有更加清晰的认识和理解，优质投资标的也将越来越多的被市场关注和认知。

在过去的一个季度中，我们的投资组合基本保持稳定，未来我们将根据市场的变化对投资组合进行动态优化。

四、集合资产管理计划风险控制报告

1、集合资产管理计划运作合规性声明

报告期内，管理人严格遵守《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》、本集合计划合同以及管理人关于客户资产管理业务制度的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划的资产，在严格控制风险的基础上，致力于投资者利益的最大化。本报告期内，本集合计划的运作合法合规，不存在损害集合计划份额持有人权益的行为，本集合计划的投资管理符合相关法律法规的规定。

2、风险控制报告

本集合计划管理人的内部风险控制工作主要由公司风险管理部负责。风险管理部采取授权管理、逐日监控、绩效评估、定期与不定期检查等多种方式对本集合计划的管理运作进行风险控制。风险管理部通过风险监控与风险预警机制，重点检查本集合计划是否达到各项风险控制指标，是否存在损害集合计划持有人利益的行为，及时发现和处理本集合计划运作过程中可能出现的风险。对报告期内发现的风险事项，风险管理部已及时进行了风险揭示，并督促相关部门及时采取风险应对措施予以解决。

我们认为，本报告期内，集合计划管理人始终能按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划合同及说明书的要求，对集合计划进行运作管理；本集合计划的投资决策、



投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易情况；相关信息披露和财务数据皆真实、准确、完整、及时。

第五节 投资组合报告

一、期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例%
股票投资	49,934,242.11	87.17%
债券投资	0	0.00%
基金投资	3,459,654.45	6.04%
应收利息	745.89	0.00%
银行存款及清算备付金	3,694,544.19	6.45%
其他资产	193,914.14	0.34%
合计	57,283,100.78	100.00%

说明：①其他资产包括存出保证金和应收证券清算款、买入返售金融资产、理财产品等。
②部分项目可能存在小数点位差调整。

二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	证券市值（元）	占净值（%）
1	002152	广电运通	502,787	3,936,822.21	6.98%
2	000625	长安汽车	277,016	3,925,316.72	6.96%
3	000069	华侨城A	293,917	2,401,301.89	4.26%
4	000063	中兴通讯	83,005	2,349,041.50	4.16%
5	000800	一汽轿车	158,054	2,174,823.04	3.85%
6	000550	江铃汽车	87,899	1,818,630.31	3.22%
7	002202	金风科技	131,682	1,719,766.92	3.05%
8	600054	黄山旅游	82,748	1,398,441.20	2.48%
9	601111	中国国航	158,400	1,381,248.00	2.45%
10	600138	中青旅	63,932	1,370,062.76	2.43%

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

本集合计划本报告期期末未持有债券。

四、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十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。

第六节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	56,296,924.70
报告期间总参与份额	469,312.34
报告期间总退出份额	3,953,931.87
报告期末份额总额	52,812,305.17

第七节 重要事项提示

一、本集合计划管理人及托管人相关事项

1、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在本报告期内没有受到任何处罚。

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、本集合计划于2017年8月25日进行了第五次收益分配，向全体委托人每10份集合计划份额派发红利为0.23元。



第八节 信息披露的查阅方式

一、本集合计划备查文件目录

- 1、《创金价值成长5期集合资产管理计划说明书》
- 2、《创金价值成长5期集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 3、 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：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人第一创业证券股份有限公司。

网址：[http:// www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

热线电话：95358



第一创业证券股份有限公司
二〇一七年十月二十五日