

国海金贝壳贵宾定制 1 号集合资产管理计划 2017 年第 3 季度资产管理报告

(2017 年 07 月 01 日—2017 年 09 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 10 月 20 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：国海金贝壳贵宾定制 1 号集合资产管理计划

产品类型：集合资产管理计划

成立日期：2014 年 10 月 30 日

成立规模：101,001,001.38 份

存续期限：无固定存续期限

投资目标：本计划投资目标为在严格管理风险前提下，力争获取安全稳健收益。

投资策略：本计划实施稳健投资策略，深入研究，准确研判市场趋势，通过重点投资于固定收益类资产获取低风险稳定收益，在控制整体风险的情况下，力争为投资者实现长期稳健收益。

风险收益特征：本集合计划属中风险产品，适合推广对象为管理人和推广机构评定的风险承受能力与产品风险等级相匹配的合格投资者。

管理人：国海证券股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司深圳市分行

二、主要财务指标

(一) 主要财务指标

序号	主要财务指标	2017 年 07 月 01 日—2017 年 09 月 30 日
1	集合计划本期利润	28,596,503.31 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	28,596,503.31 元
3	报告期末集合计划资产净值	2,636,121,919.45 元
4	报告期末单位集合计划资产净值	1.1527 元
5	报告期末单位集合计划累计资产净值	1.1527 元
6	本期集合计划净值增长率	1.10%
7	集合计划累计净值增长率	1.10%

(二) 财务指标的计算公式

1、报告期末单位集合计划资产净值=报告期末集合计划资产净值÷集合计划份额

2、报告期末单位集合计划累计资产净值=报告期末单位集合计划资产净值+单位集合计划已分红收益

3、本期集合计划净值增长率=(本期末单位集合计划资产净值-上期末单位集合计划资产净值+本期单位集合计划已分红收益)/上期末单位集合计划资产净值×100%

4、集合计划累计净值增长率=(报告期末单位集合计划累计资产净值-上期末单位集合计划累计资产净值)/上期末单位集合计划累计资产净值×100%

三、集合计划管理人报告

(一) 业绩表现

截至 2017 年 9 月 30 日,集合计划单位净值为 1.1527 元,累计单位净值为 1.1527 元。本期集合计划净值增长率 1.10%,累计净值增长率为

1.10%。

(二)投资主办人简介

翟卢琼女士，广西大学化学工艺硕士，5 年以上证券从业经验。2010 年 8 月至 2015 年 11 月曾就职于国海证券研究所，从事化工行业研究；2015 年 11 月加入国海证券资管分公司后，从事部门债券研究与产品投资工作，曾经担任金贝壳稳德利投资经理助理，在现金管理产品投资和管理方面积累了丰富的经验。

(三)投资主办人工作报告

2017 年，从宏观层面而言，伴随着政府财政刺激的进一步加码，短期内经济企稳将是大概率事件，但是由于对房地产过热的限制以及过剩产能的供给侧改革向纵深推进，长期来看经济并不容乐观。同时，在金融去杠杆的大背景下，监管政策和货币政策轮番发力，金融监管保持高压态势，央行货币政策采取“削峰填谷”，资金面始终处于紧平衡状态。

在投资策略方面，我们仍将维持中短久期和中高评级金融机构次级债为主的配置策略，保持现有品种的持仓结构和仓位，以获取持有到期的配置收益。

(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	11,155,777.86	41,038,576.85
结算备付金		
存出保证金		
交易性金融产品	2,520,000,000.00	2,520,000,000.00
其中: 股票投资		
债券投资	2,520,000,000.00	2,520,000,000.00
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	76,827,875.04	75,479,824.06
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
资产总计	2,607,983,652.90	2,636,518,400.91
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	214,118.38	198,240.73
应付托管费	214,118.38	198,240.73
应付受托费		
应付交易费用		
应交税费		
应付利息		
应付利润		
其他负债	30,000.00	
负债合计	458,236.76	396,481.46
持有人权益		
实收基金	2,286,817,388.61	2,286,817,388.61
未分配利润	320,708,027.53	349,304,530.84

所有者权益合计	2,607,525,416.14	2,636,121,919.45
负债和所有者权益总计	2,607,983,652.90	2,636,518,400.91

2、集合计划利润表

单位:人民币元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	28,992,984.77	90,249,671.34
1. 利息收入	28,992,984.77	91,263,671.34
其中: 存款利息收入	47,012.25	787,518
债券利息收入	28,945,972.52	90,476,153.34
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产利息收入		
商业银行理财产品利息收入		
信托产品利息收入		
基础设施债权投资计划利息收入		
特定资产管理计划利息收入		
其他利息收入		
2. 投资收益		104,000.00
其中: 股票投资收益		
债券投资收益		104,000.00
资产支持证券投资收益		
衍生工具收益		
股指期货投资收益		
股利收益		
商业银行理财产品投资收益		
信托产品投资收益		
基础设施债权投资计划投资收益		
特定资产管理计划投资收益		
养老金产品投资收益		
保险资产投资收益		
其他投资收益		
3. 公允价值变动收益		-1,118,000.00
4. 其他收入		
二、费用	396,481.46	1,323,192.42
1. 管理人报酬	198,240.73	635,301.21
2. 托管费	198,240.73	635,301.21
3. 受托费		
4. 交易费用		
5. 利息支出		
其中: 卖出回购金融资产支出		
6. 其他费用		52,590.00

三、利润总额	28,596,503.31	88,926,478.92
--------	---------------	---------------

(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)	占资产总值比例
银行存款及结算备付金	41,038,576.85	1.56%
股票	0.00	0.00%
债券	2,520,000,000.00	95.58%
其他资产	75,479,824.06	2.86%
合计	2,636,518,400.91	100.00%

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”等项目。

2、集合计划份额变动情况

单位：份

报告期初总份额	2,286,817,388.61
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	2,286,817,388.61

五、备查文件目录

(一)本集合计划备查文件目录

- 1、《国海金贝壳贵宾定制1号集合资产管理计划说明书》
- 2、《国海金贝壳贵宾定制1号集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 3、《国海金贝壳贵宾定制1号集合资产管理计划风险揭示书》
- 4、《国海金贝壳贵宾定制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。

