

## 旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划 2017 年第三季度资产管理报告

### 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》）及其他有关规定制作。

中国证监会对东莞证券旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具批准文件（文号：证监许可〔2009〕1113 号），但中国证监会对本集合计划做出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

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。

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、托管人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告期起止时间：2017 年 7 月 1 日—2017 年 9 月 30 日

## 一、集合计划简介

名称：旗峰1号策略精选集合资产管理计划

类型：固定收益类产品

管理人：东莞证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

成立日：2009年12月22日

成立规模：1,044,153,357.57份

存续期：无固定存续期限

## 二、主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2017年7月1日--2017年9月30日
1	集合计划本期利润	62,779,945.43
2	期末集合计划资产净值	4,789,455,658.83

## 三、集合计划管理人报告

### （一）投资主办简介

黄浩东

男，清华大学经济管理学院管理学学士及工商管理硕士，历任天华阳光控股公司高级财务经理、东莞证券深圳分公司研究员，东莞证券深圳分公司投资经理助理、投资经理等职，现任东莞证券深圳分公

司副总经理兼投资经理，擅长货币政策研究、债券信用研究和投资组合管理。自 2014 年 12 月 24 日起任旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划投资经理。

## （二）投资主办工作报告

### 1、投资策略回顾

从三季度逐月数据来看，实际 GDP 增速都会低于前值。基建的增速下滑，广义财政收缩，地产企业回款变慢，金融机构的去杠杆活动，这些因素都促使经济走弱。中国经济经历多年的高速增长，必然进入转型期，转型期间经济情况有所下滑也是情理之中。

整个三季度，十年国债和十年国开都在比较窄的区间震荡，十年国债最低点 3.56%，最高点 3.66%，平均收益率约为 3.61%，略高于前一季度。与之对应的是，资金面较为紧张，特别是非银系统的资金面在季度很多时点中都凸显压力。

旗峰 1 号三季度主要配置于企业债、公司债以及股票质押业务。

### 2、投资管理展望

展望四季度，经济数据放缓的概率变大，经济有望继续温和下行。主要因为投资增速下降，环保督察升级，新增基建资金来源受限。总体看四季度经济走低的变化会比较明显，但由于十九大的影响，经济数据将会较为温和下行。

四季度各种监管新规开始执行或者预热，过渡期内信用债将会出现比较大的分化，流动性紧张将带来部分债券收益率上行，择优配置票面较高的债券。目前，部分交易所及银行间中低等级债券已经明显

具有较强的投资价值，值得增大配置份额。

旗峰 1 号四季度主要配置于企业债、公司债以及股票质押业务。

## 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（2017 年 9 月 30 日）

单位：人民币元

项目	2017 年 9 月 30 日	年初余额
资 产：		
银行存款	4,281,602.67	8,480,971.98
结算备付金	20,481,099.69	51,804,705.63
存出保证金	11,017.57	44,354.86
交易性金融资产	4,455,104,572.31	2,579,809,843.55
其中：股票投资	0.00	0.00
债券投资	4,455,104,572.31	2,579,809,843.55
基金投资	0.00	0.00
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券投	0.00	0.00
资		
衍生金融工具	0.00	0.00
买入返售金融资产	1,035,749,480.00	1,731,795,841.80
应收证券清算款	199,711.97	0.00
应收利息	141,027,996.08	58,442,184.80
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	138,023,330.59	0.00

其他资产	0.00	13,835,670.00
资产合计	5,794,878,810.88	4,444,213,572.62
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	867,722,953.82	368,396,961.50
应付证券清算款	32,714.05	3,021,549.91
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	22,564,593.99	12,118,787.30
应付托管费	1,966,659.61	1,395,213.79
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	229,846.53	144,730.44
应交税费	0.00	0.00
应付利息	385,406.10	183,333.75
应付利润	105,900,863.58	44,785,001.16
其他负债	6,620,114.37	7,272,879.13
负债合计	1,005,423,152.05	437,318,456.98
所有者权益：		
实收基金	4,789,455,658.83	4,006,895,115.64
未分配利润	0.00	0.00
所有者权益合计	4,789,455,658.83	4,006,895,115.64
负债和所有者权益总计	5,794,878,810.88	4,444,213,572.62

## 2、集合计划利润表(2017年7月1日至2017年9月30日)

单位：人民币元

项目	本期金额	本年累计数
一、收入	81,000,071.29	230,883,078.19

1、利息收入	81,206,124.23	231,085,652.46
其中：存款利息收入	105,357.46	422,717.59
债券利息收入	64,163,043.93	161,855,918.83
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	16,937,722.84	68,807,016.04
2、投资收益	-206,052.94	-217,777.74
其中：股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	-206,052.94	-217,777.74
基金投资收益	0.00	0.00
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	0.00	0.00
3、公允价值变动收益	0.00	0.00
4、其他收入	0.00	15,203.47
二、费用	18,220,125.86	54,672,405.27
1、管理人报酬	9,515,979.46	34,991,557.68
2、托管费	1,966,659.61	5,668,844.15
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	127.20	127.20
5、利息支出	6,708,000.84	13,738,189.76
其中：卖出回购金融资产支出	6,708,000.84	13,738,189.76
6、其他费用	29,358.75	273,686.48
三、利润总和	62,779,945.43	176,210,672.92

## （二）集合计划投资组合报告（2017年9月30日）

### 1、资产组合情况

单位：人民币元

项 目	期末市值	占总资产比例
银行存款、清算备付金、存 出保证金合计	24,773,719.93	0.43%
其中：股票投资	0.00	0.00%
债券投资	4,455,104,572.31	76.88%
证券投资基金	0.00	0.00%
其他资产	1,315,000,518.64	22.69%
资产总值	5,794,878,810.88	100.00%

注：其他资产包括：应收利息、应收股利、买入返售金融资产、  
 应收证券清算款等项目。

## 2、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名 证券明细

序号	证券名称	证券代码	数量 (份/股/ 张)	期末市值 (人民币元)	市值占集合 计划资产净 值比例
1	16 太湖湾	135019	1100000	109762806	2.37%
2	17 阜宁债	1780015	850000	84821500	1.83%
3	16 高密 01	SF5888	800000	79998219.46	1.75%
4	16 株展 02	118560	800000	80005057.73	1.73%
5	17 广水鑫源债	1780011	800000	78664000	1.70%
6	16 株国投	SG5275	800000	79998505.15	1.69%
7	16 马花山	145198	700000	70000000	1.53%

8	16 爱山债	135249	700000	69824060.95	1.51%
9	14 招商债	122374	579570	59545021.8	1.26%
10	16 江夏城投债	1680249	600000	58152000	1.23%

### 3、投资组合报告附注

(1) 本集合计划本期投资的前十名证券中，无报告期内被监管部门立案调查的证券，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

(2) 本集合计划投资的前十名证券中，没有投资于超出计划合同规定备选股票、基金库之外的证券。

(3) 集合计划其他资产的构成：

应收利息（人民币元）	141,027,996.08
应收股利	0.00
买入返售金融资产	1,035,749,480.00
证券清算款	199,711.97
应收申购款	138,023,330.59
合计（人民币元）	1,315,000,518.64

### （三）集合计划份额变动

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总额
5,320,638,754.72	1,257,276,539.78	1,788,459,635.67	4,789,455,658.83



## 五、备查文件目录

### （一）本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会批准旗峰1号策略精选集合资产管理计划推广的文件
- 2、《旗峰1号策略精选集合资产管理计划说明书》
- 3、《旗峰1号策略精选集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、《旗峰1号策略精选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：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心24楼

信息披露电话：0769-22119271

联系人：宋浩瑗

EMAIL: zcgl@dgzq.com.cn

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东莞证券股份有限公司深圳分公司。

东莞证券股份有限公司

2017年10月20日