

国金工银量化恒盛精选 D 类 50 期集合资产管理计划

2017 年第三季度资产管理报告

第一节 重要提示

本报告由国金工银量化恒盛精选 D 类 50 期集合资产管理计划（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。

本集合计划托管人中国工商银行股份有限公司海南省分行于 2017 年 10 月 20 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财务数据进行复核，经核对，财务数据真实，准确。

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未经审计。

本报告期间：2017 年 7 月 1 日至 2017 年 9 月 30 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：	国金工银量化恒盛精选 D 类 50 期集合资产管理计划
集合计划类型：	集合资产管理计划
成立日：	2016 年 4 月 29 日
存续期：	18 个月
报告期末集合计划总份额：	【560,000,000.00】份 （其中含管理人持有份额【0.00】份，占比【0.00%】）
投资目标：	在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
投资理念：	本集合计划遵循稳健投资的理念，通过优选个股与优化组合的方式，在较低的回撤幅度下，获取长期稳健绝对收益。
管理人：	国金证券股份有限公司
托管人：	中国工商银行股份有限公司海南省分行
投资顾问：	无
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	14,995,905.48
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	943,537.22
加权平均每份额本期利润	0.0268
期末资产净值	617,782,894.34
期末每份额净值	1.1032
期末每份额累计净值	1.1032

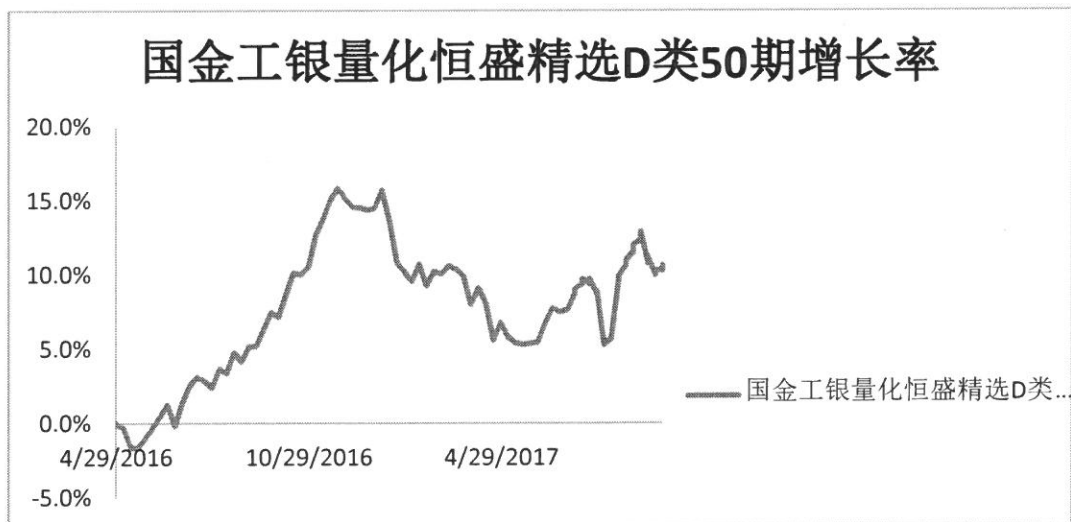
二、 财务指标计算公式

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

无。

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 2017 年 9 月 30 日，本集合计划单位净值为 1.1032 元，累计单位净值 1.1032

元，本期集合计划收益率为 2.4898%。

二、投资主办人简介

董波先生：研究生学历，具有 7 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，曾任资产管理分公司资产管理三部助理总经理，投资经理。现任资产管理分公司资产管理五部副总经理（部门负责人），投资经理。

三、投资主办人工作报告

1、 市场回顾和投资操作

随着中国经济逐渐复苏，“雄安新区”、“粤港澳大湾区”和“一带一路”等国家战略的大力推进，中上游产业和基建行业逐渐复苏，股票市场结构性机会增多，A 股基本面逐渐向好；同时，随着证券市场的逐步稳定，监管层大力贯彻金融为实体经济服务的理念，新股大量发行，监管日趋严厉化和常态化，打击炒作，都使整个 A 股的生态在潜移默化的改变。

回望本季度，在操作上，面对 A 股基本面向好，我们根据市场热点合理建仓并动态调整，截止本季末，本产品为投资人创造了一定收益。

2、 市场展望和投资策略

展望后市，“十九大”顺利召开，政策面有可能迎来利好，股市整体预期较为乐观。短期还是以关注政策导向为主，注意新股发行的节奏以及成交量的情况，关注上证指数能否继续在 3300 点上方运行，后市还将受较多外界因素的影响。

四、风险控制报告

2017 年第三季度，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，也未发送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：2017-09-30

单位：人民币元

资产	期末余额	年初余额
资 产：		
银行存款	54,100,187.46	6,810,010.48
结算备付金	4,222,488.60	2,334,686.26
存出保证金	94,341.27	524,282.03
交易性金融资产	562,613,773.70	577,485,500.00
其中：股票投资	562,613,773.70	327,485,500.00
债券投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	250,000,000.00
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	53,400,026.70	74,300,037.15
应收证券清算款	0.00	851,109.73
应收利息	5,313.22	7,180.38
应收股利	0.00	143,697.50
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	674,436,130.95	662,456,503.53

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债与持有人权益	期末余额	年初余额
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	53,400,000.00	0.00

应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	308,187.59	317,852.26
应付托管费	154,093.81	158,926.14
应付销售服务费	0.00	0.00
应付投资顾问费	2,542,523.82	20,673,397.69
应付交易费用	240,951.19	255,767.93
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	7,480.20	17,500.00
负债合计	56,653,236.61	21,423,444.02
所有者权益：		
实收基金	560,000,000.00	560,000,000.00
未分配利润	57,782,894.34	81,033,059.51
所有者权益合计	617,782,894.34	641,033,059.51
负债和所有者权益总计	674,436,130.95	662,456,503.53

二、 集合资产管理计划经营业绩表

日期：2017年07月 - 2017年09月

单位：人民币元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	17,685,054.67	-36,581,987.11
2	1、利息收入	1,478,174.28	6,794,270.73
3	其中：存款利息收入	159,365.68	562,314.10
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	1,318,808.60	6,231,956.63
7	2、投资收益	2,154,512.13	-31,749,235.94
8	其中：股票投资收益	2,154,512.13	-32,149,513.23
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	0.00	0.00
14	股利收益	0.00	400,277.29
15	3、公允价值变动收益	14,052,368.26	-11,627,021.90
16	4、其他收入	0.00	0.00

17	二、费用	2,689,149.19	-13,331,821.94
18	1、管理人报酬	308,187.59	912,458.86
19	2、托管费	154,093.81	456,229.48
20	3、销售服务费	0.00	0.00
21	4、交易费用	667,165.64	1,117,574.69
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	1,559,702.15	-15,818,084.97
25	三、利润总和	14,995,905.48	-23,250,165.17

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	562,613,773.70	83.42%
债券	0.00	0.00%
基金	0.00	0.00%
回购	53,400,026.70	7.92%
证券理财产品	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	58,322,676.06	8.65%
其他	99,654.49	0.01%
合计	674,436,130.95	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	600821	津劝业	18,663,153	170,581,218.42	27.61%
2	002715	登云股份	4,580,000	152,972,000.00	24.76%
3	600095	哈高科	17,804,647	146,710,291.28	23.75%
4	002112	三变科技	4,962,400	92,350,264.00	14.95%

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	53,400,026.70	53,400,026.70	8.64%

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	560,000,000.00
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	560,000,000.00

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.gjq.com.cn>

电话：021-60935621



国金证券股份有限公司

二〇一七年十月二十日

