

兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划  
2018 年第 1 季度资产管理报告  
(2018 年 1 月 1 日—2018 年 3 月 31 日)

资产管理人：兴证证券资产管理有限公司

资产托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 4 月 23 日



# 兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划

## 2018 年第 1 季度资产管理报告

### 一、重要提示

本报告依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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。

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。

管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本报告未经审计。本报告期自2018年1月1日起至2018年3月31日止。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

## 二、集合计划产品概况

**产品名称：**兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划

**简称：**兴证资管金麒麟领先优势

**产品类型：**集合资产管理计划

**计划运作方式：**通过筹集委托人资金交由托管人托管，由集合资产管理计划管理人统一管理和运用，投资于中国证监会认可的投资品种，并将投资收益按比例分配给委托人。

**投资目标：**本集合计划主要投资于 A 股市场，通过精选成长风格突出的股票进行投资，谋求集合计划资产的长期稳健增值。

**风险收益特征：**本计划份额属于“高风险型”的产品，适合向“积极型”的投资者推广。

**合同生效日、成立日期：**2013 年 5 月 29 日

**成立规模：**259,055,545.45

**存续期：**不设固定存续期限

**管理人：**兴证证券资产管理有限公司

**托管人：**中国工商银行股份有限公司

### 三、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

	主要财务指标	2018年1月1日—2018年3月31日
1	本期利润	23,005,910.98
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	22,550,877.08
3	加权平均计划份额本期利润	0.0411
4	期末集合计划资产净值	641,825,164.45
5	期末单位集合计划资产净值	1.151
6	期末累计单位集合计划资产净值	1.735
7	本期单位净值增长率	3.69%

#### (二) 集合计划净值表现



注：上图净值数据截止日期为2018年3月31日。

## 四、集合计划管理人报告

### （一）投资主办简介

李健：权益投资部投资主办

复旦大学工商管理硕士，现管理金麒麟、玉麒麟、稳进系列产品。

宏观视野宽阔，准确把握市场波动及行业周期性变化；善于自下而上挖掘质地优秀、竞争力突出，持续高成长的品种；对TMT行业有独到研究，对高新技术高度敏感。

陈淳：权益投资部投资主办

香港大学供应链管理学士，斯坦福大学管理科学与工程硕士，管理金麒麟、玉麒麟系列产品以及多家重要大型机构资金。

研究领域包括传媒、食品、农业、建筑建材、交运物流等，覆盖面跨越消费和周期、兼顾新兴成长和传统行业，专业能力扎实而全面。投资风格稳健，以绝对收益理念为基，操作上注重控制回撤和个股安全边际的把握。

### （二）2018年第一季度投资主办报告

#### 1、2018年第一季度行情回顾及运作分析

2018年第一季度，宏观经济稳定增长，股票市场宽幅震荡。开年以地产为代表的周期板块带动指数快速上涨，1月底上证综指上触3587点之后，市场受美股急跌拖累大幅下挫，市场对宏观经济的态度也从乐观转为担忧，市场风格突变——成长股、军工股重新受到市场追捧，周期、大盘蓝筹则持续下跌。市场在2月上旬触底反弹，围绕3300点小幅波动。3月底受中美贸易战的冲击股指重新回到3100点一线，本季末上证综指收于3168.90点，较年初下跌了4.18%。

我们在本季度初均衡配置了金融、蓝筹、周期和TMT、新能源汽车等成长行业，在2月初市场急跌时我们大幅增加了TMT板块的比重，并逐步增加了新能源汽车、高端制造、和医药股的持仓，本季度产品的总体表现强于市场。

本季度未进行股指期货和国债期货操作。

#### 2、2018年第二季度展望与投资策略

金融去杠杆压力初显，外围市场的风险未充分释放，权重股缺乏进一步的估值提升空间，市场整体估值基本合理，公司股价上涨主要依靠盈利推动。我们看好信息服务、新能源汽车、高端装备等新兴成长行业；医疗服务和文娱娱乐为代表的消费板块；以及低估值蓝筹和部分周期趋势向上确定性较高的行业（如：军工）。

## 五、集合计划风险控制报告

### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉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。本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

### 2、风险控制报告

2018年第一季度，集合计划管理人通过独立的合规风控部门，对各项业务风险进行全面的监督、检查和评价。公司专门设有合规风控部，通过系统监控和人工检查相结合的方式，对集合资产管理计划的投资风险、信用风险、操作风险等进行全面的监督和检查，同时在交易系统中对各类风险指标进行限制，实现交易的事前控制，确保集合资产管理计划合法合规。对日常集合资产管理计划出现的各类问题，合规风控部及时进行风险提示，提出合规管理与风险管理建议，并督促相关部门及时整改。

经过审慎核查，截至2018年3月31日，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；未发现内幕交易的情况；因产品规模变动、证券市场波动等原因，本集合计划在报告期内存在单只证券投资比例不符合合同约定的情况，管理人已在规定的时间内予以调整，并及时向福建证监局及中国证券投资基金业协会报告；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。集合计划管理人通过动态评估集合计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保本集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

## 六、集合计划财务报告

### (一)集合计划会计报表

#### 1、集合计划资产负债表

期间：2018年1月1日－2018年3月31日

单位：人民币元

资产	期 末	季 初	负债和所有者 权益	期 末	季 初
	余 额	余 额		余 额	余 额
资 产：			负债：		
银行存款	62,568,842.97	35,740,887.34	短期借款	-	-
结算备付金	1,890,500.35	1,955,703.87	交易性金融负 债	-	-
存出保证金	357,064.31	1,406,901.95	衍生金融负债	-	-
交易性金融资 产	610,859,256.57	542,827,094.44	卖出回购金融 资产款	-	-
其中：股票投 资	610,859,256.57	542,827,094.44	应付证券清算 款	31,333,989.59	734,892.90
债券投资	-	-	应付赎回款	-	-
资产支持证券 投资	-	-	应付赎回费	-	-
基金投资	-	-	应付管理人报 酬	821,938.31	776,730.28
衍生金融资产	-	-	应付托管费	136,989.72	129,455.04
买入返售金融 资产	-	-	应付销售服务 费	-	-
应收证券清算 款	-	43,138,547.99	应付交易费用	1,542,433.09	1,045,772.54
应收利息	10,807.43	9,822.52	应付税费	93.37	-
应收股利	-	-	应付利息	-	-
应收申购款	-	-	应付利润	-	-
其他资产	-	-	其他负债	25,863.10	16,000.00
			负债合计	33,861,307.18	2,702,850.76
			所有者权益：		
			实收基金		

				557,440,719.30	560,476,803.91
			未分配利润	84,384,445.15	61,899,303.44
			所有者权益合计	641,825,164.45	622,376,107.35
资产合计:	675,686,471.63	625,078,958.11	负债与持有人权益总计:	675,686,471.63	625,078,958.11

## 2、集合计划经营业绩表

期间：2018年1月1日—2018年3月31日

单位：人民币元

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	28,530,892.72	28,530,892.72
1、利息收入	106,647.83	106,647.83
其中：存款利息收入	103,869.42	103,869.42
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,778.41	2,778.41
2、投资收益（损失以“-”填列）	27,969,210.99	27,969,210.99
其中：股票投资收益	27,969,210.99	27,969,210.99
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
权证投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	455,033.90	455,033.90
4、其他收入（损失以“-”填列）	-	-
二、费用	5,524,981.74	5,524,981.74
1、管理人报酬	2,329,223.09	2,329,223.09
2、托管费	388,203.86	388,203.86
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	2,780,485.31	2,780,485.31
5、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产	-	-

支出		
6、其他费用	27,069.48	27,069.48
三、利润总额	23,005,910.98	23,005,910.98

## (二)、集合计划投资组合报告

### 1、资产组合情况

日期：2018年3月31日

单位：人民币

项 目	期末市值（元）	占总资产比例（%）
银行存款及备付金	64,459,343.32	9.54
股票投资	610,859,256.57	90.41
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
买入返售金融资产	—	—
其他资产	367,871.74	0.05
资产合计	675,686,471.63	100.00

### 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

证券代码	证券名称	库存数量	证券市值	市值占净值（%）
603959	百利科技	1,895,633.00	70,384,853.29	10.97
01339	中国人民保险集团	15,004,000.00	44,120,574.85	6.87
300628	亿联网络	335,964.00	42,811,892.52	6.67
00817	中国金茂	10,080,000.00	36,102,402.00	5.62
600596	新安股份	2,498,700.00	33,332,658.00	5.19
600525	长园集团	1,714,820.00	30,558,092.40	4.76
002859	洁美科技	910,400.00	30,170,656.00	4.70
000619	海螺型材	3,979,502.00	28,612,619.38	4.46
600114	东睦股份	1,724,287.00	28,588,678.46	4.45
002376	新北洋	1,569,272.00	26,803,165.76	4.18

### 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，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，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，没有投资于超出集合资产管理计划合同规定范围之外的证券。

七、集合计划份额变动情况

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
560,476,803.91	-	3,036,084.61	557,440,719.30

## 八、备查文件目录

### （一）本集合计划备查文件目录

- 1、“兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划”验资报告；
- 2、关于“兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划”成立的公告；
- 3、“兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划”计划说明书；
- 4、“兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划”托管协议；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、管理人法人主体形式变更的公告；
- 7、管理人合同变更的公告；
- 8、关于变更投资主办人的公告。

### （二）存放地点及查阅方式

文件存放地点：上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦9楼

网址：[www.ixzzcgl.com](http://www.ixzzcgl.com)

联系人：杨济铭

服务电话：021-38565866

EMAIL：[zcgl@xyzq.com.cn](mailto:zcgl@xyzq.com.cn)

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人兴证证券资产管理有限公司。

兴证证券资产管理有限公司  
2018 年 4 月 23 日

