

兴证资管玉麒麟沪港深精选1号集合资产管理计划
2018年第2季度资产管理报告
(2018年4月1日—2018年6月30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上海市分行

报告送出日期：2018年7月20日

兴证资管玉麒麟沪港深精选 1 号集合资产管理计划 2018 年第 2 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4月1日起至2018年6月30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：兴证资管玉麒麟沪港深精选 1 号集合资产管理计划

简称：兴证资管玉麒麟沪港深精选 1 号

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：本集合计划同时投资 A 股和“港股通”标的股票及其他具有投资价值的投资品种，通过资产的灵活配置，在保持适度流动性的前提下，借助股指期货等控制或对冲投资风险，力争追求绝对收益。

风险收益特征：本计划风险收益特征为高风险高预期收益，属于积极型证券投资产品，根据兴证资管客户风险承受能力评价及资产管理产品与客户风险承受能力匹配规则，本集合计划仅适合向“积极型”及高于“积极型”的投资者推广。

合同生效日、成立日期：2015 年 11 月 17 日

成立规模：37,024,338.48

存续期：不设置固定存续期限

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上海市分行

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4月1日—2018年6月30日
1	本期利润	244,888.40
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	379,314.14
3	加权平均计划份额本期利润	0.0437
4	期末集合计划资产净值	6,295,098.76
5	期末单位集合计划资产净值	1.2400
6	期末累计单位集合计划资产净值	1.2400
7	本期单位净值增长率	3.33%

(二) 集合计划净值表现

累计净值增长率



注：上图净值数据截止日期为2018年6月30日。

四、集合计划管理人报告

（一）投资主办简介

包丽华：权益投资部投资主办

南京航空航天大学管理学硕士，现管理金麒麟、玉麒麟系列产品。

管理的金麒麟5号获得“2012~2014三年期金牛券商集合资管计划”奖(中国证券报评选)；金麒麟3号曾获“最受欢迎理财产品组合投资组五强”（朝阳永续评选）、“年度金牛集合资产管理计划”（中国证券报评选）、“2016年度金牛券商集合资管计划”（中国证券报评选）。

对银行、保险和纺织服装等行业有较为深入的研究，并取得丰富的研究成果。特点是研究功底扎实，分析工作精细，投资逻辑缜密。

（二）2018年第二季度投资主办报告

1、2018年第二季度行情回顾及运作分析

二季度市场单边下跌，整体跌幅较大，上证综指下跌10.1%、深圳成指下跌13.7%、创业板指下跌15.5%。国内金融领域的去杠杆，以及外部中美贸易战摩擦加剧，导致市场的流动性收紧、整体风险偏好大幅下降。受此影响，二季度国内资产价格全面回落，股市债市汇市出现不同程度下探。

二季度持仓上延续之前的选股思路，通过持有优质个股，较好得抵御了市场下跌。二季度产品净值上涨3.3%，产品的绝对和相对收益均比较明显。

本季度未参与股指期货投资。

2、2018年第三季度展望与投资策略

展望三季度，认为宏观经济整体仍处于景气高位，但要警惕部分经济数据指标开始出现走弱趋势，特别是地产和周期性行业。三季度金融去杠杆和贸易战的负面冲击进入边际减弱区间，市场在急跌之后或出现反弹窗口。

在经历二季度的市场大幅下跌后，更多的股票进入了价值区间，三季度本产品会加大对这些个股的买入，整体仓位会出现一定提升。投资标的选择上，遵循自下而上的选股思路，持有估值和业绩增速匹配的优质公司，在先进制造业、医药、环保等非周期消费行业有较多符合投资思路的标的。

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年第二季度，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6月30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；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；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 market 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4月1日－2018年6月30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	4,491,269.38	1,380,379.36	短期借款	-	-
结算备付金	15,088.40	132,934.34	交易性金融负 债	-	-
存出保证金	1,945.17	20,019.16	衍生金融负债	-	-
交易性金融资 产	1,833,158.60	5,833,987.03	卖出回购金融 资产款	-	-
其中：股票投资	1,833,158.60	5,833,987.03	应付证券清算 款	0.19	130,897.98
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	25,825.48	27,537.38
衍生金融资产	-	-	应付托管费	4,304.25	4,589.58
买入返售金融 资产	-	-	应付销售服务 费	-	-
应收证券清算 款	-	108,012.16	应付交易费用	6,346.94	3,873.01
应收利息	905.28	385.83	应付税费	3,664.29	3,289.05
应收股利	1,800.00	-	应付利息	-	-
应收申购款	-	-	应付利润	-	-
其他资产	-	-	其他负债	8,926.92	20,438.80
			负债合计	49,068.07	190,625.80
			所有者权益：		
			实收基金	5,075,144.37	6,070,214.25
			未分配利润	1,219,954.39	1,214,877.83
			所有者权益合 计	6,295,098.76	7,285,092.08

资产合计:	6,344,166.83	7,475,717.88	负债与持有人 权益总计:	6,344,166.83	7,475,717.88
-------	--------------	--------------	-----------------	--------------	--------------

2、集合计划经营业绩表

期间: 2018年4月1日—2018年6月30日

单位: 人民币元

项 目	本期金额	本年累计数
一、收入	282,775.06	319,872.00
1、利息收入	8,254.59	11,531.83
其中: 存款利息收入	6,489.56	9,766.80
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	1,765.03	1,765.03
2、投资收益(损失以“-”填列)	408,946.21	767,365.15
其中: 股票投资收益	394,818.88	756,174.47
金融商品转让税	-3,218.77	-6,155.42
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	17,346.10	17,346.10
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-134,425.74	-459,024.98
4、其他收入(损失以“-”填列)	—	—
二、费用	37,886.66	82,189.30
1、管理人报酬	25,825.48	53,362.86
2、托管费	4,304.25	8,893.83
3、销售服务费	—	—
4、交易费用	13,310.57	20,671.05
5、利息支出	—	—
其中: 卖出回购金融资产支出	—	—
6、其他费用	-5,553.64	-738.44
三、利润总额	244,888.40	237,682.70

(二)、集合计划投资组合报告

1、资产组合情况

日期：2018年6月30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	4,506,357.78	71.03
股票投资	1,833,158.60	28.90
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	4,650.45	0.07
资产合计	6,344,166.83	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（%）
000418	小天鹅 A	4,000.00	277,400.00	4.41
H03968	招商银行	10,000.00	244,743.30	3.89
002563	森马服饰	15,000.00	214,500.00	3.41
H00939	建设银行	30,000.00	183,874.50	2.92
600104	上汽集团	5,000.00	174,950.00	2.78
S01999	敏华控股	30,000.00	156,229.92	2.48
600519	贵州茅台	200.00	146,292.00	2.32
S01234	中国利郎	15,000.00	142,788.06	2.27
H02318	中国平安	1,500.00	91,556.82	1.45
601318	中国平安	1,000.00	58,580.00	0.93

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）
6,070,214.25	-	995,069.88	5,075,144.37

八、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、“兴证资管玉麒麟沪港深精选1号集合资产管理计划”验资报告；
- 2、关于“兴证资管玉麒麟沪港深精选1号集合资产管理计划”成立的公告；
- 3、“兴证资管玉麒麟沪港深精选1号集合资产管理计划”计划说明书；
- 4、“兴证资管玉麒麟沪港深精选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；
- 6、管理人投资主办变更的公告。

（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层

网址：www.ixzzcgl.com

联系人：杨济铭

服务电话：021-38565866

EMAIL：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。

