

创金价值成长 5 期集合资产管理计划

季度资产管理报告

(2018 年 4 月 1 日—2018 年 6 月 30 日)

第一节 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》）及其它有关规定制作。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容。

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。

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2018年4月1日至2018年6月30日。

第二节 集合资产管理计划概况

一、基本资料

名称	创金价值成长5期集合资产管理计划
类型	非限定性集合资产管理计划
成立日	2013年2月28日
报告期末份额总额	46,039,325.52份
存续期	无固定存续期
投资目标	秉承价值投资理念，前瞻性研究宏观经济、行业、以及企业基本面变化，积极主动进行资产配置，精选个股，分享优秀企业的成长成



	果，实现资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数×70% +中证全债指数×30%
风险收益特征	较高风险
管理人	第一创业证券股份有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司

二、管理人

名称：第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人：刘学民

电话：95358

网址：<http://www.firstcapital.com.cn>

三、托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

电话：010-95588

网址：<http://www.icbc.com.cn>

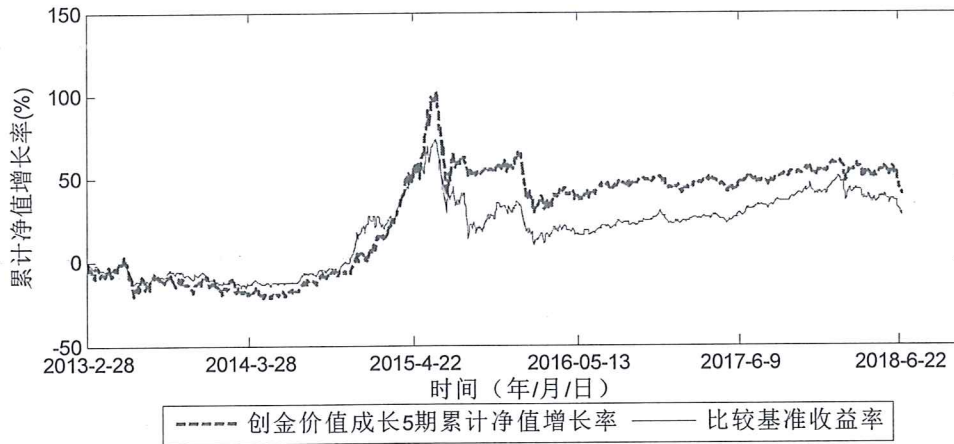
第三节 集合资产管理计划财务指标

一、主要财务指标（单位：人民币元）

集合计划本期利润	-5,245,334.73
集合计划本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	3,832,678.16
期末集合计划资产净值	41,947,882.34
期末集合计划单位净值	0.911
期末集合计划累计单位净值	1.436



二、集合计划累计单位净值增长率与投资基准收益率的历史走势对比图



第四节 管理人报告

一、集合资产管理计划业绩表现

本集合计划于2013年2月28日成立,截至2018年6月30日,集合计划单位净值0.911元,累计单位净值1.436元,本集合计划自成立之日起累计净值增长率为43.6%。

二、投资主办人简介

陈建军女士,管理学硕士,2009-2013年从事大型企业上市公司收购整合等资本运作,参与了多起二级市场收购并控股A股上市公司的案例,对上市公司的运作转型和并购重组有深刻的理解。2013年7月加盟第一创业证券资产管理部,从事旅游及商贸零售行业研究。2015年6月起担任投资主办,擅长从实业的独特视角去看待资本市场,追求行业趋势的带来的稳定回报。

三、投资主办人工作报告

(一) 投资回顾

在过去的一个季度中,市场在海外市场调整和中美贸易摩擦升温等因素影响下出现快速



回调，本基金的净值也出现了一定幅度的调整。

（二）投资展望

基于基本面研究我们相信在未来较长一段时间内部分行业集中度提升将是不可阻挡的趋势，同时随着居民财富的持续增长部分消费侧行业也将迎来发展的机遇，由此所带来的资本市场结构性投资机遇将是我们重点关注的领域。

未来我们将对投资组合持续进行优化，从而实现投资组合风险和收益的相对均衡，获取相对合理的收益。

四、集合资产管理计划风险控制报告

1、集合资产管理计划运作合规性声明

报告期内，管理人严格遵守《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》、本集合计划合同以及管理人关于客户资产管理业务制度的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划的资产，在严格控制风险的基础上，致力于投资者利益的最大化。本报告期内，本集合计划的运作合法合规，不存在损害集合计划份额持有人权益的行为，本集合计划的投资管理符合相关法律法规的规定。

2、风险控制报告

本集合计划管理人的内部风险控制工作主要由公司风险管理部负责。风险管理部采取授权管理、逐日监控、绩效评估、定期与不定期检查等多种方式对本集合计划的管理运作进行风险控制。风险管理部通过风险监控与风险预警机制，重点检查本集合计划是否达到各项风险控制指标，是否存在损害集合计划持有人利益的行为，及时发现和处理本集合计划运作过程中可能出现的风险。对报告期内发现的风险事项，风险管理部已及时进行了风险揭示，并督促相关部门及时采取风险应对措施予以解决。

我们认为，本报告期内，集合计划管理人始终能按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划合同及说明书的要求，对集合计划进行运作管理；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；未发现内幕交易情况；相关信息披露和财务数据皆真实、准确、完整、及时。

第五节 投资组合报告

一、期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例%
股票投资	39,794,319.60	92.63%
债券投资	0.00	0.00%
基金投资	482.39	0.00%
应收利息	673.96	0.00%
银行存款及清算备付金	3,069,495.07	7.14%
其他资产	99,150.99	0.23%
合计	42,964,122.01	100.00%

说明：①其他资产包括存出保证金和应收证券清算款、买入返售金融资产、理财产品等。

②部分项目可能存在小数点位差调整。

二、期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股）	证券市值（元）	占净值（%）
1	000625	长安汽车	451,390	4,062,510.00	9.68%
2	002152	广电运通	650,940	3,827,527.20	9.12%
3	601111	中国国航	364,863	3,243,632.07	7.73%
4	000550	江铃汽车	216,656	2,623,704.16	6.25%
5	600115	东方航空	359,657	2,380,929.34	5.68%
6	600029	南方航空	272,027	2,298,628.15	5.48%
7	600138	中青旅	112,683	2,245,772.19	5.35%
8	600498	烽火通信	86,305	2,144,679.25	5.11%
9	600054	黄山旅游	178,164	2,075,610.60	4.95%
10	000800	一汽轿车	260,353	1,947,440.44	4.64%

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

本集合计划本报告期期末未持有债券。

四、投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十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。

第六节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	46,907,430.73
报告期内总参与份额	341,334.06
报告期内总退出份额	1,209,439.27
报告期末份额总额	46,039,325.52

第七节 重要事项提示

一、本集合计划管理人及托管人相关事项

1、本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

2、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在本报告期内没有受到任何处罚。

二、本集合计划相关事项

1、本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大改变；

2、本报告期内集合计划未进行收益分配；

3、本集合计划于2018年5月9日发布了《关于创金价值成长5期集合资产管理计划暂停净申购的公告》。



第八节 信息披露的查阅方式

一、本集合计划备查文件目录

- 1、《创金价值成长5期集合资产管理计划说明书》
- 2、《创金价值成长5期集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 3、 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：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人第一创业证券股份有限公司。

网址：<http://www.firstcapital.com.cn>

热线电话：95358

第一创业证券股份有限公司

二〇一八年七月十八日

