

旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划 2018 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 2018 年 10 月 16 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：2018 年 7 月 1 日—2018 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	2018年7月1日--2018年9月30日
1	集合计划本期利润	42,992,381.70
2	期末集合计划资产净值	4,060,490,508.61

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

回顾三季度的市场，利率债在上半年大幅度上涨后，三季度表现比较疲软。基本面经济数据表现平稳，PPI 数据良好，GDP 有所上升，这给市场带来了负面情绪。三季末流动性有所紧张，但央行态度目前还是比较中性。

监管方面继续推进，多项细则不断出台，金融去杠杆节奏仍在继续。但信用债违约依然不断出现，民企信用债依然是市场比较担忧的问题。2018 年评级调整中上调主体大幅减少、下调数量增加，民营企业在下调主体中占比超过一半。

旗峰 1 号本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，经济基本面维持稳定的概率较大。在没有出现比较大的风险事件之前，强监管政策依然会继续推进。在去杠杆的氛围下，央行会保持相对宽松的货币环境。同时外围市场较为波动，美国加息周期也会给央行带来较大的外部压力。

对于信用债方面，城投择优配置，把握城投债投资的恐慌性机会。融资平台打破刚兑虽是大势所趋，但相信监管层不会允许城投债系统性风险爆发。城投债配置仍需有所选择，关注有公益性项目对应的债务，这部分或受益于隐性债务新规。重点投资有第三方担保的城投债

券。

旗峰 1 号下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 (2018 年 9 月 30 日)

单位:人民币元

项目	2018 年 9 月 30 日	年初余额
资 产:		
银行存款	46,665,932.36	1,058,537.23
结算备付金	5,023,884.98	17,381,804.98
存出保证金	7,762.20	4,697.95
交易性金融资产	4,316,414,965.85	4,479,884,121.29
其中: 股票投资	0.00	0.00
债券投资	4,296,414,965.85	4,479,884,121.29
基金投资	20,000,000.00	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	136,500,219.75	712,502,275.12
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	136,971,468.37	124,506,922.29
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00

其他资产	673,200.00	0.00
资产合计	4,642,257,433.51	5,335,338,358.86
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	503,097,775.33	707,135,875.75
应付证券清算款	0.00	410,209.32
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	17,661,686.39	23,708,300.87
应付托管费	1,538,951.57	1,749,666.68
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	232,608.91	207,701.12
应交税费	628,602.17	0.00
应付利息	252,983.38	687,219.36
应付利润	58,350,203.04	83,112,393.33
其他负债	4,114.11	3,568,450.82
负债合计	581,766,924.90	820,579,817.25
所有者权益:		
实收基金	4,060,490,508.61	4,514,758,541.61
未分配利润	0.00	0.00
所有者权益合计	4,060,490,508.61	4,514,758,541.61
负债和所有者权益总计	4,642,257,433.51	5,335,338,358.86

2、集合计划利润表(2018年7月1日至2018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	64,054,523.73	200,906,874.99

1、利息收入	64,207,743.05	201,539,198.02
其中：存款利息收入	83,274.27	299,711.87
债券利息收入	61,682,027.80	181,744,880.48
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	2,442,440.98	19,494,605.67
2、投资收益	-153,219.32	-633,082.95
其中：股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	-153,219.32	-642,982.65
基金投资收益	0.00	9,899.70
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
投资收益-差价收入增值税抵减	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	759.92
二、费用	21,062,142.03	45,827,551.37
1、管理人报酬	27,455.88	9,151,983.15
2、托管费	1,538,951.57	4,762,368.22
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	0.00	34,130.93
5、利息支出	5,204,149.66	17,058,359.18
其中：卖出回购金融资产支出	5,204,149.66	17,058,359.18
6、其他费用	27,484.90	93,580.32
7、资产减值损失	14,050,800.00	14,050,800.00
8、增值税金及附加税	213,300.02	676,329.57
三、利润总和	42,992,381.70	155,079,323.62

(二) 集合计划投资组合报告 (2018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	51,697,579.54	1.11%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	4,296,414,965.85	92.55%
基金投资	20,000,000.00	0.43%
其他资产	274,144,888.12	5.91%
资产总值	4,642,257,433.51	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	1,240,000.00	123,937,935.32	3.0523%
2	17 阜宁债	1780015	1,000,000.00	95,240,000.00	2.3455%
3	16 爱山债	135249	900,000.00	89,949,150.12	2.2152%
4	16 株展 02	118560	800,000.00	80,001,628.75	1.9702%
5	16 株国投	SG5275	800,000.00	79,996,406.16	1.9701%
6	16 高密 01	SF5888	800,000.00	79,995,660.16	1.9701%
7	16 普湾 01	135327	800,000.00	77,730,081.15	1.9143%
8	17 广水鑫源债	1780011	800,000.00	75,824,000.00	1.8674%

9	16 马花山	145198	700,000.00	70,000,000.00	1.7239%
10	16 华融 C2	135728	700,000.00	68,681,473.15	1.6915%

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）	136,971,468.37
应收股利	0.00
买入返售金融资产	136,500,219.75
证券清算款	0.00
应收申购款	0.00
其他资产	673,200.00
合计（人民币元）	274,144,888.12

（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
4,123,042,021.30	1,887,930,006.39	1,950,481,519.08	4,060,490,508.61

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

2018 年 10 月 18 日