

旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划 2019 年第一季度资产管理报告

重要提示

本报告依据《中华人民共和国合同法》《中华人民共和国证券投资基金法》《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关规定制作。

中国证监会对东莞证券旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划（下称“集合计划”或“本集合计划”）出具批准文件（文号：证监许可〔2010〕717 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 2019 年 4 月 15 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：2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 3 月 31 日

一、集合计划简介

名称： 旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划

类型： 混合类产品

管理人： 东莞证券股份有限公司

托管人： 中国工商银行股份有限公司广东省分行

成立日： 2010 年 08 月 10 日

成立规模： 329,474,467.18 份

存续期： 无固定存续期限

二、集合计划管理人履职报告

（一）投资表现

截至 2019 年 3 月 31 日，集合计划单位净值为 0.9960 元，本期净值增长率为 1.72%，集合计划单位累计净值为 0.9468 元，集合计划累计净值增长率为-5.32%。

集合计划单位净值历史走势图：

净值趋势



（二）投资主办简介

刘湘先生

2006年毕业于兰州大学数学与应用数学专业，获理学学士学位；2009年毕业于厦门大学金融工程专业，获经济学硕士学位；2009年7月-2012年4月，在山西证券自营部门先后担任交易员、研究员；2012年5月加入东莞证券深圳分公司，先后担任行业研究员、投资经理助理和投资经理，具有丰富的研究和投资经验。具有良好的诚信记录和职业操守，已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（三）投资主办工作报告

1、市场和投资回顾

1月份市场整体维持低位震荡，但在1月下旬上市公司商誉减值风险集中释放之后，市场从2月份开始出现迅猛反弹，直到3月中旬涨势才开始放缓，最终1季度沪深300指数大涨28.62%，创业板指更是大涨35.43%。

操作上，年初由于担忧年报业绩和商誉减值的风险，旗峰2号维持较低仓位，2月份市场涨势非常迅猛，一直没有提供太好的买点，产品仓位一直没有得到有效提升，一季度旗峰2号净值上涨1.72%。

2、投资管理展望

一季度，市场在数据真空期受政策边际改善、流动性宽松、中美关系改善、外围市场向好等多重因素的影响出现大幅反弹，估值得到

明显的修复。目前市场情绪高涨，两市成交量再度回升到万亿以上，融资余额和公募股票类基金发行份额快速上行，再考虑到5月份明晟权重提升、6月份富时指数将纳入A股，短期市场受资金推动或将继续上行。

不过，从目前公布的经济数据来看，上半年经济下行的压力依旧显著。1-2月份地产销售、新开工、土地购置等领先指标全面下行，未来地产投资压力显现；1-2月份工业企业利润增速下滑14%，企业新开工的意愿将很难得到大幅提升；基建投资已经企稳反弹，但受累于地方债务和财力的限制，大规模搞基建可能性不大，反弹力度有限。出口方面，目前全球经济在同步走弱，再加上之前存在的抢出口现象，未来一段时间出口也将持续面临压力。消费方面相对平稳，其中汽车等可选消费依旧较弱，食品等必选消费则比较平稳。

外围方面，欧美日等主要国家经济均在走弱，前期市场在美联储态度转向鸽派的政策利好刺激下出现明显涨幅，但近期开始进入震荡阶段。4月份，美股、港股都将进入年报披露期，市场关注重心或将转到基本面，市场将进入考验期。

综上所述，市场目前情绪高涨，不断流入的资金短期或将推动大盘继续上涨。不过前期的一些利好诸如中美关系好转、流动性边际改善以及减税降费等被市场反应之后，市场的重心必将转向基本面，因此在相对乐观的同时尚需保持一定的谨慎，谨防经济超预期下行或中美贸易谈判不顺等可能带来的短期冲击。操作上，鉴于旗峰2号4月

底即将到期和对市场短期相对乐观的判断，4月份以持仓待涨为主，在市场上涨过程中逐步降低仓位。

三、集合计划运作情况

(一) 集合计划投资组合报告 (2019年3月31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	2,129,204.89	16.67%
股票投资	1,624,240.00	12.72%
基金投资	8,581.38	0.07%
债券投资	0.00	0.00%
其他资产	9,006,831.39	70.54%
资产总值	12,768,857.66	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	创业慧康	300451	15,000.00	376,500.00	3.1361
2	华泰证券	601688	12,000.00	268,920.00	2.2400
3	烽火通信	600498	8,000.00	252,080.00	2.0998

4	TCL 集团	000100	60,000.00	243,600.00	2.0291
5	中兴通讯	000063	8,000.00	233,600.00	1.9458
6	安图生物	603658	2,000.00	133,100.00	1.1087
7	伊利股份	600887	4,000.00	116,440.00	0.9699
8	鹏华货币 A	160606	8,581.38	8,581.38	0.0715

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）	5,055.49
应收股利	70.13
证券清算款	3,001,405.77
买入返售金融资产	6,000,300.00
合计（人民币元）	9,006,831.39

(二) 集合计划运用杠杆情况

在本报告期内，本集合计划运用杠杆情况符合有关规定。

(三) 集合计划投资收益分配情况

根据合同约定，本报告期内本集合计划无投资收益分配情况。

(四) 集合计划计提基准、方式及支付方式情况

1、托管费：

本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年

费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划成立后，托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由管理人向托管人发送托管费划付指令，托管人复核后于次月首日起3个工作日内从集合计划资产中一次性扣除，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延至下一工作日。

2、管理费：

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.5%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划成立后，管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由管理人向托管人发送管理费划付指令，托管人复核后于次月首日起3个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延至下一工作日。

3、证券交易费用：

本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。

4、增值税等应纳税费：

本集合计划运营过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，法律法规有其他规定的，从其规定；本集合计划运营过程

中发生的增值税及附加税费在本集合计划委托资产中列支，由管理人、托管人根据规定在纳税申报期结束前将应交增值税及附加税费款项划至管理人指定的缴税账户，管理人按规定缴纳增值税及附加税费。法律、法规及其他规范性文件对资产管理计划运营过程中发生的应税行为另有规定的，管理人根据规定执行。

委托资产和委托人根据国家法律法规的规定及本合同约定，履行纳税义务。

5、其他费用：

除交易手续费、印花税、管理费、业绩报酬、托管费之外的集合计划费用，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入费用，从集合计划资产中支付。

6、管理人的业绩报酬：

本集合计划不收取业绩报酬。

（五）集合计划账户监控情况说明

本集合计划的银行托管账户由托管人负责开设和管理，使用限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人以本集合计划的名义在其营业机构开设本集合计划的银行托管账户，账户名称为“旗峰2号积极配置集合资产管理计划”。委托财产托管期间，托管账户预留印鉴为托管人托管业务专用章及托管人监管名章各一枚。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付集合计划收益、收取参与款，均通过本集合计划的银行托管账户进行。在需办理资金划拨时，托管人根据管理人的有效划款指令传真件进行划款。在托管存续期间，管理人未经托管人书面同意，不得撤销托管专户，不

得在托管人柜台办理资金划拨、购买支票等结算业务。

四、重要事项提示

(一)本报告期内本集合计划管理人及托管人未发生任何涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

(二)本报告期内集合计划的投资组合策略、投资决策程序未发生改变。

(三)本报告期内本集合计划的管理人、托管人托管业务机构及其高级管理人员未受到监管部门任何处罚。

(四)本报告期内本集合计划的投资经理由孙文阳变更为刘湘。

(五)本报告期内本集合计划未发生重大关联交易。

(六)证券期货经营机构董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划的户数为 1，份额为 103444.71 份，份额占比为 0.86%。

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 2 号积极配置集合资产管理计划推广的文件
- 2、《旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划说明书》
- 3、《旗峰 2 号积极配置集合资产管理计划资产管理合同》
- 4、《旗峰 2 号积极配置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

网址：www.dgzq.com.cn

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

2019年4月19日