

创金价值成长 5 期集合资产管理计划 季度资产管理报告

(2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)

第一节 重要提示

本报告依据《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：2021 年 4 月 1 日至 2021 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 | 20,379,785.87 份 |
| 存续期 | 无固定期限 |
| 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：陈四清

电话：010-95588

网址：www.icbc.com.cn

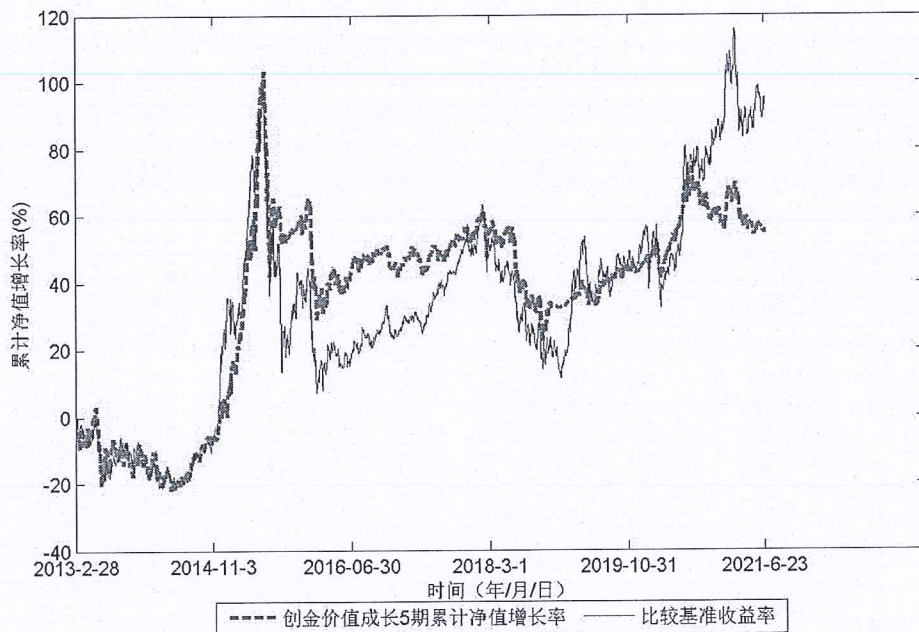
第三节 集合资产管理计划财务指标

一、主要财务指标（单位：人民币元）

| | |
|--------------------------|---------------|
| 集合计划本期利润 | -329,149.93 |
| 集合计划本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | -886,592.31 |
| 期末集合计划资产净值 | 18,129,714.54 |
| 期末集合计划单位净值 | 0.89 |

| | |
|--------------------------------|--------|
| 期末集合计划累计单位净值 | 1.578 |
| 本报告期集合计划累计单位净值增长率 ¹ | -0.94% |

二、集合计划累计单位净值增长率的历史走势图



注：累计净值增长率=（期末累计单位净值-成立之日产品累计单位净值）/成立之日产品累计单位净值*100%

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2021年6月30日，集合计划单位净值0.89元，累计单位净值1.578元，本集合计划自成立之日起累计净值增长率为57.80%。

¹本报告期累计单位净值增长率=（期末集合计划累计单位净值-本报告期期初集合计划累计单位净值）/报告期期初集合计划累计单位净值。

二、投资经理简介

谢昊，男，中山大学管理学院会计学硕士，于2017年3月加入第一创业证券股份有限公司，现任资产管理部投资经理，曾担任大成基金管理有限公司固定收益研究员、第一创业证券资产管理部投资经理助理。谢昊具备良好的信用研究功底，秉承以宏观基本面和行业基本面研判为基础，自上而下发现投资机会，风格稳健。最近三年没有受到监管机构采取的重大行政监管措施、行政处罚。

三、投资经理工作报告

（一）投资回顾

回顾上半年A股的整体走势，虽然A股大部分指数取得了上涨，但呈现出结构性波动加剧的特征，大盘成长、创业板指等为代表的核心资产指数波动率加大，而中证1000、小盘价值等波动率较小。与此同时，去年的茅指数在今年开始内部分化，在今天的流动性中性的环境下，市场回归基本面，业绩增速决定走势差异。此外，今年以来A股的主题投资氛围十分活跃，次新股、三代半导体、医美、鸿蒙等都是主题投资的重点方向。整体来看，今年上半年A股市场不再像去年一样抱团核心资产，开始走向分化，市场轮动变换加剧。看今年收益前五的公募基金里头，大部分集中在医药、健康、养老、新能源等热门板块，反映出结构性下的市场环境下，投资者的风格变化。

（二）投资展望

中报是一个重要的窗口期，半年报业绩大概率有望保持较高增速，但三季度后增速的变化值得关注。预计核心资产走势分化，核心因素仍然是基本面和业绩增速，业绩增速超预期的个股将持续胜出。后续将持续关注环保、科技、新能源等热门板块的投资机会。

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，管理人严格遵守相关法律法规、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

本集合计划管理人在内部风险控制工作上采取授权管理、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，通过风险监控与风险预警机制，重点检查本集合计划是否满足各项风险控制指标，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，风险控制部门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 管理人与托管人的履职情况

本报告期内，管理人严格遵守相关法律法规，在各重要方面的运作严格按照《创金价值成长 5 期集合资产管理计划资产管理合同》等文件的约定进行，不存在任何损害资产管理计划委托人利益的行为。

本报告期内，托管人在资产管理计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，妥善保管资产管理计划账户内资金，确保资产管理计划账户内资金的独立和安全，依法保护资产管理计划委托人的财产权益。在各重要方面的运作严格按照《创金价值成长 5 期集合资产管理计划集合资产管理合同》的约定，管理资产管理计划账户，不存在任何损害资产管理计划委托人利益的行为。

第六节 投资组合报告

一、期末资产组合情况

| 期末资产组合情况 (2021年6月30日) | | |
|-----------------------|---------------|---------|
| 资产名称 | 资产金额 (人民币元) | 占总资产比例 |
| 股票投资 | 7,410,722.20 | 40.78% |
| 债券投资 | 1,022.50 | 0.01% |
| 资产支持证券投资 | 0.00 | 0.00% |
| 基金投资 | 1,463,658.54 | 8.05% |
| 理财产品 | 0.00 | 0.00% |
| 应收利息 | 389.35 | 0.00% |
| 银行存款及清算备付金 | 2,292,678.18 | 12.62% |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00% |
| 其他资产 | 7,002,496.17 | 38.54% |
| 非标投资 | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 18,170,966.94 | 100.00% |

注：1、其他资产包括存出保证金和应收证券清算款、应收股利等
2、部分项目可能存在小数点尾差调整。

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 | 300731 | 科创新源 | 49,000.00 | 1,456,280.00 | 8.03% |
| 2 | 000338 | 潍柴动力 | 77,500.00 | 1,384,925.00 | 7.64% |
| 3 | 603517 | 绝味食品 | 16,000.00 | 1,348,640.00 | 7.44% |
| 4 | 600998 | 九州通 | 80,800.00 | 1,241,896.00 | 6.85% |
| 5 | 601800 | 中国交建 | 95,300.00 | 617,544.00 | 3.41% |
| 6 | 600893 | 航发动力 | 10,000.00 | 531,900.00 | 2.93% |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 22,000.00 | 452,100.00 | 2.49% |

| | | | | | |
|---|--------|------|-----------|------------|-------|
| 8 | 002007 | 华兰生物 | 10,290.00 | 377,437.20 | 2.08% |
|---|--------|------|-----------|------------|-------|

三、期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（张） | 证券市值（元） | 占净值（%） |
|----|--------|------|-------|----------|--------|
| 1 | 113042 | 上银转债 | 10.00 | 1,022.50 | 0.01% |

四、期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（张） | 证券市值（元） | 占净值（%） |
|----|--------|-------------|------------|--------------|--------|
| 1 | 001915 | 宝盈医疗健康沪港深股票 | 570,404.73 | 1,463,658.54 | 8.07% |

五、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。

第七节 集合计划份额变动

单位：份

| | |
|-----------|---------------|
| 期初份额总额 | 21,024,036.56 |
| 报告期间总参与份额 | 79,713.87 |
| 报告期间总退出份额 | 723,964.56 |
| 报告期末份额总额 | 20,379,785.87 |

第八节 集合计划相关费用

一、管理费

本集合计划不收取管理费。

二、托管费

在通常情况下，本计划的托管费按前一日集合计划资产净值 0.25% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

托管费每日计提, 逐日累计至每季度末, 按季度支付, 由托管人根据管理人的指令于 15 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。

三、管理人的业绩报酬

1、管理人收取业绩报酬的原则

(1) 同一委托人不同时间多次参与本计划的, 对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬;

(2) 在委托人退出日及计划终止日, 对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬;

(3) 在委托人退出日及计划终止日提取业绩报酬的, 业绩报酬从退出资金中扣除;

2、业绩报酬的计提方法

在委托人退出日及计划终止日, 若持有期计划年化收益率小于 6%, 则管理人不得提取业绩报酬; 若持有期计划年化收益率大于等于 6%, 则管理人对超出 6% 但小于 30% 的部分按 40% 的比例提取业绩报酬, 对超出 30% 的部分按 30% 的比例提取业绩报酬。

3、业绩报酬支付

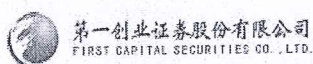
管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成, 托管人不承担复核业绩报酬的责任。由管理人向托管人发送划付指令, 托管人于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

第九节 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、本产品为非结构化产品，无产品杠杆；截至本报告期末，本产品未做正回购，也并未进行其他投资放大操作。

第十节 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

