

《国盛资管神鹰 38 号东方金钰集合资产管理计划 2017 年年度资产管理报告》

计划管理人：国盛证券资产管理有限公司

计划托管人：上海浦东发展银行股份有限公司广州分行

报告期间：2017 年 5 月 11 日—2017 年 12 月 31 日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人国盛证券资产管理有限公司依据中国证监会发布的《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》、中国证券业协会发布的规范性文件《证券公司客户资产管理业务规范》、中国证监会出具的《关于核准国盛证券有限责任公司设立资产管理子公司的批复（证监许可[2015]754号）》及其他有关规定制作。

2017年5月11日，国盛资管神鹰38号东方金钰集合资产管理计划成立，管理人于2017年5月12日向中国证券投资基金业协会提交了国盛资管神鹰38号东方金钰集合资产管理计划的发起设立情况报告等材料。

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。

集合资产管理计划托管人上海浦东发展银行股份有限公司广州分行已对本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容进行复核。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2017年5月11日—2017年12月31日

一、集合计划简介

（一）基本资料

集合计划名称：国盛资管神鹰38号东方金钰集合资产管理计划

集合计划成立日：2017年5月11日

集合计划报告期末份额总额：152,900,000.00

集合计划投资目标：本集合计划在控制风险和力争安全的前提下，通过参与集合资金信托计划，获得价值提升带来的收益，实现资产的长期稳定增值。

集合计划运作方式：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；该集合计划主要投向于光大兴陇信托有限责任公司设立的光大信托-臻道16号集合资金信托计划，该信托计划用于向借款人东方金

钰股份有限公司发放信托贷款，贷款资金用于补充借款人东方金钰股份有限公司流动资金；东方金钰股份有限公司控股股东云南兴龙实业有限公司为本集合计划的贷款提供连带责任保证担保，东方金钰股份有限公司实际控制人赵宁夫妇对本集合计划的贷款提供连带责任保证担保。

集合计划风险收益特征：本集合计划属于高风险收益品种，存在一定风险，适合具有匹配的风险承受能力且认同集合计划投资理念的投资者，包括个人投资者和机构投资者（法律法规禁止投资集合资产管理计划的除外）。

（二）集合计划管理人：国盛证券资产管理有限公司

（三）集合计划托管人：上海浦东发展银行股份有限公司广州分行

（四）注册登记机构：国盛证券资产管理有限公司

（五）会计师事务所：北京中证天通会计师事务所(特殊普通合伙)江西分所

二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

主要财务指标：

单位：人民币元

	主要财务指标	2017年5月11日—2017年12月31日
1	本期利润	7,033,480.98
2	期末集合计划资产净值	155,120,350.51
3	期末集合计划单位净值	1.0145

注：本期利润是信息披露期间内资管计划产生的投资收益；期末集合计划资产净值和期末集合计划单位净值数据来源于2017年12月31日当日的估值表和报告期的利润表。

三、集合计划管理人报告

（一）业绩表现

截至2017年12月31日止，神鹰38号东方金钰集合计划资产净值为155,120,350.51元，单位净值为1.0145元。

（二）投资经理简介

徐美云，毕业于江西财经大学工商管理，2004年7月至2010年9月在国盛证券

有限责任公司经纪业务管理总部任职业务主办。2010年10月至2013年9月，在国盛证券有限责任公司资产管理北京业务总部任职部门负责人。2015年10月至今在国盛证券资产管理有限公司金融市场部北京业务部项目经理。

（三）投资经理工作报告

1、“神鹰 38 号”的投资策略

本集合计划投资经理(即投资主办人员)在资产管理相关委员会授权的范围内，根据资产管理相关委员会确定的投资原则和资产配置比例，从备选库中选择合适的投资标的构建投资组合，并负责进行投资组合的日常管理。

2、“神鹰 38 号”的实际操作

神鹰 38 号投资光大兴陇信托发行的信托产品，该信托产品收益稳健，风险可控，符合神鹰 38 号产品投向特点。

（四）内部性声明

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》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

本集合计划在运作过程中面临的风险主要包括：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险等。针对集合计划管理的风险，管理人制定了一系列严密有效的风险管理制度、办法、规程及指引，并建立了由经理层风险管理委员会、投资决策委员会、合规法律风控部及各业务部门组成的风险管理体系，建立和完善对风险的事前识别和评估、事中监测和控制、事后稽查和监察的管理机制，各风险管理部门在各风险控制环节进行合理分工，相互监督，相互制衡。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划说明书的要求进行。本集合计划的投资

决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；本集合计划持有的证券和金融资产符合资产管理合同要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、准确、完整。

四、集合计划投资组合报告

资产组合情况

2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	期末市值（元）	占总资产比例
银行存款	2,645.89	0.0017%
信托产品	152,900,000.00	98.5686%
其他资产	2,217,724.62	1.4297%
资产类合计	155,120,370.51	100.0000%

注：因四舍五入原因，资产组合报告中市值占总资产比例的分项之和与合计可能存在尾差；其他资产是 2017 年 12 月 31 日当日的估值表中“应收股利”和“应收利息”。

五、集合计划份额变动情况

本集合计划存续期 2 年。本集合计划 2017 年 5 月份认购 30,000,000.00 份，申购 38,200,000.00 份，2017 年 6 月份净申购 48,500,000.00 份，2017 年 7 月份净申购 36,200,000.00 份。现本集合计划的份额为 152,900,000.00 份。

六、其他应披露事项

本报告期内不存在应披露而未披露的重大事项。在本报告期内公共传媒未报道可能对本公司经营情况产生较大影响的未公开重大信息。

本报告期内公司经营情况及内外部环境预计不会发生重大变化。

在本报告期内公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项或处于筹划阶段的重大事项。

最近一年未因经营管理出现重大违法违规行为受到行政处罚或被采取重大行政监管措施。

七、备查文件目录

- 1、《国盛资管神鹰 38 号集合资产管理计划说明书》
- 2、《国盛资管神鹰 38 号集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《国盛资管神鹰 38 号集合资产管理计划托管协议》
- 4、《国盛资管神鹰 38 号集合资产管理计划验资报告》
- 5、管理人业务资格批件、营业执照

备查文件查阅地点：国盛证券资产管理有限公司

查阅地址：广东省深圳市福田区滨河大道 9289 号京基滨河时代大厦 A 座 39 层

信息披露电话：0755-83270221

公司网址：www.gszq.com

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人国盛证券资产管理有限公司。

国盛证券资产管理有限公司

2018 年 1 月 26 日