

哲灵量化对冲资产管理计划 清算报告

2015 年 09 月

资产管理人：新湖期货有限公司

资产托管人：国金证券股份有限公司

第一节 资产管理计划简介

一、基本情况

哲灵量化对冲资产管理计划由新潮期货有限公司作为资产管理人,国金证券股份有限公司作为资产托管人,于2015年07月24日正式成立运作。成立时资产委托人有效认购金额为4,000,120.00元,折合计划份额为4,000,120.00份。其中优先级委托人认购金额为2,000,040.00元,折合计划份额为2,000,040.00份,进取级委托人认购金额为2,000,080.00元,折合计划份额为2,000,080.00份。

本计划为一对多资产管理计划,终止日为2015年09月18日。

二、清算原因

本计划经全体委托人同意,提前终止本计划。

第二节 资产管理计划的清算

一、清算结果

根据《哲灵量化对冲资产管理计划资产管理合同》的规定，哲灵量化对冲资产管理计划（以下简称“本计划”）已于 2015 年 09 月 18 日结束运作。本公司作为本计划资产管理人，已于 2015 年 09 月 18 日与托管人组成清算小组，处理清算相关事宜。现将资产清算结果公布如下（由于结息日为 9 月 22 日，以 9 月 22 日估值表中的数据为参考）：

1. 清盘日计划总份额：4,000,120.00 份。
2. 清盘日计划资产总值：4,252,516.27 元。
3. 清盘日计划应支付清算费用：0.00 元。
4. 清盘日计划应交纳所欠税款：0.00 元。
5. 清盘日计划应付费用：
 - 应付管理费 8,000.00 元；
 - 应付托管费 800.00 元；
 - 应付注册登记费 11,200.00 元；
 - 应付投资顾问业绩报酬：45,601.37 元；
 - 应付 A 级利润：37,480.20 元；
 - 其他应付款 2400 元，其中股东账户开户费 400 元，银行划款手续费 2,000 元。
6. 清盘日可分配计划资产净值：4,147,034.70 元，其中 A 类资产可分配资产净值 2,000,040.00 元； B 类资产可分配资产净值 2,146,994.70

元。

7. 清算日计划单位净值：1.037 元。

8. 本计划清算时先支付所有应付费用，合计 105,481.57 元。

可分配计划资产 A 类优先份额可以分配的本金及收益为 2,037,520.20 元，B 类份额可以分配的本金及收益为 2,146,994.70 元。可分配资金于 2015 年 09 月 25 日起由托管人从本计划托管专用账户划出，通过本计划注册登记机构清算账户划往委托人指定的银行账户。支付汇划手续费后多余的钱最后会通过注册登记机构账户划往 B 类委托人的账户。请注意查询。

三、清算报表

哲灵量化对冲资产管理计划估值表

估值日期：2015-09-22

单位净值：1.037

科目代码	科目名称	市值	市值占净值%
1002	银行存款	4,252,516.27	102.5435
100201	活期存款	4,252,516.27	102.5435
2206	应付管理人报酬	8,000.00	0.1929
220601	应付管理人报酬	8,000.00	0.1929
2207	应付托管费	800.00	0.0193
220701	应付托管费	800.00	0.0193
2232	应付利润	37,480.20	0.9038
223201	应付利润 A	37,480.20	0.9038
2241	其他应付款	59,201.37	1.4276
224188	应付注册登记费	11,200.00	0.2701
224192	投资顾问业绩报酬	45,601.37	1.0996
224199	其他应付款	2,400.00	0.0579
证券投资合计：	占总资产比(%)		
其中股票投资：			
其中债券投资：			
其中基金投资：			
其中权证投资：			
今日可用头寸		4,252,516.27	102.54
实收资本金额		4,000,120.00	96.46
实收资本金额:S63A44A		2,000,040.00	48.23
实收资本金额:S63B44B		2,000,080.00	48.23
资产类合计：		4,252,516.27	102.54
负债类合计：		105,481.57	2.54
基金资产净值：		4,147,034.70	100.00
基金资产净值:S63A44A		2,000,040.00	48.23
基金资产净值:S63B44B		2,146,994.70	51.77
基金单位净值：	1.037		
基金单位净值：S63A44A	1.000		
基金单位净值：S63B44B	1.073		



累计单位净值:	1.037	1.037	
累计单位净值:S63A44A	1.000	1.000	
累计单位净值:S63B44B	1.073	1.073	
可分配利润:	146,914.70		

第三节 托管人报告

在哲灵量化对冲资产管理计划存续期间，国金证券股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对哲灵量化对冲资产管理计划（以下简称“本计划”）的托管过程中，严格按照《哲灵量化对冲资产管理计划资产管理合同》及相关法律法规的规定，不存在损害计划份额持有人利益的行为，认真履行了应尽的义务。

本报告中的基础财务数据与我部记录核对无误。



国金证券股份有限公司

2015年09月



信息披露的查阅方式

投资者可到资产管理计划管理人、托管人的办公场所或计划管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本计划管理人。

咨询电话：400-8888-398

公司网址：www.xinhu.cn

公司地址：上海市裕通路 100 号 36 层

