

新湖祗海恒航一期资产管理计划年度报告（2016年）

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金名称 | 新湖祗海恒航一期资产管理计划 |
| 基金编号 | S83587 |
| 基金运作方式 | 半开放式 |
| 基金成立日期 | 2015-11-18 |
| 基金管理人 | 新湖期货有限公司 |
| 基金托管人 | 国信证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） | 深圳祗海恒航资产管理有限责任公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 15,501,080.00 |
| 基金合同存续期 | 2020-11-17 |

1.2 基金产品说明

| | |
|------------|---|
| 投资策略 | 坚持以研究驱动投资，价值选股，波段操作。首先，以基本面为依据，选择基本面良好，估值低估或合理的公司纳入股票池；其次，根据大盘及个股的技术形态特征，选定买入标的，动态仓位调节和波段操作，并适度参与股指期货对冲交易及融资融券。 |
| 业绩比较基准（如有） | |
| 风险收益特征 | 中高风险 |

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

| 期间数据和指标 | 2016年 | 2015年 | 2014年 |
|--------------|---------------|---------------|--------|
| 本期已实现收益 | 2,326,428.79 | -264,954.20 | 0.00 |
| 本期利润 | 658,216.17 | -263,304.20 | 0.00 |
| 期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配利润 | 383,911.53 | -264,954.20 | 0.00 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0248 | -0.0161 | 0.0000 |
| 期末基金资产净值 | 15,884,991.53 | 16,237,815.80 | 0.00 |
| 期末基金份额净值 | 1.025 | 0.984 | 0.000 |
| 累计期末指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 4.17 | -1.60 | 0.00 |

2.2 基金净值表现

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 (选填) | 业绩比较基准收 益率(选填) | 业绩比较基准收 益率标准差(选填) |
|----------------|-------|------------------|-------------------|----------------------|
| 当年 | 4.17 | | | |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.50 | | | |

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

2.3 过去三年基金的利润分配情况

| 年度 | 每份基金份额分 红数 | 现金形式发放总 额 | 再投资形式发放 总额 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|------|---------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 2016 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| 2015 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| 2014 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |

3、基金份额变动情况

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 16,501,120.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 0.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,000,040.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 15,501,080.00 |

4、管理人说明的其他情况（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作遵规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等）

4.1 基金运作遵规守信情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券期货经营机构落实资产管理业务“八条底线”禁止行为细则》等有关法律法规的规定，严格遵守资产管理计划合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，为发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、公司资产之间严格分开、公平对待，保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.2 基金投资策略和业绩表现

本基金投资经理主要投资策略是：坚持以研究驱动投资，价值选股，波段操作。首先，以基本面为依据，选择基本面良好，估值低估或合理的公司纳入股票池；其次，根据大盘及个股的技术形态特征，选定买入标的，动态仓位调节和波段操作，并适度参与股指期货对冲交易及融资融券。

5、托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

托管人声明，在本报告期间，本基金托管人——国信证券股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，遵守了《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。基金管理人本年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，遵守了《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

基金管理人本年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

单位：元

| 资产 | 本期末 2016-12-31 | 上年度末 2015-12-31 |
|----------|----------------|-----------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 991.23 | 52,842.92 |
| 结算备付金 | 744,528.24 | 907,627.99 |
| 存出保证金 | 8,911,269.67 | 13,282,140.99 |
| 交易性金融资产 | 6,306,305.81 | 2,034,350.00 |
| 其中：股票投资 | 3,704,158.20 | 2,034,350.00 |
| 基金投资 | 2,602,147.61 | 0.00 |
| 债券投资 | 0.00 | 0.00 |
| 资产支持证券投资 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|-----------------|-----------------------|------------------------|
| 贵金属投资 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 应收证券清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | 96.54 | 1,606.08 |
| 应收股利 | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 |
| 递延所得税资产 | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 15,963,191.49 | 16,278,567.98 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2016-12-31 | 上年度末 2015-12-31 |
| 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 | 0.00 | 0.00 |
| 应付证券清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付管理人报酬 | 11,171.41 | 5,821.74 |
| 应付托管费 | 11,171.41 | 5,821.74 |
| 应付销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 应付交易费用 | 0.00 | 0.00 |
| 应交税费 | 0.00 | 0.00 |
| 应付利息 | 0.00 | 0.00 |
| 应付利润 | 0.00 | 0.00 |
| 递延所得税负债 | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | 55,857.14 | 29,108.70 |
| 负债合计 | 78,199.96 | 40,752.18 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 15,501,080.00 | 16,501,120.00 |
| 未分配利润 | 383,911.53 | -263,304.20 |
| 所有者权益合计 | 15,884,991.53 | 16,237,815.80 |
| 负债和所有者权益合计 | 15,963,191.49 | 16,278,567.98 |

6.2 利润表

单位：元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|-------------------------|-------------------------|
| | 2016-01-01 至 2016-12-31 | 2015-11-18 至 2015-12-31 |
| 一、收入 | 1,694,241.97 | -56,217.00 |
| 1. 利息收入 | 11,074.78 | 18,329.00 |

| | | |
|-----------------------|---------------|-------------|
| 其中：存款利息收入 | 11,074.78 | 18,329.00 |
| 债券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 资产支持证券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 其他利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 3,345,760.82 | -76,196.00 |
| 其中：股票投资收益 | 2,629,210.91 | 0.00 |
| 基金投资收益 | -497,778.62 | 0.00 |
| 债券投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 资产支持证券投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 贵金属投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生工具收益 | 1,190,821.02 | -76,196.00 |
| 股利收益 | 23,507.51 | 0.00 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列） | -1,668,212.62 | 1,650.00 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”填列） | 0.00 | 0.00 |
| 5. 其他收入（损失以“-”填列） | 5,618.99 | 0.00 |
| 减：二、费用 | 1,036,025.80 | 207,087.20 |
| 1. 管理人报酬 | 92,820.11 | 5,821.74 |
| 其中：固定管理费 | 46,616.97 | 5,821.74 |
| 业绩报酬 | 46,203.14 | 0.00 |
| 2. 托管费 | 46,616.97 | 5,821.74 |
| 3. 销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 4. 外包服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 5. 交易费用 | 337,887.16 | 1,335.02 |
| 6. 利息支出 | 325,216.58 | 0.00 |
| 其中：卖出回购金融资产款支出 | 0.00 | 0.00 |
| 7. 其他费用 | 233,484.98 | 194,108.70 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 658,216.17 | -263,304.20 |
| 减：所得税费用 | 0.00 | 0.00 |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 658,216.17 | -263,304.20 |

6.3 所有者权益变动表

单位：元

| 项目 | 本期 (2016-01-01 至 2016-12-31) | | |
|---------------|---------------------------------|-------------|---------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净 | 16,501,120.00 | -263,304.20 | 16,237,815.80 |

| | | | |
|-----------------------------------|------------------------------------|-------------|---------------|
| 值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | 0.00 | 658,216.17 | 658,216.17 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -1,000,040.00 | -11,000.44 | -1,011,040.44 |
| 其中:1.基金申购款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 2.基金赎回款 | -1,000,040.00 | -11,000.44 | -1,011,040.44 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 15,501,080.00 | 383,911.53 | 15,884,991.53 |
| 项目 | 上年度可比期间 (2015-11-18至2015-12-31) | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 16,501,120.00 | 0.00 | 16,501,120.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | 0.00 | -263,304.20 | -263,304.20 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其中:1.基金申购款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 2.基金赎回款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 16,501,120.00 | -263,304.20 | 16,237,815.80 |

7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|--------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 3,704,158.20 | 23.20 |
| | 其中:普通股 | 3,704,158.20 | 23.20 |
| | 存托凭证 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 基金投资 | 2,602,147.61 | 16.30 |
| 3 | 固定收益投资 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中:债券 | 0.00 | 0.00 |
| | 资产支持证券 | 0.00 | 0.00 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 4 | 金融衍生品投资 | 8,888,365.60 | 55.69 |
| | 其中：远期 | 0.00 | 0.00 |
| | 期货 | 8,888,365.60 | 55.69 |
| | 期权 | 0.00 | 0.00 |
| | 权证 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：买断式回购的买入金融返售资产 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 货币市场工具 | 0.00 | 0.00 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 768,423.54 | 4.81 |
| 8 | 其他 | 96.54 | 0.00 |
| | 合计 | 15,963,191.49 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

| 序号 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 153,648.00 | 0.97 |
| B | 采矿业 | 0.00 | 0.00 |
| C | 制造业 | 3,550,510.20 | 22.35 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 0.00 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 0.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 0.00 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 0.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | 0.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 0.00 | 0.00 |
| J | 金融业 | 0.00 | 0.00 |
| K | 房地产业 | 0.00 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 0.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 0.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 0.00 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 0.00 | 0.00 |
| P | 教育 | 0.00 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 0.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 0.00 | 0.00 |
| S | 综合 | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 3,704,158.20 | 23.32 |

备注：以上股票投资不含港股通。

新湖祗海恒航一期资产管理计划

2016 年年度托管人报告

新湖期货有限公司：

托管人声明，在本报告期间，资产托管人——国信证券股份有限公司不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券公司客户资产管理业务管理办法》及其他有关法律法规、资产管理合同、托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内资产管理人在投资运作、集合计划资产净值的计算、利润分配、计划份额申购赎回价格的计算、计划费用开支等问题上，不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，遵守了《证券公司客户资产管理业务管理办法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。

特此报告。

国信证券股份有限公司资产托管部

2017 年 04 月 24 日

