

# 新湖-浦发-恒如 1 号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-浦发-恒如 1 号资产管理计划
基金编号	SD9942
基金运作方式	封闭型
基金成立日期	2016-02-26
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)	上海恒如投资管理有限公司
报告期末基金份额总额	50,001,000.00
基金合同存续期	2021-03-31

### 1.2 基金产品说明

投资目标	在严控风险的前提下, 力争实现资产的长期稳健增值。
投资策略	本计划运用的投资策略以股指期货期现套利为主, 包括但不限于 ETF 折溢价套利策略、封闭式基金套利策略、可转债套利策略等。本计划利用金融市场中相关市场或相关品种之间的价差变化, 在相关市场或相关合约上进行相反方向的交易, 以期价差发生有利变化而获利, 力争实现计划资产的稳健增值。
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	2,449,125.43	0.00	0.00
本期利润	2,532,767.59	0.00	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	2,449,125.43	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.0490	0.0000	0.0000
期末基金资产净值	52,533,767.59	0.00	0.00
期末基金份额净值	1.051	0.000	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	5.10	0.00	0.00
-------------	------	------	------

#### Z7210A 级基金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	0.00	0.00	0.00
本期利润	0.00	0.00	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	0.00	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.0000	0.0000	0.0000
期末基金资产净值	39,761,211.88	0.00	0.00
期末基金份额净值	1.060	0.000	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	6.00	0.00	0.00

#### Z7210B 级基金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	0.00	0.00	0.00
本期利润	0.00	0.00	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	0.00	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.0000	0.0000	0.0000
期末基金资产净值	12,772,555.71	0.00	0.00
期末基金份额净值	1.022	0.000	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	2.20	0.00	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	5.10			
自基金合同 生效起至今	5.10			

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

#### Z7210A 级基金净值表现



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	6.00			
自基金合同 生效起至今	6.00			

Z7210B 级基金净值表现

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	2.20			
自基金合同 生效起至今	2.20			

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	

Z7210A 级基金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	

Z7210B 级基金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	50,001,000.00
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	0.00
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	50,001,000.00

#### Z7210A 级基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额	37,500,750.00
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	0.00
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	37,500,750.00

#### Z7210B 级基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额	12,500,250.00
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	0.00
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	12,500,250.00

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

本基金投资经理在紧密跟踪宏观政策、市场趋势的基础上，通过专业金融投资决策系统进行多策略股票遴选，通过策略模型精选处于价值洼地的股票，并通过多类资产配置和策略运用分散风险，根据市场板块轮动情况运用积极的投资策略在不同板块间进行灵活资金配置，在把控风险的前提下为投资者创造良好收益。

##### 4.3 关于本计划合规性的特别说明



本计划成立于2016年2月26日，2016年7月15日中国证监会发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》中规定：不得直接或者间接对优先级份额认购者提供保本保收益安排，包括但不限于在结构化资产管理计划合同中约定计提优先级份额收益、提前终止罚息、劣后级或第三方机构差额补足优先级收益、计提风险保证金补足优先级收益等，按照此规定，本计划不符合上述要求，监管机构要求立即整改，因此管理人立即与委托人协商提前终止本计划，但由于委托人尚未就提前终止本计划达成一致，本计划至今尚在运行。

## 5、托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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遵规守信、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	7,988.70	0.00
结算备付金	6,630.91	0.00
存出保证金	93,225.73	0.00
交易性金融资产	47,580,923.20	0.00
其中：股票投资	1,399,124.00	0.00

基金投资	0.00	0.00
债券投资	46,181,799.20	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	2,000,020.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	2,882,916.21	0.00
应收股利	1,392.09	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	52,573,096.84	0.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016-12-31</b>	<b>上年度末 2015-12-31</b>
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	13,109.75	0.00
应付托管费	13,109.75	0.00
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	13,109.75	0.00
负债合计	39,329.25	0.00
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	50,001,000.00	0.00
未分配利润	2,532,767.59	0.00
所有者权益合计	52,533,767.59	0.00
负债和所有者权益合计	52,573,096.84	0.00

## 6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016-02-26 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
一、收入	3,263,883.69	0.00
1. 利息收入	2,653,683.99	0.00
其中：存款利息收入	23,757.73	0.00
债券利息收入	2,585,320.05	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	44,606.21	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	347,294.26	0.00
其中：股票投资收益	753,523.14	0.00
基金投资收益	1,652,632.14	0.00
债券投资收益	-732,000.84	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	-1,398,540.00	0.00
股利收益	71,679.82	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	83,642.16	0.00
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	179,263.28	0.00
减：二、费用	731,116.10	0.00
1. 管理人报酬	43,301.68	0.00
其中：固定管理费	43,301.68	0.00
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	43,301.68	0.00
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	43,301.68	0.00
5. 交易费用	601,211.06	0.00
6. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产款支出	0.00	0.00
7. 其他费用	0.00	0.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,532,767.59	0.00
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,532,767.59	0.00

### 6.3 所有者权益变动表

单位：元



项目	本期 (2016-02-26 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（基金净值）	50,001,000.00	0.00	50,001,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	2,532,767.59	2,532,767.59
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）	50,001,000.00	2,532,767.59	52,533,767.59
项目	上年度可比期间 (2015-01-01 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）	0.00	0.00	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	0.00	0.00
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）	0.00	0.00	0.00

## 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	1,399,124.00	2.66
	其中：普通股	1,399,124.00	2.66
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00



3	固定收益投资	46,181,799.20	87.84
	其中：债券	46,181,799.20	87.84
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	2,000,020.00	3.80
	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	107,845.34	0.21
8	其他	2,884,308.30	5.49
	合计	52,573,096.84	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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	1,276,834.00	2.43
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	42,960.00	0.08
J	金融业	4,000.00	0.01
K	房地产业	75,330.00	0.14
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	1,399,124.00	2.66

备注：以上股票投资不含港股通。





# 新湖-浦发-恒如 1 号资产管理计划

## 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



