

# 新湖聚合进取3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	新湖聚合进取3期资产管理计划
基金编号	SH2189
基金运作方式	封闭式
基金合同生效日期	2016-03-01
基金管理人	新湖期货有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,000,000份
基金合同存续期	20170228



### 1.2 基金产品说明

投资目标	本资产管理计划力争实现委托财产的增值
投资策略	主要投资资产管理计划劣后级份额，持有到期，力争获取超额回报
业绩比较基准（如有）	
风险收益特征	中等风险

## 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	-5,063.89	0.00	0.00
本期利润	-83,728.52	0.00	0.00
期末数据和指标	2016年末	2015年末	2013年末
期末可供分配利润	-5,063.89	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0008	0.00	0.00
期末基金资产净值	5,916,271.48	0.00	0.00
期末基金份额净值	0.986	0.00	0.00
累计期末指标	2016年末	2015年末	2013年末
基金份额累计净值增长率(%)	-1.40%	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	-1.40			
自基金合同生效起至今	-1.40			

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年	0.00	0.00	0.00	0.00	
2015年	0.00	0.00	0.00	0.00	
2014年	0.00	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	0.00
报告期期间基金总申购份额	6,000,000.00
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	6,000,000.00

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、基金运作遵纪守法情况、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 基金运作遵纪守法情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》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，本资产管理计划运作合法合规，未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，本资产管理计划与本资产管理计划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

本计划主要投资资产管理计划进取级份额，持有到期，力争获取超额回报。

### 5、托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵纪守法情况声明

托管人声明，在本报告期间，本基金托管人——宁波银行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《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》资产管理计划合同、托管协议及其他有关法律法规，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害资产管理计划持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵纪守法、净值计算、利润分配等情况的说明

2016年度，本资产管理计划管理人在本资产管理计划的投资运作、资产净值的计算、份额申购赎回价格的计算、费用开支、利润分配等问题上，托管人未发现损害资产管理计划持有人利益的行为。

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

2016年度，由本资产管理计划管理人编制并经托管人复核审查的有关本资产管理计划的年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

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	0.04	0.00
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	5,926,269.02	0.00
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	5,926,269.02	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	0.00	0.00
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	5,926,269.06	0.00
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	4,998.79	0.00
应付托管费	4,998.79	0.00
应付投资顾问费	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	0.00	0.00
负债合计	9,997.58	0.00
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6,000,000.00	0.00
未分配利润	-83,728.52	0.00
所有者权益合计	5,916,271.48	0.00
负债和所有者权益总计	5,926,269.06	0.00

## 6.2 利润表

单位：元

项目	本年度	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
一、收入	-73,730.94	0.00
1. 利息收入	1,840.63	0.00
其中：存款利息收入	400.12	0.00
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	0.00	0.00
其他利息收入	1,440.51	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,093.06	0.00
其中：股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	3,093.06	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	0.00	0.00
股利收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”填列）	-78,664.63	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）	0.00	0.00
减：二、费用	9,997.58	0.00
1. 管理人报酬	4,998.79	0.00
2. 托管费	4,998.79	0.00
3. 投资顾问费	0.00	0.00
4. 外包服务费	0.00	0.00
5. 交易费用	0.00	0.00
6. 利息支出	0.00	0.00

其中：卖出回购金融资产支出	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)	-83,728.52	0.00
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-83,728.52	0.00

### 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	-83,728.52	-83,728.52
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）	6,000,000.00	0.00	6,000,000.00
其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	0.00	6,000,000.00
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（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	6,000,000.00	-55,818.78	5,916,271.48
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（净值减少以“-”号填列）	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 (××元)	占基金总资产的 比例 (%)
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	5,926,269.02	100.00
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	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	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	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	0.04	0.00
8	其他	0.00	0.00
	合计	5,926,269.06	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	0.00	0.00
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

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00



## 宁波银行股份有限公司 托管报告

本报告期内（2016年度），本托管人在新湖聚合进取3期资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《期货公司资产管理业务试点办法》、资产管理合同和其他有关规定，不存在损害委托人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内（2016年度），本托管人按照国家有关规定、资产管理合同和其他有关规定，对委托资产净值计算、费用开支等方面进行了认真的复核，对委托资产的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有损害委托人利益的行为。

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

宁波银行股份有限公司

二〇一七年三月二十日

