

私募基金信息披露年度报表

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	新潮深圳大为 1 号
基金编号	S38049
基金运作方式	契约型开放式
基金成立日期	2015-06-26
基金管理人	新潮期货有限公司
基金托管人	国金证券股份有限公司
投资顾问（如有）	深圳大为智丰资产管理有限公司
报告期末基金份额总额	4,001,950.79
基金到期日期	2017-06-25

1.2 基金产品说明

投资目标	本资产管理计划将在严格控制风险的前提下，力争实现使投资者资本增值的目的。
投资策略	利用趋势加量化交易模式，根据趋势运行的不同阶段采取不同的交易策略，在降低市场风险的同时追求更高收益。
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	-466,472.08	-512,555.86	0.00
本期利润	-474,582.08	-512,555.86	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	-751,417.58	-512,555.86	0.00
期末可供分配基金份额利润	-0.1878	-0.0915	0.00
期末基金资产净值	3,250,533.21	5,087,556.14	0.00
期末基金份额净值	0.812	0.908	0.00
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	-18.80%	-9.20%	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(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准率(%)
当年	-10.57	-	-	-
自基金合同生效起至今	-18.80	-	-	-

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	年度利润分配情况	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	5,600,112.00
报告期期间基金总申购份额	801,886.79
减：报告期期间基金总赎回份额	2,400,048.00
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	4,001,950.79

4、管理人说明的其他情况

4.1 基金运作合规守信情况

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

本基金投资经理利用趋势加量化交易模式，根据趋势运行的不同阶段采取不同的交易策略，在

降低市场风险的同时追求更高收益。

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

2016 年度，资产管理计划托管人（或综合服务商）在本资产管理计划的托管（或保管）过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《期货公司资产管理业务试点办法》、资产管理计划合同及其他有关法律法规，尽职尽责地履行了资产管理计划托管人（或综合服务商）应尽的义务，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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，资产管理计划托管人（或综合服务商）未发现损害资产管理计划份额持有人利益的行为。

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资产管理计划托管人（或综合服务商）复核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

资产	2016-12-31	2015-12-31
资产：		
银行存款	2,933.31	1,848.74
结算备付金	842,465.18	5,094,849.79
存出保证金	419,840.12	0.00
交易性金融资产	89,790.00	0.00
其中：股票投资	89,790.00	0.00
基金投资	0.00	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	1,900,019.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	40.22	0.22
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	3,255,087.83	5,096,698.75
负债和所有者权益	2016-12-31	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	2,484.37	5,224.38
应付托管费	2,070.25	3,918.23
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	0.00	0.00
负债合计	4,554.62	9,142.61
所有者权益:		
实收基金	4,001,950.79	5,600,112.00
未分配利润	-751,417.58	-512,555.86
所有者权益合计	3,250,533.21	5,087,556.14
负债和所有者权益总计	3,255,087.83	5,096,698.75

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2016-1-1 至 2016-12-31	2015-1-1 至 2015-12-31
一、收入	-434,713.07	-482,616.36
1、利息收入	15,246.93	383.64
其中：存款利息收入	87.04	383.64
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	15,159.89	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2、投资收益（损失以“-”填列）	-441,850.00	-483,000.00
其中：股票投资收益	-2,220.00	0.00
基金投资收益	0.00	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	-439,630.00	-483,000.00
股利收益	0.00	0.00
3、公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-8,110.00	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	39,869.01	29,939.50
1. 管理人报酬	14,697.69	10,948.06
其中：固定管理费	14,697.69	10,948.06
业绩报酬	0.00	0.00
2、托管费	11,454.71	8,211.05
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	12,632.56	9,150.21
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	1,084.05	1,630.18
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-474,582.08	-512,555.86
减：所得税费用	0.00	0.00
(净亏损以“-”号填列) 四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-474,582.08	-512,555.86

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2016-1-1 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)	5,600,112.00	-512,555.86	5,087,556.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	-474,582.08	-474,582.08
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)	-1,598,161.21	235,720.36	-1,362,440.85
其中：1、基金申购款	801,886.79	-121,886.79	680,000.00
2、基金赎回款	-2,400,048.00	357,607.15	-2,042,440.85
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)	4,001,950.79	-751,417.58	3,250,533.21
项目	2015-1-1 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)	5,600,112.00	0.00	5,600,112.00
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	0.00	-512,555.86	-512,555.86
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)	5,600,112.00	-512,555.86	5,087,556.14

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	89,790.00	2.76
	其中：普通股	89,790.00	2.76
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
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	404,916.00	12.44
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	404,916.00	12.44
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	1,900,019.00	58.37
	其中：买断式回购的买	0.00	0.00

	入返售金融资产		
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	860,322.61	26.43
8	理财产品	0.00	0.00
9	其他各项资产	40.22	0.00
	合计	3,255,087.83	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	89,790.00	2.76
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	89,790.00	2.76