

新湖祚海恒航一期资产管理计划 2018年第2季度报告

1、计划基本情况

项目	信息
计划名称	新湖祚海恒航一期资产管理计划
计划编码	S83587
计划管理人	新湖期货有限公司
计划托管人(如有)	国信证券股份有限公司
投资顾问(如有)	深圳祚海恒航资产管理有限责任公司
计划运作方式	有条件的开放参与和退出
计划成立日期	2015年11月18日
报告期末计划份额总额	8,500,500.00
投资目标	坚持以研究驱动投资,价值选股,波段操作等为投资者获取收益。
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	本产品预警线0.65,止损线0.55。
报告是否经托管机构复核	是

2、计划净值表现

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差(%)
当季	-34.17	-	-	-
自计划合同生效起至今	-34.30	-	-	-

说明:净值增长率等于(期末累计净值-期初累计净值)/期初累计净值

当季净值增长率等于(本季度末累计净值-上季度末累计净值)/上季度末累计净值

3、主要财务指标

单位:人民币元

项目	2018年04月01日至2018年06月30日
本期已实现收益	-6,444,297.30
本期利润	-3,498,404.02
期末计划资产净值	4,908,699.75
期末计划份额净值	0.577

4、投资组合报告

4.1 期末计划资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占计划总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,206,381.10	92.72
	其中：普通股	5,206,381.10	92.72
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	14,178.96	0.25
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	334,655.20	5.96
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	334,655.20	5.96
	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	-3,780.35	-0.07
8	其他各项资产	63,605.42	1.13
	合计	5,615,040.33	100.00

注：其他各项资产：主要包括三方存管保证金、应收股利、应收利息等。

本报表“金融衍生品投资”下的“期货”仅列示计划持有期货合约时被占用的保证金金额，不代表期货合约的实际市值。

4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含港股通)

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占计划资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	4,845,340.10	98.71
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	274,900.00	5.60
J	金融业	27,200.00	0.55
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	58,941.00	1.20
	合计	5,206,381.10	106.06

4.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值	占计划资产净值比例 (%)
农、林、牧、渔业	0.00	0.00
采矿业	0.00	0.00
制造业	0.00	0.00
电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
建筑业	0.00	0.00
批发和零售业	0.00	0.00
交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
住宿和餐饮业	0.00	0.00
信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
金融业	0.00	0.00
房地产业	0.00	0.00
租赁和商务服务业	0.00	0.00
科学研究和技术服务业	0.00	0.00
水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
教育	0.00	0.00
卫生和社会工作	0.00	0.00
文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
综合	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

5、计划份额变动情况

单位：份

报告期期初计划份额总额	13,501,000.00
报告期期间计划总申购份额	0.00
减：报告期期间计划总赎回份额	5,000,500.00
报告期期间计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末计划份额总额	8,500,500.00

6、管理人报告（如报告期内高管、投资经理及其关联投资经验、计划运作合规守信情况、计划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、内部计划监察稽核工作、计划估值程序、计划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、对本计划持有人数或计划资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等）



6.1 计划运作合规守信情况

本报告期内，本计划管理人严格遵守《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计划资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本计划运作合法合规，未发生损害计划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，本计划与本计划管理人所管理的其他计划资产、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。

6.2 计划投资经理简介

史林先生，新湖期货财富管理中心总监助理兼投资经理，已取得期货从业资格，具有6年期货从业经验，具有良好的诚信记录及职业操守，且最近3年没有受到监管部门的行政处罚和自律处分。2012年加入新湖期货有限公司，曾担任新湖期货金融事业总部项目经理、负责人。2014年底主导发行了期货资管首支一对多产品。

6.3 计划风险控制情况

本报告期内，本计划管理人针对本计划的运作特点，通过每日的风险监控工作，确保符合计划合同投资限制要求，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，提醒并采取相应的风险规避措施。计划管理人通过动态评估计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险等，确保运作风险水平与其投资目标相一致。

托管人复核说明：本计划托管人按照相关法律法规、计划合同的规定，对本计划在本报告中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。



新湖祗海恒航一期资产管理计划

2018 年二季度托管人报告

新湖期货有限公司：

本报告期内管理人遵守《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》等有关法律法规，在基金资产净值的计算、利润分配、计划份额申购赎回价格的计算、计划费用开支等业务中，未发现有损害计划份额持有人利益的行为，基金投资运作符合基金合同约定。

资产管理人报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

特此报告。

国信证券股份有限公司资产托管部

2018年07月16日

