

新湖量元贰号资产管理计划

2018年第2季度报告

1、计划基本情况

项目	信息
计划名称	新湖量元贰号资产管理计划
计划编码	SY8732
计划管理人	新湖期货有限公司
计划托管人(如有)	招商证券股份有限公司
投资顾问(如有)	-
计划运作方式	不定期开放
计划成立日期	2018年01月04日
报告期末计划份额总额	11,000,000.00
投资目标	在控制风险的前提下,实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
投资策略	多因子选股择时策略为主,获取较稳健的超额收益;股指期货深贴水时,可以择机利用股指期货替代股票组合,以获取超额收益;可利用股指期货进行风险管理;多策略管理,同时结合灵活的现金管理方式增厚收益。
业绩比较基准(如有)	-
风险收益特征	【R3】风险等级,预警线为0.84,止损线为0.82
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	0.93	-	-	-
自计划合同生效起至今	-0.57	-	-	-

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	100,279.20
本期利润	100,705.81
期末计划资产净值	10,936,782.51
期末计划份额净值	0.9943

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	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	10,914,706.39	99.75
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	16,335.13	0.15
8	其他各项资产	11,271.74	0.10
	合计	10,942,313.26	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。

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	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



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

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 (%)
港股通	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	11,000,000.00
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	0.00
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	11,000,000.00

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 and 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

周潜先生，资产管理部投资经理。应用数学硕士、TB 交易网校认证讲师，专研组合交易。擅长跨学科应用交易、图形结构识别及组合资金调配，认为组合资金调配才是可行性风险控制的关键。

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。

