

海鑫资产稳健收益1号2016年年度报告

2016年12月31日

资产管理人：北京海鑫资产管理有限公司

资产托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月三十一日

§ 1 基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	海鑫资产稳健收益1号
基金编号	SL3715
基金运作方式	
基金合同生效日	2016年07月22日
基金管理人	北京海鑫资产管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	27883903.94份
基金合同存续期(个月)	0

1.2 基金产品说明

投资目标	债券类
投资策略	
业绩比较基准	无
风险收益特征	

1.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	北京海鑫资产管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	
	联系电话	
	电子邮箱	
传真		
注册地址		
办公地址		
邮政编码		
法定代表人		

1.4 其他相关资料

项目	名称	办公地址

会计师事务所		
注册登记机构		
外包机构		

§ 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

金额单位：人民币元

2.1.1 期间数据和指标	2016年07月22日-2016年12月31日	2015年07月22日-2015年12月31日	2014年07月22日-2014年12月31日
本期已实现收益	593,113.28	—	—
本期利润	338,477.06	—	—
2.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	604,573.12	—	—
期末可供分配基金份额利润	0.0217	—	—
期末基金资产净值	28,488,477.06	—	—
期末基金份额净值	1.0220	—	—
2.1.3 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%	—	—

2.2 基金净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④
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

单位：人民币元

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	—	—	—	—	
合计	—	—	—	—	

§ 3 基金份额变动

3.1、基金份额变动

项目	份额数（份）
报告期期初基金份额总额	10,000,000.00
报告期基金总申购份额	17,883,903.94
减：报告期期间基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	27,883,903.94

§ 4 管理人说明的其他情况

4.1、基金管理人及其管理基金的经验

- 首都经济贸易大学金融学硕士，多年大型企业管理经验和资本市场投资经历。2001-2011年中国北方工业公司战略投资部高级经理、北方国际合作股份有限公司战略投资部总经理。2014年11月至今任北京海鑫资产管理有限公司债券投资部总经理，期间负责的债券投资业务实现了低回撤的稳健增长。

4.2、管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人在管理基金过程中，严格遵守了基金合同和其他有关法律法规的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了管理人应尽的义务。

4.3 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.3.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券行情在经历了16年四季度的超调。高位回落整理态势明显，预计会逐渐企稳，众多债券已经显现出配置价值。

4.3.2 报告期内基金的业绩表现

16年8月我司首只债券型私募基金海鑫资产稳健收益1号成功募集设立，经过4个月的运行，

基金实现了平稳增长的目标，设立不久就遇到了债券市场的大幅调整，但基金经受了市场的考验，截止年底净值为1.022。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据市场情况灵活调节杠杠，降低预期收益对自营和基金的操作均会有起到比较好的保护。策略方面依然以短久期加杠杠调节以应对利率风险，杠杠调节以应对市场风险，加强对信用风险的防范，避免黑天鹅事件。

4.5 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

一、为了充分保护基金持有人和股东的合法权益，规范海鑫资产管理有限公司运作和基金管理，加强内部风险控制，根据《证券投资基金管理暂行办法》、制订《海鑫资产管理有限公司内部管理制度》。

二、监察稽核的目的是评价公司内部控制制度的合法性、合规性、合理性、完备性和有效性；监督公司内部控制制度的执行情况；揭示、控制公司内部管理及基金运作中的风险，确保国家法律、法规和公司内部管理制度的有效执行。

三、监察稽核遵循独立、客观、公正原则，为公司的正常运转提供有力保障。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

海鑫资产管理有限公司委托托管人（中信建投股份有限公司）行使基金估值的权利，定期完成估值信息的报送。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

未分配

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

预警及止损：预警线：0.9，止损线：0.85

未发生预警情形。

§ 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

在本报告期内，本基金托管人在托管基金过程中，严格遵守了基金合同和其他有关法律、法规的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，托管人按照相关法律法规、基金合同和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用等方面进行了认真的复核，对本产品的投资运作进行了监督，未发现产品管理人有关严重损害基金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

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现的相关内容，所复核内容真实、准确和完整。

§ 6 年度财务报表

6.1 资产负债表

会计主体：海鑫资产稳健收益1号

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	2,524.30	—
结算备付金	—	—
存出保证金	72.15	—
交易性金融资产	55,318,456.80	—
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	55,318,456.80	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	1,400,052.77	—

应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	56,721,106.02	—
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	28,012,579.80	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	198,411.28	—
应付托管费	8,860.07	—
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	—	—
应交税费	—	—
应付利息	3,917.74	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	8,860.07	—
负债合计	28,232,628.96	—
所有者权益：		
实收基金	27,883,903.94	—
未分配利润	604,573.12	—
所有者权益合计	28,488,477.06	—
负债和所有者权益总计	56,721,106.02	—

6.2 利润表

会计主体：海鑫资产稳健收益1号

本报告期：2016年07月22日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年07月22日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年7月22日至2015 年12月31日
一、收入	808,617.18	—
1.利息收入	1,065,078.77	—
其中：存款利息收入	2,832.90	—
债券利息收入	1,061,961.07	—
资产支持证券利息收 入	—	—
买入返售金融资产收 入	284.80	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填 列）	-1,825.37	—
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-1,825.37	—
资产支持证券投资收 益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	—	—
其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	-254,636.22	—
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	—	—

减：二、费用	470,140.12	—
1. 管理人报酬	198,411.28	—
2. 托管费	8,860.07	—
3. 销售服务费	—	—
4. 外包服务费	8,860.07	—
5. 交易费用	1,514.93	—
6. 利息支出	252,493.77	—
其中：卖出回购金融资产支出	252,493.77	—
7. 其他费用	—	—
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	338,477.06	—
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	338,477.06	—

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海鑫资产稳健收益1号

本报告期：2016年07月22日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年07月22日至2016年12月31日		
	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)	10,000,000.00		10,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	338,477.06	338,477.06
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)	17,883,903.94	266,096.06	18,150,000.00
其中：1.基金申购款	17,883,903.94	266,096.06	18,150,000.00
2.基金赎回款	—	—	—
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)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	27,883,903.94	604,573.12	28,488,477.06
项 目	上年度可比期间 2015年7月22日至2015年12月31日		
	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)	—	—	—
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	—	—
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)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	—	—	—
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)	—	—	—
五、期末所有者权益 (基金净值)	—	—	—

§ 7 期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中：普通股	—	—
	存托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	55,318,456.80	97.53

	其中：债券	55,318,456.80	97.53
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	2,596.45	—
8	其他各项资产	1,400,052.77	2.47
9	合计	56,721,106.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—

L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	—	—