

大地期货稳健成长 1 号资产管理计划

清算报告

根据管理人大地期货有限公司、托管人国信证券股份有限公司及委托人签署的《大地期货稳健成长 1 号资产管理计划资产管理合同》和管理人提交的《大地期货稳健成长 1 号资产管理计划清算公告》，管理人到期终止该资产管理计划，终止日期为 2016 年 5 月 31 日。

现对该资产管理计划运行期间的相关情况及财务数据说明如下：

一、项目本金及运行情况：

根据《大地期货稳健成长 1 号资产管理计划资产管理合同》的约定，本资产管理计划的初始委托资产本金为人民币 28,100,000.00 元，委托资产运作起始日为 2015 年 6 月 1 日，合同终止日为 2016 年 5 月 31 日，首次清算结束日为 2016 年 5 月 31 日。

二、项目运作期及清算期间损益情况：

时间：2015 年 6 月 1 日至 2016 年 5 月 31 日

单位：元

序号	项目	本期累计数
1	一、收入	889,659.86
2	二、费用	643,861.52
3	三、利润总和	245,798.34

三、项目清算资产负债情况：

时间：2016 年 5 月 31 日

单位：元

项目	期末余额
资产合计	28,442,926.55
负债合计	97,128.21
所有者权益：	
实收基金	28,100,000.00
未分配利润	245,798.34
所有者权益合计	28,345,798.34
负债和所有者权益总计	28,442,926.55

四、其他说明

1、本报告涉及数据为产品成立日至产品首次清算结束日的的数据，不包括清算结束日至划付日的利息及清算款项划付的银行汇划手续费。

2、委托人应得清算资金中的应收利息 1,018.22 元，该金额于银行结息或托管帐户销户结息时才能划付给委托人。存款结息以银行实际派息为准，实际派息金额与划付日的应收利息的尾差由委托人承担。

3、资产管理计划终止日至资产管理计划财产兑付期间，产生的利息、银行手续费等收入和费用，由委托人承担，该应付金额与实际划付日的剩余金额的尾差由委托人承担。

4、资产管理计划财产兑付日至账户销户（包括银行账户、证券资金账户、期货资金账户等）期间，资产管理计划资产所收到且未被列入资产管理计划清算财产的存款利息等收入，用于支付资产管理计划财产产生的银行手续费等费用，若有结余，归委托人所有；若不足，从归属于委托人的基金资产中支付。

5、2016 年 5 月 31 日，基金尚持有未变现的交易性金融资产 90,683.00 元（停牌股票的价值按当日收盘价计算）。由于首次清算时计提的管理人业绩报酬是以终止日扣除停牌股票账面价值后基金的净值为基础计算，因此，后续清算时将以未变现资产变现后的金额为基础再次按照合同约定补计提管理人业绩报酬，剩余资产变现后归委托人所有（扣除后续清算时补提的扣除管理人业绩报酬后）。基金首次清算日仍持有的未变现资产的价值以资产变现后实际到账金额为准，实际到账金额与账面价值 90,683.00 元的差额由委托人承担（扣除后续清算时补提的管理人业绩报酬后）。

6、2016年5月31日，可划付给委托人的总额为28,254,097.12元。

7、管理人需于资金划付前将资金全部划入托管户。

管理人：大地期货有限公司

二零一六年六月二日