

兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划
2019 年第一季度资产管理报告
(2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日)



资产管理人：兴证期货有限公司

资产托管人：招商银行股份有限公司广州分行

报告送出日期：2019 年 4 月 10 日

兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划

2019 年第一季度资产管理报告

一、重要提示

本报告依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《期货公司资产管理业务试点办法》（以下简称《试点办法》）、《期货公司监督管理办法》（以下简称《管理办法》）、《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》（以下简称《管理规则》）和其他有关规定制作。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本资产管理计划资产，不保证本资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

托管人确认已复核本报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

本报告未经审计。本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 3 月 31 日止。

二、资产管理计划概况

产品名称：兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划

简称：兴诚-信朴套利 1 号

投资经理简历：杜鹏先生，同济大学金融数学硕士。2011 年 4 月加入兴证期货有限公司，任研究发展部研究员；2014 年 11 月，任资产管理部投资经理。研究经验丰富。

产品类型：集合资产管理计划

计划运作方式：通过筹集委托人资金交由托管人托管，由资产管理计划管理人统一管理和运用，投资于中国证监会认可的投资品种，并将投资收益按比例分配给委托人。

投资目标：在合同约定的投资范围内，为委托人谋求投资回报。

投资范围及比例：

1、投资范围

本资产计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，现金、银行存款、货币市场基金、债券逆回购，北京信朴量思投资管理有限公司作为管理人发行的私募证券投资基金

2、资产配置比例（占资产总值的比例）

上述投资范围中各项投资标的的投资比例分别为委托资产的 0-100%

合同生效日、成立日期：2017 年 12 月 22 日

成立规模：200 万元

存续期：5 年

管理人：兴证期货有限公司

托管人：招商银行股份有限公司深圳分行

三、主要财务指标和集合计划净值表现

（一）、主要财务指标

会计期间：2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日

币 种：人民币

	主要财务指标	
1	本期利润	793,561.83
2	期末资产管理计划净值	39,076,326.63
3	期末单位资产管理计划净值	1.1151
4	期末累计单位资产管理计划净值	1.1151

（二）、资产管理计划净值表现

截止 2019 年 3 月 31 日，本计划单位净值为 1.1151，累计单位净值 1.1151。2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日，本计划单位净值涨幅为 2.28%。

四、资产管理计划风险控制报告

本报告期内，资产管理计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《管理办法》、《试点办法》及其他法律法规的规定，始终按照本资产管理计划合同和说明书的要求管理和运用本资产管理计划资产。

2019 年第一季度，资产管理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，及时发现运作过程中可能出的风险状况，并提醒投资顾问采取相应的风险规避措施，确保了本资产管理计划合法合规、正常平稳运行。

经过审慎核查，截至 2019 年 3 月 31 日，本资产管理计划的投资决策、投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求，交易行为合法，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据真实、完整、准确、及时。本计划管理人通过动态评估资产管理计划运作过程

中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保本资产管理计划运作风险水平与投资目标相一致。

我们认为，报告期内资产管理计划管理人本着诚实守信、勤勉尽责的原则，控制风险的基础上为本计划持有人谋求最大利益，运作合法合规，不存在损害资产管理计划持有人利益的行为。

五、资产管理计划财务报告

（一）、资产管理计划会计报表

1、资产管理计划资产负债表

日期：2019 年 3 月 31 日

币种：人民币

资 产	期末余额	季初余额	负债和所有者权益	期末余额	季初余额
资 产：			负债：		
银行存款	246,494.96	32,808.72	短期借款		
结算备付金			交易性金融负债		
存出保证金			衍生金融负债		
交易性金融资产	38,837,841.01	38,036,701.68	卖出回购金融资产款		
其中：股权投资			应付证券清算款		
债券投资			应付赎回款		
基金投资	38,837,841.01	38,036,701.68	应付管理人报酬	5,691.93	5,734.33
资产支持证券投资			应付托管费	2,371.64	2,389.23
衍生金融资产			应付投资顾问费		
买入返售金融资产			应付交易费用		
应收证券清算款			应付销售服务费		
应收利息	54.23	7.26	应付税费		
应收股利			应付利息		
应收申购款			应付利润		
应收信托红利			其他负债		
其他资产			负债合计	8,063.57	8,123.56
其他投资			所有者权益：		
			实收基金	35,042,719.31	34,910,939.40
			未分配利润	4,033,607.32	3,150,454.70
			所有者权益合计	39,076,326.63	38,061,394.10
资产合计：	39,084,390.20	38,069,517.66	负债与持有人权益总计：	39,084,390.20	38,069,517.66

2、资产管理计划费用表

期间：2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日

币 种：人民币

项目	本期金额	本年累计
一、收入	801,857.98	801,857.98
1、利息收入	718.65	718.65
其中：存款利息收入	718.65	718.65
债券利息收入		
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入		
其他利息收入		
2、投资收益（损失以“-”填列）		
其中：股票投资收益		
基金投资收益		
债券投资收益		
资产支持证券投资收益		
衍生工具收益		
股利收益		
基金红利收益		
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	801,139.33	801,139.33
4、汇兑收益（损失以“-”号填列）		
5、其他收入（损失以“-”填列）		
二、费用	8,296.15	8,296.15
1、管理人报酬	5,691.93	5,691.93
2、托管费	2,371.64	2,371.64
3、投资顾问费		
4、交易费用		
5、销售服务费		
6、利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
7、其他费用	232.58	232.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	793,561.83	793,561.83
减：所得税费用		
四、净利润总额（净亏损以“-”号填列）	793,561.83	793,561.83

(二)、资产管理计划投资组合报告

日期：2019 年 3 月 31 日

币 种：人民币

项目	期末市值	占总资产比例
银行存款及备付金	246,494.96	0.63%
存出保证金		
股票投资		
债券投资		
基金投资	38,837,841.01	99.37%
资产支持证券投资		
买入返售金融资产		
其他资产	54.23	0.00%
资产合计	39,084,390.20	100.00%

(三)、收益分配情况

本报告期内，该产品无收益分配情况

六、集合计划份额变动情况

期间：2018 年 10 月 1 日-2018 年 12 月 31 日

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
34,910,939.4	10,631,330.04	10,499,550.130	35,042,719.31

七、备查文件目录

(一)、《兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划资产管理合同》

(二)、《兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划成立公告》

(三)、管理人业务资格批件、营业执照。

八、文件存放地点

兴证期货有限公司

地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 8 楼

联 系 人：崔文婷

服务电话：021-20370952

E-MAIL: cuiwt@xzfutures.com

投资者对本报告书如有任何疑问，可以咨询管理人兴证期货有限公司

