

兴诚-元葵长青 17 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)

兴证期货

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北京分行

报告送出日期：2019 年 4 月 18 日

黄皓

资产托管业务专用章

兴诚-元葵长青 17 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-元葵长青 17 号资产管理计划

简称:兴诚-元葵

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:

- (1) 现金类:现金、同业存单、银行存款(包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款)、货币型 ETF、货币市场基金、债券逆回购;
- (2) 固定收益类:交易所市场交易的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、

资产支持证券、资产支持票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、集合票据、项目收益债、项目收益票据、可转债、可交换债、债券型 ETF、债券型基金、分级基金 A；

(3) 权益类：沪、深交易所上市交易 A 股股票（含网上新股申购）、交易所上市的封闭式及开放式证券投资基金（除货币市场基金、债券型基金、分级基金 A）、ETF 基金（除货币型 ETF、债券型 ETF）、LOF 基金、分级基金 B、深港通、沪港通；

(4) 衍生品类：股指期货、国债期货、商品期货(仅限上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所及上海国际能源交易中心的交易品种)、场内期权；

2、资产配置比例（占资产总值的比例）

本资产管理计划财产的投资组合应遵循以下限制：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总值的 0-100%（除本章第四节“投资限制”有特别说明外），股指期货、商品期货、国债期货按照保证金进行计算，保证金率采用期货公司保证金率标准，日终计算采用交易所公布的当日结算价。

本资产管理计划投资限制为：

1、股票投资部分风险控制：

- 1) 本计划所持有的权益类证券依市值计算，最大投资比例为本计划资产净值的 80%；
- 2) 本计划投资于单一股票不得超过本计划资产净值的 10%（按市值）；
- 3) 本计划投资于单一股票不超过上市公司流通股本的 4.99%（按市值）；
- 4) 本计划投资于创业板单一股票不得超过本计划资产净值的 10%，总创业板股票持有最大比例为本计划资产净值的 20%（按市值）；

2、债券资产须遵守以下投资限制：

- 1) 仅能投资于在交易所市场公开上市的债券；
- 2) 不得投资于债项评级低于 AA+ 的债券品种（短期融资券及超级短期融资券除外）；
- 3) 不得投资于发行人为民营企业的债券；

- 4) 不得投资于发行人为钢铁、水泥制造、煤炭开采过剩产能行业的债券（采用申万二级行业分类）
- 5) 按成本计, 投资于单一债券的总额不得超过计划资产净值的 10%;
- 6) 按成本计, 投资于单一主体发行的债券总额不得超过计划资产净值的 10%;
- 7) 投资于债券的市值合计不得超过资产净值的 50%。

3、期货投资部分风险控制:

- 1) 当 T 日计划份额净值 ≥ 1.20 时, T+1 日期货账户净持仓杠杆不超过 300%;
- 2) 当 $1.00 \leq T$ 日计划份额净值 < 1.20 时, T+1 日期货账户净持仓杠杆不超过 260%;
- 3) 当 $0.90 \leq T$ 日计划份额净值 < 1.00 时, T+1 日期货账户净持仓杠杆不超过 200%;
- 4) 当 T 日计划份额净值 < 0.90 时, T+1 日期货账户净持仓杠杆不超过 150%;

注: 净持仓杠杆= $ABS(期货多头合约价值 - 期货空头合约价值) / 本计划资产净值$ 。

5) 商品期货不能进行交割, 在合约最后交易日前 5 个工作日平仓, 进入交割月的商品期货合约持仓量不超过该交割合约市场持仓量的 5%, 进入交割月的商品期货合约保证金占用不超过计划资产净值的 5%。

6) 期货风险度不超过 80%, 期货账户风险度=期货账户持仓占用保证金/期货账户总权益

4、本计划投资于单只交易所场内基金不得超过计划资产净值的 20%（以成本价计算，货币基金、沪深 300 指数基金、交易所指数 ETF 基金不受此限制）；五、投资禁止行为

合同生效日、成立日期: 2017 年 12 月 28 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北京分行

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	621,457.18
2	期末资产管理计划净值	11,452,362.74
3	期末单位资产管理计划净值	0.9956
4	期末累计单位资产管理计划净值	0.9956

(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 0.9956，累计单位净值 0.9956。2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日，本计划单位净值涨幅为 5.49%。

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場风险、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	24,990.07	1,996.73	短期借款		
结算备付金	2,931,098.23	3,978,832.36	交易性金融负债		
存出保证金	246,100.58	200,800.77	衍生金融负债		
交易性金融资产	7,137,033.68	7,926,531.21	卖出回购金融资产款		
其中：股票投资	3,760,757.94	437,189.95	应付证券清算款	51,422.47	
债券投资			应付赎回款		
基金投资	3,376,275.74	7,489,341.26	应付管理人报酬	1,777.49	2,075.19
资产支持证券投资			应付托管费		
衍生金融资产			应付投资顾问费		
买入返售金融资产	1,200,012.00	1,600,016.00	应付交易费用		
应收证券清算款			应付销售服务费		
应收利息	44.68	-251.91	应付税费	18,853.43	451.88
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	14,811.75	17,292.53
其他资产			负债合计	86,916.50	19,819.60
其他投资			所有者权益：		
			实收基金	11,502,800.28	14,502,800.28
			未分配利润	-50,437.54	-814,694.72
			所有者权益合计	11,452,362.74	13,688,105.56
资产合计：	11,539,279.24	13,707,925.16	负债与持有人权益总计：	11,539,279.24	13,707,925.16

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	654,874.08	654,874.08
1、利息收入	10,075.62	10,075.62
其中：存款利息收入	283.45	283.45
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	9792.17	9792.17
其他利息收入		
2、投资收益（损失以“-”填列）	244,844.22	244,844.22
其中：股票投资收益	174,277.56	174,277.56
基金投资收入	451.84	451.84
债券投资收益		
资产支持证券投资收益		
衍生工具收益	39,438.59	39,438.59
股利收益	30,676.23	30,676.23
金融商品转让税		
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	405328.7	405328.7
4、汇兑收益（损失以“-”号填列）		
5、其他收入（损失以“-”填列）	-5374.46	-5374.46
二、费用	33,416.90	33,416.90
1、管理人报酬	1,777.49	1,777.49
2、托管费		
3、投资顾问费		
4、交易费用	14730.51	14730.51
5、销售服务费		
6、利息支出		
7、其他费用	16908.9	16908.9
8、税金及附加		
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	621457.18	621457.18
减：所得税费用		
四、净利润总额（净亏损以“-”号填列）	621457.18	621457.18

林 达

黄皓



(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	2,956,088.30	25.62%
存出保证金	246,100.58	2.13%
股票投资	3,760,757.94	32.60%
债券投资		
基金投资	3,376,275.74	29.25%
资产支持证券投资		
买入返售金融资产	1,200,012.00	10.40%
其他资产	44.68	0.00%
资产合计	11,539,279.24	100.00%

(三)、收益分配情况

本报告期内，该资管计划无收益分配情况

六、集合计划份额变动情况

期间：2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 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）
14,502,800.28	0.00	3,000,000.00	11,502,800.28

七、备查文件目录

- (一)、《兴诚-元葵长青 17 号资产管理计划资产管理合同》
- (二)、《兴诚-元葵长青 17 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



林达

黄皓

