**兴诚-泽灵1号资产管理计划**

**2018年年度资产管理报告**

**（2018年1月11日-2018年12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上海分行**

**报告送出日期：2019年4月11日**

**兴诚-泽灵1号资产管理计划**

**2018年年度资产管理报告**

**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。

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《兴诚-元葵长青17号资产管理计划合同》的规定。基金经理对投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

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2018年1月11日起至2018年12月31日止。

1. **资产管理计划概况**

产品名称：兴诚-泽灵1号资产管理计划

简称：兴诚-泽灵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

沪深交易所发行、上市的股票、沪港通中港股通标的范围内的股票、深港通中港股通标的范围内的股票、优先股、证券公司收益凭证；

2、债券逆回购、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款和其他银行存款）；

3、股指期货、商品期货、国债期货、证券交易所上市的股票期权、上海期货交易所上市的商品期权、郑州及大连商品交易所上市的商品期权；

4、融资融券、符合SAC协议范围的场外期权和收益互换等结构；

5、公募基金、信托计划(含集合资金信托计划)、证券公司及其子公司集合资产管理计划、保险公司及其子公司集合资产管理计划、期货公司及其子公司集合资产管理计划、基金公司及其子公司“一对多”特定客户资产管理计划、基金业协会官方网站公示已登记的私募证券投资基金管理人发行的私募基金。

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%。

委托人签署本资产管理合同即表明同意股指期货可以进行交割，本资产管理计划可以投资于管理人或与管理人有关联关系的公司发行的证券或其他金融产品。投资于融资融券、商品期权等金融衍生品，管理人在于托管人协商一致并确认系统可以支持相关业务后方可投资。

托管人对于场外期权和收益互换是否符合SAC协议范围、私募基金管理人相关事项不予监控。

合同生效日、成立日期：2018年1月11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上海分行

1. **产品特有风险**

本基金的集中度风险主要体现在产品主要投资于私募基金产品，该产品受子层产品净值波动性大，且若发生大额赎回时，资产变现时效较弱，会影响委托人对于赎回资产的时效性。

**四、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：2018年1月11日-2018年12月31日 币 种：人民币

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | 主要财务指标 |  |
| 1 | 本期利润 | 3,232,851.16 |
| 2 | 期末资产管理计划净值 | 38,242,001.21 |
| 3 | 期末单位资产管理计划净值 | 1.0629 |
| 4 | 期末累计单位资产管理计划净值 | 1.0629 |

（二）、资产管理计划净值表现

截止2018年12月31日，本计划单位净值为1.0629，累计单位净值1.0629。2018年10月1日至2018年12月31日，本计划单位净值涨幅为6.29%。

（三）、报告期内资产净值预警说明

截止2018年12月31日，本报告期内，未触发净值预警

**五、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。

2018年年度，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2018年12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。

**六、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：2018年12月31日 | |  |
| 资 产 | 期末余额 | 负债和所有者权益 | 期末余额 |
| **资 产 :** |  | **负债:** |  |
| 银行存款 | 408,642.98 | 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 | 37,847,292.43 | 卖出回购金融资产款 |  |
| 其中：股票投资 |  | 应付证券清算款 |  |
| 债券投资 |  | 应付赎回款 |  |
| 基金投资 | 37,847,292.43 | 应付管理人报酬 | 6,010.27 |
| 资产支持证券投资 |  | 应付托管费 | 8,013.80 |
| 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 | 89.87 | 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** | 14,024.07 |
| 其他投资 |  | **所有者权益：** |  |
|  |  | 实收基金 | 35,978,941.38 |
|  |  | 未分配利润 | 2,263,059.83 |
|  |  | **所有者权益合计** | 38,242,001.21 |
| **资产合计:** | 38,256,025.28 | **负债与持有人权益总计：** | 38,256,025.28 |

1. 资产管理计划费用表

期间：2018年1月11日-2018年12月31日 币 种：人民币

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 本年累计 | |
| **一、收入** | | 3,311,262.96 | |
| 1、利息收入 | | 10,766.74 | |
| 其中：存款利息收入 | | 10,766.74 | |
| 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） | | -67,852.46 | |
| 其中：股票投资收益 | |  | |
| 基金投资收益 | | -127,615.85 | |
| 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 | | 59,763.39 | |
| 3、公允价值变动损益（损失以"-"填列） | | 3,368,348.68 | |
| 4、汇兑收益（损失以"－"号填列） | |  | |
| 5、其他收入（损失以"-"填列） | |  | |
| **二、费用** | | 78,411.80 | |
| 1、管理人报酬 | | 24,131.51 | |
| 2、托管费 | | 32,175.29 | |
| 3、投资顾问费 | |  | |
| 4、交易费用 | | 21,450.00 | |
| 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 | | 655.00 | |
| **三、 利润总额（亏损总额以"-"号填列）** | | 3,232,851.16 | |
| 减：所得税费用 | |  | |
| **四、 净利润总额（净亏损以"-"号填列）** | | 3,232,851.16 | |
|  |  | |

**（二）、资产管理计划投资组合报告**

日期：2018年12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 | 408,642.98 | 1.07% |
| 存出保证金 |  |  |
| 股票投资 |  |  |
| 债券投资 |  |  |
| 基金投资 | 37,847,292.43 | 98.93% |
| 资产支持证券投资 |  |  |
| 买入返售金融资产 |  |  |
| 其他资产 | 89.87 | 0.00% |
| 资产合计 | 38,256,025.28 | 100.00% |

（三）、收益分配情况

本报告期内，本产品无收益分配情况

**七、集合计划份额变动情况**

期间：2018年1月11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） |
| 0.00 | 54,978,957.82 | 19,000,016.44 | 35,978,941.38 |

**八、备查文件目录**

（一）、《兴诚-泽灵1号资产管理计划资产管理合同》

（二）、《兴诚-泽灵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。

**九、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](mailto: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

**兴证期货有限公司**

**2019年4月11日**