

兴鑫-前海开源锐盈管理期货 1 号资产管理计划

清算报告

根据管理人兴证期货有限公司、托管人招商证券股份有限公司及委托人签署的《兴鑫-前海开源锐盈管理期货 1 号资产管理计划资产管理合同》和管理人提交的《关于兴鑫-前海开源锐盈管理期货 1 号资产管理计划清盘公告》，该基金因赎回触发清算，管理人终止该基金，终止日期为 2018 年 12 月 05 日。

现对该基金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《兴鑫-前海开源锐盈管理期货 1 号资产管理计划资产管理合同》的约定，本基金的初始委托资产本金为人民币 12,000,000.00 元，委托资产运作起始日为 2017 年 09 月 19 日，合同终止日为 2018 年 12 月 05 日。清算日为 2018 年 12 月 05 日。

二、项目运作期间损益情况：

时间：2017 年 09 月 19 日 至 2018 年 12 月 05 日

单位：元

项目	期间累计数
一、收入	-87,894.27
1、利息收入	5,504.83
其中：存款利息收入	5,504.83
2、投资收益（损失以“-”填列）	-132,839.54
其中：衍生工具收益	-170,575.00
基金红利收益	37,735.46
3、其他收入	39,440.44
二、费用	181,372.84
1、管理人费	68,557.31
2、托管费	8,569.64
3、投资顾问费	68,557.31
4、交易费用	35,688.58
三、利润总额	-269,267.11



三、 项目清算资产负债情况：

时间： 2018 年 12 月 05 日

单位： 元

项目	期末余额
资产：	
银行存款	17,197.26
期货清算备付金	3,837,687.59
应收利息	79.52
资产合计	3,854,964.37
负债：	
应付管理费	5,693.44
应付托管费	711.70
应付投资顾问费	5,693.44
负债合计	12,098.58
所有者权益：	
实收基金	4,000,131.67
未分配利润	-157,265.88
所有者权益合计	3,842,865.79
负债和所有者权益合计：	3,854,964.37

四、 其他说明：

- 1、 本报告涉及数据为产品成立日至产品终止日的数据。
- 2、 本产品尚未支付的费用为 12,098.58 元，其中应付管理人报酬人民币 5,693.44 元(需垫付应收利息 79.52 元，故清盘划付管理费 5,613.92 元)，应付托管费人民币 711.70 元，应付投资顾问费人民币 5,693.44 元，清算期内不再计提管理费、托管费、投资顾问费等。
- 3、 委托人应得清算资金中的应收利息 79.52 元，由管理人以管理费垫付，该应收利息于托管账户销户结息时划付管理人。托管账户利息金额以银行实际派息为准，实际派息金额与应收利息的尾差由管理人承担。
- 4、 综上所述，截止 2018 年 12 月 05 日，清算可划付给委托人的总额为人民币 3,842,865.79 元。

管理人（签章）：兴证期货有限公司



托管人（签章）：招商证券股份有限公司



日期：2018 年 12 月 6 日



731