

兴诚-信朴套利1号资产管理计划

2019年年度报告

基金管理人：兴证期货有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020年4月7日

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

项目	信息
基金名称	兴诚-信朴套利1号资产管理计划
基金编码	SY8046
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2017-12-22
基金管理人	兴证期货有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
投资顾问（如有）	-
报告期末基金份额总额	18,920,726.16份
基金到期日期	2022-12-21

2、主要财务指标和基金净值表现

2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

期间数据和指标	2019年01月01日-2019年12月31日
本期已实现收益	2,606,488.71
本期利润	2,468,928.60
期末数据和指标	2019年末
期末可供分配利润	2,610,405.09
期末可供分配基金份额利润	0.1380
期末基金资产净值	21,934,103.00
期末基金份额净值	1.1593
累计期末指标	2019年末
基金份额累计净值增长率	15.93%

2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)
当年	6.34	-	-	-

自基金合同生效起至今	15.93	-	-	-
------------	-------	---	---	---

注：净值增长率=(期末累计净值-期初累计净值)/期初累计净值

当年净值增长率=(本年度末累计净值-上年度末累计净值)/上年度末累计净值

3、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	34,910,939.40
报告期期间基金总申购份额	10,631,330.04
减：报告期期间基金总赎回份额	26,621,543.28
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	18,920,726.16

4、年度财务会计报告

4.1 资产负债表

单位：元

资 产	2019年12月31日
资 产：	-
银行存款	235,432.01
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-

应收证券清算款	-
应收利息	51.81
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	21,706,087.50
资产总计	21,941,571.32
负债和所有者权益	
负 债:	-
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	5,271.71
应付托管费	2,196.61
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	-
负债合计	7,468.32
所有者权益:	-
实收基金	18,920,726.16
未分配利润	3,013,376.84
所有者权益合计	21,934,103.00
负债和所有者权益总计	21,941,571.32

4.2 利润表

单位：元

项 目	2019-01-01 至 2019-12-31
一、收入	2,501,806.63
1. 利息收入	4,260.81
其中：存款利息收入	4,260.81
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	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-137,560.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,635,105.93
减：二、费用	32,878.03
1. 管理人报酬	23,033.28
其中：固定管理费	23,033.28
业绩报酬	-
2. 托管费	9,597.17
3. 销售服务费	-
4. 外包服务费	-
5. 交易费用	-
6. 利息支出	-

其中：卖出回购金融资产支出	-
7. 其他费用	247.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,468,928.60
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,468,928.60

4.3 所有者权益变动表

单位：元

项 目	2019-01-01 至 2019-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	34,910,939.40	3,150,454.70	38,061,394.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,468,928.60	2,468,928.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-15,990,213.24	-2,606,006.46	-18,596,219.70
其中：1. 基金申购款	10,631,330.04	968,669.96	11,600,000.00
2. 基金赎回款	-26,621,543.28	-3,574,676.42	-30,196,219.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	18,920,726.16	3,013,376.84	21,934,103.00

5、期末投资组合情况

5.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	235,432.01	1.07
8	其他各项资产	21,706,139.31	98.93
	合计	21,941,571.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末含行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别	公允价值	占基金资产净值的比例（%）
港股通	-	-
合计	-	-

6. 管理人报告

投资经理简历：廉正先生，工学学士、产业经济学硕士，现任兴证期货资产管理部总经理兼投资经理。2011 年从业以来先后从事宏观及商品研究、基于基本面的投资管理、量化策略开发与投资等，擅长大类资产配置与宏观对冲。曾获得《中国金属通报》2012 年度有色金属期货“十佳分析师”称号；《期货日报》、《证券时报》主办的“第七届中国最佳期货经营机构暨最佳分析师评选”中荣获“最佳有色金属期货分析师”第二名；上海期货交易所优秀分析师评选中获“2013 年度铜期货优秀分析师奖”。

施海先生，1983 年毕业于上海交通大学，期货从业资格证书：F0273014，投资咨询从业证书号：Z0011937。2011 年加入兴证期货有限公司，从事研究员工作，2019 年 2 月担任资产管理部投资经理。施海先生从事期货研究 25 年，主要从事天然橡胶期货研究，多次被上海期货交易所评为天然橡胶优秀分析师，并担任天然橡胶讲师。

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%

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 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。

7. 备查文件目录

(1) 《兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划资产管理合同》

(2) 《兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划成立公告》

(3) 管理人业务资格批件、营业执照。

8. 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

