

# 兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划

## 清算报告

管理人：兴证期货有限公司

托管人：招商银行股份有限公司广州分行



兴证期货

# 一、资产管理计划终止日资产负债表

单位：人民币元

| 资产       | 2020 年 5 月 27 日 | 负债和所有者权益    | 2020 年 5 月 27 日 |
|----------|-----------------|-------------|-----------------|
| 资产：      |                 | 负债：         |                 |
| 银行存款     | 2,391,425.10    | 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  | -               | 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       | -               |
| 资产管理计划投资 | 19,439.21       | 应付赎回费       | -               |
| 资产支持证券投资 | -               | 应付管理人报酬     | 1,707.39        |
| 衍生金融资产   | -               | 应付托管费       | 711.39          |
| 买入返售金融资产 | -               | 应付运营服务费     | -               |
| 应收证券清算款  | -               | 应付销售服务费     | -               |
| 应收利息     | 254.82          | 应付交易费用      | -               |
| 应收股利     | -               | 应付税费        | -               |
| 应收申购款    | -               | 应付利息        | -               |
| 其他资产     | -               | 应付投资顾问费     | -               |
|          |                 | 其他负债        | -               |
|          |                 | 负债合计        | 2,418.78        |
|          |                 | 所有者权益：      |                 |
|          |                 | 实收资产管理计划    | 2,499,550.24    |
|          |                 | 未分配利润       | -90,849.89      |
|          |                 | 所有者权益合计     | 2,408,700.35    |
| 资产总计：    | 2,411,119.13    | 负债与持有人权益总计： | 2,411,119.13    |

## 二、清算事项说明

### 一)、资产管理计划简介

#### 1、基本情况

|              |                   |
|--------------|-------------------|
| 资产管理计划名称:    | 兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划 |
| 资产管理计划代码:    | SY8046            |
| 资产管理计划成立日:   | 2017 年 12 月 22 日  |
| 资产管理计划管理人名称: | 兴证期货有限公司          |
| 资产管理计划托管人名称: | 招商银行股份有限公司        |

#### 2、清算原因

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资资产管理计划监督管理暂行办法》、《兴诚-信朴套利 1 号资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本资产管理计划出现合同终止事由。

#### 3、资产管理计划终止日及剩余财产清算

因本资产管理计划 2020 年 5 月 27 日开放日委托人提出赎回申请，赎回后该产品委托人少于 2 人，触发合同提前终止条款。管理人按照合同约定，决定 2020 年 5 月 27 日为本资产管理计划的终止日。本资产管理计划的清算期间为自 2020 年 5 月 27 日起至本资产管理计划剩余财产完全清算止。剩余财产的清算计划见“三)、资产管理计划终止日后剩余财产清算”。

### 二)、清算报表编制基础

本资产管理计划的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本资产管理计划终止日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

### 三)、资产管理计划终止日的剩余财产清算

#### 1、资产处置情况

- 1) 截至资产管理计划终止日, 银行存款为 2,391,425.10 元。
- 2) 截至资产管理计划终止日, 应收利息为 254.82 元。
- 3) 截至资产管理计划终止日, 交易性金融资产为 19,439.21 元, 明细如下:

| 标的名称      | 基金代码   | 份额数量(份)   | 估值方法        | 估值净值     |
|-----------|--------|-----------|-------------|----------|
| 信朴17号私募基金 | SCA612 | 20,249.18 | 按照终止日单位净值估值 | 0.9600 元 |

上述标的受到股票停牌无法变现的因素限制, 在基金首次清算时无法全部变现, 故在基金首次清算时, 上述标的将根据信朴17号私募基金2020年5月21日终止日的单位净值估值, 实际变现金额将根据最终变现价格重新确认, 本基金最终单位净值将以上述标的全部变现后的实际金额对目前净值调整后为准。

综上, 资产管理计划终止日合计资产为 2,411,119.13 元。

#### 2、负债清偿情况

- 1) 截至资产管理计划终止日, 应付管理费为 1,707.39 元。
- 2) 截至资产管理计划终止日, 应付托管费为 711.39 元。

综上, 资产管理计划终止日合计负债为 2,418.78 元。

### 四)、资产管理计划终止日后剩余财产清算

根据本资产管理计划合同约定, 依据资产管理计划财产清算的分配方案, 将资产管理计划财产清算后的全部剩余资产扣除资产管理计划清算费用及各项负债后, 按资产管理计划的委托人持有的计划份额比例分别进行分配。计划财产按下列顺序清偿:

- (1) 支付资产管理合同终止时尚未支付完成的管理费、业绩报酬、违约金、托管费及其他相关费用;
- (2) 交纳所欠税款(委托人必须自行缴纳的税收);
- (3) 清偿委托资产债务;
- (4) 返还委托人。

如果资产管理合同终止时, 本资产管理计划账户有流通受限的证券, 管理人和托管人在完成前款(1)、(2)、(3)后, 可将账户中的现金类资产返还给委托人。

在流通受限的证券恢复交易后的十个工作日内，管理人须将证券变现。待所有证券全部变现后，管理人按委托人持有的计划份额比例再次进行分配并履行相应的告知义务。

故本资产管理计划首次清算分配的可供分配现金金额如下：

|          |              |
|----------|--------------|
| 银行存款     | 2,391,425.10 |
| 减：管理费    | -1,707.39    |
| 托管费      | -711.39      |
| 可供分配现金金额 | 2,389,006.32 |

#### 五)、资产管理计划终止日后资产管理计划剩余财产清算（续）

- 1、本次清算分配不含托管户、募集户银行存款应收利息，纳入后续清算处理。
- 2、本基金存在未变现底层标的资产，还需进行后续清算，后续清算情况以后续清算报告为准。

管理人：兴证期货有限公司  
2020年5月28日

托管人：招商银行股份有限公司广州分行  
2020年5月28日

