

兴诚-宁泉致远 3 号资产管理计划  
2019 年第三季度资产管理报告  
(2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日)

资产管理人：兴证期货有限公司

资产托管人：兴业银行股份有限公司上海分行

报告送出日期：2019 年 10 月 10 日

## 兴诚-宁泉致远 3 号资产管理计划

### 2019 年第三季度资产管理报告

#### 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 4 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

#### 二、资产管理计划概况

产品名称：兴诚-宁泉致远 3 号资产管理计划

简称：兴诚-宁泉 3 号

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：

(1) 上海宁泉资产管理有限公司作为管理人发行的私募证券投资基金；

(2) 现金、银行存款、货币市场基金、债券逆回购。

#### 2、资产配置比例（占资产总值的比例）

本资产管理计划投资于上海宁泉资产管理有限公司作为管理人发行的私募证券投资基金占本计划资产总值的比例范围为 0%-100%，上海宁泉资产管理有限公司作为管理人发行的私募证券投资基金为混合类产品（即债权类资产、权益类资产、商品及金融衍生品类资产且任一资产的投资比例未达到固定收益类、权益类、商品及金融衍生品这三类产品标准），上述标的私募基金投资比例由管理人进行监督实施，托管人不承担监督责任。

本资产管理计划投资于现金、银行存款、货币市场基金、债券逆回购的合计比例占本计划资产总值的比例范围为 0%-80%。

总资产占净资产的比例不得超过 200%；

合同生效日、成立日期：2018 年 6 月 6 日

成立规模：200 万元

存续期：无固定期限

管理人：兴证期货有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司上海分行

### 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 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日

币 种：人民币

|   | 主要财务指标       |              |
|---|--------------|--------------|
| 1 | 本期利润         | 4812683.17   |
| 2 | 期末资产管理计划净值   | 158032181.44 |
| 3 | 期末单位资产管理计划净值 | 1.2646       |

|   |                |        |
|---|----------------|--------|
| 4 | 期末累计单位资产管理计划净值 | 1.2646 |
|---|----------------|--------|

#### 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 年第三季度，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 9 月 30 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 market 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 9 月 30 日

币种：人民币

| 资 产      | 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     |     | 6,600,639.59   | 2,103,227.71   | 短期借款        |                |                |
| 结算备付金    |     | 0.00           |                | 交易性金融负债     |                |                |
| 存出保证金    |     | 0.00           |                | 衍生金融负债      |                |                |
| 交易性金融资产  |     | 10,422,021.20  | 14,203,716.49  | 卖出回购金融资产款   |                |                |
| 其中：股票投资  |     | 0.00           |                | 应付证券清算款     |                |                |
| 债券投资     |     | 0.00           |                | 应付赎回款       | 3,662,281.97   |                |
| 基金投资     |     | 10,422,021.20  | 14,203,716.49  | 应付管理人报酬     | 0.00           | 37,999.21      |
| 资产支持证券投资 |     | 0.00           |                | 应付托管费       | 177,486.74     | 37,999.21      |
| 衍生金融资产   |     | 0.00           |                | 应付投资顾问费     | 40,234.61      |                |
| 买入返售金融资产 |     | 0.00           |                | 应付交易费用      |                |                |
| 应收证券清算款  |     | 3,788,760.00   |                | 应付销售服务费     | 575,776.27     | 265,994.51     |
| 应收利息     |     | 420.10         | 231.33         | 应付税费        | 0.00           |                |
| 应收股利     |     | 2,898.51       | 31,680.08      | 应付利息        | 0.00           |                |
| 应收申购款    |     |                |                | 应付利润        | 0.00           |                |
| 应收信托红利   |     | 0.00           |                | 其他负债        | 0.00           |                |
| 其他资产     |     | 141,673,221.63 |                | 负债合计        | 4,455,779.59   | 341,992.93     |
| 其他投资     |     |                | 154,144,712.52 | 所有者权益：      |                |                |
|          |     |                |                | 实收基金        | 124,968,881.56 | 136,969,066.45 |
|          |     |                |                | 未分配利润       | 33,063,299.88  | 33,172,508.75  |
|          |     |                |                | 所有者权益合计     | 158,032,181.44 | 170,141,575.20 |
| 资产合计：    |     | 162,487,961.03 | 170,483,568.13 | 负债与持有人权益总计： | 162,487,961.03 | 170,483,568.13 |

## 2、资产管理计划费用表

期间：2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日

币 种：人民币

| 项目                         | 本期金额                | 本年累计                 |
|----------------------------|---------------------|----------------------|
| <b>一、收入</b>                | <b>5,325,034.32</b> | <b>38,492,765.66</b> |
| 1、利息收入                     | 2,681.09            | 7,194.59             |
| 其中：存款利息收入                  | 2,681.09            | 7,194.59             |
| 债券利息收入                     | 0.00                | 0.00                 |
| 资产支持证券利息收入                 | 0.00                | 0.00                 |
| 买入返售金融资产收入                 | 0.00                | 0.00                 |
| 其他利息收入                     |                     |                      |
| 2、投资收益（损失以“-”填列）           | 1,034,191.35        | 3,116,940.61         |
| 其中：股票投资收益                  | 0.00                | 0.00                 |
| 基金投资收入                     | 940,094.80          | 2,820,533.15         |
| 债券投资收益                     | 0.00                | 0.00                 |
| 资产支持证券投资收益                 | 0.00                | 0.00                 |
| 衍生工具收益                     | 0.00                | 0.00                 |
| 股利收益                       | 94,096.55           | 296,407.46           |
| 3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）       | 4,174,895.43        | 34,930,391.20        |
| 4、汇兑收益（损失以“-”号填列）          |                     |                      |
| 5、其他收入（损失以“-”填列）           | 113,266.45          | 438,239.26           |
| <b>二、费用</b>                | <b>512,351.15</b>   | <b>1,232,516.82</b>  |
| 1、管理人报酬                    | 40,234.61           | 120,253.02           |
| 2、托管费                      | 40,234.61           | 120,253.02           |
| 3、投资顾问费                    |                     |                      |
| 4、交易费用                     | 0.00                | 0.00                 |
| 5、销售服务费                    | 281,641.93          | 841,770.78           |
| 6、利息支出                     | 0.00                | 0.00                 |
| 7、其他费用                     | 150,240.00          | 150,240.00           |
| 8、税金及附加                    | 0.00                | 0.00                 |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>4,812,683.17</b> | <b>37,260,248.84</b> |
| 减：所得税费用                    |                     |                      |
| <b>四、净利润总额（净亏损以“-”号填列）</b> | <b>4,812,683.17</b> | <b>37,260,248.84</b> |

## (二)、资产管理计划投资组合报告

日期：2019 年 6 月 30 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 | 6,600,639.59   | 1.23%   |
| 存出保证金    |                |         |
| 股票投资     |                |         |
| 债券投资     |                |         |
| 基金投资     | 10,422,021.20  | 8.33%   |
| 资产支持证券投资 |                |         |
| 买入返售金融资产 |                |         |
| 其他资产     | 141,673,221.63 | 90.44%  |
| 资产合计     | 162,487,961.03 | 100.00% |

### （三）、收益分配情况

本报告期内，本计划无收益分配情况

## 六、备查文件目录

- （一）、《兴诚-宁泉致远 3 号资产管理计划资产管理合同》
- （二）、《兴诚-宁泉致远 3 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。

## 七、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



