

中电投先融水城 4 号资产管理计划 资产管理报告 (第一次)

(本报告期：【2018】年【1】月【12】日至【2018】年【3】月【31】日)

一、 资管计划概要

- 1、资管计划起息日：【2018】年【1】月【12】日
- 2、存续资管计划规模：【3750】万份资管计划份额
- 3、计划期限：【24】个月。
- 4、业绩比较基准：8.5%/年

本资管计划投资范围是认购【光大-水城经开集合资金信托计划】，在收到【光大-水城经开集合资金信托计划】分配的信托收益后且支付本合同第四十四条中约定的资产管理计划相关费用之后，业绩比较基准的参考值为 8.5%/年。资管计划不同份额的销售费用不同，认购份额 100 万份（含）-300 万份（不含）的销售费用比认购份额 300 万份（含）以上的销售费用高 0.2%/年，故不同份额的投资者收到的收益将根据投资份额的不同在实际获得的收益中扣减相应的销售费用差额。投资者根据本资管计划收到的投资收益为信托投资分配收益中的一部分，非预期收益或保本收益，极端情况下，投资者可能会面临本金损失。

二、 资管计划管理

1、中电投先融（上海）资产管理有限公司（以下简称“管理人”或“中电投先融资管”）根据《中华人民共和国证券投资基金法》《期货公司资产管理业务试点办法》《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》《期货公司监督管理办法》《私募投资基金监督管理暂行办法》为本资管计划在资管计划资金托管银行单独开立了托管账户（即计划资金专户），建立了单独的会计账户进行管理和核算。

2、截至本信托季度末，本资管计划资金运用情况如下：

认购光大兴陇信托有限责任公司发起设立的【光大-水城经开集合资金信托计划】：

【2018】年【1】月【12】日，管理人认购光大兴陇信托有限责任公司（以下简称“光大信托”）发起设立的“光大-水城经开集合资金信托计划”【3750】万元，该信托计划于【2020】年【1】月【11】日到期。该信托计划拟以不超过 3 亿元向贵州水城经济开发区基础设施有限公司发放信托贷款，用于补充公司流动资金。

三、 资管计划的收支情况

本资管计划的投资收益来源于【光大-水城经开集合资金信托计划】的投资收益、银行存款利息收入、同业定期存款利息收入等，支出主要为管理人管理费、印刷费、验资费、咨询服务费及资管计划税金等。

1、在本报告期内，本资管计划共收到投资收益合计为【1,280,698.81】元，其中信托收益【1,278,567.96】元。

2、在本报告期内，本资管计划共支付利息、咨询服务费、验资费、托管费、管理人报酬等费用合计为【15,727.41】元。

3、在本报告期内，本资管计划共支付税金合计为【0】元。

四、 资管计划在本报告期内财产/投资收益分配情况

按期收回所有利息的前提下，资产管理人在资产管理合同生效后的每个核算日即委托人持有的计划份额自【光大-水城经开集合资金信托计划】投资运作日起的每个定期分配日（每年的6月15日和12月15日）及计划份额存续届满日且管理人获得投资标的收益分配后的十个工作日内，向资产委托人分配收益。

在本报告期内，本资管计划分配收益【0】元，包括活期利息【0】元。

五、 本报告中的内容由管理人负责解释。本报告以原件为准，受益人应认真阅读、检查、核对本报告的真实性、准确性、完整性，发现本报告存在差错、遗漏、不准确等情况时，应于送达之日起七日内书面通知中电投先融资管，否则视为受益人同意接受本报告中的披露信息并对受益人具约束力，中电投先融资管不接受与该披露信息真实性、准确性、完整性有关的任何索赔请求。中电投先融资管有权随时自行修正本报告及/或差错、遗漏、不准确的受益人信息。

咨询电话：400-820-8477

中电投先融（上海）资产管理有限公司
【2018】年【3】月【31】日