

中电投先融（上海）资产管理有限公司  
水城 5 号资产管理计划  
2018 年年度报告

管理人：中电投先融（上海）资产管理有限公司  
托管人：平安银行股份有限公司  
报告送出日期：2019 年 3 月 25 日

## 重要提示

管理人承诺秉承诚实信用、勤勉尽责的原则管理资产管理计划财产，但不保证资产管理计划一定盈利。

托管人平安银行股份有限公司根据相关规定于2019年1月23日出具了对应的托管报告。

本报告中财务资料未经审计。

本报告以原件为准，投资者应认真阅读、检查、核对本报告，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管理人，否则视为投资者同意接受本报告中的披露信息并对投资者具约束力。管理人不接受与本披露信息真实性、准确性、完整性有关的任何索赔请求。管理人有权随时自行修正本报告及/或差错、遗漏、不准确的投资者信息。本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告期自2018年2月9日起至12月31日止。



## 一、资产管理计划管理人概要

### （一）管理人简介

中电投先融（上海）资产管理有限公司于 2015 年 10 月成立于上海，是隶属于国家电力投资集团资本控股有限公司的专业化资产管理公司，注册资本金 3.5 亿元。

### （二）投资经理简介

投资经理蒋一舟毕业于同济大学国际经济与贸易专业。曾于厦门国际银行、宁波通商银行、温州银行担任信贷经理、信贷部副总经理，具有丰富的基础设施类项目操作经验，在各类项目的风险控制上具有成熟的操作经验。

## 二、管理人履职报告

### （一）公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格执行公平交易制度，公平对待管理的各资产管理计划，未发生违反公平交易制度的行为。

### （二）异常交易行为情况

本报告期内，本资产管理计划未发生异常交易行为。

### （三）本资产管理计划运作合规守信情况

本报告期内，管理人严格遵循《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他有关法律法规、监管部门的相关规定和资管合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理资产管理计划资产。

本报告期内，本资产管理计划整体运作合规合法，无不当内

幕交易和关联交易，未发生损害投资者利益的行为。

### 三、资产管理计划概况

#### （一）基本情况

资产管理计划名称	中电投先融水城5号资产管理计划
资产管理计划起息日	2018年2月9日
管理人	中电投先融（上海）资产管理有限公司
托管信息	平安银行股份有限公司 账户名称：中电投先融水城5号资产管理计划 银行账号：15052018010940 开户银行：平安银行上海分行卢湾支行
报告期末资产管理计划份额总额	11920万份
资产管理计划存续期	24个月
产品投向	中电投先融水城5号资产管理计划拟以不超过3亿元资金用于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”，用于向贵州水城经济开发区基础设施有限公司发放信托贷款。
业绩比较基准	100万（含）-300万（不含）：8.3%/年； 300万（含）以上：8.5%/年
管理费率	0.75%/年
产品类型	固定收益类
产品风险特征	本资产管理计划属于R2(中低风险)风险等级产品。 本资产管理计划不设杠杆，没有份额分级。

#### （二）投资非标准化债权类资产的基本情况

最终投向及交易结构	中电投先融水城5号资产管理计划拟以不超过3亿元资金用于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”，用于向贵州水城经济开发区基础设施有限公司发放信托贷款。
融资客户	贵州水城经济开发区基础设施有限公司
最后一期融资剩余期限	14个月

### （三）投资风险提示

本资管计划在运作过程中，可能面临各种风险，包括市场风险、管理风险、信用风险、不可抗力风险等；管理人对管理、运用和处分资产管理计划财产的盈亏不提供任何承诺；资产管理人根据资产管理合同的规定，管理本资管计划的财产而产生的盈亏由资产管理计划财产承担。

受到相关政策和区域融资环境的影响，本资管计划目前主要面临市场风险。

### 四、资产管理计划投资组合报告

序号	项目	金额 (元)	占资管计划总资产比例 (%)
1	权益投资		
	其中：股票		
2	基金投资		
3	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		
4	贵金属投资		
5	金融衍生品投资		
6	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	751,682.05	0.63

8	其他各项资产	119,200,000.00	99.37
9	合计	119,951,682.05	100

## 五、资产管理计划投资表现

主要指标	报告期
	(2018年2月9日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	751,682.05
2.资产管理计划累计单位净值	1.07
3.资产管理计划期末单位净值	1.01

注：单位：人民币元

## 六、资产管理计划的收益分配和费用情况

### （一）收益分配

在本报告期内，本资产管理计划共分配收益人民币【8,127,894.94】元。

### （二）费用情况

在本报告期内，本资产管理计划支出管理费人民币【1,755,240】元、业绩报酬人民币【0】元、交易费用人民币【0】元、税费人民币【0】元，其他费用人民币【1,380,989.16】元。

## 七、资产管理计划的重大事项说明

本报告期内，本资产管理计划无重大事项情况需要说明。

八、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第二十七条规定机构和人员（以下简称“相关人员”）资金投资本资管计划情况

（一）相关人员持有本资管计划份额情况

本资产管理计划不存在相关人员持有份额的情况。

（二）相关人员投资本资管计划交易明细

本报告期内，相关人员未进行本资产管理计划的申购、赎回或转让、受让等交易。

九、其他需要说明的情况

本报告期内，本资产管理计划无其他情况需要说明。

投资者对本报告如有疑问，可咨询管理人。管理人客户服务电话：400-820-8477。

中电投先融（上海）资产管理有限公司

2019年3月25日

