

中电投先融水城 5 号资产管理计划 资产管理报告 (第二次)

(本报告期：【2018】年【4】月【1】日至【2018】年【6】月【30】日)

一、资产管理计划基本情况

- (一)产品名称:中电投先融水城 5 号资产管理计划(以下简称“本资管计划”)
- (二)本资管计划存续份额:【11920】万份。
- (三)本资管计划存续期限:【24】个月。
- (四)本资管计划剩余期限:20 个月。
- (五)本资管计划不设杠杆,没有份额分级。

二、资产管理计划募集信息

(一)本资管计划设立时的募集资金总额为人民币 119200000 元,包括自然人投资的人民币 113200000 元,机构投资的人民币 6000000 元。本资管计划设立时投资者人数为 47 名,其中自然人投资者 46 名,机构投资者 1 名。

(二)中电投先融(上海)资产管理有限公司(以下简称“管理人”)自有资金投资本资管计划人民币 0 元;管理人关联方自有资金投资本资管计划人民币 0 元;管理人从业人员及其亲属投资本资管计划人民币 0 元。

三、托管信息

- (一)本资管计划托管行为平安银行股份有限公司。
- (二)投资账户信息如下:

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

四、投资情况



（一）本资管计划融资人：贵州水城经济开发区基础设施有限公司

（二）本资管计划的投向及交易结构具体如下：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”。该信托计划分期发行，每一期信托计划均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。

五、业绩比较基准

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。

六、本报告期内投资收益分配情况

在本报告期内，本资管计划共向资产委托人分配收益人民币【3,248,461.98】元。

七、主要投资风险

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。

八、资产管理计划的估值

（一）估值时间：管理人于每季度末对委托财产进行估值。

（二）估值方法：按成本法估值，本资管计划项下所有投资标的均以成本列示，实际收到收益时计入。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况按最能反映公允价值的价格估值。相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

（三）截止本报告期末，本资管计划单位净值为【1.0000】，累计单位净值为【1.0273】。

九、本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告以原件为准，资产委托人应认真阅读、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管理人，否则视为资产委托人同意接受本报告中的披露信息并对受益人具约束力，管理人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。管理人有权随时自行修正本报告及/或差错、遗漏、不准确的信息。

咨询电话：400-820-8477

中电投先融（上海）资产管理有限公司

2018年6月30日

