

福泽德胜 3 号资产管理计划

2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

资产管理人：福能期货股份有限公司

资产托管人：招商证券股份有限公司



§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。

资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本计划的资产管理合同。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
§ 2 资产管理计划简介.....	4
2.1 资产管理计划基本情况.....	5
2.2 资产管理计划说明.....	5
2.3 资产管理人和资产托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
§ 3 管理人报告.....	6
3.1 资产管理人及投资经理情况.....	6
3.2 管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明.....	7
3.3 管理人对报告期内公平交易情况的说明.....	7
3.4 管理人对报告期内风险控制情况的说明.....	8
3.5 管理人对报告期内利润分配情况的说明.....	8
§ 4 托管人报告.....	9
4.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	9
4.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	9
4.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	9
§ 5 主要财务指标、计划净值表现及利润分配情况.....	10
5.1 主要财务指标.....	10
5.2 计划净值表现.....	10
5.3 过去三年资产管理计划的利润分配情况.....	11
§ 6 年度财务报表.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 损益表.....	13
6.3 所有者权益（净值）变动表.....	15
§ 7 投资组合报告.....	16

7.1 计划资产组合情况.....	16
7.2 报告期末本计划投资的股票交易情况.....	17
7.3 报告期末本计划投资的期货交易情况.....	17
7.4 报告期末本计划投资的基金交易情况.....	17
7.5 报告期末本计划投资的债券交易情况.....	17
7.6 报告期末本计划投资的其他资产交易情况.....	17
§ 8 计划份额持有人信息.....	18
8.1 期末计划份额持有人个数及持有人结构.....	18
8.2 期末管理人的从业人员持有本计划的情况.....	18
§ 9 份额变动.....	19
§ 10 重大事件揭示.....	19
10.1 资产管理人的重大人事变动.....	19
10.2 涉及资产管理人、计划财产的诉讼.....	19
10.3 计划投资策略的改变.....	19
10.4 管理人及高级管理人员受到稽查或处罚等情况.....	19
10.5 其他重大事件.....	20
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	20
§ 12 备查文件目录.....	20
12.1 备查文件目录.....	20
12.2 存放地点.....	20
12.3 查阅方式.....	20

§ 2 资产管理计划简介

2.1 资产管理计划基本情况

计划名称	福泽德胜 3 号资产管理计划
计划简称	福泽德胜 3 号
产品编码	ST0160
计划运作方式	开放式，每年的 2 月 25 日，5 月 25 日，8 月 25 日及 11 月 25 日为固定开放日
计划合同生效日	2017 年 11 月 15 日
资产管理人	福能期货股份有限公司
资产托管人	招商证券股份有限公司
报告期末计划份额总额	21,891,183.91
计划合同存续期	无固定存续期限

2.2 资产管理计划说明

投资目标	在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
投资策略	本计划主要通过全市场多维度精选优秀私募基金、资管计划进行灵活配置，辅以期货策略及流动性管理等策略，在风险可控的前提下，追求长期稳定的盈利回报。
风险收益特征	本计划属于 R4 级（中高风险）投资品种。

2.3 资产管理人和资产托管人

项目	资产管理人	资产托管人
名称	福能期货股份有限公司	招商证券股份有限公司
注册资本	3 亿元人民币	66 亿元人民币

法定代表人	高海明	霍达
注册地址	福建省福州市华林路 93 号 燃料大厦 1 座 5、6 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址	福建省福州市华林路 93 号 燃料大厦 1 座 5、6 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
网站	http://www.fnqh.com.cn/	tgb@cmschina.com.cn
联系人	陈永胜	郭杰
联系电话	0591-87873559	0755-26951111
邮编	350003	518000

2.4 信息披露方式

登载资产管理计划年度报告正文的 管理人互联网网址	http://www.fnqh.com.cn/
资产管理计划年度报告备置地点	福建省福州市华林路 93 号燃料大厦 1 座 5、6 层

§ 3 管理人报告

3.1 资产管理人及投资经理情况

3.1.1 资产管理人

本计划管理人为福能期货股份有限公司，是经中国证监会批准、福建省工商行政管理局注册登记的期货专业经纪机构，成立于 1995 年 5 月 18 日，系福建省能源集团有限责任公司全资控股设立的一家专业性期货公司。统一社会信用代码：91350000796075664J。经营期货业务许可证号：31160000。为上海期货交易所（会员号：0022）、大连商品交易所（会员号：0192）、郑州商品交易所（会员号：0080）全权会员单位，中国金融期货交易所交易结算会员单位（会员号：

0157)，上海国际能源交易中心会员（会员号：8022）。总部设在福州，下设青岛营业部、漳州营业部、龙岩营业部、晋江营业部、厦门营业部、宁德营业部、莆田营业部、泉州营业部、永安营业部、南昌营业部、成都营业部、上海营业部、广州营业部、深圳营业部、南京营业部、武汉营业部。截止 2018 年 12 月 31 日，资产管理人共管理 3 只资产管理计划，分别为福泽德胜 2 号资产管理计划、福泽滚雪球 6 号资产管理计划、福泽德胜 3 号资产管理计划。

3.1.2 投资经理简介

肖平均，期货从业资格证号 F0270176，期货投资咨询从业资格号 Z0002651。为本计划、福泽滚雪球 6 号资产管理计划、福泽德胜 2 号资产管理计划的投资经理。自 2018 年 10 月 29 日任本计划投资经理，期货从业年限 9 年。

3.2 管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

报告期内，资产管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理规定》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》及其各项配套法规、《福泽德胜 3 号资产管理计划资产管理合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，在严格控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益。本计划运作管理符合有关法律法规和计划合同的规定和约定，无损害计划份额持有人利益的行为。

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的说明

管理人按照证监会《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、中期协《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严格禁止不同期货资产管理账户之间、期货资产管理账户与期货经纪业务客户账户之间、非期货类投资账户之间可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

报告期内，公司严格执行证监会《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、中期协《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》和公司内部异常交易监控和报告制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过人工监控等方式进行日常监控。

报告期内，公司对同一投资组合的同向交易、同一投资组合的反向交易、不同投资组合的同向交易以及不同投资组合的反向交易进行分析，未发现违反公平交易的异常行为。

3.4 管理人对报告期内风险控制情况的说明

管理人按照证监会《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、中期协《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设等多方面确保资产管理业务不出现重大风险事件。

报告期内，公司严格按照现行法律法规及公司内部规章制度，设置独立的风险控制岗位并配备相应的风控人员，根据审慎原则严格设计产品的风险控制方案，根据日常风险控制管理办法开展资产管理业务的日常风险跟踪监控，实时跟踪产品风险，实现产品事前事中风控。根据流动性风险控制管理办法控制产品流动性风险，禁止投资流动性小的投资标的，尽可能实现分散化投资。

报告期内，本计划整体风险均控制在合理范围内，未出现过重大风险事件。

3.5 管理人对报告期内利润分配情况的说明

报告期内本计划未实施利润分配。

§ 4 托管人报告

4.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，托管人——招商证券股份有限公司在对本计划的托管过程中，严格遵守有关法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

4.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

托管人按照资产管理合同的约定，对本计划报告期的资产净值进行了复核；同时依据法律法规和资产管理合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内，托管人未发现报告期内管理人违反资产管理合同约定的事项。报告期内，本计划的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况”部分。

4.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

基于计划管理人提供的必要的估值要素，托管人参照相关法律法规和资产管理合同的约定，对计划管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

§ 5 主要财务指标、计划净值表现

及利润分配情况

5.1 主要财务指标

单位：元

期间数据和指标	2018	2017
本期已实现收益	-730,024.39	-19,120.52
本期利润	-3,858,659.13	-310,758.01
期末数据和指标	2018	2017
期末可供分配利润	-3,549,861.29	-311,058.10
期末可供分配基金份额利润	-0.1622	-0.0122
期末基金资产净值	18,341,322.62	25,189,241.99
期末基金份额净值	0.8378	0.9878
累计期末指标	2018	2017
基金份额累计净值增长率	-16.22%	-1.22%

5.2 计划净值表现

5.2.1 份额净值增长率

基金净值表现

阶段	净值增长率
当年	-15.19
自基金合同生效起至今	-16.22

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

5.2.2 份额净值走势图

截止日：2018 年 12 月 31 日



5.3 过去三年资产管理计划的利润分配情况

截止 2018 年 12 月 31 日，未进行利润分配。

§ 6 年度财务报表

6.1 资产负债表

会计主体：福泽德胜 3 号资产管理计划

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：元

资产	本期末 2018-12-31	上年度末 2017-12-31
资产：		
银行存款	410,605.99	10,888.09
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	17,980,957.77	25,208,362.51
资产总计	18,391,563.76	25,219,250.60
负债和所有者权益	本期末 2018-12-31	上年度末 2017-12-31
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00

应付管理人报酬	47,596.88	28,429.21
应付托管费	1,322.13	789.70
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	1,322.13	789.70
负债合计	50,241.14	30,008.61
所有者权益：		
实收基金	21,891,183.91	25,500,300.09
未分配利润	-3,549,861.29	-311,058.10
所有者权益合计	18,341,322.62	25,189,241.99
负债和所有者权益总计	18,391,563.76	25,219,250.60

6.2 损益表

单位：元

项目	本期			上年度可比期间		
	2018/1/1	至	2018/12/31	2017/1/1	至	2017/12/31
一、收入	-3,635,470.53			-280,749.40		
1. 利息收入	14,770.21			10,888.09		
其中：存款利息收入	4,635.96			10,888.09		
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	10,134.25			0.00		
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-558,010.00			0.00		
其中：股票投资收益	0.00			0.00		
基金投资收	0.00			0.00		

益		
债券投资收		
益	0.00	0.00
资产支持证		
券投资收益	0.00	0.00
贵金属投资		
收益	0.00	0.00
衍生工具收		
益	0.00	0.00
股利收益	0.00	0.00
其他投资收		
益	-558,010.00	0.00
3. 公允价值变动收		
益	-3,128,634.74	-291,637.49
(损失以“-”填列)		
4. 汇兑收益(损失		
以“-”填列)	0.00	0.00
5. 其他收入(损失		
以“-”填列)	36,404.00	0.00
减：二、费用	223,188.60	30,008.61
1. 管理人报酬	211,441.96	28,429.21
其中：固定管理费	211,441.96	28,429.21
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	5,873.32	789.70
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	5,873.32	789.70
5. 交易费用	0.00	0.00
6. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金		
融资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	0.00	0.00
三、利润总额		
(亏损总额以“-”		
号填列)	-3,858,659.13	-310,758.01
减：所得税费用	0	-
四、净利润		
(净亏损以“-”号		
填列)	-3,858,659.13	-310,758.01

6.3 所有者权益（净值）变动表

会计主体：福泽德胜 3 号资产管理计划

单位：元

项目	本期		
	2018/1/1	至	2018/12/31
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	25,500,300.09	-311,058.10	25,189,241.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-3,858,659.13	-3,858,659.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,609,116.18	619,855.94	-2,989,260.24
其中：1. 基金申购款	2,391,183.91	-91,183.91	2,300,000.00
2. 基金赎回款	-6,000,300.09	711,039.85	-5,289,260.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	21,891,183.91	-3,549,861.29	18,341,322.62
项目	上年度可比期间		
	2017/1/1	至	2017/12/31
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	24,500,000.00	0.00	24,500,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-310,758.01	-310,758.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,000,300.09	-300.09	1,000,000.00
其中：1. 基金申购款	1,000,300.09	-300.09	1,000,000.00

2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	25,500,300.09	-311,058.10	25,189,241.99

§ 7 投资组合报告

7.1 计划资产组合情况

单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的
			比例（%）
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	410,605.99	2.23
8	其他各项资产	17,980,957.77	97.77
	合计	18,391,563.76	100.00

7.2 报告期末本计划投资的股票交易情况

报告期内，本计划未交易股票。

7.3 报告期末本计划投资的期货交易情况

报告期内，本计划未交易期货。

7.4 报告期末本计划投资的基金交易情况

报告期内，本计划未交易基金。

7.5 报告期末本计划投资的债券交易情况

报告期内，本计划未交易债券。

7.6 报告期末本计划投资的其他资产交易情况

报告期内，本计划持有德胜独角兽 6 号私募投资基金以及交行理财-金太阳 C 款(0191140081)。

德胜独角兽 6 号私募投资基金,管理人为共青城独角兽投资管理合伙企业(有限合伙),该私募基金投资范围本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券(包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券)、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金(不包括非货币类 ETF 基金一级市场申购、赎回)、期货、场内期权、权证、资产支持证券、收益互换及场外期权(仅限于证券公司及其子公司、期货公司及其子公司作为交易对手)、证券公司收益凭证、信托计划、证券公司(含证券公司子公司)资产管理计划、基金公司(含基金子公司)特定客户资产管理计划、期货公司(含期货子公司)资产管理计划、保险公司(含保险子公司)资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金、银行理财产品。本基金可以参与融资

融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。

截止 2018 年 12 月 31 日，持有基金份额 20,407,352.21 份，单位净值为 0.8321。交行理财-金太阳 C 款（0191140081）为交通银行发行的非保本浮动收益型理财产品。截止 2018 年 12 月 31 日，持有份额 1,000,000.00 份。

§ 8 计划份额持有人信息

8.1 期末计划份额持有人个数及持有人结构

份额单位：份

持有人个数(个)	持有人结构			
	机构投资者		个人投资者	
	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
16	3,000,000.00	13.70%	18,891,183.91	86.30%

8.2 期末管理人的从业人员持有本计划的情况

项目	持有份额总数（份）	占计划总份额比例
资产管理人所有从业人员持有本计划份额	-	-
其中：本公司高级管理人员、资管部门负责人持有本计划份额	-	-
其中：本计划投资经理持有本计划份额	-	-

§ 9 份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	25,500,300.09
报告期期间基金总申购份额	2,391,183.91
减：报告期期间基金总赎回份额	6,000,300.09
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	21,891,183.91

§ 10 重大事件揭示

10.1 资产管理人的重大人事变动

报告期内原投资经理郑恒敏（期货从业资格证号 F0306151）离职，聘任肖平均（期货从业资格证号 F0270176）为投资经理。

10.2 涉及资产管理人、计划财产的诉讼

报告期内无涉及本计划资产管理人、计划财产的诉讼。

10.3 计划投资策略的改变

报告期内本计划投资策略未发生改变。

10.4 管理人及高级管理人员受到稽查或处罚等情况

报告期内，本计划管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.5 其他重大事件

报告期内无其他需要揭示的重大事件。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内无其他需要揭示的影响投资者决策的重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 福泽德胜 3 号资产管理计划备案证明
- (2) 《福泽德胜 3 号资产管理计划资产管理合同》
- (3) 管理人业务资格批件，营业执照

12.2 存放地点

福建省福州市华林路 93 号福能期货股份有限公司。

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:00-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：管理人网址：<http://www.fnqh.com.cn/>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本计划管理人福能期货股份有限公司，咨询电话 0591-88013383，或发 E-mail: fnzgkf@fnqh.com.cn。

福能期货股份有限公司

2019 年 04 月 23 日

