

# 兴业基金-稳富 1 号单一客户资产管理计划

## 2019 年第一季度报告

2019 年 4 月 22 日

资产管理人：兴业基金管理有限公司

报告期间：2019 年 1 月 1 日—2019 年 3 月 31 日

## § 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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划的资产管理合同、风险揭示书等文件。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日—2019 年 3 月 31 日。

## § 2 产品概况

资产管理计划名称	兴业基金-稳富 1 号单一客户资产管理计划
资产管理合同生效日	2014 年 11 月 12 日
资产管理合同到期日	2027 年 05 月 26 日
资产管理人	兴业基金管理有限公司
资产托管人	中国银行股份有限公司上海分行
投资目标	本计划在本合同约定的投资范围内，为投资者寻求良好的投资回报与稳健的资产增值。
投资范围	本计划的投资范围为在交易所市场发行、交易的所有固定收益类金融工具，包括但不限于债券回购、同业存单、国债、金融债、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、公司债、企业债、次级债、资产支持证券、优先股、银行存款等。资产管理人和托管人就资金清算、数据传输、会计核算、估值方法、交易监督等方面的业务处理达成一致，并履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
投资策略	本计划结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，进行固定收益资产的投资。

业绩比较基准(如有)	-
风险收益特征(如有)	-
资产管理计划支付的管理费、托管费和业绩报酬(如有)等费用(包括计提基准、计提方式和支付方式)	<p>1、资产管理人的管理费 管理费按照 0.027% 年费率计算, 以前一日委托财产净值为基准进行计提。每日计提, 按季支付。</p> <p>2、资产托管人的托管费 托管费按前一日委托财产净值的 0.003% 年费率计提。托管费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.003\% / 365$ <p>H 为每日应计提的托管费 E 为前一日的委托财产净值</p> <p>3、业绩报酬 本计划不计提业绩报酬</p>

### § 3 主要财务指标和份额净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日—2019年3月31日)
1. 本期已实现收益	223,894,374.93
2. 本期利润	223,894,374.93
3. 期末资产净值	13,896,241,906.27
4. 期末份额净值	1.275366
5. 加权平均特定资产份额本期利润	0.0188

#### 3.2 份额净值表现: 份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③(如有)	业绩比较基准收益率标准差④(如有)	①-③(选填)	②-④(选填)
过去三个月	1.50%	0.02%	0.00%	0.00%	1.50%	0.02%

### 3.3 投资收益分配情况说明

报告期内未进行收益分配。

## § 4 季度（年度）财务报告

### 4.1 资产负债表

资产	资产期末余额	资产年初余额	负债与持有人权益	负债期末余额	负债年初余额
资产:			负债:		
银行存款	3,175,741.71	6,654,065.7	短期借款	-	-
结算备付金	-	-	交易性金融负债	-	-
存出保证金	180,945.57	53,987.48	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	12,760,509,416.84	16,086,946,218.81	卖出回购金融资产款	-	-
其中: 股票投资	-	-	应付证券清算款	-	-
基金投资	-	-	应付赎回款	-	-
债券投资	7,735,521,916.84	10,352,946,218.81	应付管理人报酬	1,001,493.56	1,248,231.67
资产支持证券投资	5,024,987,500.00	5,734,000,000.00	应付托管费	111,277.11	138,692.46
衍生金融资产	-	-	应付销售服务费	-	-
买入返售金融资产	-	-	应付交易费用	-	-
应收证券清算款	727,650,000.00	0	应交税费	1,578,221.34	1,867,134.21
应收利息	407,416,794.16	446,029,833.40	应付利息	-	-
应收股利	-	-	应付利润	-	-
应收申购款	-	-	其他负债	-	-
其他资产	-	-	负债合计	2,690,992.01	3,254,058.34
			所有者权益:		
			实收基金	10,895,887,112.16	13,160,191,234.55
			未分配利润	3,000,354,794.11	3,376,238,812.5
			所有者权益合计	13,896,241,906.27	16,536,430,047.05
资产总计	13,898,932,898.28	16,539,684,105.39	负债和所有者权益总计	13,898,932,898.28	16,539,684,105.39

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末产品资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占资管计划总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,760,509,416.84	91.81
	其中:债券	7,735,521,916.84	55.66
	资产支持证券	5,024,987,500.00	36.15
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	3,175,741.71	0.02
8	其他资产	1,135,247,739.73	8.17
9	合计	13,898,932,898.28	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本资产管理计划本报告期末未持有股票。

### 5.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占资管计划资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,555,918,121.08	32.79

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	3,179,603,795.76	22.88
10	合计	7,735,521,916.84	55.67

## § 6 资产管理人报告

### 6.1 投资经理简介

姓名	任本计划的投资经理期限		简介
	任职日期	离任日期	
雷蕾	2018/4/11	-	中国国籍，上海交通大学工学学士，复旦大学MBA，9年证券从业经历。曾先后供职于天安财产保险股份有限公司、泰信基金管理有限公司、第一创业证券股份有限公司，担任债券交易员、投资经理助理、投资经理等职。2016年8月加入兴业基金，现任固定收益专户投资经理。

### 6.2 管理人报告期内履职情况说明

报告期内，本产品管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、资产管理计划合同的约定，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，为委托人谋求最大利益。报告期内，本产品运作整体合法合规，未发现损害委托人利益的行为。

### 6.3 管理人报告期内投资表现评述及杠杆运用情况(若有)

2019年第一季度，组合正常运作，净值平稳。产品未采用杠杆操作。

### 6.4 未来市场展望及投资策略

展望2019年二季度，宏观经济面呈现边际改善的局面，风险偏好提升；但是中期经济下行压力不改，依然利于债市。预计债市短期波动加大，资金成本依

然可控，套息策略确定性强。后续将继续加强与委托人的沟通，确保产品在满足监管要求、资产管理合同约束下，正常、合规运作。

## 6.5 公平交易制度的执行情况及异常交易行为专项说明

### 6.5.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本产品管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

### 6.5.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本产品存在异常交易行为。

## 6.6 报告期内重大关联交易情况

报告期内未发现本产品存在重大关联交易行为。

## 6.7 影响投资者权益的其他重要信息

### 6.7.1 报告期内影响产品运作的风险事件说明

报告期内无影响产品运作的风险事件。

### 6.7.2 其他影响投资者权益的重要信息

无

## § 7 托管人报告

本报告期内，中国银行股份有限公司上海分行托管中心(以下称“本托管人”)在对兴业基金-稳富 1 号单一客户资产管理计划(以下称“本计划”)的托管过程中，严格遵守《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计划运作管理规定》和托管协议的规定，认真履行了应尽的义务，不存在损害计划份额持有人的行为。

兴业基金管理有限公司

2019 年 4 月 22 日