

# 兴业基金-兴富 43 号二期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。

自 2019 年 2 月 15 日起，本资管计划管理人由兴业财富资产管理有限公司变更为兴业基金管理有限公司，资产托管人由兴业银行股份有限公司变更为中国民生银行股份有限公司。

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-兴富 43 号二期单一客户资产管理计划
资产管理合同生效日	2016 年 3 月 23 日
资产管理合同到期日	2020 年 12 月 31 日
资产管理人	兴业基金管理有限公司
资产托管人	中国民生银行股份有限公司
投资目标	在保持计划资产的中低风险和高流动性的前提下，力争实现稳定的投资回报

投资范围	存量债券可投资于同业存单等货币市场工具、利率债、货币基金及债券基金、信用债、分级基金A份额；新增债券可投资于可新增利率债、银行所发行的债券、同业存单 投资组合比例：杠杆不超 160%；新增单只债券投资比例不得超过组合净值的 10%以及发行量的 20%；买入时信用债主体评级不低于 AA（含公开评级），若无主体评级，则债项评级不低于 AA（不含中债资信）。
投资策略	本计划将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。
业绩比较基准(如有)	—
风险收益特征（如有）	本计划具有中低风险收益特征。
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、管理费 本计划不收取管理费</p> <p>2、托管费 本计划的托管费按计划资产净值的 0.02% 年费率计提。托管费的计算方法如下：  <math display="block">H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}</math> H 为每日应计提的托管费  E 为前一日的计划资产净值  本计划的托管费按日计提，按自然季度支付。由资产管理人于核算日起五个工作日之内向资产托管人发送托管费划付指令，支付核算期内计提的托管费，由资产托管人复核后于 5 个工作日内从委托财产中一次性支付给资产托管人。</p> <p>3、业绩报酬 本计划无业绩报酬</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	4,124,651.74
2. 本期利润	976,268.95
3. 期末资产净值	238,996,607.57
4. 期末份额净值	1.0814
5. 加权平均特定资产份额本期利润	-0.0020

#### 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	-0.33%				-0.33%	

#### 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	5111251.05	0	短期借款	0	0
结算备付金	607136.79	0	交易性金融负债	0	0
存出保证金	17567.86	0	衍生金融负债	0	0
交易性金融资产	207670894.8	0	卖出回购金融资产款	52999765.5	0
其中：股票投资	0	0	应付证券清算款	0	0
基金投资	0	0	应付赎回款	0	0
债券投资	207670894.8	0	应付管理人报酬	0	0
资产支持证券投资	0	0	应付托管费	6179.19	0
衍生金融资产	0	0	应付销售服务费	0	0
买入返售金融资产	56810418.49	0	应付交易费用	4489.96	0
应收证券清算款	0	0	应交税费	48359.24	0
应收利息	3937358.42	0	应付利息	199075.53	0
应收股利	0	0	应付利润	0	0
应收申购款	0	0	其他负债	200	0
其他资产	18100049.58	0	负债合计	53258069.42	0
			所有者权益：		
			实收基金	221016166.54	0
			未分配利润	17980441.03	0
			所有者权益合计	238996607.57	0
资产总计	292254676.99	0	负债和所有者权益总计	292254676.99	0

## § 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	207,670,894.80	71.06
	其中：债券	207,670,894.80	71.06
	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	56,810,418.49	19.44
	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	5,718,387.84	1.96
8	其他资产	22,054,975.86	7.55
9	合计	292,254,676.99	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期内本计划未持有股票。

## 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	4,030,600.00	1.69
2	央行票据	—	—

3	金融债券	14,001,400.00	5.86
	其中：政策性金融债	14,001,400.00	5.86
4	企业债券	149,025,000.00	62.35
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	613,894.80	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	40,000,000.00	16.74
10	合计	207,670,894.80	86.89

## § 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	2019/2/15	-	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。产品采用杠杆操作，杠杆水平符合合同相关约定。

## 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。组合后续策略主要以资产处置为主，将根据市场及组合流动性的需求，择机择优进行处置。

## 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，本托管人中国民生银行股份有限公司在对本资产管理计划的托管过程中，严格遵守相关法律法规和托管人签署的本计划相关协议约定，依法安全保管本计划财产，不存在损害本计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人根据相关法律法规和托管人签署的本计划相关协议约定，对本计划资产管理人的投资运作进行了必要的监督，对本计划资产净值的计算、计划费用开支等方面进行了认真的复核。

本报告期内，本托管人根据相关法律法规和托管人签署的本计划相关协议约定，复核了本计划资产管理人所编制和披露的本资产管理计划报告中的财务指标、净值表现、计划资产的配置状况、价值变动情况等内容。

**兴业基金管理有限公司**

2019 年 4 月 22 日