兴业基金-嘉兴银行 1 号单一客户资产管理计划

2019 年第二季度报告

2019 年 7 月 19 日

资产管理人：兴业基金管理有限公司

报告期间：2019 年 4 月 1 日—2019 年 6 月 30 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 4 月 1 日—2019 年 6 月 30 日。

§2 产品概况

资产管理计划名称	兴业基金-嘉兴银行 1 号单一客户资产管理计划
资产管理合同生效日	2015 年 8 月 24 日
资产管理合同到期日	无固定期限
资产管理人	兴业基金管理有限公司
资产托管人	中信银行股份有限公司
投资目标	本计划在追求本金长期安全的基础上，力争为资产委托人创造较高的当期收益和绝对回报。
投资范围	本计划的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括债券回购、通知存款、银行定期存款和大额存单等货币市场工具、货币基金、国债、金融债、央行票据、地方政府债、债项 AA(含)及以上、主体 AA(含)以上的交易所债券或全国银行间债券市场、短期融资券、超短期融资券、中期票据、定向债务融资工具、公司债、企业债等。如法律法规或监管机构以后允许投资其他固定收益类品种，资产管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

	其中，同业存款、央票等货币市场工具投资比例为 0-90%；银行间逆回购投资比例为 0-100%；国债、金融债、信用评级不低于 A-1 级的短期融资券、信用评级不低于 AA 级的中期票据和企业债投资比例 0-100%；其他固定收益类产品投资比例为 0-100%。其他固定收益类产品需经过资产委托人书面同意后才能进行投资。银行间正回购余额占组合净资产的投资比例不超过 100%。所投债券主体评级为 AA 级（含）以上，投资单一债券规模不超过该债券发行规模的 20%，单一债券市值不超过计划资产净值的 10%。
投资策略	本计划的投资决策系管理人依据投资顾问发送的投资建议指令做出，在保持组合高度流动性的前提下，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，评价各投资品种的信用风险、流动性风险，审慎进行投资。
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 ）	1、资产管理人的管理费 管理费按 0.15%年费率计算，管理费具体计算方法如下： 委托财产每日应计提的管理费=前一日委托财产净值*0.15%/365。 管理费按日计提，逐日累计至季度末，按季支付。 2、资产托管人的托管费 托管费按前一日委托财产净值的 0.08 %年费率计提。托管费的计算方法如下： H＝E×0.08%/365 H 为每日应计提的托管费 E 为前一日的委托财产净值 3、业绩报酬 本计划不提取业绩报酬

§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 4 月 1 日—2019 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	64,814,371.45
2.本期利润	64,814,371.45
3.期末资产净值	2,850,608,890.49
4.期末份额净值	1.097
5.加权平均特定资产份额本期利润	0.0231

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	2.14%	0.05%	-	-	2.14%	0.05%

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	176,500,483.45	12,963,769.33	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.00	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	24,138.02	5,909,976.95	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	3,290,440,477.83	4,253,790,969.70	卖出回购金融资产款	730,632,744.04	1,313,015,630.46
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算款	0.00	0.00
基金投资	1,691,874.47	1,691,874.47	应付赎回款	0.00	0.00
债券投资	3,288,748,603.36	4,252,099,095.23	应付管理人报酬	1,140,107.79	1,177,140.73
资产支持证券投资	0.00	0.00	应付托管费	608,057.48	627,808.30
衍生金融资产	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	应付交易费用	19,074.45	23,564.93
应收证券清算款	0.00	0.00	应交税费	770,440.89	750,896.91
应收利息	121,974,560.74	105,145,302.13	应付利息	1,990,426.79	3,335,802.03
应收股利	64,168.35	43,165.50	应付利润	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	其他负债	3,234,086.46	5,767,933.97
其他资产	0.00	0.00	负债合计	738,394,937.90	1,324,698,777.33
			所有者权益：		
			实收基金	2,597,402,147.14	2,911,046,191.53
			未分配利润	253,206,743.35	142,108,214.75
			所有者权益合计	2,850,608,890.49	3,053,154,406.28
资产总计	3,589,003,828.39	4,377,853,183.61	负债和所有者权益总计	3,589,003,828.39	4,377,853,183.61

§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	1,691,874.47	0.05
3	固定收益投资	3,288,748,603.36	91.63
	其中：债券	3,288,748,603.36	91.63
	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	176,524,621.47	4.92
8	其他资产	122,038,729.09	3.40
9	合计	3,589,003,828.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金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	1,727,225,791.59	60.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	577,001,432.00	20.24
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	984,521,379.77	34.54
10	合计	3,288,748,603.36	115.37

§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	2018/11/1	-	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 年第二季度，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 年下半年，宏观经济面下行风险依然较大，利于债市，但是财政政策、刺激消费政策等逆周期调节政策也将持续出台，中美贸易摩擦不断反复，

市场的不确定性加大。后续将继续加强与委托人、投资顾问的沟通，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

中信银行已对兴业基金-嘉兴银行1号单一客户资产管理计划2019年第二季度报告中的主要财务指标、净值表现、财务报告及投资组合情况进行了核对，确认相关财务数据无误。

兴业基金管理有限公司

2019年7月19日