

# 兴业基金-私享纯债 2 号集合资产管理计划

## 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-私享纯债 2 号集合资产管理计划
资产管理合同生效日	2018 年 12 月 25 日
资产管理合同到期日	2028 年 12 月 24 日
资产管理人	兴业基金管理有限公司
资产托管人	招商银行股份有限公司
投资目标	追求在有效控制风险的前提下获得稳定的投资回报。
投资范围	本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求,主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具如存款、债券等债权类资产不低于本计划总资产的 80%, 投资范围包括: (1) 货币市场工具和存款工具: 包括但不限于现金、债券回购、银行存款、同业存单、货币基金等。 (2) 固定收益类品种: 包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债(含非公开发行公司债)、短期融资券、超短期融资券、中

	<p>期票据、非公开定向债务融资工具（PPN）、金融机构次级债、资产支持证券（含资产支持票据）优先级、可转换债券（含公开发行的可交换债券）等。</p> <p>（3）其他：法律、法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。</p>
投资策略	<p>通过宏观方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断，把握市场利率的运行态势，根据债券市场收益率曲线的形态变化进行久期选择。</p>
业绩比较基准(如有)	—
风险收益特征（如有）	<p>本计划具有中低风险收益特征。</p>
<p>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>	<p>1、资产管理人的固定管理费</p> <p>本计划的固定管理费按计划资产净值的 0.2% 年费率计提。固定管理费的计算方法如下：  <math display="block">H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}</math> H 为每日应计提的固定管理费  E 为前一日的计划资产净值</p> <p>本计划的固定管理费自资产管理计划合同生效日起，每日计提，按自然季度支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人于下月初五个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。</p> <p>2、资产托管人的托管费</p> <p>本计划的托管费按计划资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：  <math display="block">H = E \times 0.05\% \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</p> <p>本计划的托管费自资产管理计划合同生效日起，每日计提，按自然季度支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人于下月初五个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产托管人。</p>

	<p>3、业绩报酬</p> <p>(1) 业绩报酬的计提原则</p> <p>1) 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>2) 符合业绩报酬计提条件时，在资管计划成立满 1 年后的每年 6 月 21 日、收益分配日、委托人退出日和本计划终止日(统称“业绩报酬计提日”)计提业绩报酬，若 6 月 21 日为非工作日则向后顺延一个工作日。</p> <p>3) 委托人退出时，其份额对应的业绩报酬将在赎回款中扣除。</p> <p>(2) 业绩报酬的计算方法</p> <p>在每个业绩报酬计提日，若年化收益率(<math>r</math>)小于或等于业绩报酬计提基准(<math>R</math>)，则管理人提取业绩报酬；若年化收益率大于 <math>R</math>，则管理人提取超出部分的 15%作为管理人该投资运作期内的业绩报酬。</p> <p>本计划存续期间的业绩报酬计提基准(<math>R</math>)为：6%。</p> <p>业绩报酬由注册登记机构负责计算，无需托管人复核，由资产管理人每个业绩报酬计提日向资产托管人发送资产管理计划业绩报酬划付指令，资产托管人于管理人发出划付指令之日起 3 个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</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 4 月 1 日—2019 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	1, 182, 952. 33
2. 本期利润	868, 909. 71
3. 期末资产净值	134, 609, 526. 37

4. 期末份额净值	1.0135
5. 加权平均特定资产份额本期利润	0.0065

注：1、本期已实现收益指资管计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述资管计划业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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	0.66%	0.05%	-	-	-	-

注：无业绩比较收益率基准

### 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	788,630.77	11,000,141.67	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	21.01	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	154,003,390.00	0.00	卖出回购金融资产款	23,994,649.26	0.00
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	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
债券投资	154,003,390.00	0.00	应付管理人报酬	66,790.27	361.68
资产支持证券投资	0.00	0.00	应付托管费	16,697.58	90.42

资					
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	6,114.92	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	应交税费	21,313.95	0.00
应收利息	3,985,734.64	1,760.00	应付利息	57,724.67	0.00
应收股利	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	其他负债	4,959.40	0.00
其他资产	0.00	0.00	负债合计	24,168,250.05	452.10
			所有者权益：		
			实收基金	132,822,492.39	11,000,141.67
			未分配利润	1,787,033.98	1,307.90
			所有者权益合计	134,609,526.37	11,001,449.57
资产总计	158,777,776.42	11,001,901.67	负债和所有者权益总计	158,777,776.42	11,001,901.67

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，资产管理计划份额净值 1.0135 元，份额总额 132,822,492.39 份。

### § 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)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	154,003,390.00	96.99
	其中：债券	154,003,390.00	96.99
	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	788,630.77	0.50
8	其他资产	3,985,755.65	2.51
9	合计	158,777,776.42	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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)	占基金资产净值比例(%)
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	56,480,000.00	41.96
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	68,280,000.00	50.72
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	29,243,390.00	21.72
10	合计	154,003,390.00	114.41

注：其他为私募债券。

## § 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	2018/12/25	-	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。后续将根据宏观经济的走势及市场表现灵活调整组合杠杆及久期。

### **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《证券投资基金管理人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**

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在对兴业基金-私享纯债 2 号集合资产管理计划托管的过程中，



严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

兴业基金管理有限公司

2019年7月19日