

兴业基金-厦门农商 2 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-厦门农商 2 号单一客户资产管理计划
资产管理合同生效日	2015 年 7 月 8 日
资产管理合同到期日	2019 年 8 月 23 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	在有效控制投资风险的前提下，力争实现委托财产的保值增值，为委托人谋求稳定的投资回报。
投资范围	(1) 债券，包括在交易所/银行间上市交易的国债、地方政府债、金融债（不含次级债、混合资本债）、中央银行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向融资工具（PPN）、公司债、企业债、资产支持票据等； (2) 货币市场工具，包括 1 年以内（含 1 年）的银行存款（含通知存款）、大额可转让存单、债券回购（包括正回购和逆回购）等； (3) 其他固定收益类资产仅限于投资于货币市场的货币市场基金和债券市场基金；

	<p>(4) 投资于其他符合法律法规或监管部门要求的投资品种，需取得委托人的书面同意。如法律法规或监管部门以后允许计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，经委托人确认并书面通知托管人后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p>
投资策略	<p>确保本金安全和资产的充分流动性，追求安全稳定的投资收益。</p> <p>本定向资产管理业务将根据委托资产的投资目标，通过对无风险品种、低风险品种适当配置来达到避险增值的目的。将运用久期控制、类别配置和无风险套利等投资策略追求低风险稳定收益并保持委托资产合理的安全性和流动性。</p>
业绩比较基准(如有)	<p>每一期委托资产的委托人超额投资收益及管理人业绩报酬计算的基准。</p> <p>每笔追加金额在追加委托时对应一个业绩比较基准 R，具体以追加时点资产委托人于资产管理人协商一致的结果为准。</p>
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【0.3】%年费率计算，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×【0.3】%/当年天数。 托管费自委托财产运作起始日起，每日计提，按季支付。</p> <p>(2) 资产管理人的业绩报酬 每个封闭期结束后计提业绩报酬，产品结束后的3个工作日内，收取投资管理人的业绩报酬，每笔追加资金的业绩报酬计算方法如下： 1、每笔追加资金的业绩比较基准不低于 X 时，业绩报酬总额=0。 2、每笔追加资金的业绩比较基准低于 X 时，业绩报酬总额=A* (X-R) *20%*D/365。</p>

	<p>注：A 为每一期期初资产净值，x 为每一期封闭终止日资产单位净值/每一期期初资产单位净值 -1；期初是每一封闭期开始日的前一工作日。D 为每期运作起始日至当期终止日的委托管理续存天数。</p> <p>业绩报酬在产品结束后 2 个工作日由资产管理人发送划款指令，经资产托管人复核后 1 个工作日内从委托财产中一次性支付给资产管理人。</p> <p>(3) 资产托管人的托管费</p> <p>托管费按【0.05】%年费率计算，具体计算方法如下：委托财产每日应计提的托管费=前一日委托财产净值×【0.05】%/当年天数。</p> <p>托管费自委托财产运作起始日起，每日计提，按季支付。</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04月01日 – 2019年06月30日）
1. 本期已实现收益	360,635.90
2. 本期利润	360,635.90
3. 加权平均资管计划份额 本期利润	0.0085
4. 期末资管计划资产净值	31,691,743.45
5. 期末资管计划份额净值	1.207

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	0.67%	0.04%	0.00%	0.00%	0.67%	0.04%
-------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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	资产行次	资产期末余额	资产年初余额	负债与持有人权益	负债行次	负债期末余额	负债年初余额
资产:	0			负债:	21		
银行存款	1	1,688,122.49	1,055,780.22	短期借款	22	0.00	0.00
结算备付金	2	0.00	0.00	交易性金融负债	23	0.00	0.00
存出保证金	3	1,028.03	15,647.70	衍生金融负债	24	0.00	0.00
交易性金融资产	4	16,002,368.17	70,011,109.94	卖出回购金融资产款	25	0.00	0.00
其中：股票投资	5	0.00	0.00	应付证券清算款	26	0.00	0.00
基金投资	6	0.00	0.00	应付赎回款	27	0.00	0.00
债券投资	7	16,002,368.17	70,011,109.94	应付管理人报酬	28	165,986.55	187,659.61
资产支持证券投资	8	0.00	0.00	应付托管费	29	6,378.50	9,990.69
衍生金融资产	9	0.00	0.00	应付销售服务费	30	0.00	0.00
买入返售金融资产	10	14,000,000.00	0.00	应付交易费用	31	133.50	142.37
应收证券清算款	11	0.00	0.00	应交税费	32	3,194.78	8,442.17
应收利息	12	175,918.09	1,896,649.51	应付利息	33	0.00	0.00
应收股利	13	0.00	0.00	应付利润	34	0.00	0.00
应收申购款	14	0.00	0.00	其他负债	35	0.00	0.00
其他资产	15	0.00	0.00	负债合计	36	175,693.33	206,234.84
	16			所有者权益:	37		

	17			实收基金	38	26,248,149.95	61,194,018.36
	18			未分配利润	39	5,443,593.50	11,578,934.17
	19			所有者权益合计	40	31,691,743.45	72,772,952.53
资产总计	20	31,867,436.78	72,979,187.37	负债和所有者权益总计	41	31,867,436.78	72,979,187.37

§ 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	16,002,368.17	50.22
	其中：债券	16,002,368.17	50.22
	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	14,000,000.00	43.93
	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	1,688,122.49	5.30
8	其他资产	176,946.12	0.56
9	合计	31,867,436.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本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	16,002,368.17	50.49
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	-	-
10	合计	16,002,368.17	50.49

§ 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	
王倩倩	2016/3/28	—	国籍：中国。南开大学金融硕士，FRM，CFA 三级（通过）。14 年银行、基金从业经历，曾任职于中国农业银行、兴业银行和恒丰银行，从事信用审查和债券投资管理。2007 年 10 月至 2015 年 12 月，任职于恒丰银行资金营运中心、恒丰银行资产管理部，负责债券交易、投资和资产组合管理。于 2016 年 1 月加入兴业基金任投资经理。

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)

报告期内，基于对经济基本面、通胀水平、货币政策方向、债券绝对收益率水平、信用利差状况等多方面综合考虑，对各类细分资产的风险和收益率预期变化进行动态调整。

6.4 未来市场展望及投资策略

2019年国内基本面仍处下行趋势，资金面平稳宽松有望维持，基本面仍有利于债券。因本产品委托人提出提前清盘诉求，为维护委托人利益最大化，将视市场情况择机处置存量债券。

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7月19日