

兴业财富-兴金 380 号单一客户专项资产管理计划
2019 年第二季度报告

一、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本资产管理计划资产，但不保证本资产管理计划一定盈利。

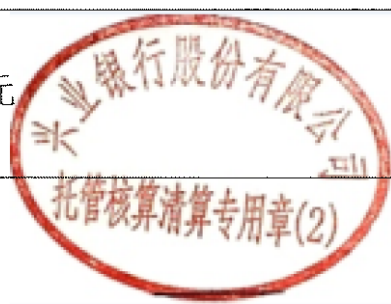
投资有风险，资产委托人在做出投资决策前应当认真阅读本资产管理计划“资产管理合同”、“风险揭示书”等法律文件。在做出投资决策后，本资产管理计划运营状况与所投资资产引致的投资风险，由资产委托人自行承担。

- 1、本报告中财务资料未经审计。
- 2、本报告期自 2019 年 4 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止。

二、产品基本情况

资产管理计划名称	兴业财富-兴金 380 号单一客户专项资产管理计划
资产管理计划运作方式	开放式
资产管理合同生效日	2016-12-01
资产管理合同到期日	无
资产管理人	兴业财富资产管理有限公司
资产托管人	兴业银行股份有限公司
期末资产管理计划份额	1,779,810,000

投资范围	本资产管理计划的委托财产主要投资于符合监管机构相关要求的资产支持证券（ABS）、交易商协会主管的资产支持票据（ABN）、项目收益票据（PRN）、发改委主管的项目收益债券。 投资比例占资产总值的 0-100%。在法律法规允许的条件下，委托人、管理人和托管人可另行协商更新投资范围，并签署补充协议。
投资标的	18 福田中车优先级 17 远东租赁 ABN0001A 17 建元 1A2 17 建元 4 优先
穿透底层资产（如有）	无
穿透底层资产融资人（如有）	无
风险缓释措施/增信措施	无
管理费率	0.03%/年
托管费率	0.02%/年
业绩报酬（如有，包括业绩比较基准、计提方式和支付方式）	无



三、管理人履职情况

1、在报告期内，管理人以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托财产。

2、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制

度，保证所管理的委托财产与旗下基金财产、其他委托财产和资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。

3、保存委托财产管理业务活动的全部会计资料，并妥善保管有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料。

4、2019年4月26日、5月27日、6月21日、6月26日，管理人根据委托人出具的《提取委托财产通知书》，进行了委托财产提取操作。

四、主要财务指标

单位：元

产品本期利润	23,667,644.49
期末资产净值	1,779,755,655.02
期末单位份额净值	1.000

注：

五、报告期末投资组合报告

项目	金额（元）	占总资产比例（%）
权益投资	/	/
其中：股票	/	/
基金投资	/	/
固定收益投资	1,779,810,000.00	99.9753
其中：债券	/	/
资产支持证券	1,779,810,000.00	99.9753
金融衍生品投资	/	/
买入返售金融资产	/	/
其中：买断式回购的买入返售金	/	/

融资产		
银行存款和结算备付金合计	439,520.20	0.0247
...	/	/
其他资产	/	/
合计	1,780,249,520.20	100.00

六、资产管理计划投资表现

报告期间资产管理计划期间累计收到各笔投资收益 24,702,756.79 元。所有投资标的运作良好，均未发生本息偿付违约情况。

七、资产管理计划投资收益分配情况

资产委托人在资产管理计划报告期内每月提取投资收益与部分本金。累计提取投资收益 23,672,540.06 元，累计提取投资本金 88,660,400.00 元。

八、投资经理变更情况

报告期内未变更投资经理。

投资经理简介：

沈宵，男，现任投资经理，日本早稻田大学金融工程硕士，2012 年 2 月至 2014 年 6 月于 ZAIS Group 资产管理有限公司从事资产证券化产品的投资工作，2014 年 7 月至 2016 年 4 月于海通证券股份有限公司从事资产证券化产品的设计、定价、发行与交易，2016 年 5 月加入兴业财富资产管理有限公司，任投资经理。拥有美国金融师协会特许金融分析师(CFA)资格。

九、重大关联交易情况

报告期内无重大关联交易。

十、产品其他重大事项简述

无

十一、产品主要风险简述

本产品资管合同及风险揭示书已对本产品主要风险进行了揭示。结合报告期内本产品投资运作情况，特别提示委托人以下风险：

（一）投资标的票面利率变动风险

本产品投资组合中包含票面利率浮动挂钩五年期贷款基准利率的住房抵押贷款资产支持证券，当央行调整相应贷款基准利率时，投资标的票面利率可能发生变动，影响实际利息收益。

（二）投资标的剩余期限变动风险

本产品投资组合中全部资产支持证券及资产支持票据的本金偿付均带有过手摊还安排，当底层基础资产发生早偿或发行时假设的早偿率发生变动时，投资标的本金摊还情况可能发生变化，导致剩余期限及各期摊还的本金比例发生变动。

兴业财富资产管理有限公司

2019年7月26日

附件、托管人履职报告

托管人履职报告

报告期内，本托管人严格遵守《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》及其他有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本计划委托人利益的行为。

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，对管理人在本计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、计划费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本计划委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

