

兴鑫-兴业观富 1 期资产管理计划
2019 年第二季度资产管理报告
(2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)



资产管理人：兴证期货有限公司

资产托管人：兴业银行股份有限公司上海分行

报告送出日期：2019 年 7 月 16 日

兴鑫-兴业观富 1 期资产管理计划

2019 年第二季度资产管理报告

一、重要提示

本报告依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《期货公司资产管理业务试点办法》（以下简称《试点办法》）、《期货公司监督管理办法》（以下简称《管理办法》）、《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》（以下简称《管理规则》）和其他有关规定制作。

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，不保证本资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

托管人确认已复核本报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

本报告未经审计。本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

二、资产管理计划概况

产品名称：兴鑫-兴业观富 1 期资产管理计划

简称：兴鑫-兴业观富 1 期

投资经理简历：廉正先生，工学学士、产业经济学硕士，现任兴证期货资产管理部总经理兼投资经理。2011 年从业以来先后从事宏观及商品研究、基于基本面的投资管理、量化策略开发与投资等，擅长大类资产配置与宏观对冲。曾获得《中国金属通报》2012 年度有色金属期货“十佳分析师”称号；《期货日报》、《证券时报》主办的“第七届中国最佳期货经营机构暨最佳分析师评选”中荣获“最佳有色金属期货分析师”第二名；上海期货交易所优秀分析师评选中获“2013 年度铜期货优秀分析师奖”。

施海先生，1983 年毕业于上海交通大学，期货从业资格证书：F0273014，投资咨询从业证书号：Z0011937。2011 年加入兴证期货有限公司，从事研究员工作，2019 年 2 月担任资产管理部投资经理。施海先生从事期货研究 25 年，主要从事天然橡胶期货研究，多次被上海期货交易所评为天然橡胶优秀分析师，并担任天然橡胶讲师。

产品类型：集合资产管理计划

计划运作方式：通过筹集委托人资金交由托管人托管，由资产管理计划管理人统一管理和运用，投资于中国证监会认可的投资品种，并将投资收益按比例分配给委托人。

投资目标：在合同约定的投资范围内，为委托人谋求投资回报。

投资范围及比例：

1、投资范围

本资产计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的各类股票、证券投资基金等权益类金融工具和各类债券、央行票据、短期融资券、资产支持证券等固定收益类金融工具、股指期货以及中国证监会允许投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许资产管理计划投资其他品种，资产管理人与资产托管人协商一致且在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、资产配置比例（占资产总值的比例）

本资产管理计划财产的投资组合应遵循以下限制：本资产管理计划参与股票发行申购时，本计划所申报的金额不得超过本计划的总资产，本计划所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

本投资组合的投资比例为：股票等权益类资产占本计划财产总值的比例范围为 0%-100%、债券，货币市场工具，资产支持证券等固定收益类资产占本计划财产总值的比例范围为 0%-100%、证券投资基金占本计划财产总值的比例范围为 0%-100%、股指期货的期货保证金占本计划财产总值的比例范围为 0%-100%。

产品基本信息：

合同生效日、成立日期：2017 年 1 月 6 日

成立规模：5100 万元

存续期：3 年

管理人：兴证期货有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司上海分行

三、主要财务指标和集合计划净值表现

（一）、主要财务指标

会计期间：2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日

币 种：人民币

	主要财务指标	
1	本期利润	-15,511,663.29

2	期末资产管理计划净值	174,501,173.87
3	期末单位资产管理计划净值	1.1767
4	期末累计单位资产管理计划净值	1.1767

（二）、资产管理计划净值表现

截止 2019 年 6 月 30 日，本计划单位净值为 1.1767，累计单位净值 1.1767。2019 年 4 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日，本计划单位净值涨幅为-8.16%。

四、资产管理计划风险控制报告

本报告期内，资产管理计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《管理办法》、《试点办法》及其他法律法规的规定，始终按照本资产管理计划合同和说明书的要求管理和运用本资产管理计划资产。

2019 年第二季度，资产管理计划管理人针对本计划的运作特点，通过每日的风险监控工作并及时发现运作过程中可能出的风险状况，同时提醒投资顾问采取相应的风险规避措施，确保了本资产管理计划合法合规、正常平稳运行。

经过审慎核查，截至 2019 年 6 月 30 日，本资产管理计划的投资决策、投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求，交易行为合法，未出操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据真实、完整、准确、及时。本计划管理人通过动态评估资产管理计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保本资产管理计划运作风险水平与投资目标相一致。

本产品 2019 年第二季度运作中，和其他资产管理计划发生过同向交易和反向交易。前述交易均在二级市场集中撮合成交，成交价格为市场公允价格，没有发生不公平交易、利益输送等行为，未损害产品投资者的合法权益。本产品 2019 年第二季度运作中，有投资管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或其他关联方发行的证券（或承销期内承销的证券）的行为，主要是买卖了管理人、托管人及关联方在二级市场发行的股票。前述交易均在二级市场集中撮合成交，成交价格为市场公允价格，没有发生不公平交易、利益输送、提供或变相提供融资等行为，未损害产品投资者的合法权益。

我们认为，报告期内资产管理计划管理人本着诚实守信、勤勉尽责的原则，控制风险的基础上为本计划持有人谋求最大利益，运作合法合规，不存在损害资产管理计划持有人利益

的行为。在 2019 年第二季度运作中，有投资管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或其他关联方发行的证券（或承销期内承销的证券）的行为，主要是申赎了管理人、托管人及关联方公开发行的货币基金。前述交易均以市场公允价格成交并获得收益，没有发生不公平交易、利益输送、提供或变相提供融资等行为，未损害产品投资者的合法权益。

五、资产管理计划财务报告

（一）、资产管理计划会计报表

1、资产管理计划资产负债表

日期：2019 年 6 月 30 日

币种：人民币

项目	期末余额	季初余额	项目	期末余额	季初余额
资产：			负债：		
银行存款	9,098.72	110,715.28	应付管理人报酬	68,417.26	64,979.96
结算备付金	5,544,906.44	4,971,444.27	应付托管费	45,611.47	43,319.95
存出保证金	3,757,444.50	8,828,611.30	应付投资顾问费	228,057.35	216,599.85
交易性金融资产	102,542,369.03	126,906,051.99	应付交易费用	0.00	0.00
其中：股票投资	102,542,369.03	126,906,051.99	应付行政服务费	0.00	0.00
债券投资			应付外包服务费	0.00	0.00
基金投资			应付其他运营费	0.00	0.00
其他投资			应付运营服务费	0.00	0.00
衍生金融资产			应交税费	10,844.42	480,542.72
买入返售金融资产	63,000,063.00	50,000,050.00	应付利息	0.00	0.00
应收证券清算款			应付利润	0.00	0.00
应收利息	222.68	1,406.80	其他负债	0.00	0.00
应收股利			负债合计	352,930.50	805,442.48
应收参与款			所有者权益：		
其他资产			实收资产	148,292,755.11	148,292,755.11
			未分配利润	26,208,418.76	41,720,082.05
			所有者权益合计	174,501,173.87	190,012,837.16
资产合计	174,854,104.37	190,818,279.64	负债和所有者权益总计	174,854,104.37	190,818,279.64

2、资产管理计划经营业绩表

期间： 2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日

币 种：人民币

项目	本期数	本年累计数
一、收入	-14,587,540.88	12,251,621.98
1、利息收入	334,307.63	624,668.97
其中：存款利息收入	11,557.37	21,898.61
债券利息收入		
信托利息收入		
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入	332,432.77	620,853.47
票据产品利息收入		
利息收入-增值税抵减	-9,682.51	-18,083.11
2、投资收益（损失以“-”号填列）	-1,720,999.07	6,418,343.52
其中：股票投资收益	-1,049,513.77	10,337,541.11
债券投资收益		
衍生工具收益	-1,273,000.00	-4,342,298.15
基金投资收益		
基金红利收益		60,297.57
其他投资收益		
股利收益	601,514.70	601,514.70
投资收益-增值税抵减		-238,711.71
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-13,200,849.44	5,208,609.49
其中：公允价值变动损益-增值税抵减	181,943.69	0.00
4、其他收入（损失以“-”号填列）		
二、费用	924,122.41	1,852,239.50
1、管理人报酬	68,417.26	133,397.22
2、托管费	45,611.47	88,931.42
3、受托费		
4、投顾费	228,057.35	444,657.20
5、交易费用	602,707.66	1,154,438.27
6、外包服务费		
7、其他运营费		
8、利息支出		
9、其他费用	-20,671.33	30,815.39
三、利润总额	-15,511,663.29	10,399,382.48
减：所得税费用		
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-15,511,663.29	10,399,382.48

(二)、资产管理计划投资组合报告

日期：2019 年 6 月 30 日

币 种：人民币

项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
股票投资	102,542,369.03	58.64
基金投资		
固定收益投资		
其中：债券		
金融衍生品投资	83,400.00	0.05
买入返售金融资产	63,000,063.00	36.03
货币市场工具	0.00	0.00
银行存款和结算备付金合计	5,554,005.16	3.18
其他资产	3,674,267.18	2.10
合计	174,854,104.37	100.00

(三)、收益分配情况

本报告期内，本产品无收益分配情况

(四)、期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值
农、林、牧、渔业	0.00
采矿业	0.00
制造业	85,814,223.03
电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00
建筑业	0.00
批发和零售业	2,720,608.00
交通运输、仓储和邮政业	0.00
住宿和餐饮业	0.00
信息传输、软件和信息技术服务业	8,459,422.00
金融业	5,548,116.00
房地产业	0.00
租赁和商务服务业	0.00
科学研究和技术服务业	0.00
水利、环境和公共设施管理业	0.00
居民服务、修理和其他服务业	0.00

教育	0.00
卫生和社会工作	0.00
文化、体育和娱乐业	0.00
综合	0.00
合计	102,542,369.03

六、集合计划份额变动情况

期间：2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
148,292,755.11	0.00	0.00	148,292,755.11

七、备查文件目录

- （一）、《兴鑫-兴业观富 1 期资产管理计划资产管理合同》
- （二）、《兴鑫-兴业观富 1 期资产管理计划成立公告》
- （三）、管理人业务资格批件、营业执照。

八、文件存放地点

兴证期货有限公司

地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 8 楼

联 系 人：崔文婷

服务电话：021-20370952

E-MAIL：cuiwt@xzfutures.com

投资者对本报告书如有任何疑问，可以咨询管理人兴证期货有限公司

