

**兴证资管鑫益可转债增强 2 号集合资产管理计划**  
**2020 年第 3 季度资产管理报告**  
(2020 年 7 月 1 日—2020 年 9 月 30 日)



资产管理人：兴证证券资产管理有限公司

资产托管人：兴业银行股份有限公司福州分行

报告送出日期：2020 年 10 月 29 日

## 一、重要提示

本报告依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“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》（以下简称“运作管理规定”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“指导意见”）及其他有关规定制作。

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供本集合计划客户参考。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或删改，否则将构成侵权。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本委托资产的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的其他资产的业绩也不构成本委托资产业绩表现的保证。

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

本报告未经审计。本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期自2020年7月1日至2020年9月30日止。

## 二、集合计划产品概况

**产品名称：**兴证资管鑫益可转债增强 2 号集合资产管理计划

**简称：**兴证资管鑫益可转债增强 2 号

**产品类型：**集合资产管理计划

**计划运作方式：**开放式

**投资目标：**本集合计划主要投资于可转换债券、可交换债券、同业存单等固定收益类资产，同时部分投资于权益类资产，力争为本集合计划获取稳健回报。

**投资策略：**本集合计划主要投资于可转换债券、可交换债券，同时部分投资于权益类资产，投资目的是力争增强产品收益。但是权益类资产价格存在一定的波动，存在投资出现亏损从而影响净值下跌的风险，导致产品收益的不确定性增强。除此之外，管理人判断债券市场没有投资机会出现时，会投资其他固定收益类资产。

**风险收益特征：**本计划的产品风险等级为 R21，仅适合向风险承受能力等级为 C2 及高于 C2 的投资者推广。

**资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式：**

(一) 资产管理人的管理费

在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的【1.5】%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年管理费率为【1.5】%

(二) 资产托管人的托管费

在通常情况下，资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的【0.05】%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年托管费率为【0.05】%

(三) 业绩报酬

**业绩报酬计提办法：**

$$S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$$

$$H = Q \times C \times (S - \text{【6】\%}) \times \frac{D}{365} \times 20\%$$

(四) 税收

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。投资者应缴纳的税收由投资者负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

(五) 其他费用的支付

资产管理计划银行资金账户发生的银行结算费用等银行费用，由托管人直接从资金账户中扣划，无须管理人出具指令。

合同生效日、成立日期：2020年5月22日

成立规模：10,203,838.50

存续期：10年，可展期

管理人：兴证证券资产管理有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司福州分行

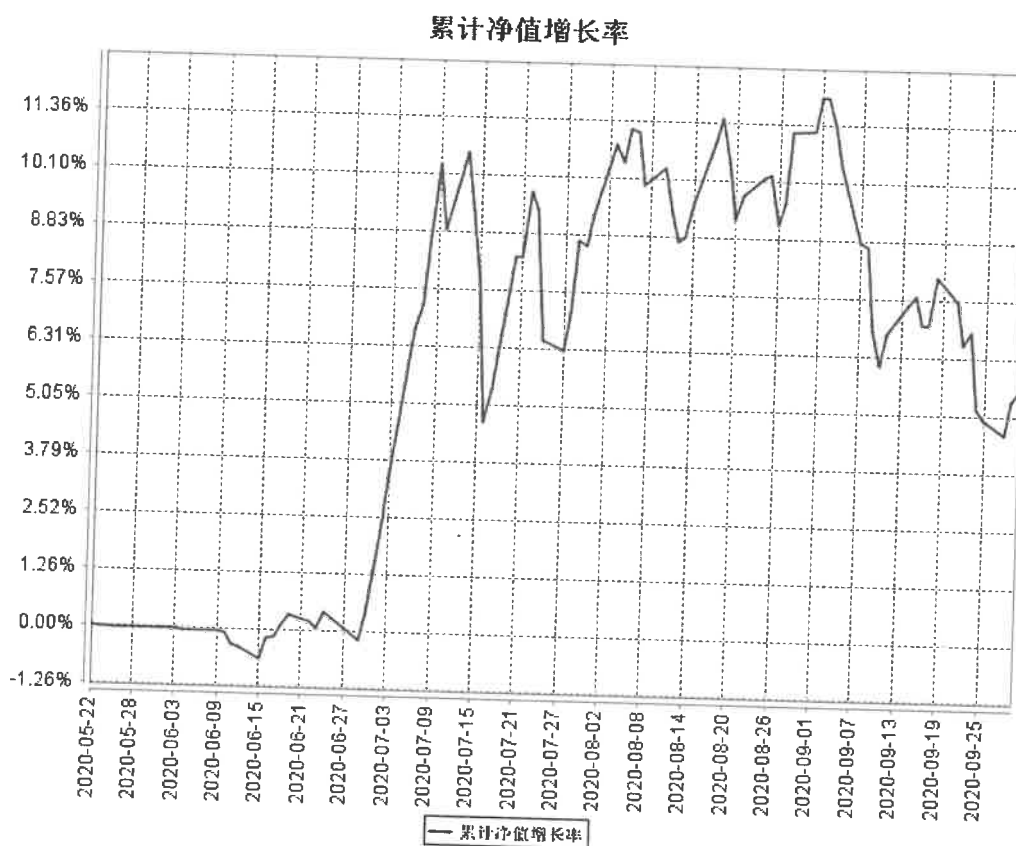
### 三、主要财务指标和集合计划净值表现

#### (一) 主要财务指标:

单位：人民币元

主要财务指标	2020年7月1日—2020年9月30日
1 本期利润	533,065.69
2 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	292,365.97
3 加权平均计划份额本期利润	0.0522
4 期末集合计划资产净值	10,776,265.07
5 可供分配利润	280,802.61
6 期末单位集合计划资产净值	1.0561
7 期末累计单位集合计划资产净值	1.0561
8 本期单位净值增长率	5.20%

#### (二) 集合计划净值表现



注：上图净值数据截止日期为2020年9月30日

## 四、集合计划投资经理报告

### (一) 投资经理简介

吴轩：权益投资部投资经理

CFA, FRM, 美国南加州大学金融工程硕士，现管理可转债系列产品。

负责过大量上市公司私募可交换债、可转债、员工持股计划、结构化产品等项目。历任美国Alcioun Capital基金分析师、兴业证券计划财务部经营与财务分析研究员。复合背景，擅长量化分析、产品设计，并结合各类金融产品特性为客户提供定制化服务。

### (二) 2020年第三季度投资经理工作报告

#### 1、2020年第三季度行情回顾及运作分析

2020年3季度市场向上波动较大，我们借此获取了银行、券商转债的一定收益。

#### 2、2020年第四季度展望与投资策略

A股在三季度初期出现过一波快速上涨行情，但在金融股普遍上行后，市场进入稳定期，疫苗、光伏、电动车等高景气度板块持续上行。展望四季度，市场或继续高位震荡，我们认为市场向下风险有限，仍然可能是结构性的行情；海外疫情反复，与外需相关性高的产业受影响较大，而内需板块确定性相对强，预计仍或是市场关注的重点。我们或将继续关注内需为主+正股低估值+转债低估值的部分标的。

## 五、集合计划风险控制报告

### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

### 2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的合规风控部门，对各项业务风险进行全面的监督、检查和评价。公司专门设有合规风控部，通过系统监控和人工检查相结合的方式，对集合资产管理计划的投资风险、信用风险、操作风险等进行全面的监督和检查，同时在交易系统中对各类风险指标进行限制，实现交易的事前控制，确保集合资产管理计划合法合规。对日常集合资产管理计划出现的各类问题，合规风控部及时进行风险提示，提出合规管理与风险管理建议，并督促相关部门及时整改。

经过审慎核查，本报告期内，本集合计划的投资决策、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；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划的投资运作严格按照合同约定及有关外规要求执行；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。集合计划管理人通过动态评估集合计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保本集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

## 六、集合计划管理人报告

### (一) 集合计划收益分配情况

分配红利日期	每10份集合计划分红(元)	备注
-	-	-

### (二) 集合计划投资组合报告

#### 1、资产组合情况

日期：2020年9月30日

单位：人民币

项 目	期末市值(元)	占总资产比例(%)
银行存款及备付金	5,286.51	0.05
股票投资	3,153,734.00	29.10
债券投资	7,077,092.03	65.29
资产支持证券投资	-	-
基金投资	100.05	0.00
买入返售金融资产	-	-
其他资产	602,919.27	5.56
资产合计	10,839,131.86	100.00

#### 2、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

证券代码	证券名称	库存数量	证券市值	市值占净值(%)
128096	奥瑞转债	5,713.00	708,366.30	6.57
128013	洪涛转债	6,090.00	655,826.01	6.09
127013	创维转债	5,906.00	633,902.79	5.88
128034	江银转债	5,887.00	632,593.47	5.87
113013	国君转债	4,750.00	580,925.00	5.39
128044	岭南转债	5,410.00	543,537.29	5.04
113582	火炬转债	2,820.00	502,834.20	4.67
128071	合兴转债	3,500.00	444,279.50	4.12
128078	太极转债	3,410.00	442,011.02	4.10
132018	G三峡EB1	3,670.00	426,454.00	3.96

#### 3、投资组合报告附注

1) 本集合计划本期投资的前十名证券中，国君转债在报告编制日前一年内发行主体被中国证监会及中国证券监督管理委员会福建监管局采取出具警示函的监督管理措施；太极转债在报告期内前一年内发行主体被深圳证券交易所公开批评。

2) 本集合计划投资的前十名证券中，没有投资于超出集合资产管理计划合同规定范围之外的证券。



## 七、集合计划份额变动情况

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）
10,203,838.50	-	-	10,203,838.50

## 八、重大事项提示

(一) 本报告期内, 本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到监管部门的任何处罚。

(二) 本报告期内无涉及对公司运营管理及本集合计划运作产生重大影响的, 与本集合计划管理人、委托财产、托管业务相关的重大诉讼或仲裁事项。

(三) 本报告期内, 本集合计划未发生合同变更。

(四) 本报告期内, 本集合计划未发生投资经理变更。

(五) 本报告期内, 本集合计划投资策略未发生重大改变。

(六) 本报告期内, 本集合计划未发生自有资金参与或退出。

(七) 本报告期内, 本集合计划未发生重大关联交易。

(八) 董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与情况。

项目	持有份额总数(份)	占总份额比例
报告期末董事、监事、从业人员及其配偶持有本计划份额情况	0.00	0.00%
报告期末控股股东、实际控制人或者其他关联方持有本计划份额情况	0.00	0.00%

(九) 其他涉及投资者利益的重大事项。

## 九、托管人履职报告

本托管人依据与兴证证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）签订的集合计划的合同、托管协议以及集合计划说明书，托管了管理人发行的本集合资产管理计划的资产。

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、本集合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，不存在损害本集合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、各集合计划合同和托管协议的规定，对管理人在本集合计划的投资运作、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集合计划委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告期内本集合资产管理计划资产管理报告中的财务指标、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。

## 十、备查文件目录

### (一) 本集合计划备查文件目录

- 1、“兴证资管鑫益可转债增强2号集合资产管理计划”验资报告；
- 2、关于“兴证资管鑫益可转债增强2号集合资产管理计划”成立的公告；
- 3、“兴证资管鑫益可转债增强2号集合资产管理计划”计划说明书；
- 4、“兴证资管鑫益可转债增强2号集合资产管理计划”托管协议；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照。

### (二) 存放地点及查阅方式

文件存放地点：上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦9楼

网址：[www.ixzzcgl.com](http://www.ixzzcgl.com)

联系人：龚苏平

服务电话：021-38565499

EMAIL：[zcgl@xyzq.com.cn](mailto:zcgl@xyzq.com.cn)

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人兴证证券资产管理有限公司。

兴证证券资产管理有限公司

2020年10月29日

