

瑞银财富1号集合资产管理计划
2015年第2季度报告

集合计划管理人：瑞银证券有限责任公司

集合计划托管人：中国建设银行股份有限公司

§ 1 重要提示

本报告由瑞银财富1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）管理人瑞银证券有限责任公司编制。

本集合计划托管人中国建设银行股份有限公司于2015年7月17日对本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等数据进行了复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

本报告内容由管理人负责解释。

§ 2 集合计划产品概况

集合计划全称	瑞银财富1号集合资产管理计划
交易代码	C30001
集合计划运作方式	非限定性
集合计划成立日	2010年11月11日
报告期末集合计划份额总额	65,092,252.85份
投资目标	通过灵活的资产配置策略尽可能规避证券市场的风险，在风险可控的前提下积极把握证券场所带来的获利机会，追求资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	无
集合计划管理人	瑞银证券有限责任公司
集合计划托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和集合计划净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2015年4月1日-2015年6月30日)
1. 本期已实现收益	44,502,971.82
2. 本期利润	20,424,580.38
3. 加权平均集合计划份额本期利润	0.2048
4. 期末集合计划资产净值	86,984,034.54
5. 期末集合计划份额净值	1.336

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

3.2 集合计划净值表现

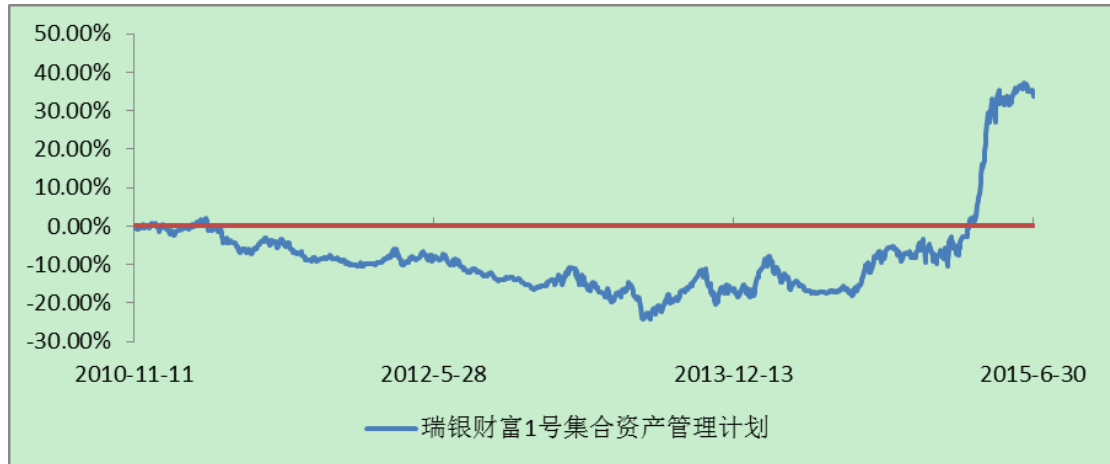
3.2.1 本报告期集合计划份额净值增长率

阶段	净值增长率	净值增长率标准差
过去三个月	11.80%	1.12%

3.2.2 自集合计划成立以来集合计划累计净值增长率变动

瑞银财富1号集合资产管理计划累计份额净值增长率历史走势图

(2010年11月11日至2015年6月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 集合计划投资主办人简介

姓名	职务	任本集合计划投资主办人期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赖晶铭	资产管理部副总监、投资主管	2010年11月11日	—	20年	加入瑞银证券前曾任益民基金管理有限公司投资管理部总经理、益民红利成长开放式基金经理，富国基金管理有限公司汉兴基金经理、富国动态平衡开放式基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

4.2.1 集合计划合规运作说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、其他相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，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。

报告期内，本集合计划合法合规运作，投资管理符合相关法律法规、本集合计划说明书和合同的规定，不存在违法违规、未履行承诺或损害本集合计划份额持有人利益的情形。

4.2.2 集合计划风险管理报告

报告期内，瑞银证券有限责任公司资产管理部风险控制与合规委员会负责独立、客观、公正地开展本集合计划投资运作的风险管理，定期召开风险控制与合规委员会会议，风险经理定期向委员会提交风险管理与绩效评估报告。报告期内，未出现风险事故。

4.3 报告期内集合计划的投资策略和业绩表现说明

4.3.1 本集合计划业绩表现

截至2015年6月30日，本集合计划份额净值为1.336元。

4.3.2 行情回顾及运作分析

市场方面，二季度虽然整体宏观经济呈现弱势探底的态势，但在两次降息，一次降准的宽松货币政策，以及国家“一带一路”战略、“京津冀一体化”战略、“互联网+”和“中国制造2025”等战略的大力倡导和实施，各路资金不断涌入股市，A股一路上行，特别是创业板和中小板中呈现出巨幅上涨，其中不少新兴产业中的个股涨幅惊人。但从6月中下旬开始，随着监管层严查场外配资，A股对前期快速上涨所累积的风险开始了集中释放，出现了一波急速的调整，由于前期涨幅可观，季度末指数仍录得较高涨幅。全季上证指数、深证成指、中小板指、创业板指分别上涨14.12%、8.95%、15.32%以及22.42%。

产品操作方面，季度初我们延续了前期对行情的乐观判断，较高仓位配置与战略新兴产业中的成长股，但随着股价短期的迅速上涨，4月底至五月初我们陆续减持了组合中达到或大大超过目标价位的成长股，大幅降低了仓位，轻仓持有了一些涨幅较少估值较为合理的价值股和少量成长股，5月和6月上旬我们略微调整了组合中的个股，一直没有加仓，同时为了应对较大幅度的赎回和即将启动的清盘程序，6月下旬我们逐步对组合实施了获利清仓。

截止六月底，本产品已基本全部变现，二季度实现净值涨幅11.8%，今年以来实现净值涨幅45.69%，产品累积单位净值1.336元，以较好的净值增长和绝对回报来顺利迎接即将到来的产品清盘工作。我们衷心感谢本产品的所有持有人，希望以后有机会再为您们提供服务。

§ 5 托管人报告

本托管人依据《瑞银财富1号集合资产管理计划集合资产管理合同》与《瑞银财富1号集合资产管理计划托管协议》，自2010年11月11日起托管瑞银财富1号集合资产管理计划（以下称“本计划”）资产。

2015年第二季度期间，中国建设银行及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

2015年第二季度期间，中国建设银行对管理人的投资运作行为按合同约定进行监督，发现个别监督指标不符合集合计划合同约定并及时通知了集合计划管理人。

2015年第二季度期间，中国建设银行对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

中国建设银行复核了本计划资产管理报告（2015年第二季度报告）中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。

中国建设银行投资托管业务部

2015年7月17日

§ 6 投资组合报告

6.1 报告期末集合计划资产组合情况

项目	金额（元）	占总资产比例
银行存款及清算备付金合计	8,742,252.95	8.99%
股票	29,680.00	0.03%
债券	0.00	0.00%
基金	0.00	0.00%
权证	0.00	0.00%
买入返售金融资产	78,500,000.00	80.70%
其他资产	10,005,855.86	10.29%
合计	97,277,788.81	100.00%

注：其他资产包括存出保证金、应收利息、应收证券清算款等。

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值（元）	占净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采矿业	24,750.00	0.03%

C 制造业	4,930.00	0.01%
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 批发和零售业	0.00	0.00%
G 交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00%
H 住宿和餐饮业	0.00	0.00%
I 信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00%
J 金融业	0.00	0.00%
K 房地产业	0.00	0.00%
L 租赁和商务服务业	0.00	0.00%
M 科学研究和技术服务业	0.00	0.00%
N 水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00%
O 居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00%
P 教育	0.00	0.00%
Q 卫生和社会工作	0.00	0.00%
R 文化、体育和娱乐业	0.00	0.00%
S 综合	0.00	0.00%
合计	29,680.00	0.03%

6.3 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占净值比例
1	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.03%
2	002770	科迪乳业	500	4,930.00	0.01%

6.4 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

6.5 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

6.6 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

6.7 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本集合计划本报告期末未持有基金。

6.8 投资组合报告附注

6.8.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有流通受限股票。

6.8.2 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 集合计划份额变动

单位：份

报告期初份额总额	150,988,380.22
报告期内总参与份额	0.00
报告期内红利再投资份额	0.00
报告期内总退出份额	85,896,127.37
报告期末份额总额	65,092,252.85

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内的关联交易

本集合计划于2015年6月2日参加了“中国核电”A股股票的网上申购，6月5日中签19000股中国核电（股票代码：601985）。瑞银证券有限责任公司是本次中国核电A股股票发行的联席保荐机构（主承销商）。此次交易符合《瑞银财富1号集合资产管理计划说明书》、《瑞银财富1号集合资产管理计划集合资产管理合同》的相关约定。本集合计划管理人已经在网站上进行了公告。

8.2 其他重大事项情况

8.2.1 报告期内，本集合计划的推广机构未发生变更。

8.2.2 报告期内，管理人在本集合计划项下的高级管理人员和投资主办人员（投资经理）未发生变更。

8.2.3 报告期内，托管人的托管部总经理未发生变更。

8.2.4 报告期内，未发生本集合计划投资证券的发行公司出现重大事件，导致本集合计划所持有的该证券不能按正常的计价方法进行计价的情形。

8.2.5 报告期内，本集合计划管理人和托管人托管部门未受到监管部门的重大处罚。

8.2.6 报告期内，未发生涉及管理人、集合计划资产、集合计划资产托管业务的

重大诉讼、仲裁事项。

8.2.7 报告期内,其他需要公告的可能对本集合计划持续运作产生重大影响的情形。

2015年6月16日,本集合计划管理人在网站上发布了“瑞银财富1号集合资产管理计划资产净值低于一亿元的提示性公告”。公告中提示,根据《瑞银财富1号集合资产管理计划集合资产管理合同》第16部分第五十七条“集合计划的终止”的规定,“如出现下列情形之一,本集合计划应当终止:5、存续期内,连续20个交易日集合计划资产净值低于1亿元时”。在截至2015年7月14日的20个交易日内,如果本集合计划资产净值持续低于1亿元,本集合计划管理人将按照集合资产管理合同的约定,在本集合计划终止后5个工作日内,开始集合计划资产的清算程序。

2015年6月24日和2015年6月30日,本集合计划管理人分别发布了“瑞银财富1号集合资产管理计划资产净值公告”,公布了集合计划的净值情况。

§ 9 信息披露的查阅方式

集合资产管理定期报告、托管定期报告及其他临时通告等信息披露文件放置于管理人网站(www.ubssecurities.com, www.ubs-s.com),供委托人查阅。委托人也可拨打管理人客户服务电话:400-818-8838或010-58351876进行查询。相关法律法规对信息披露有新规定的,本集合计划的信息披露也将按照新规定执行。

瑞银证券有限责任公司

2015年7月21日