

# 兴业财富-兴享进取FOF1号

## 2017年第1季度报告

填制机构：兴业财富资产管理有限公司

报告期间：2017年1月13日至2017年3月31日

填制日期：2017年4月17日

### 一、投资管理人基本信息

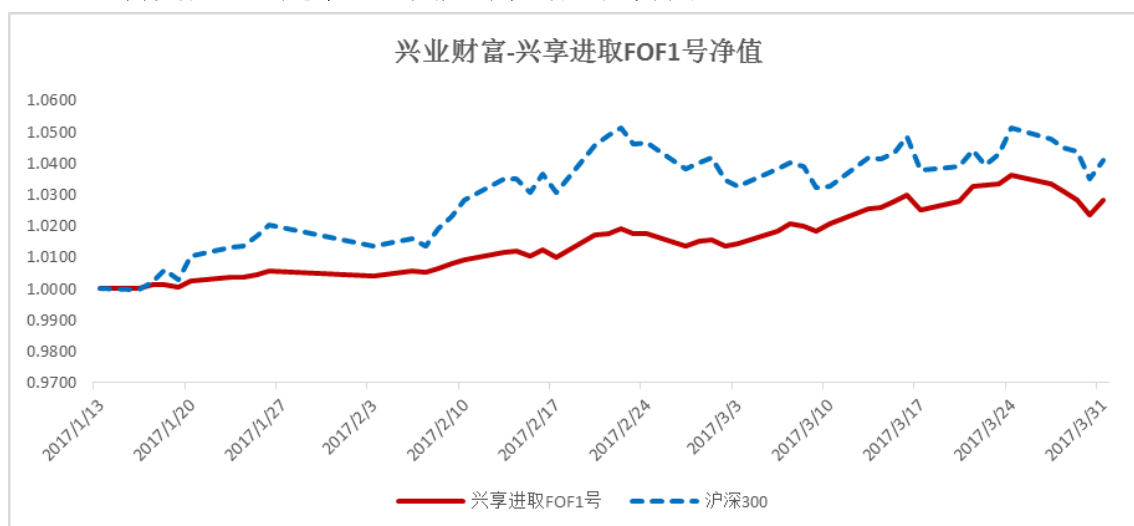
|         |                       |
|---------|-----------------------|
| 名称      | 兴业财富资产管理有限公司          |
| 地址      | 上海市浦东新区浦明路198号财富广场7号楼 |
| 法定代表人   | 卓新章                   |
| 本组合投资经理 | 周璐、杨梦影                |

### 二、主要财务及业绩指标

#### (一) 投资组合表现

|                    |                  |
|--------------------|------------------|
| 1、本组合初始委托资产（元）     | 2,900,000,000.00 |
| 2、本期期初资产净值（元）      | 1,600.032,000.00 |
| 3、本期期末资产净值（元）      | 2,968,216,737.12 |
| 4、本期资产增值（元）        | 1,368,184,737.12 |
| 5、本期资产净值增长率        | 2.35%            |
| 6、自委托之日起资产净值增长率    | 2.35%            |
| 7、本期期末单位净值(参考值)（元） | 1.0235           |

#### (二) 自委托之日起本组合资产净值增长走势图



### 三、投资组合报告

#### (一) 投资资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 期末市值             | 市值占净值比  |
|----|-------------------|------------------|---------|
| 1  | 权益投资              | 0.00             | 0.00%   |
|    | 其中：股票             | 0.00             | 0.00%   |
| 2  | 固定收益投资            | 0.00             | 0.00%   |
|    | 其中：债券             | 0.00             | 0.00%   |
|    | 资产支持证券            | 0.00             | 0.00%   |
| 3  | 金融衍生品投资           | 0.00             | 0.00%   |
| 4  | 买入返售金融资产          | 0.00             | 0.00%   |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00             | 0.00%   |
| 5  | 银行存款和结算备付金合计      | 32,000.00        | 0.00%   |
| 6  | 其他资产              | 2,970,380,000.00 | 100.07% |
|    | 合计                | 2,970,412,000.00 | 100.08% |

#### (二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 期末市值(元) | 市值占净值比 |
|----|------|------|-------|---------|--------|
| 合计 |      |      | 0.00  | 0.00    | 0.00%  |

#### (三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 期末市值(元) | 市值占净值比 |
|----|------|------|-------|---------|--------|
| 合计 |      |      | 0     | 0.00    | 0.00%  |

#### (四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有基金明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 数量(份) | 期末市值(元) | 市值占净值比 |
|----|------|------|-------|---------|--------|
| 合计 |      |      | 0.00  | 0.00    | 0.00%  |

#### (四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有信托产品明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 产品名称       | 数量(份)       | 期末市值(元)        | 市值占净值比  |
|----|------------|-------------|----------------|---------|
| 1  | 兴享进取重阳 1 号 | 200,000,000 | 207,400,000.00 | 6.9874  |
| 2  | 兴享进取和聚 1 号 | 400,000,000 | 409,000,000.00 | 13.7793 |
| 3  | 兴享进取汇利 1 号 | 200,000,000 | 209,360,000.00 | 7.0534  |
| 4  | 兴享进取弘尚 1 号 | 100,000,000 | 99,280,000.00  | 3.3448  |

|    |            |                  |                  |         |
|----|------------|------------------|------------------|---------|
| 5  | 兴享进取景林 1 号 | 400,000,000      | 419,200,000.00   | 14.1230 |
| 6  | 兴享进取理成 1 号 | 400,000,000      | 407,240,000.00   | 13.7200 |
| 7  | 兴享进取明达 1 号 | 200,000,000      | 215,900,000.00   | 7.2737  |
| 8  | 兴享进取涌峰 1 号 | 400,000,000      | 404,400,000.00   | 13.6243 |
| 9  | 兴享进取展博 1 号 | 400,000,000      | 396,080,000.00   | 13.3440 |
| 10 | 兴享进取朱雀 1 号 | 200,000,000      | 202,520,000.00   | 6.8230  |
| 合计 |            | 2,900,000,000.00 | 2,970,380,000.00 | 100.07  |

## 四、风险指标及归因分析

### （一）兴业财富-兴享进取FOF1号风险指标

|                |       |
|----------------|-------|
| 1. 投资组合收益年化波动率 | 3.70% |
| 2. 投资组合区间最大回撤  | 1.24% |
| 3. 夏普比率        | 3.16  |

## 五、投资经理报告

### （一）本期市场与操作回顾（概述）

产品成立于2017年1月13日，并于1月16日和3月16日追加两笔投资。

整个一季度，A股市场呈现结构化分化的行情。沪深300指数上涨4.4%，创业板指数下跌2.8%，跑赢7%。个股结构上，行业龙头为的大市值个股继续跑赢中小市值个股。

### （二）下期市场展望与投资策略（概述）

展望后期，我们认为，个股分化的震荡行情会继续。管理人选择上继续推荐精选个股的管理人，并逐步布局擅长成长股的管理人。

## 六、重大事项

无。

## 七、其他需要说明的情况

### （一）本期报表数据是否经与托管人复核

是。

## （二）其他

无。

## 八、声明

本公司郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。

## 九、附件

### 资产负债表：

#### 兴业财富资产管理有限公司\_\_兴业财富-兴享进取 FOF1 号专项资产管理计划\_\_专用表

日期：2017-03-31

单位：元

| 资产       | 期末余额             | 年初余额 | 负债与持有人权益   | 期末余额             | 年初余额 |
|----------|------------------|------|------------|------------------|------|
| 资 产：     |                  |      | 负 债：       |                  |      |
| 银行存款     | 32,000.00        | 0.00 | 短期借款       | 0.00             | 0.00 |
| 结算备付金    | 0.00             | 0.00 | 交易性金融负债    | 0.00             | 0.00 |
| 存出保证金    | 0.00             | 0.00 | 衍生金融负债     | 0.00             | 0.00 |
| 交易性金融资产  | 0.00             | 0.00 | 卖出回购金融资产款  | 0.00             | 0.00 |
| 其中：股票投资  | 0.00             | 0.00 | 应付证券清算款    | 0.00             | 0.00 |
| 债券投资     | 0.00             | 0.00 | 应付赎回款      | 0.00             | 0.00 |
| 基金投资     | 0.00             | 0.00 | 应付管理人报酬    | 2,076,606.67     | 0.00 |
| 权证投资     | 0.00             | 0.00 | 应付托管费      | 118,663.25       | 0.00 |
| 资产支持证券投资 | 0.00             | 0.00 | 应付销售服务费    | 0.00             | 0.00 |
| 衍生金融工具   | 0.00             | 0.00 | 应付交易费用     | 0.00             | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00             | 0.00 | 应交税费       | 0.00             | 0.00 |
| 应收证券清算款  | 0.00             | 0.00 | 应付利息       | 0.00             | 0.00 |
| 应收利息     | 7.04             | 0.00 | 应付利润       | 0.00             | 0.00 |
| 应收股利     | 0.00             | 0.00 | 其他负债       | 0.00             | 0.00 |
| 应收申购款    | 0.00             | 0.00 | 负债合计       | 2,195,269.92     | 0.00 |
| 其他资产     | 2,970,380,000.00 | 0.00 |            |                  |      |
|          |                  |      | 所有者权益：     |                  |      |
|          |                  |      | 实收基金       | 2,900,000,000.00 | 0.00 |
|          |                  |      | 未分配利润      | 68,216,737.12    | 0.00 |
|          |                  |      | 所有者权益合计    | 2,968,216,737.12 | 0.00 |
| 资产合计     | 2,970,412,007.04 | 0.00 | 负债和所有者权益总计 | 2,970,412,007.04 | 0.00 |

利润表：

兴业财富资产管理有限公司\_\_兴业财富-兴享进取 FOF1 号专项资产管理计划\_\_专用表

日期：2017 年 01 月 — 2017 年 03 月

单位：元

| 序号 | 项目            | 本期数           | 本年累计数         |
|----|---------------|---------------|---------------|
| 1  | 一、收入          | 70,412,007.04 | 70,412,007.04 |
| 2  | 1、利息收入        | 32,007.04     | 32,007.04     |
| 3  | 其中：存款利息收入     | 32,007.04     | 32,007.04     |
| 4  | 债券利息收入        | 0.00          | 0.00          |
| 5  | 资产支持证券利息收入    | 0.00          | 0.00          |
| 6  | 买入返售证券收入      | 0.00          | 0.00          |
| 7  | 2、投资收益        | 0.00          | 0.00          |
| 8  | 其中：股票投资收益     | 0.00          | 0.00          |
| 9  | 债券投资收益        | 0.00          | 0.00          |
| 10 | 基金投资收益        | 0.00          | 0.00          |
| 11 | 权证投资收益        | 0.00          | 0.00          |
| 12 | 资产支持证券投资收益    | 0.00          | 0.00          |
| 13 | 衍生工具收益        | 0.00          | 0.00          |
| 14 | 股利收益          | 0.00          | 0.00          |
| 15 | 个股期权收益        | 0.00          | 0.00          |
| 16 | 3、公允价值变动收益    | 70,380,000.00 | 70,380,000.00 |
| 17 | 4、其他收入        | 0.00          | 0.00          |
| 18 | 二、费用          | 2,195,269.92  | 2,195,269.92  |
| 19 | 1、管理人报酬       | 2,076,606.67  | 2,076,606.67  |
| 20 | 2、托管费         | 118,663.25    | 118,663.25    |
| 21 | 3、销售服务费       | 0.00          | 0.00          |
| 22 | 4、交易费用        | 0.00          | 0.00          |
| 23 | 5、利息支出        | 0.00          | 0.00          |
| 24 | 其中：卖出回购金融资产支出 | 0.00          | 0.00          |
| 25 | 6、其他费用        | 0.00          | 0.00          |
| 26 | 三、利润总和        | 68,216,737.12 | 68,216,737.12 |

兴业财富资产管理有限公司

2017年4月17日