

兴业财富-兴享进取FOF1号

2017年第2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4月1日至2017年6月30日

填制日期：2017年7月13日

一、投资管理人基本信息

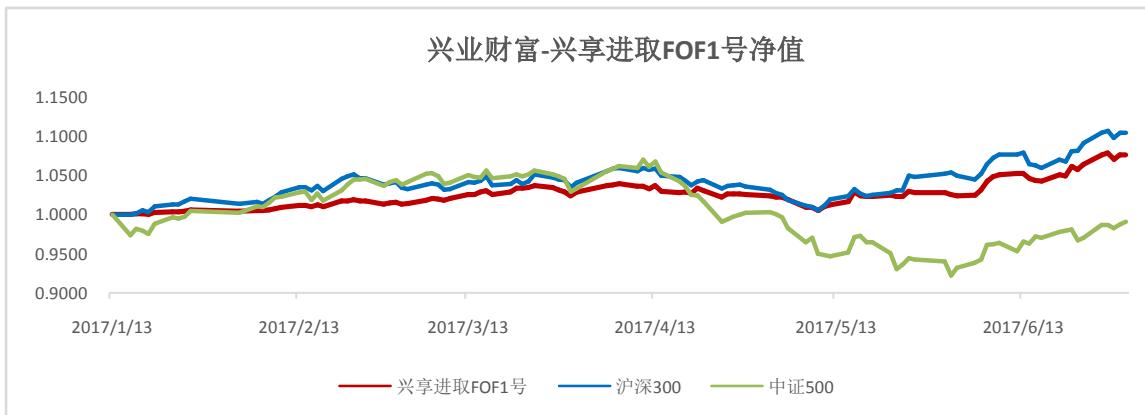
名称	兴业财富资产管理有限公司
地址	上海市浦东新区浦明路198号财富广场7号楼
法定代表人	卓新章
本组合投资经理	周璐、杨梦影

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)	1,600,000,000.00
2、本期期初资产净值(元)	2,968,216,737.12
3、本期期末资产净值(元)	5,030,529,520.29
4、本期资产增值(元)	2,062,312,783.17
5、本期资产净值增长率	5.09%
6、自委托之日起资产净值增长率	7.65%
7、本期期末单位净值(参考值)(元)	1.0765

(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	43,654.67	0.001%
6	其他资产	5,035,392,807.15	100.097%
	合计	5,035,436,461.82	100.098%

(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	214,660,000.00	4.2671
2	兴享进取和聚 1 号	598,668,918	583,762,061.94	11.6044
3	兴享进取汇利 1 号	935,158,978	1,047,845,634.85	20.8297
4	兴享进取弘尚 1 号	100,000,000	96,870,000.00	1.9256
5	兴享进取景林 1 号	868,867,216	1,037,775,002.79	20.6295
6	兴享进取理成 1 号	400,000,000	416,120,000.00	8.2719
7	兴享进取明达 1 号	844,389,211	1,002,965,504.83	19.9376

8	兴享进取涌峰1号	598,412,698	635,394,602.74	12.6308
合计		4,545,497,021	5,035,392,807.15	100.10%

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	5.93%
2. 投资组合区间最大回撤	3.24%
3. 夏普比率	2.51

五、投资经理报告

(一) 本期市场与操作回顾（概述）

本季度在5月追加24亿、赎回3.87亿，6月赎回1.93亿。

整个二季度，A股市场呈现结构化分化的行情。沪深300指数上涨6.1%，创业板指数下跌4.68%。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: 2017-06-30

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	43,654.67	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	5,796,591.97	0.00
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	331,233.84	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	1,220,884.28	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	6,127,825.81	0.00
其他资产	5,035,392,807.15	0.00			
			所有者权益:		
			实收基金	4,673,026,955.87	0.00
			未分配利润	357,502,564.42	0.00
			所有者权益合计	5,030,529,520.29	0.00
资产合计	5,036,657,346.10	0.00	负债和所有者权益总计	5,036,657,346.10	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 06 月 30 日

单位: 元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	231,261,318.61	316,446,751.47
2	1、利息收入	3,883.33	43,663.37
3	其中: 存款利息收入	3,883.33	43,663.37
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	236,945,330.29	335,392,807.15
17	4、其他收入	-5,687,895.01	-18,989,719.05
18	二、费用	1,518,779.35	6,127,825.81
19	1、管理人报酬	1,436,683.18	5,796,591.97
20	2、托管费	82,096.17	331,233.84
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	229,742,539.26	310,318,925.66

兴业财富资产管理有限公司

2017年7月13日