

兴业财富-兴享进取 FOF1 号专项资产管理计划

运作报告

一、重要提示

资产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，但不保证本资产管理计划一定盈利。

投资有风险，资产委托人在做出投资决策前应当认真阅读本资产管理计划“资产管理合同”、“风险揭示书”等法律文件。在做出投资决策后，本资产管理计划运营状况与所投资产引致的投资风险，由资产委托人自行负担。

- 1、本报告中财务资料未经审计。
- 2、本报告期自 2017 年 07 月 1 日至 2017 年 09 月 30 日止。

二、产品基本情况

资产管理计划名称	兴业财富-兴享进取 FOF1 号专项资产管理计划
资产管理计划运作方式	不定期开放运作
资产管理合同生效日	2017 年 1 月 13 日
资产管理合同到期日	2020 年 1 月 12 日
资产管理人	兴业财富资产管理有限公司
资产托管人	兴业银行股份有限公司苏州分行
期末资产管理计划份额	5,047,492,858.26
投资范围	主要投资于各类金融工具及金融产品，包括公募基金、私募证券投资基金、信托计划、保险资产管理计划、基金公司特定资产管理计划(包括基金子公司特定资产管理计划)、期货公司资管计划、券商资管计划、商业银行理财产品、券商集合理财产品、资产支持专项计划及法律法规或中国相关监管机构允许投资的金融产品，产品投资过程中，闲置资金可用于投资流动性资产。流动性资产仅包括银行存款、银行理财和货币基金。
投资标的	兴享进取和聚 1 号 兴享进取汇利 1 号 兴享进取弘尚 1 号 兴享进取景林 1 号

	兴享进取明达 1 号 兴享进取涌峰 1 号 兴享进取高毅国鹭 1 号 兴享进取高毅利伟 1 号
穿透底层资产（如有）	
穿透底层资产融资人（如有）	无
风险缓释措施/增信措施	无
管理费率	【0.35%】
托管费率	【0.02%】
业绩报酬（如有，包括业绩比较基准、计提方式和支付方式）	无

三、主要财务指标

单位：元

产品本期收益率	3.24%
期末资产净值	5,609,882,773.31
期末单位份额净值	1.1114

四、报告期末投资组合报告

项目	金额（元）	占总资产比例（%）
证券投资	5,619,783,807.65	100.18
其中：股票	0.00	0.00
基金	5,619,783,807.65	10.49
债券	0.00	0.00
资产支持证券	0.00	0.00
权证	0.00	0.00
其他	0.00	0.00
资产合计	5,621,048,426.92	100.20
负债合计	11,165,653.61	0.20

五、报告期内资产运作情况

1、投资经理简介

周璐

从业简历：兴业财富 FOF 基金投资部投资经理。10 年金融行业从业经验，历任中国平安集团执委秘书、平安证券基金研究、海富通基金机构经理、Pegasus 产品总监。

杨梦影

从业简历：兴业财富 FOF 基金投资部投资经理。3 年金融从业经验，历任诺亚财富产品经理、朝阳永续 FOF 投资助理。

2、报告期内还本付息情况简述

本报告期内委托人分两次分别赎回 403,740,828.08 元及 208,998,012.42 元。

3、报告期内重大事项简述

本报告期内委托人于 8 月新增投资 10 亿元人民币。

报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有产品明细				
序号	产品名称	数量(份)	期末市值(元)	市值占净值比(%)
1	兴享进取高毅国鹭 1 号	500,000,000	506,100,000.00	9.02
2	兴享进取和聚 1 号	598,668,918	624,052,480.12	11.12
3	兴享进取汇利 1 号	935,158,978	1,062,808,178.50	18.95
4	兴享进取弘尚 1 号	100,000,000	96,880,000.00	1.73
5	兴享进取景林 1 号	868,867,216	1,092,948,071.01	19.48
6	兴享进取高毅利伟 1 号	500,000,000	531,150,000.00	9.47
7	兴享进取明达 1 号	844,389,211	1,048,309,205.46	18.69
8	兴享进取涌峰 1 号	598,412,698	657,535,872.56	11.72
	合计		5,619,783,807.65	100.18

4、产品其他重大事项简述

无。

5、产品主要风险简述

委托财产可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使计划资产面临潜在的风险。

1、证券投资基金投资风险，主要包括：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

（2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

（3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

2、债券投资风险，主要包括：

（1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。

（2）债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

（3）债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

（二）管理风险

在实际操作过程中，资产管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势的判断，其精选出的投资品种的业绩表现不一定持续优于其他投资品种。

（三）流动性风险

在市场流动性不足的情况下，资产管理人可能无法迅速、低成本地调整投资组合，从而对委托财产收益造成不利影响。

在资产委托人提出追加或减少委托财产时，可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

（四）信用风险

本委托财产交易对手方违约，导致委托财产损失。

（五）特定的投资方法及委托财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

本投资组合为灵活配置型组合，资产管理人可在资产配置层面采取较为灵活的策略。因此，投资经理的判断可能与市场的实际表现有一定偏离，从而带来对投资收益不利影响的风险。

本计划有可能投资于信托计划、期货公司资管计划、私募证券投资基金、保险资产管理计划、基金公司特定资产管理计划（包括基金子公司特定资产管理计划）、券商资管计划、商业银行理财产品、券商集合理财产品、公募基金、资产支持专项计划及法律法规或中国相关监管机构允许投资的金融产品，上述产品具有所投资的特定投资对象可能引起的特定风险（包括但不限于信用风险、道德风险、管理风险等），流动性较差或存在赎回资金到账时间不确定的风险，同时还可能存在本金损失的风险。

（六）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在委托财产的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记结算机构、销售机构等。

（七）关联交易风险

本计划财产可能投资于资产管理人、资产管理人股东或其关联方发行的资产管理计划或专户等金融产品，从而带来潜在的关联交易的风险。

（八）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响市场的运行，可能导致委托财产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致资产委托人利益受损。

兴业财富资产管理有限公司

2017年10月15日