

兴业财富-兴金 479 号特定多客户专项资产管理计划

重大风险事件报告

尊敬的委托人：

兴业财富-兴金 479 号特定多客户专项资产管理计划主要投资于兴业财富-兴隆 89 号 2 期特定多客户专项资产管理计划，兴隆 89 号 2 期特定多客户专项资产管理计划主要投资于天风证券股份有限公司管理的天风证券天权 25 号定向资产管理计划，该定向资管计划投资标的为股票质押式回购业务，对应标的股票为奥特佳（代码：002239.SZ），融资人为上市公司实际控制人王进飞。

一、项目存续期内所投资资产的风险情况

2018 年 1 月 15 日，“奥特佳”跌破预警线，次日融资人王进飞进行现金补仓 1,900 万元，解除预警；

2018 年 1 月 17 日，“奥特佳”再次跌破预警线，1 月 19 日融资人王进飞补充质押 1,369,284 股，解除预警；

2018 年 2 月 5 日、3 月 2 日及 3 月 15 日标的证券又 3 次跌破预警线，后均因股价上涨自动解除预警，在此期间，融资人王进飞未采取补仓等任何解救措施；

2018 年 3 月 23 日，标的证券跌破平仓线，融资人王进飞亦未采取任何措施；

2018 年 04 月 02 日奥特佳发布停牌公告，以停牌前一日股价计算，股票预警价格为 3.8 元，平仓价格为 3.54 元。融资人履约担保比例为 1.48，低于预警线 1.55，高于平仓线 1.45。目前，项目标的证券“奥特佳”依然跌破预警线。

我司于 2018 年 08 月 09 日向兴隆 89 号 2 期产品下层天权 25 号资管计划的管理人天风证券股份有限公司出具了平仓指令，要求其于标的证券复牌之日起，通过大宗交易或二级市场直接卖出等方式对该笔违约交易进行强制平仓。

二、重大风险情况说明

我司于 2018 年 08 月 17 日接到天风证券《关于天风证券天权 25 号定向资产管理计划的告知函》的通知：“根据清算文件显示，王进飞质押的 68,596,640 股奥特佳股票已于 2018 年 8 月 16 日被江苏省南通市中级人民法院司法冻结。”我司对应做出如下应急处置：

1、2018年8月17日我司向天风证券发出投资指令，要求天风证券将融资人在其资金账户中的1900万元保证金划转至天权25号定向资管计划的托管户，天风证券已于2018年8月20日完成上述操作；

2、根据天风证券与融资人签订的《股票质押式回购交易业务协议》第22条约定：“质押期间，甲方质押的标的证券由流通股转变为限售股或其他影响该标的证券处置条件的”，天风证券有权要求融资人提前购回标的证券。我司已要求天风证券向融资人发送提前回购标的证券的通知，天风证券已于2018年8月21日通过邮件、短信和电话方式通知融资人。

后续我司拟采取下述处理方案：

公司已成立专项工作小组，工作小组专项负责跟踪融资人及其关联方的动态，调查其资产状况，并尽快促使天风证券向融资人提起诉讼，对融资人王进飞名下资产进行财产保全，最大化程度维护委托人利益。

三、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。

兴业财富资产管理有限公司

2018年8月29日