

兴业财富-稳富 31 号单一客户专项资产管理计划

2018 年第 4 季度季度报告

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。

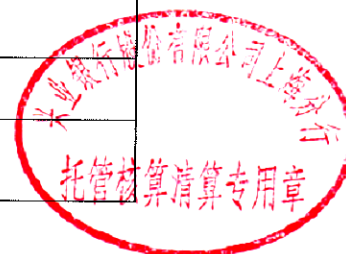
投资有风险，资产委托人在做出投资决策前应当认真阅读本资产管理计划“资产管理合同”、“风险揭示书”等法律文件。在做出投资决策后，本资产管理计划运营状况与所投资产引致的投资风险，由资产委托人自行承担。

1、本报告中财务资料未经审计。

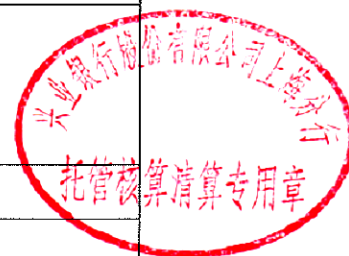
2、本报告期自 2018 年 10 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日止。

二、产品基本情况

资产管理计划名称	兴业财富-稳富 31 号单一客户专项资产管理计划
资产管理计划运作方式	开放式
资产管理合同生效日	2017-09-12
资产管理合同到期日	2020-09-22
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
期末资产管理计划份额	200,000,000



投资范围	本资产管理计划投资于如下品种： (1) 现金及货币市场工具：包括现金、同业存款、协议存款、同业存单、债券正回购、债券逆回购、货币型基金。 (2) 债券及固定收益品种：包括国债、政策性金融债、地方政府债、各类金融债（包括商业银行、非银行金融机构、证券公司等各类金融机构发行的各类债券）、超短融及短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、企业债、银行间同业存单 NCD、公司债（包括面向公众投资者、合格投资者公开发行的以及非公开发行的公司债券）、金融机构次级债或二级市场资本债、可转债（含可交换债和可分离债）、资产证券化产品（资产支持证券、资产支持票据等）、项目收益债、证券公司收益凭证以及其他债券。 (3) 其他固定收益类产品：债券型基金及货币基金
投资标的	17 如皋 02 17 皋投债 17 皋沿 01
穿透底层资产（如有）	无
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	0.08%/年
托管费率	0.02%/年
业绩报酬（如有，包括	无



业绩比较基准、计提方式和支付方式)	
--------------------	--

三、管理人履职情况

- 1、在报告期内，管理人以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托财产。
- 2、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的委托财产与旗下基金财产、其他委托财产和资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。
- 3、保存委托财产管理业务活动的全部会计资料，并妥善保管有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料。

四、主要财务指标

单位：元

产品本期利润	3,053,074.29
期末资产净值	203,776,062.46
期末单位份额净值	1.0788

五、报告期末投资组合报告

项目	金额（元）	占总资产比例（%）
权益投资	/	/
其中：股票	/	/
基金投资	/	/
固定收益投资	203,717,401.37	99.93
其中：债券	/	/

资产支持证券	203,717,401.37	99.93
金融衍生品投资	/	/
买入返售金融资产	/	/
其中：买断式回购的买入返售金融资产	/	/
银行存款和结算备付金合计	146,657.1	0.07
其他资产	/	/
合计	203,864,058.47	100.00

六、资产管理计划投资表现

报告期间资产管理计划各笔投资未分配收益。所有投资标的运作良好，均未发生本息偿付违约情况。

七、资产管理计划投资收益分配情况

报告期间资产管理计划未发生收益分配与委托人提取。

八、投资经理变更情况

报告期资管计划投资经理未发生变更

投资经理简介：

崔迪，女，现任投资经理，法国国立应用科学学院工业工程硕士，八年金融行业从业经验，曾任职浦发银行总行私人银行部，从事资管产品的开发与投资管理工作。于2017年5月加入兴业财富资产管理有限公司投资银行部，担任投资经理，主要从事资管产品的设计、发行与投资交易等工作。

沈宵，男，现任投资经理，日本早稻田大学金融工程硕士，2012年2月至2014年6月于ZAIS Group资产管理有限公司从事资产证券化产品的投资工作，2014年7月至2016年4月于海通证券股份有限公司从事资产证券化产品的设计、定价、发行与交易，2016年5月



加入兴业财富资产管理有限公司，任投资经理。拥有美国金融师协会特许金融分析师(CFA)资格。

九、重大关联交易情况

报告期内无重大关联交易。

十、产品其他重大事项简述

无

十一、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）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。

（二）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。

（三）信用风险

本委托财产交易对手方违约，导致委托财产损失。

（四）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资产管理公司、登记结算机构、销售机构、证券登记结算机构等。

（五）特定的投资方法及委托资产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险。

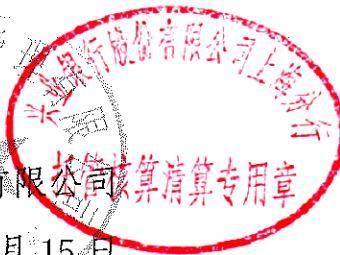
1、本计划采取的投资策略可能存在使计划收益不能达到投资目标或者本金损失的风险。

2、本资产管理计划投资的资产支持证券等资产可能存在管理人、发行人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。

（六）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
2019年1月15日



附件：托管人履职报告

附件、托管人履职报告

兴业财富-稳富 31 号单一客户专项资产管理计划托管报告

（报告期：2018 年 4 季度）

本托管人依据兴业财富-稳富 31 号单一客户专项资产管理计划的合同，自计划成立日起托管“兴业财富-稳富 31 号单一客户专项资产管理计划”（以下简称“本计划”）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关法律法规和本计划合同的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本计划委托人利益的行为。

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规和本计划合同的规定，对管理人在本计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、计划费用开支等方面进行必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本计划委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告期《兴业财富-稳富 31 号单一客户专项资产管理计划资产管理报告》中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

托管人：兴业银行股份有限公司上海分行

2019 年 03 月 20 日

托管核算清算专用章