

兴业财富-兴金 390 号单一客户专项资产管理计划

2019 年第 3 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 2019 年 7 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日止。

二、产品基本情况

资产管理计划名称	兴业财富-兴金 390 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	2016-11-25
资产管理合同到期日	2021-11-25
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	118,954,900.00

投资范围	本资产管理计划的委托财产主要投资于兴业财富资产管理有限公司作为管理人设立并管理的“国祯环保污水处理收费收益权资产支持专项计划”项下优先级份额。 投资比例占资产总值的 0-100%。在法律法规允许的条件下，委托人、管理人和托管人可另行协商更新投资范围，并签署补充协议。
投资标的	“国祯环保污水处理收费收益权资产支持专项计划”项下优先级份额
穿透底层资产（如有）	合肥朱砖井污水处理有限公司、故城国祯污水处理有限公司、遵化国祯污水处理有限公司、淮北中联环水环境有限公司、泗阳县华海水处理有限公司所运营污水处理厂的污水处理费收入
穿透底层资产融资人（如有）	合肥朱砖井污水处理有限公司、故城国祯污水处理有限公司、遵化国祯污水处理有限公司、淮北中联环水环境有限公司、泗阳县华海水处理有限公司
风险缓释措施/增信措施	“国祯环保污水处理收费收益权资产支持专项计划”项下优先级份额由合肥朱砖井污水处理有限公司、故城国祯污水处理有限公司、遵化国祯污水处理有限公司、淮北中联环水环境有限公司、泗阳县华海水处理有限公司提供差额补足，由安徽环保节能科技股份有限公司提供担保
管理费率	0.1%/年
托管费率	0.05%/年
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、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，并妥善保存有关的合同、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	1,432,542.43
期末资产净值	118,964,248.22
期末单位份额净值	1.000

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	118,954,900.00	99.79
其中：债券		
资产支持证券	118,954,900.00	99.79
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	251,909.80	0.21
应收利息	50.30	0.00
合计	119,206,860.10	100.00

六、资产管理计划投资表现

报告期间资产管理计划期间累计收到投资收益 1,529,935.08 元。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

资产委托人在资产管理计划报告期内共分配一次：累计提取投资收益 1,430,884.69 元，累计提取投资本金 12,448,800 元。

八、投资经理变更情况

2019 年 7 月 2 日，本资管计划投资经理由孙霖变更为李茂文。

李茂文简历如下：李茂文，男，中国国籍，山东大学数学学士、金融学硕士，十年证券基金行业从业经验。曾任德邦证券股份有限公司固定收益部业务董事，主要从事公司债、企业债、资产支持证券等固定收益证券的发行和投资工作；2015 年 3 月加入兴业财富资产管理有限公司，主要从事非标债权、债券、资产支持证券等固定收益产品的发行和投资工作。

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

2019年9月20日，国祯环保发布《关于控股股东转让股权的公告》，公司控股股东安徽国祯集团股份有限公司（简称“国祯集团”，目前持股32.46%）与长江生态环保集团有限公司（简称“长江环保集团”，目前持股5.23%）和三峡资本控股有限责任公司（简称“三峡资本”，目前持股6.40%）于2019年9月19日在安徽省合肥市签署了《股权转让协议》，转让方国祯集团拟将其持有的公司15%股份以协议转让方式转让给受让方长江环保集团和三峡资本，标的股份转让价格为12.70元/股，合计转让价格为12.77亿元，其中长江环保集团和三峡资本的控股股东均为中国长江三峡集团有限公司。

转让完成后，中国长江三峡集团有限公司将成为国祯环保间接第一大股东。国祯环保本次股东变更事项所带来的业务发展机遇，将有助于提升国祯环保的综合实力，从而提升对本专项计划的偿债保障能力。

本次转让尚需履行相关审批程序。

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10月29日

