

财富1号集合资产管理计划(展期)资产管理报告

(2016年07月01日-2016年9月30日)

### 第一节 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人建设银行于2016年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

### 第二节 集合资产管理计划概况

名称:	财富1号集合资产管理计划(展期)
类型:	非限定型
成立日:	2013年05月31日
报告期末份额总额:	5,428,895.65份
业绩基准:	上证指数×60% + 上证基金指数×40%

管理人：                    财富证券有限责任公司

托管人：                    中国建设银行股份有限公司

### 第三节 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

#### 一、 主要财务指标（单位：人民币元）

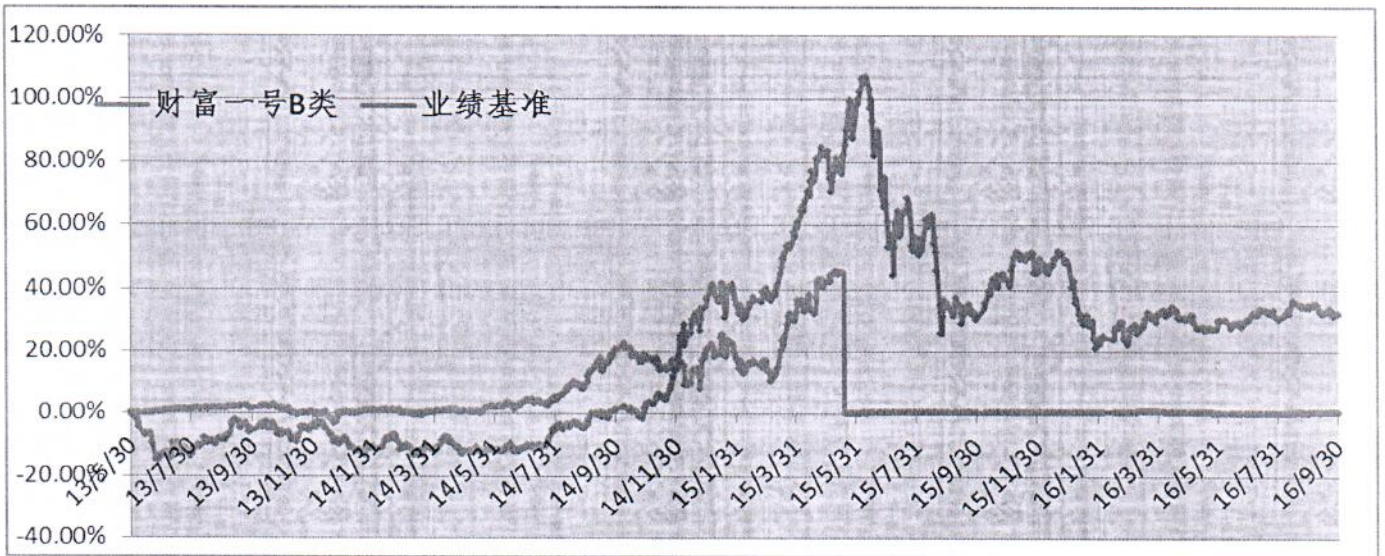
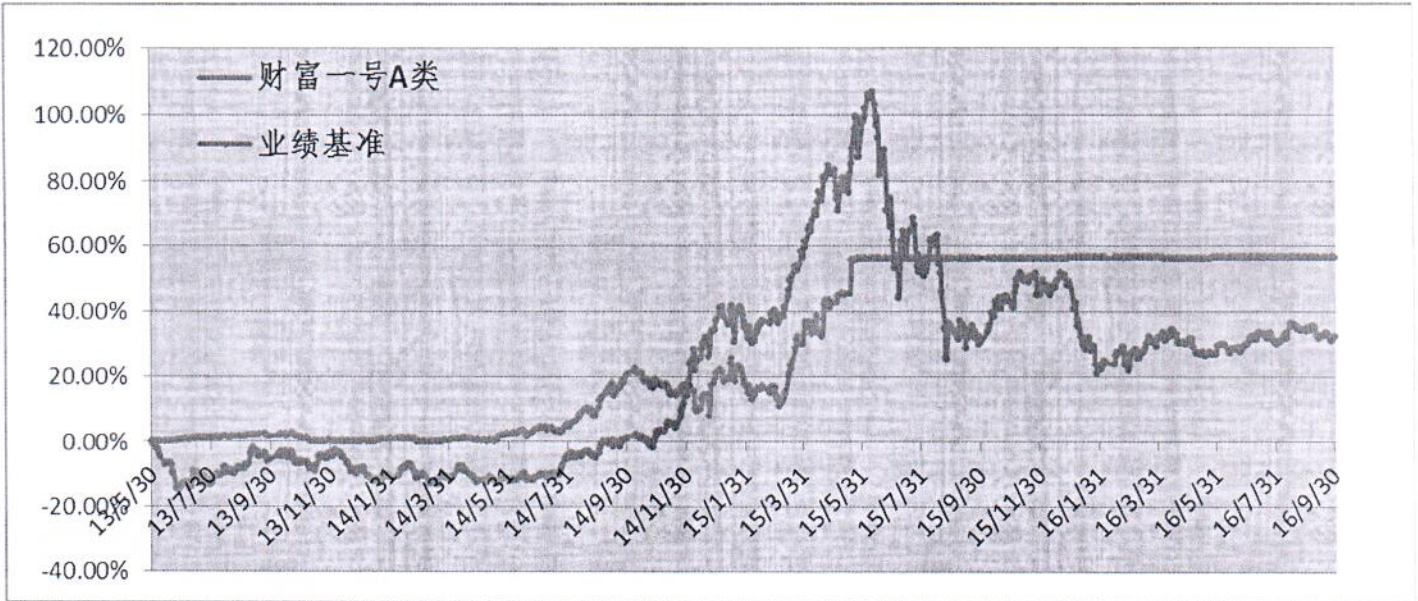
本期已实现收益	9,067.77
本期利润	6,588.77
每份额本期已实现收益	0.0017
期末资产净值	5,446,235.80
期末每份额净值	1.0032
期末每份额累计净值	1.4589

#### 二、 报告期每份额累计净值增长率与业绩基准收益率的比较

阶段	收益率		
	财富1号A	比较基准	超额收益率
2016.07.01-2016.09.30	0.08%	1.82%	-1.74%

阶段	收益率		
	财富1号B	比较基准	超额收益率
2016.07.01-2016.09.30	0.12%	1.82%	-1.70%

三、 集合计划每份额累计净值增长率与业绩基准收益率的历史走势  
对比图



## 第四节 管理人报告

### 一、 业绩表现

截止 2016 年 09 月 30 日，本集合计划 A 类单位净值 1.0032 元，累计单位净值 1.5640 元，本期单位净值增长率 0.12%，累计净值增长率 0.077%；B 类单位净值 1.0032 元，累计单位净值 1.0032 元，本期单位净值增长率 0.12%，累计净值增长率 0.12%。

### 二、 管理人工作报告

#### 1、 投资回顾

本季度财富 1 号仍保留债券国开 1302，仓位 7.29%，目的尽量让资金不闲置，提升资金收益率，便于客户赎回。此外，财富 1 号本季度未进行其他市场买卖与操作，截止 2016 年 9 月 30 日，产品单位净值为 1.0032。

#### 2、 投资展望

我们认为尽管楼市调控加码但资金是否回流股市仍有待时间检验，另外美国大选、12 月加息预期以及英国脱欧实质影响等众多因素也将给市场带来一定的影响。我们预计四季度市场持续性存忧，加之市场流动性边际收窄但绝对量仍巨大，故市场上下两难，预计将继续维持区间震荡，但不乏结构性行情的存在。行业配置上持续看好供给侧改革主线方向及前期调整较为充分的部分行业龙头，如：1、基本面有支撑且行业层面有推动因素的标的，如民办教育、积极财政下的 PPP 等；2、部分行业调整充分且有较强诉求的龙头；3、关注三季度业绩预增较高的标的。

## 第五节 托管人报告

### 财富 1 号集合资产管理计划

2016 年 07 月 01 日-2016 年 09 月 30 日托管人报告

中国建设银行根据《财富 1 号集合资产管理计划合同（展期）》和《财富 1 号集合资产管理计划托管协议》，自 2013 年 05 月 31 日起托管财富 1 号集合资产管理计划（展期）（以下称“本计划”）资产。

2016 年第三季度期间，中国建设银行及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

2016 年第三季度期间，中国建设银行对管理人的投资运作行为按合同约定进行了监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

2016 年第三季度期间，中国建设银行对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

中国建设银行复核了本计划资产管理报告(2016 年第三季度报告)中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。

中国建设银行投资托管业务部

2016 年 10 月 21 日

## 第六节 集合资产管理计划财务报告

### 一、集合资产管理计划资产负债表

日期：2016-09-30

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
<b>资 产：</b>			<b>负 债：</b>		
银行存款	5,041,794.08	7,518,890.99	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	2,660.80	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	397,269.00	800,160.00	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	397,269.00	800,160.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00	应付管理人报酬	0.00	0.00
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	903.84	1,478.04
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	17,061.02	47,854.81	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	其他负债	8,984.46	12,000.00
应收申购款	0.00	0.00	<b>负债合计</b>	<b>9,888.30</b>	<b>13,478.04</b>
其他资产	0.00	0.00			
			<b>所有者权益：</b>		
			实收基金	8,247,242.92	12,524,746.77
			未分配利润	-2,801,007.12	-4,168,658.21
			<b>所有者权益合计</b>	<b>5,446,235.80</b>	<b>8,356,088.56</b>
<b>资产合计</b>	<b>5,456,124.10</b>	<b>8,369,566.60</b>	<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>5,456,124.10</b>	<b>8,369,566.60</b>

## 二、集合资产管理计划经营业绩表

日期：2016年07月01日-2016年09月30日

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	12,383.87	41,483.24
2	1、利息收入	14,862.87	49,587.24
3	其中：存款利息收入	9,416.47	32,865.79
4	债券利息收入	5,446.40	16,721.45
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	-1,978.00
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	0.00	-1,978.00
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	-2,479.00	-6,126.00
17	4、其他收入	0.00	0.00
18	二、费用	5,795.10	37,275.44
19	1、管理人报酬	0.00	0.00
20	2、托管费	2,778.42	9,604.75
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	0.00	1.23
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	3,016.68	27,669.46
26	三、利润总和	6,588.77	4,207.80

## 第七节 投资组合报告

### 一、 期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例
股 票	0.00	0.00%
债 券	397,269.00	7.28%
基 金	0.00	0.00%
其中：货币市场基金	0.00	0.00%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
银行存款及结算备付金合计	5,041,794.08	92.41%
其他资产	17,061.02	0.31%
资产合计	5,456,124.10	100.00%

备注：因四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 二、 期末市值占集合计划资产净值前五名证券明细

股票

无

基金

无

债券

序号	证券代码	证券名称	持仓量	当前市值	占净值比例
1	018002	国开 1302	3,700	397,269.00	7.29%



## 第八节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	5,572,920.56
红利再投资份额	0.00
报告期间参与份额	0.00
报告期间退出份额	144,024.91
报告期末份额总额	5,428,895.65

## 第九节 信息披露的查阅方式

网址：<http://www.cfzq.com>

信息披露电话：0731-84403481（服务时间为工作日上午  
9:00-11:30，下午13:00-17:00）

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人财富证券有限责任公司。

财富证券有限责任公司

2016年10月25日

## 财富1号集合资产管理计划(展期)

### 2016年三季度托管人报告

中国建设银行根据《财富1号集合资产管理计划(展期)》和《财富1号集合资产管理计划(展期)托管协议》，自2013年5月31日起托管财富1号集合(展期)(以下称“本计划”)资产。

2016年三季度，中国建设银行及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

2016年三季度，中国建设银行对管理人的投资运作行为按合同约定进行了监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

2016年三季度，中国建设银行对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

中国建设银行复核了本计划资产管理报告(2016年三季度报告)中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。

中国建设银行股份有限公司资产托管业务部

2016年10月24日

