

兴鑫-睿郡众享 1 号资产管理计划

2020 年第 3 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	兴鑫-睿郡众享 1 号资产管理计划
基金编号	SCL700
基金管理人	兴证期货有限公司
基金托管人（如有）	兴业银行股份有限公司
投资顾问（如有）	上海睿郡资产管理有限公司
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2018 年 04 月 18 日
报告期末基金份额总额（份）	18,660,952.43
投资目标	在投资期限内，积极获取股票、债券、新股申购等各种投资收益，在严格控制风险的前提下，谋求委托财产的稳定增值。
投资策略	本计划采取灵活配置投资策略，以基本面选股策略为核心进行股票精选，可通过股票仓位变动获取择时超额收益，并辅以各类具有安全垫特性的增强投资策略。
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本资产管理计划属于 R4 风险等级的资产管理计划品种，适合风险识别、评估、承受能力为 C4 型和 C5 型的合格投资者。

2、基金净值表现

阶段	净值增长率（%）	净值增长率标准差（%）	业绩比较基准收益率（%）	业绩比较基准收益率标准差（%）
当季	6.36	-	-	-
自基金合同生效起至今	39.80	-	-	-

☐ 无分级 ☐ 二级基金 ☐ 三级基金

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2020 年 7 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日（元）
本期已实现收益	1,533,333.63
本期利润	2,273,558.51

期末基金资产净值	24,967,479.40
期末基金份额净值	1.3380

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额 (人民币)	占基金总资产的 比例 (%)
1	权益投资	19,196,785.70	72.49
	其中：普通股	19,196,785.70	72.49
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	4,924,105.46	18.60
	其中：债券	4,924,105.46	18.60
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	2,345,737.88	8.86
-	其他	13,752.59	0.05
-	-	-	-
	合计	26,480,381.63	100.00

4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	13,452,912.33	53.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	809,340.00	3.24
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00

J	金融业	745,200.00	2.98
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	268,926.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	880,850.00	3.53
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	16,157,228.33	64.71

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
港股通	3,039,557.37	12.17
-	-	-
合计	3,039,557.37	12.17

5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	23,906,556.93
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	5,245,604.50
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	18,660,952.43

6、管理人报告

6.1 报告期内基金投资目标和业绩表现

本计划投资目标：在投资期限内，积极获取股票、债券、新股申购等各种投资收益，在严格控制风险的前提下，谋求委托财产的稳定增值。截止 2020 年 9 月 30 日本基金期末基金单位净值为 1.3980 元，期末基金累计单位净值 1.3980 元。

6.2 投资经理及投资顾问的指定

本计划有两位投资经理，分别为廉正先生和施海先生，本计划本报告期内未发生变更。

廉正先生，工学学士、产业经济学硕士，现任兴证期货资产管理部总经理兼

投资经理，期货从业资格编码为 F3054039。2011 年从业以来先后从事宏观及商品研究、基于基本面的投资管理、量化策略开发与投资等，擅长大类资产配置与宏观对冲。曾获得《中国金属通报》2012 年度有色金属期货“十佳分析师”称号；《期货日报》、《证券时报》主办的“第七届中国最佳期货经营机构暨最佳分析师评选”中荣获“最佳有色金属期货分析师”第二名；上海期货交易所优秀分析师评选中获“2013 年度铜期货优秀分析师奖”。

施海先生，1983 年毕业于上海交通大学，期货从业资格编码为 F0273014，投资咨询从业证书号为 Z0011937。2011 年加入兴证期货有限公司，从事研究员工作，2019 年 2 月担任资产管理部投资经理。施海先生从事期货研究 25 年，主要从事天然橡胶期货研究，多次被上海期货交易所评为天然橡胶优秀分析师，并担任天然橡胶讲师。

本计划投资经理符合法律法规规定的以下条件：

- (1) 已取得基金从业资格；
- (2) 具有 3 年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验；
- (3) 具有良好的诚信记录及职业操守，且最近 3 年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。。

本计划投资顾问为上海睿郡资产管理有限公司，在本计划运作期间，投资顾问勤勉尽责为本计划提供投资建议，与我司不存在利益输送及其他不合规行为。投资顾问为满足以下条件的私募证券投资基金管理人：

- (1) 在证券投资基金业协会登记满 1 年、无重大违法违规记录的会员；
- (2) 具备 3 年以上连续可追溯证券、期货投资管理业绩且无不良从业记录的投资管理有限公司不少于 3 人；
- (3) 中国证监会规定的其他条件。

6.3 报告期内基金估值程序

根据监管相关规定及基金合同约定，本计划管理人严格按照监管相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

6.4 报告期内管理人履职情况

公司在资产管理业务经营过程中，将严格遵守以下管理人的职责：

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理、分别记账，进行投资；
- (3) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；
- (4) 依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；
- (5) 办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (6) 保存受托资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (7) 以管理人名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定的其他职责。

6.5 文件存放地点

兴证期货有限公司

地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 8 楼

联系人：崔文婷

服务电话：021-20370952

E-MAIL: cuiwt@xzfutures.com

投资者对本报告书如有任何疑问，可以咨询管理人兴证期货有限公司。

6.6 报告期内其他说明情况

本计划本报告期内未进行利润分配、投资经理未变更、未发生关联交易、未发生损害投资者利益的事件及其他不符合法律法规的事项。公司将继续遵守相关法律法规要求，严格履行管理人职责。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

