

兴证期货-兴享开元 1 号集合资产管理计划

2020 年第 3 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	兴证期货-兴享开元 1 号集合资产管理计划
基金编号	SLP721
基金管理人	兴证期货有限公司
基金托管人（如有）	东方证券股份有限公司
投资顾问（如有）	元胜投资管理（上海）有限公司
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020 年 9 月 3 日
报告期末基金份额总额（份）	32,001,049.97
投资目标	在投资期限内，在严格控制风险的前提下，力求委托财产的保值增值。
投资策略	资产管理人聘请元胜投资管理（上海）有限公司（以下简称“元胜投资”）作为投资顾问，为本计划提供投资建议。资产管理人将参考投资顾问的投资建议进行本计划的投资运作。元胜投资主要运用元盛集团开发的中国多元化投资策略（以下简称“CDP”），进行期货的分散化趋势投资。元盛中国多元化投资策略（简称“CDP”），由元盛集团根据海外多年的低频量化期货交易策略的经验开发。该策略投资于国内期货交易所流动性较好的期货品种，同时根据资产管理人的需要进行流动性管理。
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	资产管理计划的风险收益级别：【R4 中高风险，适合专业投资者和风险承受能力为 C4、C5 的普通投资者，并符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准。】

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	-1.80	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.80	-	-	-

√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9月3日至2020年9月30日(元)
本期已实现收益	-334,713.15
本期利润	-575,200.84
期末基金资产净值	31,425,849.13
期末基金份额净值	0.9820

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	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	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	31,472,941.17	100.00
-	其他	1.20	0.00
-	-	-	-
	合计	31,472,942.37	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	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
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	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
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	0.00	0.00
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	0.00	0

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	-	-
-	-	-
合计	-	-

5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	32,001,049.97
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	0.00
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	32,001,049.97

6、管理人报告

6.1 报告期内基金投资决策依据和业绩表现

本计划投资决策依据：本资产管理计划主策略以定量和定性相结合的方式，通过多策略分散投资，在严格控制风险的情况下，实现资产的稳健增值。截止

2020年9月30日本基金期末基金单位净值为0.9820元，期末基金累计单位净值0.9820元。

6.2 投资经理及投资顾问的指定

本计划投资经理为廉正，期货从业资格编码：F3054039，本计划本报告期内未发生变更。

投资经理从业经验：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。2011年至2015年9月历任新潮期货有限公司研究所资深分析师、资产管理部投资经理、部门副经理；2015年9月至2018年11月任西南期货有限公司资产管理部总经理兼投资经理；2018年11月加盟兴证期货资产管理部。长期从事宏观经济、商品及大类资产配置研究和投资工作。

本计划投资经理符合法律法规规定的以下条件：

- (1) 已取得从业资格；
- (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。

本计划投资顾问为元胜投资管理（上海）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人员不少于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

