

兴诚-宁泉致远3号资产管理计划

2020年4季度报告



基金管理人：兴证期货有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司



1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	兴诚-宁泉致远 3 号资产管理计划
基金编码	SCY196
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）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2018-06-06
报告期末基金份额总额（份）	112,768,503.26

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	-1.61	-	-	-
自基金合同生效起至今	50.38	-	-	-

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率=（本季度末累计净值-上季度末累计净值）/上季度末净值

如为分级基金，应按级别分别列示。

表中指标均以不带百分号数值形式填写，请保留至小数点后2位。

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2020-10-01	至	2020-12-31	(元)
本期已实现收益				58,930,213.11
本期利润				-2,774,268.07
期末基金资产净值				169,581,710.55
期末基金份额净值				1.5038

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

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	占基金总资产
----	----	----	--------

		人民币	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	169,980,484.72	100.00
8	其他	2,122.92	0.00
	合计	169,982,607.64	100.00

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

本报“其他”项中列示的主要包括期货交易保证金、各类应收款等，具体情况见《其他资产构成报表》。

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

	技术服务业		
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	0.00

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

4.2.2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例(%)
基础材料	0.00	0.00
消费者非必需品	0.00	0.00
消费者常用品	0.00	0.00
能源	0.00	0.00
金融	0.00	0.00
医疗保健	0.00	0.00
工业	0.00	0.00
信息技术	0.00	0.00
电信服务	0.00	0.00
公用事业	0.00	0.00
房地产	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：

以上分类采用全球行业标准（GICS）。

5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	112,768,503.26
-------------	----------------

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	112,768,503.26

注：

如为分级基金，应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

6、管理人报告

6.1 报告期内基金投资策略和业绩表现

本计划投资策略：本资产管理计划主要投向上海宁泉资产管理有限公司作为管理人发行的私募证券投资基金。委托人签署本资产管理合同即表明同意本资产管理计划投资于本公司或与本公司有关联关系的公司发行的证券或其他金融产品。截止 2020 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 1.5038 元，期末基金累计单位净值 1.5038 元。

6.2 投资经理

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。

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) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (6) 保存受托财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。本计划于 2020 年 12 月 31 日正式终止并进入清算阶段，为最大限度保证资产委托人的利益，清算完成后将按照合同约定进行分配。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

兴证期货有限公司

附：其他资产构成报表

金额单位：元

序号	名称	金额
1	交易保证金	0.00
1.1	其中：期货交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收基金红利	0.00
5	应收利息	2,122.92
6	应收申购款	0.00
7	其他应收款	0.00
8	待摊费用	0.00
9	其他	0.00
10	合计	2,122.92

11