



## 兴诚-观富红杉 1 期资产管理计划

2021 年第 1 季度报告



### 1、基金基本情况

| 项目          | 信息                                                    |
|-------------|-------------------------------------------------------|
| 基金名称        | 兴诚-观富红杉 1 期资产管理计划                                     |
| 基金编码        | SCL109                                                |
| 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）    | 观富（北京）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 4 月 4 日                                        |
| 期末基金总份额（万份） | 1,120.010792                                          |
| 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        | 本计划为股票类产品，采用的策略为灵活资产配置+主动投资+择时对冲。                     |
| 业绩比较基准（如有）  | -                                                     |
| 风险收益特征      | 本资产管理计划属于中高风险的资产管理计划品种。                               |

### 2、基金净值表现

| 阶段             | 净值增长率<br>(%) | 净值增长率标准<br>差 (%) | 业绩比较基准收益<br>率 (%) | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>(%) |
|----------------|--------------|------------------|-------------------|-------------------------|
| 当季             | -2.89        | -                | -                 | -                       |
| 自基金合同生效<br>起至今 | -3.98        | -                | -                 | -                       |

☒ 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        | 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日 (元) |
|-----------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益   | 496,464.80                           |
| 本期利润      | -321,564.74                          |
| 期末基金净资产   | 10,754,135.31                        |
| 报告期期末单位净值 | 0.9602                               |

### 4、投资组合情况

#### 4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

| 项目              |                   | 金额            |
|-----------------|-------------------|---------------|
| 现金类资产           | 银行存款              | 27,398.86     |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 股权投资              | 0.00          |
|                 | 其中：优先股            | 0.00          |
|                 | 其他股权类投资           | 0.00          |
| 上市公司定向增发投资      | 上市公司定向增发股票投资      | 0.00          |
| 新三板投资           | 新三板挂牌企业投资         | 0.00          |
| 境内证券投资规模        | 结算备付金             | 0.00          |
|                 | 存出保证金             | 10,768,889.94 |
|                 | 股票投资              | 0.00          |
|                 | 债券投资              | 0.00          |
|                 | 其中：银行间市场债券        | 0.00          |
|                 | 其中：利率债            | 0.00          |
|                 | 其中：信用债            | 0.00          |
|                 | 资产支持证券            | 0.00          |
|                 | 基金投资（公募基金）        | 0.00          |
|                 | 其中：货币基金           | 0.00          |
|                 | 期货及衍生品交易保证金       | 0.00          |
|                 | 买入返售金融资产          | 0.00          |
|                 | 其他证券类标的           | 0.00          |
| 资管计划投资          | 商业银行理财产品投资        | 0.00          |
|                 | 信托计划投资            | 0.00          |
|                 | 基金公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00          |
|                 | 保险资产管理计划投资        | 0.00          |
|                 | 证券公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00          |
|                 | 期货公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00          |
|                 | 私募基金产品投资          | 0.00          |
|                 | 未在协会备案的合伙企业份额     | 0.00          |
| 另类投资            | 另类投资              | 0.00          |
| 境内债权类投资         | 银行委托贷款规模          | 0.00          |
|                 | 信托贷款              | 0.00          |
|                 | 应收账款投资            | 0.00          |
|                 | 各类受（收）益权投资        | 0.00          |
|                 | 票据（承兑汇票等）投资       | 0.00          |

|        |         |                               |
|--------|---------|-------------------------------|
|        | 其他债权投资  | 0.00                          |
| 境外投资   | 境外投资    | 0.00                          |
| 其他资产   | 其他资产    | 应收股利：8540.00；<br>应收利息：720.13； |
| 基金负债情况 | 债券回购总额  | 0.00                          |
|        | 融资、融券总额 | 0.00                          |
|        | 其中：融券总额 | 0.00                          |
|        | 银行借款总额  | 0.00                          |
|        | 其他融资总额  | 0.00                          |

#### 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：万份/万元

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,220.015773 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 0            |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 100.004981   |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0            |
| 期末基金总份额（万份）               | 1,120.010792 |

## 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 2021 年 03 月 31 日本基金期末基金单位净值为 0.9602 元，期末基金累计单位净值 0.9602 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。。

本计划投资顾问为观富（北京）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。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

15

15