

# 兴证期货-兴珑全天候 FOF 集合资产管理计划

## 2022 年第 2 季度报告

### 1、基金基本情况

| 项目                           | 信息                                                           |
|------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| 基金名称                         | 兴证期货-兴珑全天候 FOF 集合资产管理计划                                      |
| 基金编码                         | STA119                                                       |
| 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）                     | -                                                            |
| 基金运作方式                       | 开放式                                                          |
| 基金成立日期                       | 2021 年 11 月 19 日                                             |
| 期末基金总份额（万份）/<br>期末基金实缴总额（万元） | 1,900.918759                                                 |
| 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                         | 以定量和定性相结合的方式选择和组合子基金，通过多策略分散投资，在严格控制风险的情况下，实现 FOF 的稳健增值。     |
| 业绩比较基准（如有）                   | 业绩比较基准：无                                                     |
| 风险收益特征                       | 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<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             | -0.74        | -                | -                 | -                       |
| 自基金合同生效<br>起至今 | -5.76        | -                | -                 | -                       |

☒ 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        | 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日 (元) |
|-----------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益   | -627,820.12                          |
| 本期利润      | -133,320.47                          |
| 期末基金净资产   | 17,914,624.72                        |
| 报告期期末单位净值 | 0.9424                               |

#### 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              | 47,832.44                                                                                                                                             |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 股权投资              | -                                                                                                                                                     |
|                 | 其中：优先股            | -                                                                                                                                                     |
|                 | 其他股权类投资           | -                                                                                                                                                     |
| 上市公司定向增发投资      | 上市公司定向增发股票投资      | -                                                                                                                                                     |
| 新三板投资           | 新三板挂牌企业投资         | -                                                                                                                                                     |
| 境内证券投资规模        | 结算备付金             | 618,533.28                                                                                                                                            |
|                 | 存出保证金             | -                                                                                                                                                     |
|                 | 股票投资              | -                                                                                                                                                     |
|                 | 债券投资              | -                                                                                                                                                     |
|                 | 其中：银行间市场债券        | -                                                                                                                                                     |
|                 | 其中：利率债            | -                                                                                                                                                     |
|                 | 其中：信用债            | -                                                                                                                                                     |
|                 | 资产支持证券            | -                                                                                                                                                     |
|                 | 基金投资（公募基金）        | 3,771,322.31                                                                                                                                          |
|                 | 其中：货币基金           | 2,800,000.00                                                                                                                                          |
|                 | 期货及衍生品交易保证金       | -                                                                                                                                                     |
|                 | 买入返售金融资产          | -                                                                                                                                                     |
|                 | 其他证券类标的           | -                                                                                                                                                     |
| 资管计划投资          | 商业银行理财产品投资        | -                                                                                                                                                     |
|                 | 信托计划投资            | -                                                                                                                                                     |
|                 | 基金公司及其子公司资产管理计划投资 | -                                                                                                                                                     |
|                 | 保险资产管理计划投资        | -                                                                                                                                                     |
|                 | 证券公司及其子公司资产管理计划投资 | -                                                                                                                                                     |
|                 | 期货公司及其子公司资产管理计划投资 | -                                                                                                                                                     |
|                 | 私募基金产品投资          | SGV805#1891645.21;<br>SNW746#1182347.31;<br>SQF842#3474674.39;<br>STH145#3474910.40;<br>STQ184#931048.03;<br>SU677A#1565667.95;<br>SVP311#1003690.03; |

|         |               |              |
|---------|---------------|--------------|
|         | 未在协会备案的合伙企业份额 | -            |
| 另类投资    | 另类投资          | -            |
| 境内债权类投资 | 银行委托贷款规模      | -            |
|         | 信托贷款          | -            |
|         | 应收账款投资        | -            |
|         | 各类受（收）益权投资    | -            |
|         | 票据（承兑汇票等）投资   | -            |
|         | 其他债权投资        | -            |
| 境外投资    | 境外投资          | -            |
| 其他资产    | 其他资产          | 应收股利#119.42; |
|         | 债券回购总额        | -            |
| 基金负债情况  | 融资、融券总额       | -            |
|         | 其中：融券总额       | -            |
|         | 银行借款总额        | -            |
|         | 其他融资总额        | -            |

#### 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 | 0.00         |





#### 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  | 0.00      | 0.00         |
| -    | -         | -            |
| 合计   | 0.00      | 0.00         |

#### 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               | 1,900.918759 |
| 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            | 0            |
| 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）/期末基金实缴总额（万元）  | 1,900.918759 |

#### 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：以定量和定性相结合的方式选择和组合子基金，通过多策略分散投资，在严格控制风险的情况下，实现 FOF 的稳健增值。截止 2022 年 6 月 30 日本基金期末基金单位净值为 0.9424 元，期末基金累计单位净值 0.9424 元。

##### 6.2 投资经理

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。

##### 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: 胡艳

服务电话: 021-20370953

E-MAIL : huyan@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 报告期末所投子基金和穿透后投资标的情况

| 所投子基金                     | 穿透后主要投资标的 |
|---------------------------|-----------|
| 盛冠达 CTA 基本面量化 8 号私募证券投资基金 | 期货        |
| 大塘飒露紫一号私募证券投资基金           | 期货        |
| 复熙明德 9 号私募证券投资基金          | 债券        |
| 复熙明德 13 号私募证券投资基金         | 债券        |
| 兴证期货-兴瑞量化 CTA2 号集合资产管理计划  | 期货        |
| 凡二巴舍里耶量化对冲 6 期私募证券投资基金 A  | 股票        |
| 国恩回报 6 号增强私募证券投资基金        | 债券        |
| 易方达恒生科技联接 C               | 股票        |
| 金信民发货币 A                  | 债券        |

#### 6.7 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



