

# 兴证期货-兴享添利 1 号单一资产管理计划

## 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-兴享添利 1 号单一资产管理计划                                                                                 |
| 基金编码                     | STJ615                                                                                                |
| 基金管理人                    | 兴证期货有限公司                                                                                              |
| 基金托管人（如有）                | 宁波银行股份有限公司                                                                                            |
| 投资顾问（如有）                 | 上海拉曼资产管理中心（有限合伙）                                                                                      |
| 基金运作方式                   | 开放式                                                                                                   |
| 基金成立日期                   | 2021 年 12 月 22 日                                                                                      |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 3,011.827541                                                                                          |
| 投资目标                     | 在严格控制投资组合风险的前提下，积极配置优质债券、合理安排组合期限，力争获取稳健的收益。                                                          |
| 投资策略                     | 固定收益投资策略：在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下，进行积极的固定收益投资组合管理，以提高计划资产的运用效率。<br>现金管理策略：通过债券逆回购，货币基金，债券基金等方式对闲散资金进行现金管理。 |
| 业绩比较基准（如有）               | 本资产管理计划不设置业绩比较基准。                                                                                     |
| 风险收益特征                   | 本计划属于[R3]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[C3、C4、C5]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         | 52.51    | 0.65        | -            | -               |
| 自基金合同生效起至今 | 74.99    | 0.69        | -            | -               |

备注：

注：无。

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        | 2022-04-01 至 2022-06-30 |
|-----------|-------------------------|
| 本期已实现收益   | 17,592,162.80           |
| 本期利润      | 17,592,162.80           |
| 期末基金净资产   | 52,702,567.40           |
| 报告期期末单位净值 | 1.7499                  |

备注：

注：无。

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

### 4、投资组合报告

#### 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           | 1,854,857.78 |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | -            |
| 其中：优先股          | -            |
| 其他股权类投资         | 0.00         |
| 上市公司定向增发投资      | -            |
| 新三板投资           | -            |
| 境内证券投资规模        | 7,322.20     |
| 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）        | -             |
|         | 其中：货币基金           | -             |
|         | 期货及衍生品交易保证金       | -             |
|         | 买入返售金融资产          | 52,002,635.62 |
|         | 其他证券类标的           | -             |
|         | 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 | 0.00          |
| 资管计划投资  | 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 | 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          | -             |
|         | 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              | -             |
| 基金负债情况  | 债券回购总额            | -             |
|         | 融资、融券总额           | -             |
|         | 其中：融券总额           | -             |
|         | 银行借款总额            | -             |
|         | 其他融资总额            | -             |

备注： -

#### 4.2.1 期末按行业分类的股票投资组合(不含沪港通)

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          |

备注： -

#### 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|------|------|---------------|
| 港股通  | -    | -             |
| 合计   | -    | -             |

备注： -

#### 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               | 2,943.622696  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 13,379.239668 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 13,311.034823 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | 0.000000      |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额          | 3,011.827541  |

备注：

注：无。

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：本资产管理计划在严格控制投资组合风险的前提下，积极配置优质债券、合理安排组合期限，力争获取稳健的收益。截止 2022 年 6 月 30 日本基金期末基金单位净值为 1.7499 元，期末基金累计单位净值 1.7499 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。

邢敏，期货从业资格编码：F03087819，本计划本报告期内未发生变更。

投资经理从业经验：材料物理学与金融学双学士，现任兴证期货资产管理部投资经理。有六年的债券固收投资交易经验，2017 年 7 月至 2021 年 6 月在领睿资产管理公司任交易部副总经理、投资经理，2021 年 7 月加入兴证期货资管部。

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。

本计划投资顾问为上海拉曼资产管理中心（有限合伙），是一家根据《中华人民共和国证券法》等法律法规要求，经中国基金业协会登记备案注册的，具有专业资质的证券类私募投资基金公司。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。

### 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：-

---