

兴证期货-兴享多空价值1号集合资产管理计划 2022 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-兴享多空价值1号集合资产管理计划
基金编码	SSR417
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）	中庚基金管理有限公司
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2021 年 10 月 12 日
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	20,266.398941
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	本计划秉承价值投资的理念，通过严谨的风险控制管理流程，主要基于不确定性定价的价值策略模型进行稳健投资，并辅之以其他投资策略，力求实现资产管理计划财产的稳健增长。
业绩比较基准（如有）	本基金不设业绩比较基准。
风险收益特征	本资产管理计划属于[R5 高风险]风险投资品种，适合专业投资者和风险识别、评估、承受能力[C5]的普通投资者。

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	12.96	-	-	-
自基金合同生效 起至今	32.58	-	-	-

√ 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 7 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日 (元)
本期已实现收益	19,455,145.23
本期利润	30,814,892.78
期末基金净资产	268,688,258.16
报告期期末单位净值	1.3258

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	151,412.53
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	17,024,229.56
	存出保证金	-
	股票投资	248,925,244.09
	债券投资	123,006.07
	其中：银行间市场债券	-
	其中：利率债	-
	其中：信用债	123,006.07
	资产支持证券	-
	基金投资（公募基金）	245,318,120.66
	其中：货币基金	245,318,120.66
	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	-
	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：252201.58；
基金负债情况	债券回购总额	-
	融资、融券总额	240,729,066.82
	其中：融券总额	240,729,066.82
	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	38,793,580.00	14.44
C	制造业	121,337,538.29	45.16
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	3,592,674.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,409,340.00	0.52
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	42,527,643.90	15.83
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	7,697,950.00	2.87
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	215,358,726.19	80.16

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	33,566,517.90	12.49
-	-	-
合计	33,566,517.90	12.49

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	20,266.398941
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）	20,266.398941

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：本计划秉承价值投资的理念，通过严谨的风险控制管理流程，主要基于不确定性定价的价值策略模型进行稳健投资，并辅之以其他投资策略，力求实现资产管理计划财产的稳健增长。截止 2022 年 9 月 30 日本基金期末基金单位净值为 1.3258 元，期末基金累计单位净值 1.3258 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 月历任新湖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。

本计划投资顾问为中庚基金管理有限公司，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。投资顾问是经中国证监会证监许可[2018]918 号文批准设立并持续经营的公募基金管理公司。该公司建立了专业化的投资管理机制，目前已经拥有一支具有丰富的投资经验、具有良好的业务能力和职业道德、具有团队协作和开拓创新精神的专业化团队。同时，该公司具备完善的风险控制体制，通过完善各类风险控制制度，建立全面的风险控制体系，最大程度上避免内部与外部风险对投资者利益的侵害。该公司的管理团队和投资研究团队在业内声誉良好，无不良从业记录，并有可追溯投资管理业绩证明。

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: 是

