

# 私募基金信息披露季度报告



## 1、基金基本情况

| 项目                           |                                                                                                                  |
|------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称                         | 兴证期货·兴证 FOF 三号集合资产管理计划                                                                                           |
| 基金编码                         | SXB006                                                                                                           |
| 基金管理人                        | 兴证期货有限公司                                                                                                         |
| 基金托管人 (如有)                   | 广发证券股份有限公司                                                                                                       |
| 投资顾问 (如有)                    |                                                                                                                  |
| 基金运作方式                       | 开放式                                                                                                              |
| 基金成立日期                       | 2022-08-29                                                                                                       |
| 期末基金总份额 (万份) / 期末基金实缴总额 (万元) | 11269.891392                                                                                                     |
| 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                         | 本资产管理计划主策略以定量和定性相结合的方式选择和组合固收类子基金, 通过分散投资, 在严格控制风险的情况下, 力求 FOF 的保值增值。                                            |
| 业绩比较基准 (如有)                  | 无                                                                                                                |
| 风险收益特征                       | 基于本计划的投资范围及投资策略, 本计划不承诺保本及最低收益, 按照资产管理人对计划产品或者服务的风险等级划分, 本计划属预期风险等级【R3】级的投资品种, 适合具有【C3 及以上】级别风险识别、评估、承受能力的合格投资者。 |

## 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         | 1.61      |              |               |                  |
| 自基金合同生效起至今 | 8.39      |              |               |                  |

说明: 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) / 上季度末累计净值

## 3、主要财务指标

金额单位: 元

|         |                         |
|---------|-------------------------|
| 项目      | 2023-10-01 至 2023-12-31 |
| 本期已实现收益 | 934988.02               |
| 本期利润    | 1866381.95              |

|           |              |
|-----------|--------------|
| 期末基金净资产   | 122156936.74 |
| 报告期期末单位净值 | 1.0839       |

#### 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              | 199248.35                      |
| 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             |                                |
|                 | 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）        |                                |
|                 | 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          |                                |
|                 | 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 | 7717014.22<br>占总资产比例为 6.31%    |
|                 | 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          | 114054803.87<br>占总资产比例为 93.29% |
|                 | 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        | 证券清算款：281000.00； |
| 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      |                  |

#### 4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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         |

注：以上分类采用中证协行业分类。

#### 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               | 11551.785363 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 3609.897258  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3891.791229  |
| 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          | 11269.891392 |

## 6、管理人报告（如有）

### 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。从策略应呈现的风险收益特征出发，对子基金进行分类，然后根据既定目标进行 FOF 的资产配置。截止 2023 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 1.0839 元，期末基金累计单位净值 1.0839 元。

### 6.2 投资经理

本计划投资经理廉正，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。

### 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）进行资产管理计划会计核算并编制资产管理计划财务会计报告；
- （5）依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；

- (6) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;
- (7) 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;
- (8) 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;
- (9) 保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户;
- (10) 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: 蔡培

服务电话: 021-20370953

E-MAIL : caipei@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。

|             |   |
|-------------|---|
| 报告是否经托管机构复核 | 是 |
|-------------|---|



1000

