

兴证期货满亿 1 号单一资产管理计划

2024 年第 3 季度报告

资产管理人：兴证期货有限公司

资产托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：二零二四年十月

§ 1 重要提示

计划管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

计划托管人上海银行股份有限公司根据本计划合同规定，复核了本报告中的收益表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，但不保证计划一定盈利。

计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本计划的募集说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日至 9 月 30 日止。

§ 2 计划概况

2.1 计划基本情况

计划名称	兴证期货满亿 1 号单一资产管理计划
计划编码	SB8567
投资及销售币种	人民币
计划运作类型	开放式
计划成立日	2023 年 8 月 4 日
计划到期日	2026 年 8 月 3 日
报告期末资产管理计划份额总额（份额）	2,999,076.4300
投资目标	本资产管理计划追求在有效控制风险的前提下谋求资产的稳健增值。
投资策略	以定量和定性相结合的方式选择标的，在严格控制风险的情况下，实现稳健增值。
业绩比较基准（若有）	无
风险收益特征（若有）	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，资产管理计划风险收益特征界定为[R2] 级别的计划，适合专业委托人或普通委托人中[C2、C3、C4、C5] 的委托人认购。

§ 3 计划净值表现

3.1 期末净值数据

单位：人民币元

主要财务指标	报告期末(2024 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	2, 878, 878. 80
2. 本期利润	2, 878, 878. 80
3. 期末资产净值	3, 360, 945. 61
4. 期末份额净值	1. 1207
5. 期末份额累计净值	1. 1207

注：本期已实现收益=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额

3.2 本报告期计划净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
本季度	0. 77	0. 11

§ 4 投资组合报告

4.1 报告期末资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占计划总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中： 股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中： 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
	其中： 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3, 554, 889. 99	100. 00
7	其他资产	-	-
8	合计	3, 554, 889. 99	100. 00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

4.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本计划不涉及。

4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本计划不涉及。

4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本计划不涉及。

4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本计划不涉及。

4.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资
明细

本计划不涉及。

4.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十大基金明细

本计划不涉及。

4.8 其他资产构成

本计划不涉及。

§ 5 计划份额变动情况

单位：份

报告期期初计划份额总额	1,332,672.5000
报告期期间计划总申购份额	39,275,360,097.5300
减：报告期期间计划总赎回份额	39,273,693,693.6000
报告期期间计划拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-
报告期期末计划份额总额	2,999,076.4300

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

§ 6 计划费用发生情况

6.1 管理费

单位：人民币元

项目	报告期 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)
当期计提的管理费	161, 545. 74
当期支付的管理费	138, 946. 86

。

6.2 托管费

单位：人民币元

项目	报告期 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)
当期计提的托管费	30, 777. 78
当期支付的托管费	26, 472. 26

。

§ 7 收益分配

本报告期内，本计划未发生收益分配。

§ 8 管理人报告

8.1 计划经理简介

本计划投资经理廉正，期货从业资格编码:F3054039，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。

8.2 报告期内计划的投资策略和运作分析

本计划以定量和定性相结合的方式选择标的，在严格控制风险的情况下，实现稳健增值。截止 2024 年 9 月 30 日，本计划单位净值为 1.1207 元，累计单位净值 1.1207 元。

8.3 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。

8.4 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。

8.5 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：孙雯

服务电话：021-20370952

E-MAIL：sunwen@xzfutures.com

§9 托管报告

本报告期内，上海银行股份有限公司作为兴证期货满亿 1 号单一资产管理计划的托管人，根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关要求以及本计划法律性文件的相关约定，托管人对管理人编制的《兴证期货满亿 1 号单一资产管理计划 2024 年第 3 季度报告》的财务指标、净值表现、投资组合报告等财务数据进行了复核，认为上述内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 10 重要事项提示

- 1、本资产管理计划的管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本资产管理计划管理、财产、托管业务的重大诉讼事项。
- 2、本报告期内资产管理计划的投资组合策略没有重大改变。
- 3、本资产管理计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。
- 4、本报告期内本资产管理计划投资经理没有发生变更。
- 5、本报告期内没有发生重大关联交易情况。