

钜沣量化对冲一号证券投资基金 2023年第三季度报告

基金管理人：安徽钜瑞资产管理有限公司

基金托管人：兴业证券股份有限公司

送出日期：2024-04-08

私募基金信息披露季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	钜沣量化对冲一号证券投资基金
基金编码	SE0703
基金管理人	安徽钜瑞资产管理有限公司
基金托管人（如有）	兴业证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2015-12-15
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	628.844329
投资目标	“本基金通过将基金投资者投入的资金加以集合运用，对资产进行专业化的管理和运用，谋求资产的稳定增值。”
投资策略	“本基金依基金管理人的投资指令进行投资决策。基金管理人的投资策略如下：1、股票投资策略：本基金基于自上而下的优势主题分析框架下，精选未来具有高成长速度、广阔成长空间、较好成长模式并且成长估值相对合理的个股进行重点投资。2、股指期货策略：本基金通过利用股指期货的独立性和领先性，使用对冲策略有效分散投资风险。同时在严格控制风险敞口的前提下，运用对冲策略，通过对经济增长趋势、资金流动、财政和货币政策变化等因素自上而下进行统计分析，并辅以对高频交易数据的捕捉分析，区分有信息含量和非理性的交易行为，来获取对股指期货价格走势判断的领先优势，制定投资策略，获取低风险甚至无风险的套利收益。”
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本基金具有较高风险高预期收益特征

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	-3.71	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	-48.10	0.00	0.00	0.00

备注：

-

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	2023-07-01	至	2023-09-30	（元）

本期已实现收益	-299,159.24
本期利润	-120,360.27
期末基金净资产	3,266,782.98
报告期期末单位净值	0.519

备注：

-

注：

如为分级基金，应按级别分别列示。

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	144.97
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	333,596.79
	存出保证金	274,585.37
	股票投资	2,741,911.48
	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	69,587.2
	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	-
	银行委托贷款规模	-
	信托贷款	-

境内债权类投资	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	-

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	0
B	采矿业	0	0
C	制造业	1,323,095.48	40.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0	0
E	建筑业	0	0
F	批发和零售业	919,800.00	28.16
G	交通运输、仓储和邮政业	0	0
H	住宿和餐饮业	0	0
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,100.00	3.13
J	金融业	0	0
K	房地产业	0	0
L	租赁和商务服务业	0	0
M	科学研究和技术服务业	109,916.00	3.36
N	水利、环境和公共设施管理业	287,000.00	8.79
O	居民服务、修理和其他服务业	0	0
P	教育	0	0
Q	卫生和社会工作	0	0
R	文化、体育和娱乐业	0	0
S	综合	0	0
	合计	2,741,911.48	83.93

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（人民币）	占基金资产净值比例（%）
港股通	0	0.00
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	628.844329
报告期期间基金总申购份额	0.000000
减: 报告期期间基金总赎回份额	0.000000
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	628.844329

备注:

—

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 (如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等)

—

信息披露报告是否经托管机构复核:

是

