

广州期货非凡卓越13号集合资产管理计划 2020年第三季度报告



基金管理人：广州期货股份有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：二〇二〇年十月二十六日

私募基金信息披露季度报表

1、 基金基本情况

项目	信息
基金名称	广州期货非凡卓越 13 号集合资产管理计划
基金编码	SJE546
基金管理人	广州期货股份有限公司
基金托管人	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	2019-12-05
报告期末基金份额总额	900,300.41
投资目标	
投资策略	
业绩比较基准（如有）	
风险收益特征	

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	0.40	-	-	-

自基金 合同生 效起至 今	1.00	-	-	-
------------------------	------	---	---	---

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	2020-07-01 至 2020-09-30
本期已实现收益	3,211.71
本期利润	3,211.71
期末基金资产净值	909,272.78
期末基金份额净值	1.010

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的 比例 (%)
----	----	-----------	-------------------

1	权益投资	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	811,040.11	88.91
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	100,951.99	11.07
8	其他资产组合	138.67	0.02
	合计	912,130.77	100.00

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

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：份

报告期期初基金份额总额	900,300.41
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	900,300.41

6、管理人报告

6.1 本资产管理计划投资运作合规守信情况的说明

报告期内，本资产管理计划管理人严格遵守《中华人民

《中华人民共和国证券投资基金法》、《期货公司监督管理办法》、《广州期货非凡卓越 13 号集合资产管理计划资产管理合同》、《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》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，在严格控制投资风险的基础上，为资管计划份额持有人谋求最大利益。报告期内，资产管理计划运作合法合规，无损害资产管理计划持有人利益的行为，资产管理计划的投资管理符合有关法规及资产管理计划的规定。

6.2 本资产管理计划估值程序、估值方法

报告期内，本资产管理计划的估值程序、估值方法符合本资产管理计划资产管理合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。

6.3 本资产管理计划投资运作情况

报告期内，本资产管理计划净值增长率为 0.4%。2020 年三季度本计划主要投资国债逆回购、可转债，总体运行平稳。展望 2020 年第四季度，本计划将继续投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，配合其他权益类、衍生品类投资等增厚策略运行。

6.4 本资产管理计划投资组合的补充说明

报告期内，本资产管理计划各类投资标的的投资比例符合相关法律法规及合同约定，投资组合情况详见本报告“4、

投资组合情况”，相关投资风险详见合同相关条款。

6.5 本资产管理计划风险管理执行情况

公司通过建立科学的投资决策体系，加强投资交易环节的内部控制，并通过事前、事中、事后风控，对可能导致不公平交易和利益输送的交易行为，如异常交易、关联交易、同向交易、反向交易等进行监控，对投资策略及其执行情况、持仓头寸及其比例等进行监控，对资产管理计划严格按照资产管理合同约定以及相关法律法规要求进行风险控制。

报告期内，本资产管理计划在投资交易过程中未发现不公平交易和利益输送等异常交易行为，风险控制措施得当、投资策略正常执行；报告期内，本资产管理计划在投资运作过程中，未出现触及预警线及止损线情况，也未发生追保、强平等情况。

6.6 本资产管理计划投资账户信息

截止报告期末，本资产管理计划开立证券账户、期货账户、基金账户。

6.7 其他重大事项

无。

6.8 总结

报告期内，本资产管理计划的投资管理均按有关法律法规、公司相关制度及本资产管理计划合同及说明书的相关规定进行。本资产管理计划的投资决策、投资交易程序、投资

权限等方面符合相关规定的要求；本资产管理计划的投资运作合法合规，未出现风险事件，未发现不公平交易和利益输送等异常交易行为，风险控制措施得当、投资策略正常执行；本资产管理计划的杠杆比例符合监管要求，相关信息披露和财务数据真实、完整、准确、及时。

广州期货股份有限公司资产管理部

二〇二〇年十一月二十二日



报告是否经托管机构复核

是