

创元创优 2 号集合资产管理计划 2020 年第 4 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	创元创优 2 号集合资产管理计划
基金编码	SLC726
基金管理人	创元期货股份有限公司
基金托管人（如有）	华泰证券股份有限公司
投资顾问（如有）	长安基金管理有限公司
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020 年 08 月 05 日
报告期末基金份额总额（份）	46,116,357.54
投资目标	<p>（1）债券（国债、地方政府债、央行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、非公开定向债务融资工具（PPN）、中小企业私募债、可转换债券、短期融资券、超短期融资券、可交换债券）</p> <p>（2）因可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票及其派发的权证、因分离交易的可转换公司债券产生的权证</p> <p>（3）公募基金（封闭式基金、开放式基金、股票型基金、债券型基金、货币市场型基金、混合型基金）</p> <p>（4）回购（债券正回购、债券逆回购）</p> <p>（5）其他（现金、银行活期存款、定期存款、协议存款等）</p>
投资策略	本计划主要投资策略包括资产配置策略，各类债券投资策略（持有到期策略、基于信用利差曲线变化的策略、利率策略），跨市场套利交易策略，可交换债券投资策略，现金类资产投资策略等。

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	-4.15	-	-	-
自基金合同生效起至今	-2.97	-	-	-

说明：净值增长率等于（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率等于（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

单位：人民币元

项目	2020-10-01 至 2020-12-31
----	-------------------------

本期已实现收益	452,232.32
本期利润	-1,838,338.54
期末基金资产净值	44,748,934.12
期末基金份额净值	0.9703

4、投资组合报告

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	5,702,045.16	12.71
3	固定收益投资	37,343,706.90	83.26
	其中：债券	37,343,706.90	83.26
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	306,816.10	0.68
8	其他各项资产	1,501,336.46	3.35
	合计	44,853,904.62	100.00

注：其他各项资产：主要包括三方存管保证金、其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含沪港通)

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

4.3 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	占基金资产净值比例 (%)
港股通	-	-
合计	-	-

5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	22,915,954.86
报告期期间基金总申购份额	23,200,402.68
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	46,116,357.54

6、管理人报告

信息披露报告是否经托管机构复核：是

