

弘业馥利 1 号集合资产管理计划 2021 年第 2 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	弘业馥利 1 号集合资产管理计划
基金编码	SNT276
基金管理人	弘业期货股份有限公司
基金托管人（如有）	华泰证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2021 年 01 月 25 日
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	717.287121
投资目标	本计划力求在有效控制投资风险的基础上，追求资产的稳健增值。
投资策略	本产品为固收+策略，通过主投固收，辅以权益加强组合收益。在对国内外宏观环境充分研究判断的基础上，以货币政策、债券供需为核心，基础策略为投资于利率品种及信用品种，结合债券市场具体投资品种的风格轮换，自上而下地决定组合久期及杠杆比例、动态调整各类金融资产配比，结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析，优化债券组合的期限结构和类属配置，灵活配置国债、金融债、产业债、城投债等债券品种的持仓；并时刻关注利率债、高收益债等投资品种波段操作所提供的资本利得机会。在严控风险的前提上，通过深入分析各类债券等固定收益金融工具的投资价值，力争实现资产的稳健增值。 （1）债券配置策略：本计划重点在一级市场或二级市场选择资质较好、流动性较好的 AA 或 AA+级交易所或银行间上市的企业债券、公司债券和中短期债务融资工具进行投资。 （2）息差策略：在基本面不确定性较大，市场缺乏趋势性机会时，组合收益来源从资本利得转变为息差收益，缩短组合久期，以防御为主，选择短久期高收益信用债或者存单进行配置，获取较为确定的息差收益。 （3）骑乘策略：当债券收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对

	应的将是债券价格的走高，而这一期间债券的涨幅将会高于其他期间，即可以获得丰厚的价差收益即资本利得收入。 本计划委托人一致同意指定上海辰翔投资管理有限公司为本计划的投资顾问。经全体委托人、托管人和管理人协商一致，可对投资范围和投资策略进行变更，变更投资应为管理人及托管人调整投资组合变更投资策略留出充足的时间。
业绩比较基准（如有）	5.5
风险收益特征	本计划属于 R3 风险等级投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C3 及以上的合格投资者。

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	3.95	-	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	7.80	-	0.00	0.00

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

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	2021-04-01 至 2021-06-30
本期已实现收益	137,485.87
本期利润	243,355.32
期末基金净资产	7,735,918.00
报告期末单位净值	1.0780

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

4、投资组合报告

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	18.09
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	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	0.00

新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	1,091.20
	存出保证金	0.00
	股票投资	0.00
	债券投资	6,486,063.60
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	6,486,063.60
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	0.00
	期货及衍生品交易保证金	0.00
	买入返售金融资产	0.00
	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	SGH592#1025009.81；
	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	应收利息#251388.35;
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	

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：万份/万元	
报告期期初基金份额总额	505.038888
报告期期间基金总申购份额	321.670105
减：报告期期间基金总赎回份额	109.421872
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

期末基金总份额/期末基金实缴总额	717.287121
------------------	------------

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

管理人声明,在本报告期内，资产管理人——弘业期货股份有限公司不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，严格遵守了《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》及其他有关法律法规、资产管理合同的约定，完全尽职尽责地履行了管理人应尽的义务。 本报告期内，管理人在本计划的投资运作、计划资产净值的计算、收益分配、计划份额申购赎回价格的计算、计划费用开支等问题上，未发现存在损害计划份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。 本计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划说明书。 本报告相关财务资料未经审计。 本报告中的内容由管理人负责解释。
--

信息披露报告是否经托管机构复核：是