

敏行阿杏一号私募证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

1、基金基本情况

基金名称	信息
敏行阿杏一号私募证券投资基金	
基金代码	SGT687
基金管理人	上海阿杏投资管理有限公司
基金托管人 (如有)	招商证券股份有限公司
投资顾问 (如有)	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2019 年 07 月 18 日
期末基金总份额 (万份) / 期末基金实缴总额 (万元)	607.294809
投资目标	致力寻找证券市场中具有核心竞争力的优秀企业, 并以合理甚至低估的价格买入并持有, 以获得良好的收益, 与投资者一起分享公司成长的价值。
投资策略	<p>主要寻找以下三类投资机会:</p> <p>1、具有良好的既往业绩表现, 行业竞争格局较为稳定, 所在的细分行业与 GDP 增长相近甚至更快, 并且拥有诚信、有能力、老板式管理人员的上市公司。当公司具有合理的市场价格时进入, 过度高估时或者基本面恶化时退出。该部分投资, 为本基金主要寻找的投资对象, 这部分公司投资的基石。本基金通过持有沪深交易所上市交易的存托凭证间接投资于境外基础证券。</p> <p>2、新兴行业的机会, 主要寻找契合社会发展趋势的小市值公司。由于该部分投资, 不确定因素较多, 是作为第一部分投资部分的补充。考虑风险相对较大, 采取分散的投资策略。</p> <p>3、市场的一些套利。主要包括分级基金的折溢价套利, 可转债的折价套利, 并购事件中现金选择权等类似的套利等。该部分主要为了适当平抑市场波动的风险。</p>
业绩比较基准 (如有)	无。
风险收益特征	本基金属于 R5 级 (高风险) 投资品种。
信息披露报告是否经托管机构复核	是

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	-8.15	-	-	-

自基金合同生效起至今	158.38	-	-	-
------------	--------	---	---	---

注：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）/上季度末净值

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2021-07-01 至 2021-09-30
本期已实现收益	1,523,040.60
本期利润	-1,492,116.43
期末基金净资产	15,691,153.47
报告期期末单位净值	2.5838

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	44,675.36	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	银行存款	44,675.36
	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	0.00
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	780,621.84
境内证券投资规模	结算备付金	2,140.39
	存出保证金	0.00
	股票投资	19,333,442.89
	债券投资	655,558.98
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	655,558.98
	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	0.00
	资管计划投资	商业银行理财产品投资
信托计划投资		0.00
基金公司及其子公司资产管理计划投资		0.00
保险资产管理计划投资		0.00
证券公司及其子公司资产管理计划投资		0.00
期货公司及其子公司资产管理计划投资		0.00
私募基金产品投资		0.00
未在协会备案的合伙企业份额		0.00

证券
资产
核算
403

另类投资	另类投资	0.00
境内债权类投资	银行委托贷款规模	0.00
	信托贷款	0.00
	应收账款投资	0.00
	各类受（收）益权投资	0.00
	票据（承兑汇票等）投资	0.00
	其他债权投资	0.00
境外投资	境外投资	0.00
其他资产	其他资产	应收利息#647.38；
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	5,019,361.76
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	0.00

4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含港股通)

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	0.00	0.00
B	采矿业	625,397.00	3.99
C	制造业	15,503,672.56	98.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	108,180.00	0.69
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	950,980.00	6.06
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	17,188,229.56	109.54

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(人民币)	占基金资产净值比例(%)
原材料	0.00	0.00
非日常生活消费品	0.00	0.00
日常消费品	0.00	0.00
能源	0.00	0.00

金融	0.00	0.00
医疗保健	2,417,711.36	15.41
工业	0.00	0.00
信息技术	0.00	0.00
通讯服务	0.00	0.00
公用事业	508,123.81	3.24
房地产	0.00	0.00
合计	2,925,835.17	18.65

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	726.4343
报告期期间基金总申购份额	4.00625
减：报告期期间基金总赎回份额	123.145741
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
期末基金总份额/期末基金实缴总额	607.294809

6、管理人报告

6.1、基金运作遵规守信情况

报告期内，本基金投资运作符合基金合同的约定。

6.2、报告期内基金投资策略和业绩表现

截止 2021 年 09 月 30 日本基金期末基金单位净值为 2.5838 元，期末基金累计单位净值 2.5838 元。

6.3、报告期内基金估值程序

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会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。本基金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。

6.4、报告期内基金运作情况和运作杠杆情况

截至报告期末，本基金资产总值为 20,817,086.84 元，净资产为 15,691,153.47 元，本基金总资产与净资产的比例为 132.6677%。

6.5、报告期内投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.6、报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形

报告期内，本基金投资运作符合基金合同的约定。

有限
业务
印章

托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的规定，对本基金在本报告中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。

敏行阿杏一号私募证券投资基金
上海阿杏投资管理有限公司

敏行阿杏一号私募证券投资基金
上海阿杏投资管理有限公司

敏行阿杏一号私募证券投资基金
上海阿杏投资管理有限公司

敏行阿杏一号私募证券投资基金
上海阿杏投资管理有限公司

