

创元创优 5 号债券增强集合资产管理计划 2022 年第 2 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	创元创优 5 号债券增强集合资产管理计划
基金编码	STK861
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）	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2021 年 12 月 14 日
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	2,148.178683
投资目标	<p>（1）沪深交易所或银行间市场发行及交易的债券（含国债、地方政府债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、新债申购）、沪深交易所或银行间市场发行及交易的资产支持证券优先类份额、银行存款（包括定期存款、协议存款、结构性存款和其他银行存款）、同业存单；</p> <p>（2）国内交易所发行上市公司股票（含新股申购）、沪港通中港股通标的范围内的股票、深港通中港股通标的范围内的股票、优先股、中国存托凭证；</p> <p>（3）在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的期货及期权合约等标准化商品及金融衍生品类资产（包括股指期货和国债期货，商品期货（含特定品种），商品及股指期货，股票期权，利率期权）；</p> <p>（4）公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）、商业银行理财产品、证券公司及其子公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划；</p> <p>此外，本计划可依法参与债券回购、融资融券、转融通业务。</p> <p>本计划投资资产管理产品的，所投资的资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。</p>
投资策略	<p>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。</p>

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	2.23	-	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	5.41	-	0.00	0.00

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	2022-04-01至2022-06-30
本期已实现收益	450,642.35
本期利润	754,381.07
期末基金净资产	22,643,648.37
报告期期末单位净值	1.0541

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	271,170.96
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	650,712.56
	存出保证金	0.00
	股票投资	0.00
	债券投资	17,146,523.72
	其中：银行间市场债券	3,752,090.63
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	17,146,523.72
	资产支持证券	0.00

	基金投资（公募基金）	4,648,539.99
	其中：货币基金	4,648,539.99
	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	
	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	
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	3,121.539396
报告期期间基金总申购份额	654.527772
减：报告期期间基金总赎回份额	1,627.888485
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	2,148.178683

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。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

