

# 中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划

## 2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

集合计划管理人：中国国际金融股份有限公司

集合计划托管人：中国工商银行股份有限公司广州分行

报告送出日期：2024 年 7 月 31 日

## §1 重要提示

本报告由中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划（“本集合计划”）管理人中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）编制。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司广州分行根据本集合计划合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

本集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划合同、说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

## §2 集合计划产品概况

集合计划全称:	中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划
产品代码:	920122
集合计划运作方式:	开放式
集合计划成立日:	2018 年 5 月 29 日
报告期末集合计划份额:	2,114,611.98 份
集合计划存续期限:	10 年
投资目标:	集合计划聚焦于投资人资产的保值增值,主要投资于风险收益相匹配的金融工具;依靠对大类资产配置和趋势研判的丰富实践与投资能力,主要通过科学配置于现金类资产、各类型金融产品及金融衍生品资产(作为对冲、投机、套利工具)等资产,结合系统化策略模型体系以及严格的风险预算机制,争取长期获取优异的绝对回报。
投资策略:	通过基本面分析和量化手段,对各类资产以及底层的子基金进行动态调整。在此过程中严格遵守预先设立的风险控制指标,从组合层面控制投资风险,辅以在必要时投资于货币市场基金、同业存单、银行存款、债券逆回购等现金管理类产品,以追求委托资产的长期价值增长。
业绩比较基准:	无业绩比较基准
风险收益特征:	本集合计划属于中等风险(R3)产品,适合风险承受能力为激进型(C5)、积极型(C4)、稳健型(C3)的投资者。
集合计划管理人:	中国国际金融股份有限公司
集合计划托管人:	中国工商银行股份有限公司广州分行

## §3 主要财务指标和集合计划净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2024年4月1日-2024年6月30日)
1.本期已实现收益	689.59

2.本期利润	-2,073.19
3.加权平均集合计划份额本期利润	-0.0008
4.期末集合计划资产净值	2,153,555.10
5.期末集合计划份额净值	1.0184

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

### 3.2 集合计划净值表现

#### 3.2.1 本报告期集合计划份额净值增长率

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差
过去三个月	-0.52%	0.29%

#### 3.2.2 自集合计划成立以来集合计划份额累计净值增长率变动

中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划份额累计净值增长率历史走势图  
(2018 年 5 月 29 日至 2024 年 6 月 30 日)



### 3.3 集合计划报告期内的利润分配情况

本集合计划本报告期内未实施利润分配。

## §4 管理人履职报告

### 4.1 集合计划投资经理简介

姓名	职务	任本集合计划 投资经理期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔海亮	投资经理	2023 年 12 月 29 日	-	17.50	崔海亮先生，注册金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM），毕业于剑桥大学，拥有超过 12 年资产管理经验。曾在外管局从事全球资产配置和基金选聘等工作超过 7 年；养老金资产配置经验 3 年；后担任华创证券资金部负责人、资产配置委员会和投资决策委员会委员。崔先生擅于把握大类资产的趋势和轮动机会，灵活运用多种工具，使用系统化方法自上而下实现组合保值增值；同时拥有丰富的国内外基金管理人选聘经验。
张瑞	投资经理	2023 年 12 月 29 日	-	6.83	张瑞先生，清华大学电子工程学士、博士，持有特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM）证书。历任中金公司资产管理部 FOF/MOM 研究员、投资经理助理，专注于量化资产配置、基金评价及组合管理策略。具备法律法规规定的投资管理等相关业务三年以上经验，已经取得基金从业资格，最近三年未被

					监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。
--	--	--	--	--	----------------------

注：(1)基金的首任投资经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的涵义参照行业的相关规定，包括资管相关从业经历。

## 4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》等其他相关法律法规规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产。本集合计划运作期间，不存在违法违规、未履行合同约定承诺或损害本集合计划份额持有人利益的情形。

## 4.3 报告期内集合计划的投资策略和业绩表现说明

### 4.3.1 本集合计划业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本集合计划份额净值为 1.0184 元，份额累计净值为 1.0184 元，本期份额净值增长率为-0.52%。

### 4.3.2 行情回顾及运作分析

4 月政治局会议召开，决定将于 7 月召开三中全会，重点研究进一步全面深化改革、推进中国式现代化问题。5 月地产新政落地，指向政策思路大转变。高频数据层面，出口链相对景气，工业生产仍有韧性，但地产销售依旧偏弱，地方专项债发行仍慢，海运紧张及潜在贸易保护主义风险给出口带来不确定性，市场信心和基本面预期存在一定波动，6 月权益市场表现承压。账户五月下旬开始降低权益敞口，持仓结构偏向红利、资源、低位成长。

### 4.3.3 市场展望与投资策略

近期宏观经济显示国内外经济增长进一步疲软。国内制造业和消费开始放缓，地产在降价预期下并未出现趋势性修复，出口维持中性偏高状态，考虑到后续有

新增特别国债落地，国内增长大概率温和复苏。美国劳动力市场在本月进一步走弱，工资增长和消费后续有望放缓。通胀层面，猪油共振预计带动上半年 CPI 转正，PPI 转正可能在三季度。流动性层面，海外降息预期再起，推动美债利率下行。当前央行为了稳定汇率强行拉抬长端利率，但考虑到国内经济疲软，海外降息预期再起，这一动作无法支持长端利率趋势性上行。经济和通胀温和改善，流动性边际宽松，对国内权益市场维持谨慎乐观态度，在红利和成长方面均衡配置，适当增配港股，久期维持中性，久期超跌可适当加仓。

#### 4.4 异常交易情况说明

报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.5 公平交易情况说明

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定公司内部公平交易制度，明确公平交易的适用范围、原则、管控措施、行为监控、信息披露等，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，严禁利用所管理的投资组合为任何第三方谋取不正当利益。

公司建立了严谨的投资管理体系和规范的投资运作流程，通过制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，并通过对投资交易行为的监控和分析评估，加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内，公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和内部公平交易制度，未发现投资组合之间存在不公平交易的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占集合计划总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,853,919.85	83.27
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	资产管理产品	-	-
7	其他投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	370,280.66	16.63
10	其他资产	2,276.94	0.10
	合计	2,226,477.45	100.00

## 5.2 报告期末集合计划运用杠杆情况

杠杆指标	报告期末
集合计划总资产/集合计划资产净值 (%)	103.39

## 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有境内股票。

### 5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.4 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资 明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

## 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。



**5.6 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本集合计划本报告期末未持有债券。

**5.7 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

**5.8 报告期末股指期货、国债期货投资情况**

本集合计划本报告期末未持有股指期货、国债期货。

**5.9 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名除期货外其他金融衍生品投资明细**

本集合计划本报告期末未持有除期货外的其他金融衍生品。

**5.10 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

序号	基金代码	基金名称	数量 (份)	公允价值 (元)	占集合计划 资产净值比 例(%)
1	006829	鹏扬利沣 短债 A	186,140.0 0	216,164.38	10.04
2	511880	银华日利 货币 A	2,100.00	211,959.30	9.84
3	511360	海富通中 证短融 ET F	1,900.00	209,020.90	9.71
4	005754	平安短债 债券 A	166,761.4 2	201,948.08	9.38
5	005725	国投瑞银 恒泽中短 债债券 A	182,508.1 7	201,817.53	9.37
6	008205	交银稳利 中短债债	175,438.6 0	200,035.09	9.29

		券 C			
7	008448	德邦短债 A	166,769.36	189,983.65	8.82
8	511660	建信现金添益货币 H	1,600.00	160,008.00	7.43
9	016049	华商甄选回报混合 C	92,882.80	122,447.40	5.69
10	511990	华宝添益	1,200.00	120,010.80	5.57

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 报告期末其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,276.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
	合计	2,276.94

### 5.11.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 5.11.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 集合计划份额变动

单位：份

报告期期初集合计划份额总额	2,774,329.62
报告期期间集合计划总参与份额	-
减：报告期期间集合计划总退出份额	659,717.64
报告期期间集合计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末集合计划份额总额	2,114,611.98

## §7 影响投资者决策的其他重要信息

### 7.1 关联方报酬

项目	计提基准或费率	计提方式	支付方式
管理费	1.5%	每自然日计提	按季支付
托管费	0.03%	每自然日计提	按季支付

业绩报酬：本集合计划收取业绩报酬。业绩报酬计提时点为资产管理计划投资者赎回时，资产管理计划分红时，资产管理计划到期时；计提基准和计提比例为超过 7% 低于 10% 的部分提取 20%，超过 10% 的部分提取 30%。具体详见合同。

注：两费及业绩报酬的具体条款详见本计划资产管理合同约定。

### 7.2 本季度重大事项及其他需要说明的情况

其他重大事件详见中金公司官网 [www.cicc.com](http://www.cicc.com) 资产管理-最新消息。

《关于中金公司高级管理人员变动的公告》 2024-4-12

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

8.1.1 《中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》

8.1.2 《中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》

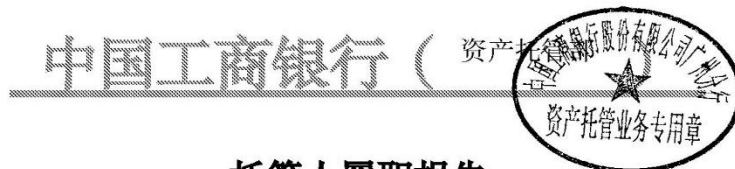
### 8.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和/或集合计划托管人的住所。

### 8.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人、集合计划托管人的住所或集合计划管理人网站 <http://www.cicc.com> 查阅备查文件或致电：800-810-8802（固话用户），(010)6505-0105（手机用户）查询。

## §9 托管人履职报告



### 托管人履职报告

本报告期内，本托管人在对中金福睿1号 FOF 集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，托管人根据《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

本报告期内，本托管人依法对中国国际金融股份有限公司编制和披露的中金福睿1号FOF集合资产管理计划2024年第2季度报告中财务指标、净值表现、利润分配、会计核算、资产估值等业务进行了核查，以上内容真实、准确和完整。



中国工商银行资产托管部

2024年7月12日

中国国际金融股份有限公司  
2024年7月31日