



中电投先融（上海）资产管理有限公司 丰享周周盈集合资产管理计划 2024 年第二季度资产管理报告



管理人：中电投先融（上海）资产管理有限公司

托管人：东方证券股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 29 日



重要提示

资产管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

资产托管人东方证券股份有限公司根据本资产管理计划资产管理合同约定，于 2024 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作资产管理计划，但不保证资产一定盈利。

本报告中财务资料未经审计。

报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

一、资产管理计划概况

资产管理计划名称	中电投先融丰享周周盈集合资产管理计划
资产管理计划编号	SVQ049
资产管理计划管理人	中电投先融（上海）资产管理有限公司
资产管理计划托管人	东方证券股份有限公司
资产管理计划运作方式	本资产管理计划为开放式运作。
资产管理计划成立日	2022 年 7 月 18 日
报告期末资产管理计划份额总额	80439880.55（单位：份）
投资目标	本资产管理计划力争在有效管理风险、保持资产较高流动性的基础上，实现稳定回报。具体投资策略包括资产配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、骑乘策略、回购杠杆策略等。
投资策略	本集合资产管理计划在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定： 投资于存款、债券等固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产 80%。
产品类别	固定收益类
风险收益特征	本计划的投资风险收益特征为 R2（中低风险等级）。

二、管理人履职报告

（一）管理人简介

中电投先融（上海）资产管理有限公司于 2015 年 10 月成立于上海，是隶属于国家电力投资集团资本控股有限公司的专业化资产管理公司，注册资本金 3.5 亿元。

（二）投资经理简介

本资产管理计划投资经理为郑一宁、陈国栋。

郑一宁、陈国栋的基本信息，以及投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验如下：

郑一宁，中山大学博士研究生学历，理学博士学位，2002 年 8 月-2007 年 8 月在上海交通大学化学与化学工程学院担任教师；2010 年 5 月-2018 年 2 月在德邦证券资产管理部担任董事总经理；2019 年 1 月-2022 年 11 月在中电投先融（上海）资产管理有限公司担任研究总监；2022 年 11 月-2023 年 10 月在中电投先融（上海）资产管理有限公司担任研究总监兼新能源产业部部门总经理；2023 年 10 月-至今在中电投先融（上海）资产管理有限公司担任

研究总监兼资产管理部部门总经理。现任中电投先融（上海）资产管理有限公司研究总监兼资产管理部部门总经理岗位，无在外兼职情况。

郑一宁投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验如下：

2010年5月至2015年6月：作为研究员，从事股票/债券/投资研究；2015年7月至今：作为投资经理，从事股票/债券/投资研究。

陈国栋，华东理工大学博士研究生学历，工学博士学。2009年4月-2009年8月在美亚企业集团能源发展有限公司研究发展部担任化学翻译专员；2009年9月-2011年11月在湘财证券股份有限公司研究所担任研究员；2011年12月-2013年12月在国融证券股份有限公司研究所担任研究员；2014年1月-2015年6月在德邦证券股份有限公司研究所担任研究员；2015年7月-2017年8月在德邦证券股份有限公司资产管理部担任投资主办；2017年8月-2018年1月在德邦星盛资本有限公司投资部担任投资主办；2018年1月-2018年7月在德邦证券股份有限公司资产管理部担任投资主办；2018年7月-2019年6月在德邦基金管理有限公司投资研究部担任研究员；2019年7月-2022年11月在中电投先融（上海）资产管理有限公司投资管理部担任高级投资经理；2022年11月-2023年10月在中电投先融（上海）资产管理有限公司 新能源产业部担任高级投资经理；2023年10月-至今在中电投先融（上海）资产管理有限公司资产管理部担任高级投资经理。现任中电投先融（上海）资产管理有限公司资产管理部高级投资经理，无在外兼职情况。

陈国栋投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验如下：

2009年9月至2011年12月，作为研究员，在湘财证券从事股票方面投资研究。2011年12月至2014年1月，作为研究员，在国融证券从事股票方面投资研究。2014年1月至2018年7月，在德邦证券从事股票方面投资研究/投资管理。2018年7月至2019年6月，在德邦基金从事股票方面投资研究。2019年7月至今，作为投资经理，在中电投先融（上海）资产管理有限公司从事股票/债券方面的投资管理。

投资经理取得了基金从业资格、通过期货从业资格考试，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（三）公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格执行公平交易制度，公平对待管理的各资产管理计划，未发生违反公平交易制度的行为。

（四）异常交易行为情况

本报告期内，本资产管理计划未发生异常交易行为。

（五）本资产管理计划运作合规守信情况

本报告期内，管理人严格遵循《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他有关法律法规、监管部门的相关规定和资管合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理资产管理计划资产。

本报告期内，本资产管理计划整体运作合规合法，无不当内幕交易行为，未发生损害投资者利益的行为。

三、托管人履职报告

本报告期内，托管人严格遵守法律法规、监管规定、自律规则的规定以及资产管理合同的约定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害份额持有人利益的行为。

本报告期内，托管人按照国家有关规定、资产管理计划合同、托管协议和其他有关规定，对本资产管理计划的资产净值计算、费用开支等方面进行了认真的复核，对本资产管理计划的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，托管人复核审查了本资产管理计划中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

四、主要财务指标、净值表现、收益分配、费用等情况

（一）主要财务指标

单位：元

项目	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
本期已实现收益	1,218,081.82
本期利润	1,155,206.50
期末资产管理计划资产净值	92,320,295.63
期末资产管理计划份额净值	1.1477

（二）净值表现

阶段	净值增长率（%）	净值增长率标准差（选填）	业绩比较基准收益率（选填）	业绩比较基准收益率标准率（选填）
当季	1.47	-	-	-
自资产管理计划成立起至今	14.77	-	-	-

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

（三）资产管理计划的收益分配情况

本报告期内，本资产管理计划无收益分配情况。

（四）资产管理计划的费用情况

费用种类	计提基准、计提方式和支付方式	报告期内计提情况
管理费	0.3%/年，按日计提，按季度收取	80,468.93
托管费	0.025%/年，按日计提，按季度支付	6,705.69
外包服务费	0.025%/年，按日计提，按季度支付	6,705.69
业绩报酬	本资管计划一年提取业绩报酬的次数不超过 2 次，间隔不少于 6 个月； $Y1(R) = A \times (R - 4.8\%) \times 60\% \times T / 365$	381,712.74
投资顾问费（如有）	-	-
审计费（如有）	-	-

（五）杠杆运用情况（如有）

截至本报告期末，本资产管理计划杠杆率为 101.09%。

五、份额变动情况

单位：份

报告期期初资产管理计划份额总额	106234862.89
报告期期间资产管理计划总申购份额	5277230.20
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	26322705.36
报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.0000
报告期期末资产管理计划份额总额	80439880.55

六、投资组合报告

（一）期末资产组合情况

单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	53,720.75
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	-
	其中：优先股	-
	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	-
新三板投资	新三板挂牌企业投资	-
境内证券投资规模	结算备付金	2,444,314.54
	存出保证金	-
	股票投资	-
	债券投资	71,984,283.45
	其中：银行间市场债券	28,884,889.62
	其中：利率债	-
	其中：信用债	71,984,283.45
	资产支持证券	1,548,092.47
	基金投资（公募基金）	422,745.36
	其中：货币基金	558.02
	期货及衍生品交易保证金	-
	买入返售金融资产	6,300,913.48
	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	应收利息#570000.00; 证券清算款#10000000.00;
基金负债情况	债券回购总额	-
	融资、融券总额	-
	其中：融券总额	-
	银行借款总额	-
	其他融资总额	-

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

单位：元

序号	行业类别	公允价值	占资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
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	0.00	0.00
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	0.00	0.00

（三）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）	占资产净值比例（%）
港股通	-	-
合计	-	-

七、资产管理计划涉及投资者利益的重大事项说明

（一）关联交易事项

本计划在托管人东方证券股份有限公司处开立证券账户，本报告期内，托管人因此收取佣金等费用，并向本计划支付利息，所有相关费用均按市场化费率执行。

上述关联交易的交易价格公允，且不存在利益输送的情况，在进行关联交易前已依照法律法规的要求履行了相关审批程序。

（二）合同变更事项

本报告期内，未发生合同变更事项。

（三）重要投资事项

本报告期内，未发生合同变更事项。

（四）其他事项

本报告期内，管理人实际办公地址于 2024 年 7 月 1 日变更，具体情况请见管理人于 2024 年 7 月 1 日于官网发布的《关于管理人实际办公地址变更的公告》临时信息披露公告（官网地址：www.spicam.cn）。

八、自有资金、关联方或其他相关人员投资本资管计划情况

（一）管理人自有资金持有本资管计划份额情况及交易明细

截至报告期末，管理人自有资金持有本计划 1800400.00 份，占总份额的 2.24%；管理人母公司中电投先融期货股份有限公司持有本计划 2000066.67 份，占总份额的 2.49%。以上合计占总份额的 4.72%，符合监管要求及资产管理合同约定。

本报告期内，管理人自有资金未进行本资产管理计划的申购、赎回或转让、受让等交易。

（二）关联方和其他相关人员持有本资管计划份额情况及交易明细

截至本报告期末，除前述第一款外，无关联方和其他相关人员持有本资管计划。

本报告期内，关联方和相关人员未进行本资产管理计划的申购、赎回或转让、受让等交易。

九、其他需要说明的情况

本报告期内，本资产管理计划无其他情况说明。

投资者对本报告如有疑问，可咨询管理人。管理人客服电话：400-820-8477。

中电投先融（上海）资产管理有限公司
2024 年 7 月 29 日