

2024 年 2 季度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

项目	信息
基金名称	磐耀三期
基金编码	S29763
基金管理人	上海磐耀资产管理有限公司
基金托管人（如有）	国金证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
基金运作方式	
基金成立日期	2015-04-16
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	37,111.09952
投资目标	本基金在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资。
投资策略	在国家认定的 7 个大行业里面精选个股、适度集中、组合投资，不融资不杠杆为投资的主要原则。遵循价值投资的选股理念，深入分析企业的基本面，注重企业未来的成长性以及护城河优势，运用重大事件分析法来制定具体交易策略，注重买入个股的安全边际，坚信伟大的企业可以穿越周期，遇到这样的企业敢于重仓买入，同时也不盲目的长期持有，在为投资者带来长期优异回报的。同时也追求获得年度绝对收益。
业绩比较基准（如有）	
风险收益特征	



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	-0.78			
自基金合同生效起至今	386.50			



3、主要财务指标

项目	2024-04-01	至	2024-06-30	(元)
本期已实现收益	-1,342,510.95			
本期利润	-14,519,850.02			
期末基金净资产	304,942,094.15			
报告期期末单位净值	0.8217			

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

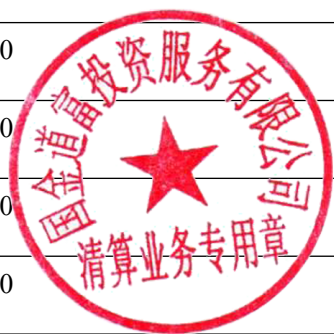
金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	6,273,570.78
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	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	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	6,562,412.28
	存出保证金	0.00
	股票投资	292,235,411.09
	债券投资	1,549,280.93
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	1,549,280.93
	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	0.00
	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
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	0.00
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	0.00



4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	0.00	0.00
C	制造业	230,896,984.59	75.72
D	电力、热力、燃气及水	0.00	0.00

	生产和供应业		
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	5,822.04	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和技术服务业	61,312,065.48	20.11
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	11,383.68	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	9,155.30	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	292,235,411.09	95.83



4.2.2 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（%）
港股通	0.00	0.00

合计		
----	--	--

5、基金份额变动情况



报告期期初基金份额总额	37,915.705095
报告期期间基金总申购份额	543.532138
减：报告期期间基金总赎回份额	1,348.137713
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	37,111.09952

6、管理人报告

（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等）

磐耀三期证券投资基金管理人报告

一、报告期内高管、基金经理及其管理基金经验：

报告期内，本基金的投资经理由【辜若飞】担任。投资经理简介如下： 【辜若飞】先生，现任上海磐耀资产管理有限公司投资经理。【辜若飞】先生具备良好的经济理论基础和扎实的证券研究经验和投资管理经验。

二、基金运作合规守信情况：

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募基金投资监督管理办法》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

三、报告期内基金业绩表现：

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金份额单位净值为 0.8217 元，本基金份额累计净值为 4.865 元，本报告期基金份额累计净值增长率为-0.78%。

四、报告期内对宏观经济、证券市场及其行业走势展望：

上半年 A 股市场整体表现不佳。板块方面分化进一步加剧，高股息红利、以及部分海外映射的

科技板块继续走强，其余板块表现低迷。原因主要是受短期较弱的经济数据以及市场未来信心缺失影响。

在部分权重红利板块，如煤炭、石油、银行、电力等趋势性新高的背景下，本轮“反弹”从二月初一直持续到五月中旬，随后转为周线连跌，上证指数再次失守 3000 点。如果抛开这些强势板块，仅从其他“非抱团”板块或个股来看，已接近或跌破二月初“极致情绪”低点区域。从基本面来看，部分细分行业依然独立于宏观经济，走出了边际向上的趋势，与各位的股价相对比，呈现了明显的背离，这大概率是极端市场无差别杀跌的再次“馈赠”。

当下市场表现极度萎靡，成交额创年内新低，和年初的情况类似；但越是这种时候，越要保持定力，不要輕易被情绪所影响，我们要择股从优，坚定持股，静候无差别杀跌后的“价值回归”。

五、报告期内内部基金监察稽核工作：

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。

六、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。

七、报告期内会计事务所出具非标准审计报告所涉相关事项：

不适用。

八、报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形：

无。

九、报告期内可能存在的利益冲突：

无。

十、报告期内其他说明情况：

无。

信息披露报告是否经托管机构复核：是