

# 国证资管同享收益1号FOF集合资产管理计划 2026年第1季度报告

资产管理人:国投证券资产管理有限公司

资产托管人:中信银行股份有限公司杭州分行

## §1 重要提示

本报告由集合计划管理人编制。托管人中信银行股份有限公司杭州分行根据本集合资产管理计划合同规定，已复核了本报告中的主要财务指标、报告期内资产管理计划投资收益分配情况、投资组合报告（不包含业绩报酬）、集合计划份额变动情况的财务数据的内容。

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

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划合同及风险揭示书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年03月31日止。

## §2 资产管理计划产品概况

资产管理计划全称	国证资管同享收益1号FOF集合资产管理计划
资产管理计划成立日	2023年12月21日
报告期末资产管理计划份额总额	95,452,931.22份
资产管理人	国投证券资产管理有限公司
资产托管人	中信银行股份有限公司杭州分行

## §3 主要财务指标和资产管理计划净值表现及业绩表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年01月01日-2026年03月31日)
本期已实现收益	7,615,378.41
本期利润	602,325.43
期末资产管理计划资产净值	149,649,720.37
期末资产管理计划份额净值	1.5678

### 3.2 集合计划成立以来净值变动情况

国证资管同享收益1号FOF集合资产管理计划成立以来净值变动情况  
(2023年12月21日-2026年03月31日)



### 3.3 业绩表现

截至期末，国证资管同享收益 1 号 FOF 集合资产管理计划单位净值为 1.5678 元，累计单位净值 1.6678 元，集合计划本期单位净值增长率 1.81%。

## §4 管理人报告

### 4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

陈霄汉，男，英国华威大学硕士。曾任华泰期货有限公司研究员、红塔红土基金管理有限公司研究员、联储证券股份有限公司投资经理。具有多年基金、期货、权益投资研究相关从业经验。2022 年加入国投证券资产管理有限公司，现任国投证券资产管理有限公司权益投资部投资经理。

### 4.2 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其他相关法律法规的规定，严格执行管理人内部各项管理制度，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。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关的法律法规、集合资产管理合同与说明书、公司相关制度进行投资运作，没有出现重大违法违规行为，投资管理各项业务均符合相关规定。

### 4.3 报告期内资产管理计划的投资策略和运作分析

#### 1、市场回顾

2026 年初至 3 月 31 日，沪深 300 指数下跌 3.89%，中证 500 指数上涨 2.03%，创

业板指数微跌 0.57%。1、2 月市场走出“开门红”行情，创出近十年来新高，2 月底以来受海外地缘政治冲突影响，市场风险偏好显著回落，A 股市场出现较大幅度调整。

截至 3 月 31 日，本产品目前绝大部分持仓为采用指增和量化选股策略的私募子基金，少部分配置股指期货多头，预计未来将继续维持该配置比例和配置策略。

#### 2、下阶段市场判断与投资展望

我们认为市场将逐渐进入年报和一季报的业绩博弈阶段，同时由于海外地缘政治的不确定性，市场风险偏好和未来流动性预期反复或会加大市场波动，行情仍然有赖于基本面和流动性的支撑，因此需要密切关注流动性的高频变化。

本产品将根据市场以及产品开放期流动性情况调整子基金的持仓，为产品及投资人保值增值。

#### 4.4 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内分红 1 次，分红总金额合计 9,302,565.41 元。

#### 4.5 报告期内资产管理计划关联交易情况

##### 4.5.1 报告期内资产管理计划一般关联交易情况

无

##### 4.5.2 报告期内资产管理计划重大关联交易情况

无

### §5 投资组合报告

#### 5.1 期末资产管理计划资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	6,300,000.00	4.20
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	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,095,881.10	16.06
8	其他各项资产	119,633,730.26	79.74
9	合计	150,029,611.36	100.00

## 5.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,355,555.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	432.79
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	116,277,742.27
8	合计	119,633,730.26

## 5.3 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名公募基金投资明细

序号	名称	基金代码	类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	华润元大现金通货币B	002884	货币型	契约型开放式	华润元大基金管理有限公司	5,300,355.42	3.54
2	中金现金管家货币B	000883	货币型	契约型开放式	中金基金管理有限公司	1,000,077.37	0.67

#### 5.4 报告期末本资产管理计划投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IM2606	中证 1000 股指期货 2606 合约	17	25,097,440.00	-3,174,760.00	-
IM2609	中证 1000 股指期货 2609 合约	2	2,865,520.00	-220,720.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-3,395,480.00
股指期货投资本期收益(元)					5,420,421.67
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-5,312,128.00

#### 5.5 报告期末本资产管理计划投资的私募基金投资明细

序号	名称	运作方式	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	龙旗股票量化多头3号私募证券投资基金A	契约型开放式	35,026,934.64	23.41
2	龙旗龙信15号私募证券投资基金	契约型开放式	33,888,323.22	22.65
3	龙旗锐泰一号私募证券投资基金B	契约型开放式	27,997,734.32	18.71
4	龙旗新征程2号私募证券投资基金B	契约型开放式	12,122,180.83	8.10
5	龙旗股票量化多头6号私募证券投资基金B	契约型开放式	3,802,162.16	2.54
6	龙旗金选股票量化优选1号私募证券投资基金	契约型开放式	3,440,407.10	2.30

#### 5.6 资产管理计划运用杠杆情况

产品杠杆：本产品为非结构化产品，无产品杠杆。

投资杠杆：截至报告期末，本产品投资杠杆约为 100.25%。

### 5.7 两费及业绩报酬说明

项目	计提方式
管理费	1.00%/年，每日计提，按季支付
托管费	0.02%/年，每日计提，按季支付
业绩报酬	若符合业绩报酬提取条件，管理人于本资产管理计划分红日、投资者退出日和本资产管理计划终止日提取业绩报酬。如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率小于【0】%，管理人不提取业绩报酬；如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率等于或大于【0】%，管理人将对超过部分的收益提取【3】%作为业绩报酬。

## §6 资产管理计划份额变动

### 6.1 集合计划份额变动情况

单位：份

资产管理计划合同生效日2023年12月21日 资产管理计划份额总额	11,390,623.77
本报告期期初资产管理计划份额总额	72,536,608.78
本报告期资产管理计划总参与份额	31,074,504.76
减：本报告期资产管理计划总退出份额	8,158,182.32
本报告期资产管理计划拆分变动份额	-
本报告期期末资产管理计划份额总额	95,452,931.22

### 6.2 关联方持有本集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额	-
报告期间参与份额	-
红利再投资份额	-
报告期间退出份额	-
报告期末份额	-
期末份额占集合计划总份额的比例	-

注：关联方指本公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方。

### §7 其他重大事项

本报告期内，本集合资产管理计划没有其他需要披露的重大事项。

### §8 查阅方式

投资者可或登录集合计划管理人网站 [www.axzqzg.com](http://www.axzqzg.com) 查阅，还可拨打本公司客服电话 95517 查询相关信息。

国投证券资产管理有限公司

2026年04月30日