苏新基金阳澄 2 号集合资产管理计划

2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

资产管理人:苏新基金管理有限公司

资产托管人:江苏银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 30 日

1.重要提示

本报告期内，本资产管理人严格遵守《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》及其他有关法律法规、资产管理合同的规定，勤勉尽责地为本资产管理计划委托人谋求最大利益，没有发生损害本资产管理计划委托人利益的行为。

本资产管理计划本报告期内未发生利益冲突以及其他可能影响投资者合法权益的情况。

本资产管理计划将继续以取信于市场、取信于本资产管理计划委托人为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托财产，在规范委托财产运作和严格控制投资风险的前提下，努力为本资产管理计划委托人谋求最大利益。

2.计划简介

2.1 计划基本情况

计划简称	苏新阳澄 2 号
交易代码	SBNS50
合同生效日	2026 年 04 月 27 日
报告期末份额总额	10,001,166.66 份

2.2 管理人和托管人

项目	管理人	托管人
名称	苏新基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司

3.主要财务指标和份额净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标（未经审计）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日)
本期已实现收益	216,676.31
本期利润	804,312.95
期末可供分配利润	-120,195.38
期末资产净值	9,880,971.28
期末份额净值	0.9880

期末份额累计净值	0.9880

3.2 利润分配情况

本报告期内，本集合计划未进行利润分配。

3.3 份额净值表现

截至本报告期末，本资产管理计划份额净值 0.9880 元，本报告期内净值增长率 8.86%。

4.管理人报告

4.1 管理人及投资经理情况

4.1.1 投资经理（或投资经理小组）简介

姓名	职务	任本计划的投资经理期限		说明
		任职日期	离任日期	
童家晖	投资经理	2026-04-27	-	香港理工大学博士，具有基金从业资格。2018 年 12 月入职弘量研究有限公司任量化研究部量化研究员。2019 年 9 月起任平安证券股份有限公司资产管理事业部量化投资团队投资经理助理。2022 年 3 月起任深圳前海铸融科技有限公司量化投资部量化研究员。2023 年 9 月起任华西证券股份有限公司衍生金融总部量化投资部研究员。2024 年 9 月入职苏新基金，现任苏新基金管理有限公司指数及量化业务管理部投资经理。

4.2 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.2.1 公平交易制度和控制方法

本资产管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《苏新基金管理有限公司公平交易管理办法》，涵盖了投资研究、交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合。公司通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，同时，对公平交易的过程和结果进行监督。

4.2.2 公平交易制度执行情况

本资产管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。本报告期内，本资产管理人严格执行了公平交易制度，公平对待各投资组合，不存在不公平交易和利益输送的行为。

4.2.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本资产管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本资产管理计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

5.管理人及托管人履职情况

5.1 管理人履职情况

本报告期内，本计划资产管理人严格按照法律法规、资产管理合同的规定，独立管理和运用资产管理计划财产，自本计划合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产，配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产，建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的资产管理计划财产与本公司管理的基金财产、其他委托财产和资产管理人的财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。未发现有为资产管理人及任何第三人谋取利益的情况。

5.2 托管人履职情况

报告期内，本计划托管人在托管过程中，严格遵守《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》和相关法律法规的规定，以及资产管理合同的约定，不存在任何损害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。

报告期内，本计划托管人依据法律法规的规定以及资产管理合同的约定对本计划管理人的投资运作进行了监督，管理人在本计划投资运作过程中遵规守信情况良好。托管人对本计划报告期内的净值计算、利润分配情况进行了复核，未发现本计划管理人在上述事项中存在违反资产管理合同相关约定的行为。

本计划托管人依法对季度报告中托管履职期间的财务指标、净值表现、投资组合情况、利润分配情况（如有）、财务会计报告（如有）等财务信息进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6.投资组合报告

6.1 期末资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占总资产的比例（%）
1	权益投资	9,856,273.00	99.64
	其中：股票	9,856,273.00	99.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	35,624.64	0.36
7	其他资产	-	-
8	合计	9,891,897.64	100.00

6.2 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	持仓数量	市值（元）	占资产净值比例（%）
1	600546	山煤国际	21,200	278,144.00	2.81
2	600256	广汇能源	39,300	262,131.00	2.65
3	601101	昊华能源	17,900	227,867.00	2.31
4	601168	西部矿业	6,200	219,170.00	2.22
5	601919	中远海控	13,000	212,810.00	2.15
6	601699	潞安环能	13,700	206,733.00	2.09
7	601225	陕西煤业	7,800	203,034.00	2.05
8	601857	中国石油	16,500	184,965.00	1.87
9	000651	格力电器	4,700	179,916.00	1.82
10	601633	长城汽车	12,700	174,371.00	1.76

6.3 期末按公允价值占资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本资产管理计划报告期末未持有债券。

6.4 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本资产管理计划报告期末未持有基金。

6.5 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名金融衍生品投资明细

本资产管理计划报告期末未持有金融衍生品。

6.6 资产管理计划运用杠杆情况

本资产管理计划截止本报告期末，资产杠杆比例为 100.11%。

7.管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

7.1 资产管理计划管理费

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	24,884.53

注：本计划资产的年固定管理费率为 1.00%。计算方法如下：

H＝E×1.00%÷当年天数

H 为每日应计提的计划资产固定管理费

E 为前一日计划资产净值

管理费每日计提，按自然月支付。

7.2 资产管理计划托管费

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	497.73

注：本计划资产年托管费率为 0.02%。计算方法如下：

H＝E×0.02%÷当年天数

H 为每日应计提的计划资产托管费

E 为前一日计划资产净值
托管费每日计提，按自然月支付。

7.3 业绩报酬

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日
当期计提的业绩报酬	0

注：业绩报酬的计算方法
a.年化收益率的计算公式如下：
R=(P1-P0)/P0'/D×100%
其中：
R 为年化收益率。
P1 为业绩报酬计提日的单位累计净值。
P0 为上一个分红业绩报酬计提日的单位累计净值(若某笔份额无上一个分红业绩报酬计提日的，则为本计划成立日或投资者该笔份额参与的申请日)。
P0'为上一个分红业绩报酬计提日的单位净值（若该笔份额无上一个分红业绩报酬计提日的，则为本计划成立日或投资者该笔份额参与的申请日)。
D 为上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日份额持有的天数（算尾不算头）/365 天（1 年按照 365 天计算）(若该笔份额无上一个分红业绩报酬计提日的，则为本计划成立日或投资者该笔份额参与的申请日)。
b.业绩报酬计提比例
管理人对本计划年化收益率超过 5.00%(不含)且不超过 10.00%(含)的部分提取 10%的业绩报酬，对本资产管理计划年化收益率超过 10.00%（不含）的部分提取 20%的业绩报酬。计算公式如下：

年化收益率（R）	业绩报酬计提比例	业绩报酬（Y）
R≤5%	0	0
5%＜R≤10%	10%	Y=(R-5%)×A×10%×D
10%＜R	20%	Y=(R-10%)×A×20%×D+(10%-5%)×A×10%×D

注：R 为年化收益率
Y 为管理人应计提的业绩报酬。
A 为委托人持有每笔份额的成本，即当个业绩报酬计提日的委托人持有的每笔份额数量或退出时对应的退出份额数量×上一个业绩报酬计提日（若该笔份额无上一个业绩报酬计提日的，则为本计划成立日或投资者申购该笔份额的申购日）的单位净值。

8.关联交易情况

8.1 报告期内资产管理计划发生关联交易的情况

8.1.1 投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划或证券投资基金

注：本资产管理计划本报告期未投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划或证券投资基金。

8.1.2 一级申购或二级交易关联方发行的证券的情况

本资产管理计划本报告期未投资一级申购或二级交易关联方发行的证券。

8.1.3 在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本资产管理计划本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

8.1.4 与关联方开展证券（含回购）交易，交易对手涉及关联方

注：本资产管理计划本报告期未与关联方进行证券（含回购）交易，交易对手未涉及关联方。

8.1.5 与关联方开展证券（含回购）交易，质押券涉及关联方

本资产管理计划本报告期未与关联方进行证券（含回购）交易，质押券未涉及关联方。

8.2 各关联方投资本资产管理计划的情况

8.2.1 报告期内管理人运用固有资金投资本资产管理计划的情况

注：本资产管理计划的管理人本报告期未运用固有资金投资本资产管理计划。

8.2.2 报告期末管理人的董事、从业人员及其配偶持有本资产管理计划的情况

注：本资产管理计划的管理人董事、从业人员及其配偶，本报告期末未持有本资产管理计划。

8.2.3 报告期末资产管理计划管理人的其他关联方持有本资产管理计划的情况

注：本资产管理计划管理人的其他关联方，本报告期末未持有本资产管理计划。

8.3 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行股份有限公司	18,188.87	7.55

8.4 支付关联方的佣金及手续费

注：本资产管理计划本报告期未与关联方产生佣金及手续费。

8.5 重大关联交易情况说明

本资产管理计划本报告期未发生重大关联交易。

9.影响投资者决策的其他重要信息

9.1 投资经理变更

本报告期内，本计划投资经理没有发生变更。

9.2 其他涉及投资者权益的重大事项

本报告期内，本计划无其他需要说明的涉及投资者权益的重大事项的情况。

苏新基金管理有限公司

二〇二六年十月三十日