

钜沣量化对冲一号证券投资基金 2024年第一季度报告

基金管理人：安徽钜瑞资产管理有限公司

基金托管人：兴业证券股份有限公司

送出日期：2024-05-17

私募基金信息披露季度报告

1、基金基本情况

| 项目                       | 信息                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称                     | 钜沣量化对冲一号证券投资基金                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金编码                     | SE0703                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 基金管理人                    | 安徽钜瑞资产管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金托管人（如有）                | 兴业证券股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资顾问（如有）                 | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式                   | 开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金成立日期                   | 2015-12-15                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 628.844329                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资目标                     | 在控制风险的前提下，实现客户资产的长期、稳定、持续增值                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 投资策略                     | 本基金依基金管理人的投资指令进行投资决策。基金管理人的投资策略如下：1、股票投资策略：本基金基于自上而下的优势主题分析框架下，精选未来具有高成长速度、广阔成长空间、较好成长模式并且成长估值相对合理的个股进行重点投资。2、股指期货策略：本基金通过利用股指期货的独立性和领先性，使用对冲策略有效分散投资风险。同时在严格控制风险敞口的前提下，运用对冲策略，通过对经济增长趋势、资金流动、财政和货币政策变化等因素自上而下进行统计分析，并辅以对高频交易数据的捕捉分析，区分有信息含量和非理性的交易行为，来获取对股指期货价格走势判断的领先优势，制定投资策略，获取低风险甚至无风险的套利收益。 |
| 业绩比较基准（如有）               | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 风险收益特征                   | 本基金具有较高风险高预期收益特征                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

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         | -18.30   | 0.00        | 0.00         | 0.00            |
| 自基金合同生效起至今 | -57.60   | 0.00        | 0.00         | 0.00            |

备注：

|   |
|---|
| - |
|---|

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）/上季度末净值  
如为分级基金，应按级别分别列示。  
表中指标均以不带百分号数值形式填写，请保留至小数点后2位。

3、主要财务指标

| 项目      | 2024-01-01 | 至 | 2024-03-31 | 金额单位：元<br>(元) |
|---------|------------|---|------------|---------------|
| 本期已实现收益 | -5,102.26  |   |            |               |

|           |              |
|-----------|--------------|
| 本期利润      | -597,818.17  |
| 期末基金净资产   | 2,663,230.54 |
| 报告期期末单位净值 | 0.424        |

备注：

|   |
|---|
| - |
|---|

注：

如为分级基金，应按级别分别列示。

#### 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              | 431.33       |
| 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             | 163,753.74   |
|                 | 存出保证金             | 251,265.91   |
|                 | 股票投资              | 2,314,280.19 |
|                 | 债券投资              | -            |
|                 | 其中：银行间市场债券        | -            |
|                 | 其中：利率债            | -            |
|                 | 其中：信用债            | -            |
|                 | 资产支持证券            | -            |
|                 | 基金投资（公募基金）        | -            |
|                 | 其中：货币基金           | -            |
|                 | 期货及衍生品交易保证金       | 214,149.6    |
|                 | 买入返售金融资产          | -            |
|                 | 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              | -            |
|                 | 银行委托贷款规模          | -            |
|                 | 信托贷款              | -            |
|                 | 应收账款投资            | -            |

|         |             |   |
|---------|-------------|---|
| 境内债权类投资 | 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        | - |
| 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      | - |

#### 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            | 0            |
| B  | 采矿业              | 0            | 0            |
| C  | 制造业              | 1,161,264.19 | 43.60        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 0            | 0            |
| E  | 建筑业              | 0            | 0            |
| F  | 批发和零售业           | 731,280.00   | 27.46        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 0            | 0            |
| H  | 住宿和餐饮业           | 0            | 0            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 99,360.00    | 3.73         |
| J  | 金融业              | 0            | 0            |
| K  | 房地产业             | 0            | 0            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 0            | 0            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 80,876.00    | 3.04         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 241,500.00   | 9.07         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | 0            | 0            |
| P  | 教育               | 0            | 0            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 0            | 0            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 0            | 0            |
| S  | 综合               | 0            | 0            |
|    | 合计               | 2,314,280.19 | 86.90        |

备注：

-

#### 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         | 0.00         |
| 合计   | -         | -            |

备注：

-

-

5、基金份额变动情况

单位：万份/万元

|                           |            |
|---------------------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 628.844329 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 0.000000   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 0.000000   |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.000000   |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额          | 628.844329 |

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

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）

-

信息披露报告是否经托管机构复核：

是

